

中國信託15年期以上新興市場美元主權低碳債券ETF基金

2022年1月

基金特色

- 低碳愛地球，把關長期投資風險。
- 鎖定長天期新興市場主權債。
- 篩選投資等級債以上之優質債券。

基金小檔案

成立日期	2021/1/27
類型	指數股票型
經理人	游忠憲
保管銀行	彰化銀行
經理費	基金淨資產價值30億以下(含)： 0.30%/年 30億(不含)以上：0.20%/年
保管費	基金淨資產價值30億(含)以下： 0.16% 30(不含)-200億(含)：0.10% 200億(不含)以上：0.06%
風險等級	RR3註
基金淨值(元)	38.0988
總資產規模(台幣)	10.07 (億元)
彭博代碼	00884 TT Equity

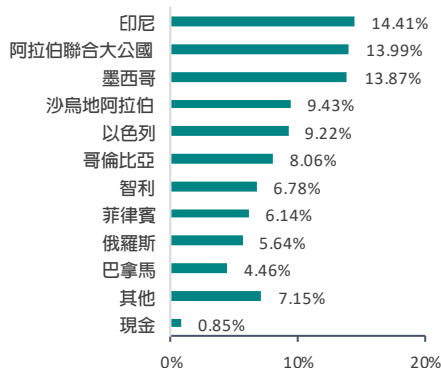
基金績效(%)

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	1.81	-0.02	NA	NA	NA	NA	-2.73

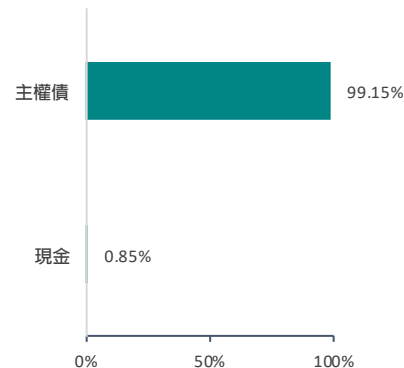
淨值走勢



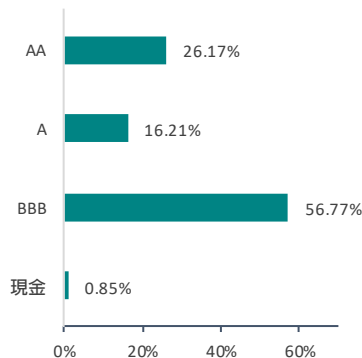
國家配置



產業配置



債信配置



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
ADGB 3 7/8 04/16/50	4.20%	阿布達比政府國際債券
RUSSIA 5 1/4 06/23/47	4.19%	俄羅斯外國債券-歐洲債券
ADGB 4 1/8 10/11/47	3.66%	阿布達比政府國際債券
ADGB 2 7/8 09/02/70	3.30%	阿布達比政府國際債券
ISRAEL 3 8 05/13/60	3.23%	以色列國
CHILE 3 5 04/15/53	2.87%	智利政府國際債券
ADGB 3 1/8 09/30/49	2.83%	阿布達比政府國際債券
COLOM 5 06/15/45	2.74%	哥倫比亞政府國際債券
ISRAEL 3 7/8 07/03/50	2.63%	以色列政府國際債券
KSA 4 1/2 10/26/46	2.60%	Saudi Government Internation

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

中國信託15年期以上新興市場美元主權低碳債券ETF基金

2022年1月

經理人評論

- 中信低碳新興債ETF追蹤ICE 15年期以上新興市場美元主權低碳債券指數，主要投資於新興市場政府發行之15年期以上且債信評等BBB-以上之美元計價債券，指數鎖定長天期新興市場主權債，篩選投資等級債以上之債券，精選前12大新興市場國家。截至12月底，基金持有51檔債券，持債比重99.15%，最差殖利率3.64%，最差信用利差1.79%，修正存續期間16.16年。
- 12月份基金上漲0.99%，整體新興市場從去年復甦情況較不如成熟型國家，但主權債被調降的情況也持續改善，有助利差的收斂。利率方面，12月FOMC會議fed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，部分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，經濟回升下，新興市場財政收入增加，赤字減少，有助利差收斂的空間。長期則須留意fed調升利率的速度將影響資金流向，和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	0.33700	2.66%	0.86%	-3.19%

