

中信上櫃ESG 30 (股票代號：00928)

追蹤指數：臺灣指數公司特選上櫃ESG 30指數

2024年5月

基金特色

- 本基金追蹤「臺灣指數公司特選上櫃ESG 30指數」由30檔財務品質及ESG永續表現優異之上櫃股票組成，以表彰兼具可投資性與永續發展表現佳之上櫃公司投資績效表現。
- 基金投資組合與標的指數成分股相近，指數提供者定期公布標的指數之最新成分股，亦會不定期公布最新成分股異動訊息，資訊取得容易且公開透明。
- ETF交易方式便利，且交易成本相對低。本基金在證券櫃檯買賣中心掛牌上櫃，於證券交易營業日之交易時間內可隨時進行買賣交易，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買回。

基金小檔案

成立日期	2023/5/17
類型	指數股票型
經理人	張嘉祐
保管銀行	第一銀行
經理費	0.4%/年
保管費	0.035%(年)
風險等級	RR5
基金淨值(元)	17.03
總資產規模(台幣)	4.32 (億元)
彭博代碼	00928 TT Equity

註：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。參酌中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會所制定之基金風險報酬等級分類標準，該分類標準係計算過去5年基金淨值波動度標準差，以標準差區間予以分類等級，惟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），不宜作為投資唯一依據，投資人仍應注意所有投資本基金之風險，如：價格波動風險、類股過度集中或產業景氣循環風險等。

基金績效(%)

期間	3個月	6個月	1年	2年	3年	5年	今年以來	成立以來
報酬率	6.24	18.73	NA	NA	NA	NA	7.02	17.93

淨值走勢

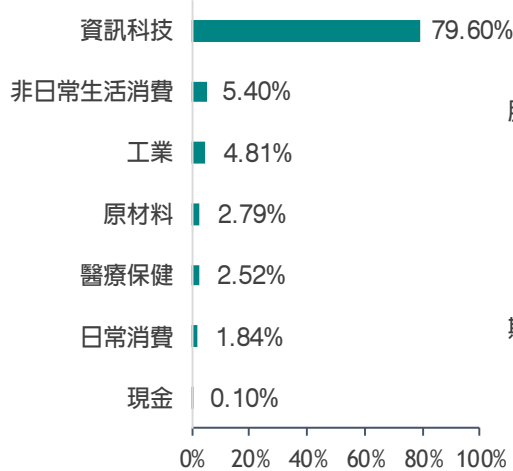


前十大標的

公司名稱	產業類別	比重
元太	光電業	13.83%
新普	電腦及週邊設備業	10.22%
中光電	光電業	9.39%
力旺	半導體業	5.49%
群聯	半導體業	5.31%
環球晶	半導體業	5.29%
中美晶	半導體業	4.65%
台耀	電子零組件業	4.60%
世界	半導體業	3.80%
寶雅	居家生活	3.57%

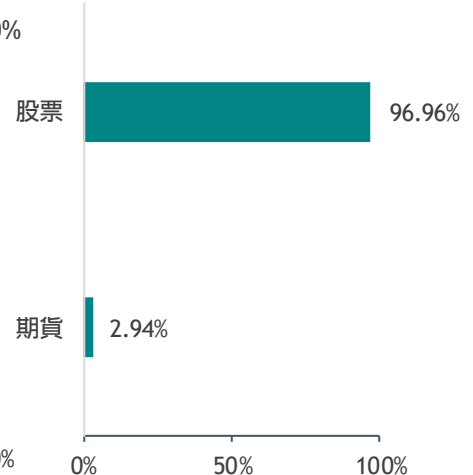
產業配置

註：僅表示所投資之股票產業配置



資產配置

註：本ETF配置部分期貨，故總和可能超過100%



本月報資料來源：中國信託投信，資料日期：2024/04/30



中國信託投信
CTBC INVESTMENTS

中信上櫃ESG 30 (股票代號：00928)

