

# 瀚亞證券投資信託股份有限公司 函

地 址：(110)台北市信義區松智路1號4樓

電 話：(02)8758-6688 分機 1793,1792,1791

聯絡人：吳旻純、李書新、游琇惠

受文者：各境外基金銷售機構及投資型保險專設帳簿

發文日期：中華民國 110 年 10 月 6 日

發文字號：(110)瀚亞字第 0302 號

速別：最速件

密等及解密條件或保密期限：

附件：附件一

主旨：謹通知本公司總代理之境外基金短線交易認定原則，詳如說明，敬請配合辦理。

說明：

- 一、依「境外基金機構或總代理人與銷售機構就境外基金短線交易防制措施實務作業原則」辦理，本公司業已檢視總代理之境外基金短線交易認定原則，並已於民國 110 年 10 月 1 日公告於境外基金資訊平台之短線交易公告專區。其公告內容請詳附件或於該平台進行查詢。
- 二、本公司總代理之境外基金短線交易認定原則如有更新時，本公司將於境外基金資訊平台之短線交易公告專區辦理公告並發文通知。
- 三、嗣後境外基金機構如依前述短線交易認定原則、基金公開說明書或其它內部審查標準，需進一步提供投資人相關交易資料或說明，以協助判識疑似短線交易之行為者，請 貴公司協助配合提供予本公司或境外基金機構，俾便判斷。

正本：台灣銀行信託部、土地銀行信託部、合作金庫商業銀行信託部、第一商業銀行信託處、華南商業銀行信託部、彰化商業銀行信託處、花旗(台灣)商業銀行財富管理暨企劃行銷處、上海商業儲蓄銀行信託部、台北富邦商業銀行信託業務處、台北富邦商業銀行投資商品處、國泰世華商業銀行信託部、國泰世華商業銀行財富管理商品部、高雄銀行信託部、兆豐國際商業銀行信託部、王道商業銀行信託部、台灣中小企業銀行信託部、台中商業銀行信託部、京城商業銀行信託部、匯豐台灣商業銀行股份有限公司、匯豐台灣商業銀行財富管理部(CVM WD)、法商法國巴黎銀行、渣打國際商業銀行、華泰商業銀行、臺灣新光商業銀行信託部、陽信商業銀行信託部、陽信商業銀行財富管理部、板信商業銀行股份有限公司、三信商業銀行信託部、聯邦商業銀行財富管理部、遠東國際商業銀行產品行銷部、

元大商業銀行股份有限公司、永豐銀行理財商品部、玉山商業銀行、凱基商業銀行信託部、星展(台灣)商業銀行股份有限公司、星展(台灣)商業銀行股份有限公司、台新國際商業銀行信託部、日盛國際商業銀行、日盛國際商業銀行、安泰商業銀行個金產品行銷部、中國信託商業銀行信託部、瑞士商瑞士銀行股份有限公司、瑞興商業銀行股份有限公司、統一綜合證券股份有限公司、日盛證券股份有限公司、日盛證券股份有限公司財富管理部、群益金鼎證券股份有限公司、永豐金證券股份有限公司、凱基證券股份有限公司、元富證券股份有限公司、大昌證券股份有限公司、兆豐證券股份有限公司、富邦證券股份有限公司、元大證券股份有限公司、基富通證券股份有限公司、萬寶證券投資顧問股份有限公司、永豐證券投資顧問股份有限公司、中租證券投資顧問股份有限公司、鉅亨證券投資顧問股份有限公司、核聚證券投資顧問股份有限公司、富盛證券投資顧問股份有限公司、保誠人壽保險股份有限公司、保誠人壽保險股份有限公司、安聯人壽保險股份有限公司、全球人壽保險股份有限公司、台銀人壽保險股份有限公司、中國人壽保險股份有限公司、南山人壽保險股份有限公司、國泰人壽保險股份有限公司、法國巴黎人壽保險股份有限公司(SPM)、合作金庫人壽保險股份有限公司(SPM)、英屬百慕達商安達人壽保險股份有限公司台灣分公司、英屬百慕達商安達人壽保險股份有限公司國際保險業務分公司、富邦人壽保險股份有限公司、國際康健人壽保險股份有限公司、台灣人壽保險股份有限公司、第一金人壽保險股份有限公司、永豐證券投資顧問股份有限公司、台新證券投資顧問股份有限公司、國泰證券投資顧問股份有限公司、元大證券投資顧問股份有限公司、國泰證券投資信託股份有限公司、王道商業銀行股份有限公司

副本：

總經理 王伯莉

1. 2. 3. 4. 5. 6. 7. 8. 9. 10. 11. 12. 13. 14. 15. 16. 17. 18. 19. 20. 21. 22. 23. 24. 25. 26. 27. 28. 29. 30. 31. 32. 33. 34. 35. 36. 37. 38. 39. 40. 41. 42. 43. 44. 45. 46. 47. 48. 49. 50. 51. 52. 53. 54. 55. 56. 57. 58. 59. 60. 61. 62. 63. 64. 65. 66. 67. 68. 69. 70. 71. 72. 73. 74. 75. 76. 77. 78. 79. 80. 81. 82. 83. 84. 85. 86. 87. 88. 89. 90. 91. 92. 93. 94. 95. 96. 97. 98. 99. 100.

