



聯博證券投資信託股份有限公司

「聯博大利證券投資信託基金」公告

聯博信字第 1150000443 號

公告主旨：本公司所經理之「聯博大利證券投資信託基金」(以下簡稱「本基金」)修正公開說明書相關內容，業經金融監督管理委員會(以下簡稱金管會)核准，特此公告。

公告依據：依本基金證券投資信託契約第 12 條及第 31 條規定辦理。

公告事項：

- 一、本基金業經金管會中華民國 115 年 9 月 10 日金管證投字第 1150354507 號函核准在案，因本基金擬運用量化與質化分析進行投資決策，故修正公開說明書相關內容。
- 二、修訂後之公開說明書可於公開資訊觀測站(<http://mops.twse.com.tw>)及本公司網站(<https://www.abfunds.com.tw/>)查詢。
- 三、特此公告。



聯博大利證券投資信託基金公開說明書修正前後對照表

條項	修正後文字	修正前文字	說明
	【基金概況】	【基金概況】	
一.基金簡介	(十)投資策略及特色之重點摘述 1.本基金主要投資於國內股票，以「鎖定大股本，投資高股利」為投資特色。<u>主要投資於下列兩類型股票：</u> (1)績優股：近三個會計年度之盈餘增資配股、資本公積配股及現金股利合計平均在新台幣一點五元（含本數）以上之績優股；或 (2)大型股：實收資本額在新台幣壹佰億元（含本數）以上之大型股。 2.在投資決策上，運用<u>量化與質化分析進行。投資組合之股票配置主要運用聯博獨家系統性多因子選股策略（AB Systematic Multi-Factor Strategy）</u>，透過系統性量化篩選機制建立一籃子投資組合，以投資於具有長期資本增值潛力之公司，並視情況輔以質化分析，以評估重大事件對投資組合之影響。投資團隊藉由此方法，分析不同投資風格與產業之公司，以發掘具潛力之投資機會。 3.本基金系統性多因子選股策略所運用之多因子訊號(Alpha Signals)，主要可區分但<u>不限於以下幾大主題因子：品質(Quality)、價值(Value)、動能(Momentum)、盈餘預期調整(Revision)、情緒因子</u>	(十)投資策略及特色之重點摘述 「鎖定大股本，投資高股利」為<u>大利基金主要投資特色。大利基金投資於下列兩類型股票：</u> 績優股：近三個會計年度之盈餘增資配股、資本公積配股及現金股利合計平均在新台幣一點五元（含本數）以上之績優股。 大型股：實收資本額在新台幣壹佰億元（含本數）以上之大型股。	本基金投資決策擬運用 <u>量化與質化分析</u> 進行，爰修訂相關文字，以利投資人知悉，俾保其權益。



條項	修正後文字	修正前文字	說明
	(Sentiment) 、 技 術 面 (Technical) 、 另 類 因 子 (Alternative)等。 4.在投資組合建構上，依據多因子訊號進行分數排序，並結合風險模組與投資組合目標，篩選具潛力之標的，同時考量投資組合貝他值、追蹤誤差、收益目標、類股與產業狀況，以及投資部位集中度限制等面向，來建構投資組合，以期達到風險分散與多元配置之投資組合。此外，亦將依市場情況，納入總體經濟環境、產業或市場風險等質化因素，對投資組合進行個別或整體評估，作為投資組合建構與調整之依據。		
	(十一)本基金適合之投資人屬性分析 本基金之風險程度： 本基金為股票型基金，在正常市場條件下，本基金主要將其至少60%的資產投資於在中華民國上市上櫃之企業股票、可轉換公司債或債券換股權利書。投資經理整合<u>量化分析</u>並輔以基本面研究，發掘具高品質與優越之長期增值潛力企業，建構相對集中且具高確信度之投資組合，爭取資本增值機會。目前本基金主要投資於流動性較佳、市值在一定規模以上之中華民國中大型股票，且在投入特定有價證券時均已考量其流動性風險，在正常市場情況下流動性風險相對較低。本基金主要投資於中華民國股票，投資人仍須承受產業景氣循環及投資地區政治、社會或經濟變動風	(十一)本基金適合之投資人屬性分析 本基金之風險程度： 本基金為股票型基金，在正常市場條件下，本基金主要將其至少60%的資產投資於在中華民國上市上櫃之企業股票、可轉換公司債或債券換股權利書。投資經理整合基本面研究，<u>以由下而上之方法</u>，發掘具高品質與優越之長期增值潛力企業，建構相對集中且具高確信度之投資組合，爭取資本增值機會。目前本基金主要投資於流動性較佳、市值在一定規模以上之中華民國中大型股票，且在投入特定有價證券時均已考量其流動性風險，在正常市場情況下流動性風險相對較低。本基金主要投資於中華民國股票，投資人仍須承受產業景氣循環及投資地區政治、社會或經濟	配合投資策略決策方式採量化與質化分析進行，爰修訂之。