追蹤指數：臺灣指數公司特選上櫃ESG 30指數

2024年5月

經理人評論

- 資金市場：目前美國經濟表現稍有疲弱態勢，勞動市場出現持續降溫，表彰薪資通膨的薪資增速回落、就業人數與失業率均未於市場預期，PMI回落榮枯線50以下，以上綜合聯準會月初FOMC聲明不升息，但降息未確定的態度，2024年降息應無懸念，聯準會可能於下半年迎來第一次降息之預期不變、奧運行情及美國總統大選，可望助攻台股長線走勢，謹慎樂觀看待。
- 國內經濟：國內最新公布三月景氣對策信號，連續 3 個月呈現穩定的綠燈，較 2月增加1分，至30 分，經理人指數未來六個月展望維持上行趨勢，新增訂單、生產數量持續回升，產業普遍站上榮枯線以上，其中以電子暨光學產業表現最為強勢，科技與新能源發展為長期趨勢，指數若逢整理正為長期資金部位分批介入的時機，投資以具多重題材，與政策支持的產業，如AI、新能源、電動車等產業為主，我們看好由AI及通訊帶來的科技革命，搭配上櫃市場中的利基型產業，透過ETF做一籃子持有投資，增加資金運用效率，但仍應留意實質需求(訂單)續航力，做為投資部位調節之依據。

配息紀錄

月份	配息金額(元)	單次配息率	單次報酬率(含息)
2023/12	0.6000	3.68%	--

【中國信託投信獨立經營管理】

- ◆ 本基金經金融監督管理委員會(以下簡稱「金管會」)核准或同意生效，惟不表示本基金絕無風險。經理公司以往之經理績效不保證本基金之最低投資收益；經理公司除盡善良管理人之注意義務外，不負責本基金之盈虧，亦不保證最低之收益，投資人申購前應詳閱本基金公開說明書。投資人可至下列網址查詢本公開說明書：本公司網站(www.ctbcinvestments.com)或公開資訊觀測站(<http://mops.twse.com.tw>)。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買回。
- ◆ 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。故投資本基金可能發生部分或全部本金之損失，最大可能損失則為全部投資金額。金融消費爭議處理及申訴管道：就本公司所提供之金融商品或服務所生紛爭投資人應先向本公司提出申訴，若三十日內未獲回覆或投資人不滿意處理結果得於六十日內向「金融消費評議中心」申請評議。
- ◆ 本基金屬環境、社會及治理相關主題基金，永續相關重要發行資訊之揭露請詳見第21頁至第25頁，定期評估資訊將於公司網站(<https://www.ctbcinvestments.com>)公告
- ◆ 有關基金之 ESG資訊，投資人應於申購前詳閱基金公開說明書或投資人須知所載之基金所有特色或目標等資訊。
- ◆ 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，本基金之淨資產價值亦承受大幅波動的風險。
- ◆ 本基金雖以追蹤標的指數為操作目標，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. 本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，故基金淨值將受到所交易之有價證券或期貨價格波動、交易費用、基金其他必要之費用(如：經理費、保管費、上櫃費等)或基金整體曝險比例等因素影響而使基金報酬與投資目標產生偏離。2. 本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，基金投資組合中如持有一期期貨部位，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所對應的有價證券，因此當市場出現特定信息時，基金淨值將同時承受期貨及所投資之有價證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。
- ◆ 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，不同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至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，本基金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。基金受益憑證上櫃後之買賣成交價格應依指財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心(以下簡稱證券櫃檯買賣中心)有關規定辦理。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時間內提供的本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。

【臺灣指數免責聲明】

- ◆ 臺灣指數公司特選上櫃 ESG 30 指數係由臺灣指數股份有限公司(臺灣指數公司)、財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心(櫃檯買賣中心)(以上機構合稱「合作單位」)共同開發，並由臺灣指數公司單獨授權中國信託證券投資信託股份有限公司使用。「合作單位」並未以任何方式贊助、背書、出售或促銷「臺灣指數公司特選上櫃 ESG 30 指數」，且「合作單位」亦未明示或默示對使用指數之結果及/或指數於任一特定日期之任一特定時間或其他時間之數據提供任何保證或聲明。指數係由臺灣指數公司所計算。然「合作單位」就指數之任何錯誤、不正確、遺漏或指數資料之傳輸中斷對任何人均不負任何責任，且無任何義務將該等錯誤、不正確或遺漏通知任何人。

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