

統一NYSE FactSet亞洲半導體淨報酬指數指數投資證券

簡式公開說明書

刊印日期：中華民國114年4月

- (一)本簡式公開說明書係公開說明書之重點摘錄，相關名稱及文字定義與公開說明書完全相同。
- (二)投資人申購本指數投資證券後之權利義務詳述在公開說明書，投資人如欲申購本指數投資證券，建議參閱公開說明書。

壹、基本資料

指數證券名稱	統一NYSE FactSet亞洲半導體淨報酬指數指數投資證券	發行證券商	統一綜合證券股份有限公司
發行總額	新台幣2,000,000,000元	發行單位數	250,000,000個單位
發行價格	每單位新台幣8.00元	發行期間	中華民國110年7月21日至 中華民國120年7月21日
發行日期	中華民國110年7月21日	到期日	中華民國120年7月21日， 到期日如為非營業日則順延 至下一個營業日
標的指數名稱	NYSE FactSet亞洲半導體淨報酬指數	交易市場	財團法人中華民國證券櫃檯 買賣中心
到期償還方式	現金匯撥交付投資人	收益分配	本指數投資證券不分配收益

貳、標的指數說明

一、指數授權契約之重要內容：詳細內容請參見公開說明書第2~4頁。

(一) 授權範圍

本公司為執行本商品有關之發行、公開募集、公開銷售或交易相關業務，在合理必要之範圍內，非專屬且不可轉讓地使用標的指數及指數商標。

(二) 授權相關費用：

年度指數授權費用為 20,000 美元或按本商品平均每日發行流通在外面額的 0.05%之比率計算之數額，以孰高者定之。

(三)契約期間：指數授權契約自2021年1月22日生效，有效期限至2022年1月22日，到期自動續約，續約期間為1年，之後均依此類推。

二、指數之編製及計算方法：詳細內容請參見公開說明書第4~6頁。

NYSE FactSet亞洲半導體淨報酬指數以上市於香港、日本、南韓、台灣等地交易所之企業的普通股；或上市於紐約證交所、那斯達克證交所但註冊於香港、日本、南韓、台灣之企業證券或美國存託憑證(ADRs)為母體，經市值及流動性篩選後，以Factset的RBICS 產業分類系統挑選出半導體產業相關成分股，依照市值納入成分股組成之指數。計算公式如下：

$$\text{指數} = \frac{\text{指數成分股市值總和}}{\text{當日淨報酬指數之指數除數}} \times \text{基準指數}$$

三、標的指數符合發行處理準則第二條第三項之說明：詳細內容請參見公開說明書第7~9頁。

(一) 指數編製者應具有編製指數之專業能力及經驗

ICE 數據指數跨越所有主要資產類別，包括超過 5000 個固定收益、股票、貨幣與商品指數，日期最遠可追溯至 1966 年，並被全世界市場參與者廣泛應用。

展望未來，ICE 將繼續擴展其指數系列，以滿足各類投資者對指數投資的不同需求。

(二) 指數應對所界定之市場具有代表性

NYSE FactSet 亞洲半導體淨報酬指數以上市於香港、日本、南韓、台灣等地交易所之企業的普通股；或上市於紐約證交所、那斯達克證交所但註冊於香港、日本、南韓、台灣之企業證券或美國存託憑證(ADRs)為母體，經市值及流動性篩選後，以 Factset 的 RBICS 產業分類系統挑選出半導體產業相關成分股，依照市值納入成分股組成之指數。

(三) 標的指數成分具備分散性、流動性

1. 分散性：依據2025年3月31日收盤資料計算，NYSE FactSet亞洲半導體淨報酬指數共包含16檔成分股，權值比重最高之成分股為三星電子，權重為22.69%，符合需具有十種成分以上，且權值比重最高之成分，所占比重不得高於百分之三十之規定。
2. 流動性：
 - A. 依據 2025/3/31 之收盤資料，NYSE FactSet 亞洲半導體淨報酬指數成分股合計有 16 檔個股，參考近 12 個月成分股的成交資料，日均成交金額計為新台幣 147,123 百萬元。
 - B. 本公司預計以每半年定審之指數成分權重進行完全複製。完全複製法完全依照追蹤指數的成分股及成分比重進行投資，而當指數成分股變動時，避險也相應調整。16 檔指數成分股近一年日平均成交金額為新台幣 147,123 百萬元，假設單日建立避險部位金額新台幣 1000 萬元及 5 億元，避險部位均能於一日內建立完畢。

