

中信新興亞洲債(股票代號: 00848B)

追蹤指數: 彭博新興亞洲(不含中國)美元精選綜合債券指數

2022年1月

基金特色

- 投資人可直接參與美元亞洲債券市場: 提供看好亞洲成長潛力, 可直接參與投資等級亞洲主權債券及類主權債券。本基金至少70%以上資產直接投入標的指數成分債券, 並輔以證券相關商品交易使曝險比例貼近本基金淨資產價值100%。
- 複製指數, 投資標的透明: 本基金以追蹤「彭博新興亞洲(不含中國)美元精選綜合債券指數」績效表現為基金投資組合管理之目標。基金投資組合透明且容易掌握, 指數提供者亦會定期或不定期公布基金之標的指數的最新指數成分債券組合及相關異動訊息, 投資人也可透過許多公開資訊管道取得詳細的指數資料, 掌握投資效益。
- 投資有效率, 免除選標的煩惱: 本基金所追蹤之彭博新興亞洲(不含中國)美元精選綜合債券指數, 不但有其一定之編製規則及成分篩選機制, 且於定期檢視並調整成分債內容, 可以免除投資人選擇債券投資組合的煩惱。
- 交易方式便利, 交易成本低廉: 本基金在證券櫃檯買賣中心上櫃, 於證券交易營業日之交易時間內均可隨時進行買賣或於經理公司規定時間內透過參與證券商於初級市場進行申購回, 交易方式較一般共同基金一天只能買賣一次更為多元便利, 交易成本相對一般共同基金更為便宜。

基金小檔案

成立日期	2019/7/23
類型	指數股票型
經理人	游忠憲
保管銀行	台新銀行
經理費	基金淨資產價值低於30億(含)以下:0.40%/年 30億-200億(含):0.35%/年 200億(不含)以上:0.3%/年
保管費	基金淨資產價值低於30億(含)以下:0.10%/年 30-200億(含):0.09%/年 200億(不含)以上:0.08%/年
風險等級	RR3註
基金淨值(元)	37.217
總資產規模(台幣)	57.52 (億元)
彭博代碼	00848B TT Equity

註: 基金風險報酬等級之分類標準, 主要中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會基金風險報酬等級分類標準進行分類; 依中國信託投信之風險報酬等級表達原則, 其中RR1~RR2為保守型, RR3~RR4為穩健型, RR5為積極型。

前十大標的

標的	比重	發行公司
GENTMK 4 1/4 01/24/27	4.41%	雲頂海外控投資本有限公司
RILIN 4 1/8 01/28/25	3.30%	印度信實工業有限公司
ICICI 3 1/4 09/09/22	2.95%	印度工業信貸投資銀行有限公司
INDON 6 5/8 02/17/37	2.74%	印尼政府國際債券
PHILIP 7 3/4 01/14/31	2.52%	菲律賓政府國際債券
PETMK 4 1/2 03/18/45	2.43%	國油資本有限公司
PHILIP 5 01/13/37	2.32%	菲律賓政府國際債券
INDONESIA (REP)-INDON 5 1/4 01/1	2.28%	印尼政府國際債券
MINCAP 4 5/8 08/10/30	2.27%	Minejesa資本私人有限公司
INDON 8 1/2 10/12/35	2.26%	印尼政府國際債券

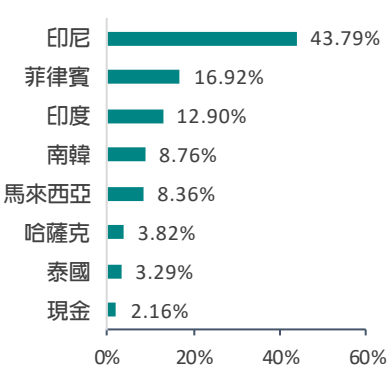
基金績效 (%)

期間	3個月	6個月	1年	2年	3年	今年以來	成立以來
新台幣	0.84	0.25	-2.23	0.08	NA	-2.23	-0.12

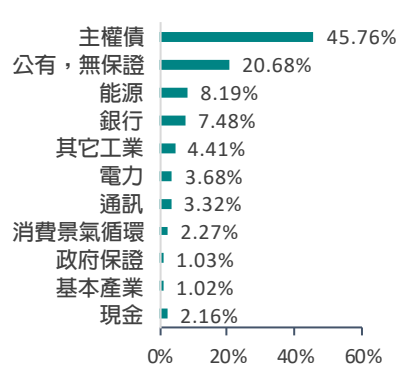
淨值走勢



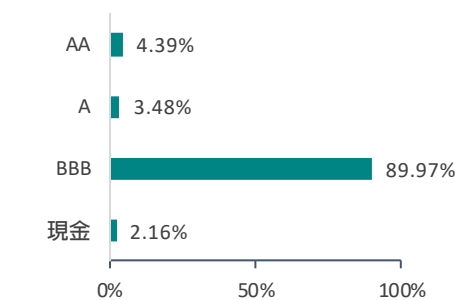
國家配置



產業配置



債信配置



本月報資料來源: Lipper、中國信託投信, 資料日期: 2021/12/30



中國信託投信
CTBC INVESTMENTS

中信新興亞洲債(股票代號: 00848B)