條項	修正後文字	修正前文字	說明
	險。本基金過去五年淨值波動度，亦與同類型基金相近。綜合評估本基金主要投資風險及投資策略、區域與組合，並考量投信投顧公會所訂之基金風險報酬等級標準等多項因素後，本基金之風險報酬為RR4(註)。 (註)風險報酬等級係依基金類型、投資區域或主要投資標的／產業，由低至高，區分為RR1~RR5五個風險報酬等級。RR係計算過去5年基金淨值波動度標準差，以標準差區間予以分類等級。此等級分類係基於一般市場狀況反映市場價格波動風險，無法涵蓋所有風險(如：基金計價幣別匯率風險、投資標的產業風險、信用風險、利率風險、流動性風險等)，亦不宜作為投資唯一依據，投資人仍應注意所投資基金個別之風險，其他主要風險(如信用風險、流動性風險…等)請詳見基金公開說明書。其他相關資料(如年化標準差、Alpha、Beta及Sharpe值等)可至中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會網站之「基金績效及評估指標查詢專區」(https://www.sitca.org.tw/index_pc.aspx)查詢。 本基金之投資人屬性分析： 一、本基金主要投資於中華民國上市上櫃股票，並透過資本增值，逐漸增加投資人之投資價值，故較適合(1)了解本	變動風險。本基金過去五年淨值波動度，亦與同類型基金相近。綜合評估本基金主要投資風險及投資策略、區域與組合，並考量投信投顧公會所訂之基金風險報酬等級標準等多項因素後，本基金之風險報酬為RR4(註)。 (註)風險報酬等級係依基金類型、投資區域或主要投資標的／產業，由低至高，區分為RR1~RR5五個風險報酬等級。RR係計算過去5年基金淨值波動度標準差，以標準差區間予以分類等級。此等級分類係基於一般市場狀況反映市場價格波動風險，無法涵蓋所有風險(如：基金計價幣別匯率風險、投資標的產業風險、信用風險、利率風險、流動性風險等)，亦不宜作為投資唯一依據，投資人仍應注意所投資基金個別之風險，其他主要風險(如信用風險、流動性風險…等)請詳見基金公開說明書。其他相關資料(如年化標準差、Alpha、Beta及Sharpe值等)可至中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會網站之「基金績效及評估指標查詢專區」(https://www.sitca.org.tw/index_pc.aspx)查詢。 本基金之投資人屬性分析： 一、本基金主要投資於中華民國上市上櫃股票，並透過資本增值，逐漸增加投資人之投資價值，故較適合(1)了解本	



條項	修正後文字	修正前文字	說明
	基金風險並具備基本投資知識；(2)擬進行中長期投資；(3)希望曝險於中華民國上市上櫃股票市場；(4)具有中度至較高風險承受度且能夠承受損失之投資人。 二、有關本基金是否適合其投資需要，應由投資人自行判斷。	識；(2)擬進行中長期投資；(3)希望曝險於中華民國上市上櫃股票市場；(4)具有中度至較高風險承受度且能夠承受損失之投資人。 二、有關本基金是否適合其投資需要，應由投資人自行判斷。	