## 瀚亞投信境外基金短線交易認定標準

|  |   |
|--|---|
| <p>瑞萬通博基金系列</p>                              | <p>為利用子基金在評價上的無效率(下稱「時機交易」)而反覆買賣股份可能會影響子基金之投資策略及增加基金的成本，並對子基金長期股東之利益造成不利影響。董事會不允許時機交易的操作，且保留權利拒絕其懷疑可能從事時機交易之股東的申購及轉換申請，以及採取必要措施保護子基金其他股東。此外，客戶申購後於 30 個日曆日內對同一基金進行買回，將被視為潛在短線交易並列入短線交易報表進行交易監控，惟定期(不)定額、定額(不)定期、於同一基金間不同股份級別的轉換，及事先約定條件之電腦自動交易投資(如效率投資)得不納入短線交易控管範圍。總代理人為協助境外基金機構辨識上述之短線交易活動(如有)，得要求銷售機構提供相關投資人之交易活動細節說明及解釋。</p>  |
| <p>M&amp;G(Lux)投資基金(1)系列</p>                 | <p>擇時交易行為係指投資人利用時間差和/或 UCI 資產淨值決定方式之漏洞或缺陷，於短時間內有系統地申購並贖回或轉換同一 UCI 之股份的一種套利方法。本公司考量擇時交易行為可能致費用增加和/或稀釋獲利而影響本公司績效，故不接受之。因此，就任何可能或看似與擇時交易行為相關之申購或轉換股份之申請，本公司保留拒絕之權利，並於保障投資人權利不受此等行為影響之目的下，保留採取任何適當措施之權利。除具收取贖回費用之一般權力外，本公司如認投資人屬短時間內有系統地贖回或轉換股份者，本公司將考慮對該投資人收取股份贖回費用。此外，客戶申購後於 7 個日曆日內對同一基金進行買回，將被視為潛在短線交易並列入短線交易報表進行交易監控，惟定期(不)定額、定額(不)定期、於同一基金間不同股份級別的轉換，及事先約定條件之電腦自動交易投資(如效率投資)得不納入短線交易控管範圍。總代理人為協助境外基金機構辨識上述之短線交易活動(如有)，得要求銷售機構提供相關投資人的交易活動細節說明及解釋。</p> |
| <p>M&amp;G 投資基金(1)系列<br/>M&amp;G(英國)收益優化</p> | <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 被核可公司董事鼓勵股東以中至長期之投資策略投資子基金，不鼓勵頻繁交易、短線交易或違規交易操作。這些活動可能會對子基金或股東造成不利影響，被核可公司董事有權確保股東權益不受前述活動影響，包含：             <ol style="list-style-type: none"> <li>1) 絕其購買申請；</li> <li>2) 公平價格；</li> <li>3) 實施稀釋費用調整。</li> </ol> </li> <li>2. 被核可公司董事將監控股東之交易，若經認定為不當或頻繁交易時，可能對該股東採取任一下列步驟：</li> </ol>  |

|                 |   |
|-----------------|---|
|                 | <p>1) 發出警告通知，若不理會該通知可能導致申購被拒絕；</p> <p>2) 對特定股東限制交易方式；且/或，</p> <p>3) 徵收轉換費。</p> <p>3. 客戶申購後於7個日曆日內對同一基金進行買回，將被視為潛在短線交易並列入短線交易報表進行交易監控，惟定期(不)定額、定額(不)定期、於同一基金間不同股份級別的轉換，及事先約定條件之電腦自動交易投資(如效率投資)得不納入短線交易控管範圍。</p> <p>4. 總代理人為協助境外基金機構辨識上述之短線交易活動(如有)，得要求銷售機構提供相關投資人的交易活動細節說明及解釋。</p>   |
| <p>瀚亞投資基金系列</p> | <p>瀚亞投資基金並非為短線交易之投資人所設計，不允許任何對瀚亞投資之投資人利益有不利影響之行為，例如擇時交易或利用瀚亞投資基金作為過度或短線交易之工具。如管理公司研判特定交易或一定期間的交易模式(根據其交易監管程序)具有頻繁或短線交易性質，管理公司得暫停、取消、拒絕或另外處理投資人之申購或轉換申請，並得採取適當或必要之措施，以保護瀚亞投資及其投資人，包括最高得按贖回股份之每股資產淨值(NAV)的2%加計罰款，付予相關子基金。此外，客戶申購後於7個日曆日內對同一基金進行買回，將被視為潛在短線交易並列入短線交易報表進行交易監控，惟定期(不)定額、定額(不)定期、於同一基金間不同股份級別的轉換，及事先約定條件之電腦自動交易投資(如效率投資)得不納入短線交易控管範圍。總代理人為協助境外基金機構辨識上述之短線交易活動(如有)，得要求銷售機構提供相關投資人的交易活動細節說明及解釋。</p> |