(四) 指數資訊應充分揭露並易於取得

1. ICE Data

指數績效與基本資料 <https://www.theice.com/market-data/indices>

2. 金融報價平台: Bloomberg

A. 指數日內即時報價

B. 指數基本資料

3. 統一綜合證券官方網站 <http://www.pscnet.com.tw/>

4. 證券櫃檯買賣中心官網 <http://www.tpex.org.tw>

四、有關標的指數發生對投資人權益有重大影響情事之通知及公告方式：詳細內容請參見公開說明書第9頁。

除金管會或其他有關法令另有規定外，發行人應於事實發生之日起算二日內向金管會申報並於事實發生日或傳播媒體報導日之次一營業日交易時間開始前公告。另有關標的指數累積漲跌幅度、指數成分股等之相關資訊，應定期傳輸於財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心、公開資訊觀測站，或其他依金管會所指定之方式公告。

五、如為編製價格指數，須敘明成分證券配息時，指數投資證券之配息方式或指標價值之調整方式：本指數投資證券標的指數為報酬指數，非價格指數，不適用本項說明。

參、估計指標價值與指標價值之計算方式

一、估計指標價值(盤中)及指標價值(盤後)之計算方法：詳細內容請參見公開說明書第 10 頁。

1. 估計指標價值 $T = (\text{指標價值}_{T-1} * \text{估計每日指數因子 } T) - \text{每日投資手續費 } T$
估計每日指數因子 $T = \text{估計標的指數值 } T / \text{標的指數值}_{T-1}$
2. 盤後指標價值 $T = (\text{指標價值}_{T-1} * \text{盤後每日指數因子 } T) - \text{每日投資手續費 } T$
盤後每日指數因子 $T = \text{盤後標的指數值 } T / \text{標的指數值}_{T-1}$
3. 本指數投資證券指標價值之計算方法含有新臺幣匯率

二、估計指標價值揭露方式

1. ETN 盤中預估之每單位指標價值，依至少每十五秒更新乙次之頻率，於基本市況報導網站 (<http://mis.twse.com.tw/stock/index.jsp>) 申報。
2. ETN 盤後每單位指標價值，於每營業日開盤前申報可算得最近一營業日之資料，於公開資訊觀測站 (<http://mops.twse.com.tw>) 申報。指數投資證券之標的指數有外國指數者，自上午八點三十分起至下午五點止，取用即時指數值依上開更新頻率申報。

三、估計指標價值與交易價格差異原因：詳細內容請參見公開說明書第 10 頁。

次級市場交易價格受到多項市場因素之影響，如投資人對股票市場的信心、供需狀況、流動性不足等等，使得本指數投資證券在櫃買中心的交易價格可能高於或低於指標價值，造成所謂折溢價的風險。不過，藉由發行人擔任流動量提供者進行合理報價，可以縮小折溢價偏離的情形。

肆、標的指數績效

報酬率走勢圖表：

下表為 NYSE FactSet 亞洲半導體淨報酬指數過去三年績效，NYSE FactSet 亞洲半導體淨報酬指數之漲幅為 23.91%

	近 1 月	近 3 月	近 6 月	近 1 年	近 3 年
NYSE FactSet 亞洲半導體淨報酬指數	-6.07%	-4.07%	-4.10%	-12.16%	23.91%



資料來源為 Bloomberg，計算期間為 2022/3/31 到 2025/3/31

伍、投資人風險

投資人買賣ETN，係為具有到期日之有價證券，追蹤標的指數表現，並在證券交易市場交易，交易ETN有可能會在短時間內產生極大利潤或極大的損失，於開戶、交易前應審慎考慮自身之財務能力及經濟狀況是否適合買賣此種商品。買賣ETN非為共同基金，並不實際持有指數成分資產，而係以ETN發行人之信用作為擔保，且ETN在存續期間不另支付息值。投資人應瞭解投資可能產生之潛在風險，知悉各項風險，詳細內容請參見公開說明書第16~20頁。

