

# 中國信託ESG碳商機多重資產基金

(本基金有相當比重投資於非投資等級之高風險債券且本基金之配息來源可能為本金)

2022年8月

## 基金特色

- 掌握「ESG 碳商機」 站在綠色永續浪潮上：主要投資具「ESG 碳商機」概念之有價證券，網羅目前主流 ESG 碳商機相關之產業及概念個股，亦包括未來因碳排放管理應用所產生的新興行業，提供投資人資產成長機會之投資管道。
- 多重資產靈活調整，順全球景氣而為：除了股票及債券外，也將配置在基金受益憑證等資產類別；並根據全球景氣變化彈性調整不同資產投資比重，不拘泥於固定資產配置比例，善用景氣循環所帶來的資產報酬。
- 結合海外投資團隊，共享資源與經驗：與海外領先資產管理公司結盟，借重其在全球範圍內之經驗專長及研究能量，針對投資主題提供最新投資建議與產業發展脈動，建構具有獲利成長與前瞻性的投資組合，進一步提升操作績效。

## 基金小檔案

成立日期	2022/5/5
類型	多重資產型
經理人	張正鼎
保管銀行	彰化銀行
經理費	1.7%(每年)
保管費	0.26%(每年)
風險等級	RR3註
基金淨值(元)	美元A 10.16
	新台幣A 10.31
	美元B 10.16
	新台幣B 10.31
	美元NB 10.16
	新台幣NB 10.31
總資產規模(新台幣)	34.99 (億元)
彭博代碼	美元A CTCTMAU TT
	新台幣A CTCTMAT TT
	美元B CTCTMBU TT
	新台幣B CTCTMBT TT
	美元NB CTCTMNU TT
	新台幣NB CTCTMNT TT

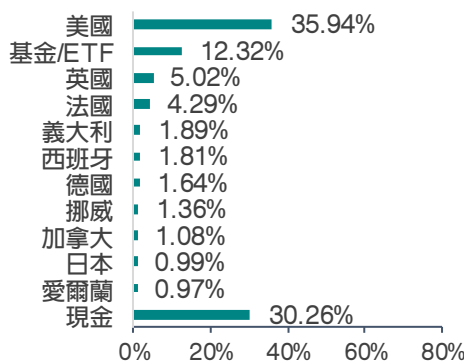
## 基金績效(%)

待成立滿 6 個月 (2022年12月底) 之後提供

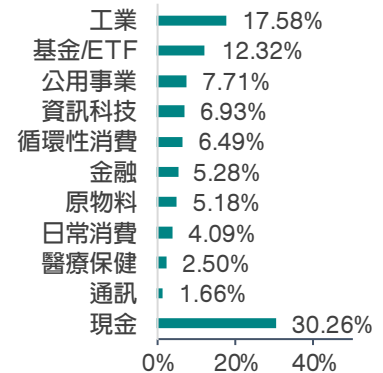
## 淨值走勢

待成立滿 6 個月 (2022年12月底) 之後提供

## 國家配置



## 產業配置

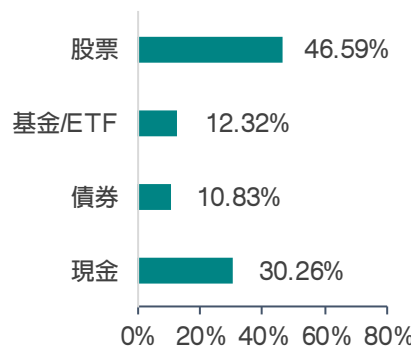


註：依中國信託投信之風險報酬等級表達原則，其中RR1~RR2為保守型，RR3~RR4為穩健型，RR5為積極型。參酌中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會所制定之基金風險報酬等級分類標準，該分類標準係計算過去5年基金淨值波動度標準差，以標準差區間予以分類等級，惟此等級分類係基於一般市場狀況反映市場價格波動風險，無法涵蓋所有風險（如：基金計價幣別匯率風險、投資標的產業風險、信用風險、利率風險、流動性風險等），不宜作為投資唯一依據，投資人仍應注意所有投資本基金之風險，如：價格波動風險、類股過度集中或產業景氣循環風險等。

## 前十大標的

公司名稱	產業類別	比重
中國信託華盈貨幣市場基金	基金/ETF	8.01%
KraneShares全球碳策略ETF	基金/ETF	4.07%
AGCO公司	工業	1.77%
美國水處理公司	公用事業	1.75%
威立雅環境有限責任公司	公用事業	1.70%
天寶公司	資訊科技	1.63%
凱捷公司	資訊科技	1.61%
多佛公司	工業	1.61%
Cadence設計系統公司	資訊科技	1.59%
廢棄物管理	工業	1.55%