追蹤指數: 彭博新興亞洲(不含中國)美元精選綜合債券指數

2022年1月

經理人評論

- 中信新興亞洲(不含中國)ETF追蹤彭博新興亞洲(不含中國)美元精選綜合債券指數,並主要投資於非中國之主權債及非主權債,政府及相關企業8年以上,一般企業1年以上。截至12月底,基金持有72檔債券,持債比重97.84%,最差殖利率3.07%,最差信用利差1.52%,修正存續期間10.04年。
- 12月份,基金上漲0.22%,新興亞洲除了提高兩劑接種,中國和新加坡開始提高加強劑的接種率,皆有助後續經濟增長表現。利率方面,12月FOMC會議釋出減購資產規模翻倍聲明,符合市場共識,且暗示明年最多可能加息三碼,此為Powell近年來最強烈的鷹派轉向訊號。展望1月,持續追蹤新冠變異病毒Omicron對全球經濟的衝擊,為因應通膨,全球主要央行如聯準會、英國央行和歐洲央行均收緊了貨幣政策,新興市場央行也已調升基準利率水準來做因應,若供應鍊問題能有效解決,通膨將相對可控,而新興市場債券利差在經濟回升下有收斂的空間,在長期方面,則須留意政府與企業信用基本面變化,進而影響利差表現。

配息紀錄

月份	配息金額(元)	年化配息率	單季配息率	單季報酬率(含息)
2021/09	0.33800	3.62%	0.89%	-2.19%
2021/06	0.34100	3.57%	0.90%	2.28%
2021/03	0.41100	4.32%	1.10%	-1.95%
2020/12	0.35300	3.63%	0.91%	-0.53%
2020/09	0.30500	3.06%	0.78%	-0.65%
2020/06	0.33600	3.36%	0.83%	6.30%

說明: 基金配息之年化配息率=每單位配息金額÷除息日前一日之淨值×一年配息次數×100%。年化配息率為估算值。
基金配息之單月配息率計算方式:(每單位配息金額÷除息日前一日淨值)*100%。
基金配息之單月報酬率(含息)=[(當月除息日淨值+每單位配息金額)/前月除息日淨值-1]*100%。
本基金自成立以來由本會支付配息之相關資料可至本公司官網www.ctbcinvestments.com查詢。