陸、投資人應負擔費用項目及其計算、收取方式

詳細內容請參見公開說明書第10~11頁。

- 一、投資手續費：年投資手續費率為百分之一點四八（1.48%），以日曆日計，本指數投資證券之投資手續費將於估計指標價值及盤後指標價值之計算過程中扣除，其計算方式請參見公開說明書第 1~2 頁。
- 二、申購手續費：申購基數 × 5,000 元(每申購基數為 500,000 單位)，於申購時支付。
- 三、申購交易費：申購價金之百分之一（1%），於申購時支付。
- 四、賣回手續費：賣回基數 × 5,000 元(每賣回基數為 500,000 單位)，於賣回時支付。
- 五、賣回交易費：賣回價金之百分之一（1%），於賣回時支付。
- 六、投資人應負擔租稅之項目依財政部有關法令辦理：
 1. 證券交易所所得稅：投資人於證券交易所所得稅停徵期間，不需繳交所得稅。
 2. 證券交易稅：證券交易稅：0.1%
 - (1) 投資人轉讓 ETN 時，應由受讓人代徵證券交易稅。
 - (2) 投資人申請賣回，或發行人提前或屆期贖回本 ETN 時，賣回或贖回 ETN 註銷不再轉讓者，非屬有價證券之買賣，不課徵證券交易稅。

柒、證券商提前贖回、強制贖回及投資人申購賣回

一、提前贖回：詳細內容請參見公開說明書第 25 頁。

1. 提前贖回條件：本指數投資證券發行上櫃滿六個月後，投資人持有單位數連續 20 個交易日均小於申報生效單位數之 10%。
2. 提前贖回價格：以符合提前贖回條件當日之次一營業日為最後交易日，以最後交易日盤後公告之指標價值計算償還金額。
3. 符合提前贖回條件之通知方式：發行人應於符合條件日之次一營業日，檢附終止上櫃時程及相關附件函報財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心，並依「財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心對上櫃指數投資證券重大訊息之查證暨公開處理程序」規定，於事實發生日之次一營業日交易時間開始前，將該訊息內容或說明輸入財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心指定之網際網路申報系統。
4. 提前贖回償還時程：發行人於終止上櫃買賣日之次一營業日上午十一時前，將應付款項匯撥財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心，經財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心彙總款項後，即匯撥證券商交付投資人。

二、強制贖回：詳細內容請參見公開說明書第 25 頁。

1. 強制贖回條件：收盤後公布的指標價值低於 1.60 元。
2. 強制贖回價格：以符合強制贖回條件當日之次一營業日為最後交易日，以最後交易日盤後公告之指標價值計算償還金額。
3. 符合強制贖回條件之通知方式：通知方式同提前贖回。
4. 強制贖回償還時程：償還時程同提前贖回。