## 資產配置



本月報資料來源：中國信託投信，資料日期：2022/7/29



中國信託投信  
CTBC INVESTMENTS

# 中國信託ESG碳商機多重資產基金

## (本基金有相當比重投資於非投資等級之高風險債券且本基金之配息來源可能為本金)

2022年8月

### 經理人評論

- 本基金自5/5成立至7/29止，整體投資部位累積至61.68%。其中股票50.85%、債券10.83%、國際碳權ETF 4.29%，國家配置(股+債)以美國、法國、英國為前三大，分別佔38.71%、5.5%、5.02%。產業配置則以工業、公用事業、科技為前三大，分別為20.2%、7.68%、6.11%。由於7月聯準會升息策略與市場一致，再加上第二季企業財報優於預期占比仍達73%，因此激勵美、歐股市跌深反彈。國際油價自6月下旬高點回檔約20%，對通膨居高不下的壓力形成舒緩，故研判第四季通膨利空可逐漸淡化，有利於風險性資產價格出現波段反彈。因此本基金操作上將從「資產保護」階段進入「成長收益」階段，將積極布局於業績成長型的企業，如科技、必選性消費等。債券部位則維持策略不變，以平均5年以下、殖利率4%以上的投資級債，另搭配少量非投資等級債為主。以股優於債的投資組合，朝向第四季創造資本利得最大化之投資目標。

### 【中國信託投信獨立經營管理】

- ◆ 本基金經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。
- ◆ 本公開說明書可至下列網址查詢：公開資訊觀測站<http://mops.twse.com.tw>或經理公司網站<http://www.ctbcinvestments.com>
- ◆ 本基金有關ESG主題的篩選邏輯須依賴第三方ESG評鑑機構取得的資料及數據來評估某一有價證券或發行人，而該等資料及數據可能並不完整、不準確或無法取得，而存在依賴該等資料或數據評估相關之風險。
- ◆ ESG投資在某程度上而言是主觀的，不保證基金所作的投資將會反映任何特定投資者的信仰或價值觀。基金的投資政策將採用以ESG為基礎的剔除標準，若干產業可能被排除，包括色情、賭場和博奕、軍火、未具有碳數據或碳政策揭露有關產業之企業及本公司所制定基於考量環境、社會與公司治理所需排除之投資企業名單。但所排除的相關產業未必直接與投資者本身主觀的倫理觀點相符。
- ◆ 本基金以「ESG碳商機」主題為投資訴求，或可能或侷限本基金之其他投資機會，或當所持有價證券的ESG碳商機投資特徵改變，導致必須出售該有價證券。本基金可能因基金投資方針聚焦於「ESG碳商機」主題而影響本基金之投資表現。
- ◆ 有關本基金特性及與永續相關重要發行資訊詳請如公開說明書【附錄五】本公司發行環境、社會與治理(ESG)相關主題基金之資訊揭露及本公司網站<http://www.ctbcinvestments.com>
- ◆ 受益人投資遞延手續費之NB類型各計價類別受益憑證者，其手續費之收取將於買回時支付，且該費用將依受益人持有期間而有所不同，其餘費用之計收與前收手續費類型受益憑證相同，亦不加計分銷費用。NB類型各計價類別受益憑證遞延手續費之規定，請詳本基金公開說明書「基金概況/壹、基金簡介/十四、銷售價格」及「基金概況/玖、受益人之權利及費用負擔」之內容。
- ◆ 本基金得視市場情況投資非投資等級債券，投資人投資本基金時不宜占其投資組合過高之比重。由於非投資等級債券之信用評等未達投資等級或未經信用評等，且對利率變動的敏感度甚高，本基金可能因利率上升、市場流動性下降或債券發行機構違約不支付利息、本金或破產而蒙受虧損，故本基金不適合無法承受相關風險之投資人。又本基金可投資於美國Rule144A債券，該債券屬私募性質，故而發行人之財務狀況較不透明，較可能發生流動性不足，財務訊息揭露不完整或因價格不透明導致波動性較大之風險。
- ◆ 本基金之配息級別採每月配息評價機制，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。基金的配息可能由基金的收益或本金中支付，任何涉及由本金支出的部份，可能導致原始投資金額減損。本基金之配息級別進行配息前未先扣除應負擔之相關費用。有關本基金之配息級別之配息組成項目揭露於本公司網站。
- ◆ 本基金投資於基金受益憑證部份可能涉有重複收取經理費。
- ◆ 本基金包含新臺幣及美元計價級別，除法令另有規定或經主管機關核准外，新臺幣計價級別之所有申購及買回價金之收付，均以新臺幣為之；美元計價級別之所有申購及買回價金之收付，均以美元為之。如投資人以非本基金計價幣別之貨幣換匯後申購本基金者，須自行承擔匯率變動之風險。此外，因投資人與銀行進行外匯交易有賣價與買價之差異，投資人進行換匯時須承擔買賣價差，此價差依各銀行報價而定。此外，基金可能投資於各計價幣別之投資標的，當不同幣別間之匯率產生較大變化時，將會影響基金不同計價幣別受益權單位之淨資產價值。另外，投資人亦須承擔匯款費用，且外幣匯款費用可能高於新臺幣匯款費用。
- ◆ 為避免因受益人短線交易頻繁，造成基金管理費及交易成本增加，進而損及基金長期持有之受益人之權益，並稀釋基金之獲利，本基金不歡迎受益人進行短線交易。
- ◆ 投資人應特別留意，本基金因計價幣別不同，投資人申購之受益權單位數為該申購幣別金額除以發行價格計，於召開受益人會議時，各計價幣別受益權單位每受益權單位有一表決權，不因投資人取得各級別每受益權單位之成本不同而異。

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