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公司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】

- ◆ 【中國信託投信 獨立經營管理】本公司經理之基金，皆經金管會核准或同意生效在國內募集及銷售，惟並不表示絕無風險，本公司除盡善良管理人之注意義務外，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，投資人申購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(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。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。
- ◆ 本基金以追蹤標的指數報酬為操作目標，而標的指數之成分證券價格波動將影響標的指數的走勢，當標的指數的成分證券價格波動劇烈或變化時，本基金的淨資產價值亦承受大幅波動的風險。因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. 基金可能受成本費用、投資組合價格波動或基金整體槓桿比例等因素的影響而使基金報酬與投資目標產生偏離。2. 基金如持有期貨部位，基金淨值將同時承受期貨及債券對市場信息反應不一而產生的追蹤偏離。3. 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。
- ◆ 基金上市/上櫃日前(不含當日)，經理公司不接受基金受益權單位數之贖回。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，不同於基金掛牌上市/上櫃之價格，參與申購投資人需自行承擔基金成立日起自掛牌日止期間之基金淨資產價格波動所產生折/溢價的風險，各子基金上市/上櫃後的次級市場成交價格亦可能不同於基金每營業日結算所得之淨值，而有折/溢價之交易風險。基金受益憑證上市/上櫃後之買賣成交價格無升降幅度限制，並應依臺灣證交所所屬規定辦理。惟投資人應注意盤中估計淨值與實際淨值可能有誤差值之風險，經理公司於臺灣證券交易所提供之各子基金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。本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。
- ◆ 【中國信託全球收益ETF傘型基金】之操作目標在追蹤與標的指數相關之報酬(中國信託15年期以上新興市場美元主權低碳債券ETF證券投資信託基金之標的指數為ICE 15年期以上新興市場美元主權低碳債券指數)
- ◆ 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。本基金上櫃日前(不含當日)，經理公司不接受基金受益權單位數之贖回。基金受益憑證上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)所有關規定辦理。
- ◆ 各子基金於上櫃日後將依證交所櫃檯買賣中心所規定於臺灣證券交易所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值之風險，經理公司於臺灣證券交易所提供之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。
- ◆ 指數免責聲明：基金標的指數經許可使用來源ICE Data Indices, LLC(以下稱ICE Data)。ICE 15年期以上新興市場美元主權低碳債券指數係ICE Data或其關係企業之服務/營業標章，且已與系列指數一併授權以供中國信託投信使用之。中國信託投信及基金均非由ICE Data Indices, LLC、其關係企業或第三人供應商(「ICE Data 和其供應商」)贊助、背書、販售或宣傳。ICE Data對中國信託投信之惟一關係，僅止於授權特定商標和商號以及指數或指數成分。ICE Data及其供應商不提供任何保證、陳述及所有的明示和/或暗示，包括對適銷性或適用於特定用途或使用的包括指數、指數數據以及包含相關或衍生的任何信息(“Index Data”)的任何保證。ICE Data及其供應商不對指數和Index Data的充分性、準確性、時性或完整性承擔任何損害或責任，均按“原樣”提供，使用者取得相關資料的風險自行承擔。
- ◆ 投資於新興市場國家企業所發行債券，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，另本基金可能會因匯率變動、市場流動性變動等因素而蒙受虧損，故不適合無法承擔相關風險之投資人。

中國信託證券投資信託股份有限公司 / 台北總公司：台北市南港區經貿二路188號12樓 / 02-2652-6688；台中分公司：台中市西區忠明南路499號9樓之1 / 04-2372-5199



中國信託投信
CTBC INVESTMENTS