三、投資人申購：詳細內容請參見公開說明書第 20~21 頁。

1. 得申請申購時間：本 ETN 上櫃日至到期前最後交易日期間之每一營業日。
2. 申請截止時間：申請日上午 11:00 以前委託證券商向發行人申請。若有不接受申購情事者，發行人應即時於網站及公開資訊觀測站公告，並於當日 15:00 前通知證券商轉知投資人。
3. 最低申購數量：最低為 500,000 單位(簡稱每基數)，投資人申請申購之單位數應為最低申購數量或其整倍數，如未達此基數，只能透過證券交易市場買賣。
4. 申購費用：每基數申購手續費為 5,000 元新台幣，以及每基數申購價金之 1% 為申購交易費；申購手續費、交易費為證券商得就每一申購申請收取之申購費用，此費用不列入本指數投資證券指標價值計算，且包括但不限於證券商事務處理費、申請作業費、相關市場規費等。
5. 申購價格：申請申購當日盤後公布之指標價值。
6. 如遇下列情事條件之一，本指數投資證券得停止申購，並待上述事件消失後當日始受理投資人申購申請。惟截止時間前已完成申購手續之交易仍屬有效：
 - (1) 避險工具之交易市場因例假日及國定假日停止交易，導致發行人無法進行避險部位交易，本指數投資證券得停止申購。
 - (2) 本指數投資證券避險部位因無法預見、無法抗拒、無法避免，包括但不限於洪水、地震及其他自然災害、戰爭、騷亂、火災、政府徵用、沒收、恐怖襲擊、傳染病傳播、法律法規變化、突發停電或其他突發事件、證券交易所非正常或停止交易，導致發行人無法進行避險部位交易，本指數投資證券得停止申購。
 - (3) 如遇天然災害或其他經主管機關認定為不可抗力因素之重大事件導致無法正常營業，發行人得依安全考量調整截止時間，並待上述事件消失後當日始受理投資人申購申請。惟截止時間前已完成申購手續之交易仍屬有效。
 - (4) 申請日前一日指數權重合計達 20% 之成分股所屬市場於申請日暫停交易、停止買賣或收盤價格漲停，致申請日本 ETN 申購總價金之避險部位無法完全補足。
7. 申購失敗：本指數投資證券上櫃日後，發行人應於收足申購人之實際申購總價金之日起，依相關規定於申購日後(不含當日)二個營業日內，無實體發行交付指數投資證券予申購人。但申購總價金若未能依規定交付時，應視為申購失敗，發行人即不交付指數投資證券予申購人。

四、投資人賣回：詳細內容請參見公開說明書第 22~24 頁。

1. 得申請賣回時間：本 ETN 上櫃日至到期前最後交易日期間之每一營業日。
2. 申請截止時間：申請日中午 11:00 以前委託證券商向發行人申請。若有不接受賣回情事者，發行人應即時於網站及公開資訊觀測站公告，並於當日 15:00 前通知證券商轉知投資人。
3. 最低賣回數量：最低為 500,000 單位(簡稱每基數)，投資人申請賣回之單位數應為最低賣回數量或其整倍數，如未達此基數，只能透過證券交易市場買賣。
4. 賣回費用：每基數賣回手續費為 5,000 元新台幣，以及每基數賣回價金之 1.00% 為賣回交易費；

賣回手續費、交易費為證券商得就每一賣回申請收取之賣回費用，此費用不列入本指數投資證券指標價值計算，且包括但不限於證券商事務處理費、申請作業費、相關市場規費等。

5. 賣回價格：申請賣回當日盤後公布之指標價值。

6. 符合下列條件之一，且發行人避險部位達本 ETN 流通在外總值 80%以上，發行人得不受理投資人賣回，待下列情況消失後開始（最快可自消失當日開始）接受投資人賣回：

- (1) 申請日前一日指數權重合計達 20%之成分股所屬市場於申請日休市，致申請日本 ETN 賣回總價金之避險部位無法完全出售。
- (2) 申請日前一日指數權重合計達 20%之成分股於申請日暫停交易或停止買賣，致申請日本 ETN 賣回總價金之避險部位無法完全出售。
- (3) 申請日前一日指數權重合計達 20%之成分股於申請日收盤價格跌停，致申請日本 ETN 賣回總價金之避險部位無法完全出售。
- (4) 申請日前一日占本指數投資證券流通在外總市值達 40%之避險 ETF(指數型基金)、ETN(指數投資證券)、期貨契約或指數相關衍生性商品，於申請日暫停交易或所屬市場休市，致申請日本 ETN 賣回總價金之避險部位無法完全出售。
- (5) 避險部位因匯兌交易受限制或所在國或地區之法規或命令，限制資金匯出或匯入。
- (6) 不可歸責於發行人之原因致通常使用之通信中斷、電腦系統異常、電力異常。
- (7) 證券集中保管事業因故無法進行指數投資證券劃撥轉帳交付或註銷作業。
- (8) 其他不可抗力之天然災害或重大事件，致申請日本 ETN 賣回總價金之避險部位無法完全出售或發行人就本 ETN 無法正常作業。