【中國信託投信獨立經營管理】

- ◆ 本基金經管會核備在國內募集及銷售,惟不表示絕無風險,本公司除盡善良管理人注意義務外,不負責投資之盈虧,基金經理公司以往之經理績效不保證基金之最低投資收益,亦不必然為未來績效表現,投資人申請前應詳閱基金公開說明書。基金應負擔之費用(含分銷費用)已揭露於基金之公開說明書中,投資人可前往本公司網站投資人可前往本公司網站(www.ctbcinvestments.com)及公開資訊觀測站(mops.twse.com.tw)中查詢。各銷售機構均備有基金公開說明書,歡迎索取。本基金並無受存款保險、保險安定基金或其他相關保障機制之保障。匯率走勢亦可能影響所投資之海外資產而使資產價值變動。
- ◆ 本資料僅供參考,請勿將其視為買賣基金或其他任何投資之建議或邀約。以上所作任何投資意見與市場分析結果,係依據資料製作當時情況進行判斷,本公司已力求資訊之正確與完整,惟文中之數據、預測或意見仍可能有脫漏或錯誤之處,本公司不保證本資料內容及來源資料之正確及完整性;或因市場環境變化已有變更,投資標之價格與收益亦將隨時變動,投資人因不同時間進場,將有不同之投資績效,過去的績效亦不代表未來績效之保證,投資人應自行判斷投資標的、投資風險,或尋求專業之投資建議,不應將本資料內容引為投資之唯一依據,若有投資損益或因使用本資料所生之直接或間接損失,應由投資人自行負責。本文提及之經濟走勢預測不必然代表基金之績效,基金投資風險請詳閱基金公開說明書。
- ◆ 各基金之操作目標在追蹤與標的指數相關之報酬【(中國信託新興亞洲(不含中國)美元精選綜合債券ETF證券投資信託基金(本基金有一定比重投資於非投資等級之高風險債券)之標的指數為彭博新興亞洲(不含中國)美元精選綜合債券指數),而標的成分債券價格波動(包括但不限於受利多、利空、債券交易市場流動性不足、交易對手之信用風險、利率風險等因素影響)將影響基金標的指數的走勢,然基金追求標的指數報酬之目標,不因標的指數劇烈波動而改變。
- ◆ 投資涉及新興市場部份,因其波動性及風險程度可能較高,且其政治經濟情勢穩定度可能低於已開發國家,基金淨資產價值可能承受不同程度的影響及基金資產有一定比重投資於非投資等級之高風險債券,由於高收益債券之信用評等由於未達投資等級,且對利率變動的敏感度甚高,故部份基金可能會因利率上升、市場流動性下降,或債券發行機構違約不支付本金、利息或破產而蒙受虧損,該等基金不適合無法承擔相關風險之投資人,且不宜占投資人投資組合過高之比重。各子基金可能面臨之風險包含但不限於債券流動性風險、匯率風險、投資地區政治或經濟變動之風險、交易對手信用風險等,而基金所投資之債券可能隱含發行人無法償付本息之違約風險,各子基金所投資標的發生上開風險時,基金之淨資產價值可能因此產生波動。各子基金配息率不代表基金報酬率,且過去配息率不代表未來配息率,基金淨值可能因市場因素而上下波動,於獲配息時須一併注意基金淨值之變動。
- ◆ 本基金雖以追蹤標的指數報酬為目標,然下列因素仍可能使基金報酬偏離標的指數報酬,且偏離方向無法預估:
(1) 基金可能因應申贖或維持所需曝險比例等因素而需每日進行基金曝險調整,故基金淨值將受到每日所交易之有價證券或期貨成交價格、交易費用、基金其他必要之費用(如:經理費、保管費、上櫃費等)、投資組合成分價格波動或基金整體曝險比例等因素的影響而使基金報酬與投資目標產生偏離。
(2) 基金投資組合與標的指數相關性將受到基金持有之有價證券或期貨與標的指數之相關性等因素影響。此外,基金投資組合中持有的期貨部位,因期貨的價格發現功能使其對市場信息、多空走勢之價格反應可能不同於債券,因此當市場出現特定信息時,基金淨值將同時承受期貨及債券對市場信息反應不一所產生的價格波動影響,可能使基金報酬與投資目標產生偏離。
(3) 基金以新臺幣計價,而基金所投資的有價證券或期貨標的可能為新臺幣以外之計價貨幣,由於各子基金暫不從事匯率避險,因此各子基金承受相關匯率波動風險可能使基金報酬與投資目標產生偏離。
- ◆ 基金自成立日起,即運用基金資產進行投資組合佈局,基金投資組合成分價格波動會影響基金淨值表現。投資人於基金成立日(不含當日)前參與申購所買入的基金每受益權單位之發行價格,不等於基金掛牌上櫃之價格,參與申購投資人需自行承擔基金成立日起自上市櫃掛牌日止期間之基金淨資產價格波動所產生之折/溢價的風險。本基金上市櫃前(不含當日),經理公司不接受基金受益權單位數之買回。基金受益憑證上市櫃後之買賣成交價格無升降幅度限制,並應依財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心(以下簡稱證交所)所有規定辦理。
- ◆ 各子基金於上市櫃日後將依證券櫃檯買賣中心所規定於臺灣證券交易所時間內提供盤中估計淨值供投資人參考。基金淨值以新臺幣計價而基金主要投資標的為債券或期貨,因此匯率波動會影響基金淨值之計算,而計算盤中估計淨值所使用的盤中即時匯率,因評價時點及資訊來源不同,與實際基金淨值計算之匯率或有差異,因此計算盤中估計淨值與實際基金淨值計算之基金投組或有差異,投資人應注意盤中估計淨值與實際淨值可能有誤差之風險,經理公司於臺灣證券交易所時間內提供的盤中估計淨值僅供投資人參考,實際淨值應以本公司最終公告之每日淨值為準。
- ◆ 「彭博®」及中國信託投信基金公開說明書所載之彭博指數為Bloomberg Finance L.P.及其關係企業(包括指數管理公司—彭博指數服務有限公司(「BISL」)) (統稱「彭博」)的服務商標,且已授權由中國信託投信用於若干用途。彭博與中國信託投信並無關聯,且彭博並不會審批、認證、審查或推薦中國信託投信基金。彭博不就中國信託投信基金任何相關資料或資訊之即時性、準確性或完整性作出任何保證。