捌、公開說明書之取得

一、本指數投資證券之公開說明書備置於統一綜合證券股份有限公司金融商品部，投資人可免費索取。

二、投資人亦可於統一證券網址：[\(http://www.pscnet.com.tw/\)](http://www.pscnet.com.tw/)及公開資訊觀測站

(<http://mops.twse.com.tw/mops/web/index>) 免費取得本公開說明書電子檔。

玖、其他

統一NYSE FactSet亞洲半導體淨報酬指數指數投資證券(本指數投資證券於114年2月14日起更名為「統一NYSE FactSet亞洲半導體淨報酬指數指數投資證券」)(以下統稱「本證券」)係以「NYSE FactSet 亞洲半導體淨報酬指數」(本指數於114年2月14日起更名為「NYSE FactSet亞洲半導體淨報酬指數」)(NYSE FactSet Asia Semiconductor Net Total Return Index) (本指數於114年2月14日起更名為「NYSE FactSet Asia Semiconductor Net Total Return Index」)(以下統稱「標的指數」)之全部或部分為基礎。該標的指數係由 ICE Data Indices, LLC 或其關係企業所擁有，且已由 ICE Data Indices, LLC 授權予統一綜合證券股份有限公司使用。標的指數為 ICE Data Indices, LLC 與其關係企業之商標，並須經授權才可使用。標的指數係由 ICE Data Indices, LLC 或其關係企業所維護。ICE Data Indices, LLC 與統一綜合證券股份有限公司或其關係企業並無附屬關係。統一綜合證券股份有限公司已與 ICE Data Indices, LLC 就使用標的指數簽署授權契約。統一綜合證券股份有限公司或本證券並非由 ICE Data Indices, LLC 資助、擔保、分銷或推廣，且 ICE Data Indices, LLC 對統一綜合證券股份有限公司、本證券或本證券追蹤指數之能力不作出任何聲明及保證。ICE Data Indices, LLC 對標的指數及其包含之資料於特定目的之適銷性或適合性不作任何明示或暗示的保證，且排除任何的保證。ICE Data Indices, LLC 在任何情況下均不對任何特殊的、懲罰性的、直接或間接的或衍生的損害或損失(包括利潤損失)承擔任何責任，即使ICE Data Indices, LLC 已告知該等損失或損害發生的可能性亦同。ICE Data Indices, LLC不負責也不參與金融商品發行時機、價格、數量的決定。ICE Data Indices, LLC 不負責金融商品定價、買賣或贖回的公式計算與決策。ICE Data Indices, LLC 並非投資顧問。指數中包含的標的並非代表 ICE Data Indices, LLC 推薦買賣或持有，也不作為投資建議。指數過去表現不代表未來表現。指數由ICE Data Indices, LLC編輯與計算，編輯與計算過程中ICE Data Indices, LLC沒有義務納入被授權人或持有人的需求。

本指數投資證券經金融監督管理委員會同意生效，惟不表示本指數投資證券絕無風險。本指數投資證券為無優先受償順位、無擔保之有價證券，且不保障本金、無第三方保證。發行指數投資證券之證券商僅承諾，在指數投資證券到期或提前贖回後支付投資人與所追蹤標的指數表現連結之報酬，另扣除投資手續費用或追蹤費用。以國外指數為標的之指數投資證券，均採無升降幅度限制。本指數投資證券到期時或到期前賣回可領回金額，可能因市場波動、發行證券商違約或發生信用風險等因素，低於原始投資本金（最壞情形下可能為零），投資人交易前應詳閱公開說明書並確定已充分了解本指數投資證券之風險及特色。證券商不得以其已取得標的指數資格認可及櫃買中心同意其擬發行之指數投資證券上櫃，作為證實其申請事項或保證指數投資證券價值之宣傳。本公開說明書之內容如有虛偽或隱匿之情事者，應由發行證券商及其負責人與其他曾在公開說明書上簽章者依法負責。查詢本公開說明書之網址，包括主管機關指定之

資訊申報網站之網址及證券商揭露公開說明書相關資料之網址。

統一證券服務電話：(02)2747-8266 分機3725金融商品部