

# 中信低碳新興債 (股票代號：00884B)

## (本基金非屬環境、社會及治理相關主題基金)

追蹤指數：ICE 15年期以上新興市場美元主權低碳債券指數

2024年5月

### 基金特色

- 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	呂紹儀
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% 30億(不含)以上：0.20%
保管費	基金淨資產價值 30億以下(含):0.16% 30(不含)-200億(含):0.10% 200億(不含)以上:0.06%
風險等級	RR3註
最差殖利率(%)	6.21
平均存續期間	12.90
基金淨值(元)	29.9392
總資產規模(台幣)	21.24 (億元)
彭博代碼	00884B 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。

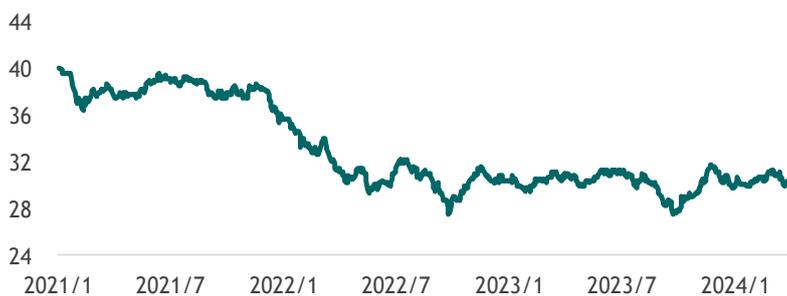
### 前十大標的

標的	比重	發行公司
MEX 5.75 10/12/10 GMTN	5.11%	UNITED MEXICAN STATES
KSA 4.625 10/04/47 REGS	4.30%	SAUDI INTERNATIONAL BOND
MEX 5.55 01/21/45	3.32%	UNITED MEXICAN STATES
CHILE 3.1 05/07/41	3.08%	智利政府國際債券
INDON 4.2 10/15/50	3.04%	印尼政府國際債券
MEX 4.5 01/31/50	3.02%	UNITED MEXICAN STATES
PERU 5.625 11/18/50	2.92%	秘魯政府國際債券
COLOM 5 06/15/45	2.85%	哥倫比亞政府國際債券
KSA 4.5 04/22/60 REGS	2.37%	SAUDI INTERNATIONAL BOND
ADGB 2.7 09/02/70 REGS	2.33%	阿布達比政府國際債券

### 基金績效(%)

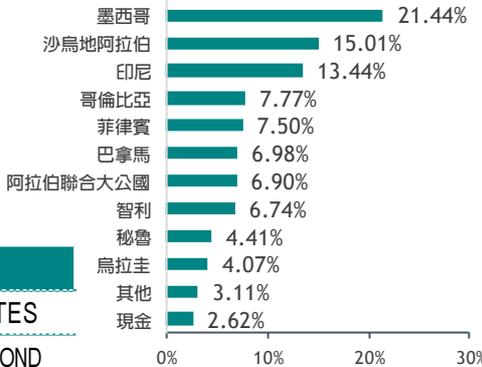
期間	3個月	6個月	1年	2年	3年	今年以來	成立以來
新台幣	-0.66	9.40	1.02	5.27	-9.01	-1.99	-14.90

### 淨值走勢

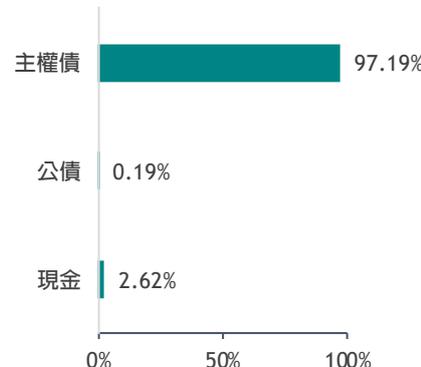


### 國家配置

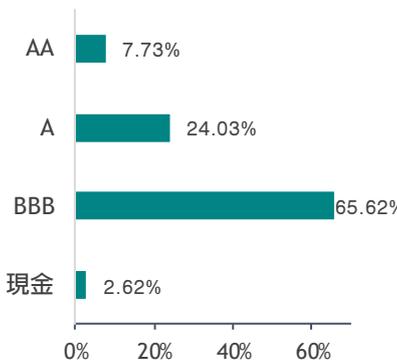
註：國家為曝險國別



### 產業配置



### 債信配置



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

# 中信低碳新興債 (股票代號：00884B)

## (本基金非屬環境、社會及治理相關主題基金)

### 追蹤指數：ICE 15年期以上新興市場美元主權低碳債券指數

2024年5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4月底，基金持有67檔債券，持債比重97.38%，最差殖利率6.21%，最差信用利差1.49%，修正存續期間12.90年。
- 4月份基金淨值下跌4.18%，聯準會主席鮑威爾在會後提問環節抹去升息的可能，將利率維持在限制區間 5.25%~5.50% 並將自6月起放緩縮表規模，進一步安撫了市場對今年稍早通膨陷入停滯的疑慮。考量到美國近期經濟持續穩健地擴張，就業市場依舊強勁，過去一年的通膨雖有所放緩但仍處在高位，在有足夠信心通膨能夠持續朝向2%的目標之前，不會調整利率區間，市場也同步延後第一次預期降息時間點來到2024年11月。展望5月，新興國家的通膨持續放緩，可望令新興國家央行維持寬鬆立場，提振經濟，有助資金重啟回流新興市場，較高息收的新興市場料將持續得到資金青睞。整體而言產業面受到政府支持，有助信用利差穩定，而美債走勢也是影響新興市場利率表現重要因素之一。

#### 配息紀錄

月份	配息金額(元)	單季配息率	單季報酬率(含息)
2024/03	0.1800	0.60%	-0.97%
2023/12	0.3590	1.17%	11.94%
2023/09	0.3590	1.16%	-10.42%
2023/06	0.3480	1.15%	3.58%
2023/03	0.3440	1.13%	0.99%
2022/12	0.3550	1.26%	9.23%

說明：

1. 當期配息率計算方式：每單位配息金額 ÷ 除息日前一日之淨值 × 100%。
2. 年化配息率計算方式：「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，第一次配息或將包含成立以來的可分配配息值，可能導致首次年化配息率偏高，請投資人注意。如該月之配息適逢月配息、季配息、半年配息或年配息有其中二種以上時，該月之年化配息率將分別計算後加總呈現。
3. 當期報酬率(含息)計算方式：[(當次除息日淨值 + 每單位配息金額) ÷ 前次除息日淨值 - 1] × 100%。基金成立未滿六個月者，依規定不得揭露績效。
4. 本基金歷史配息紀錄可至本公司官網<https://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](http://www.ctbcinvestments.com))及公開資訊觀測站([mops.twse.com.tw](http://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風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買回。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，不等同於基金掛牌上市/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有關規定辦理。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時間內提供的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買回。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(以下簡稱證櫃買賣中心)所有關規定辦理。
- ◆ 各子基金於上櫃日後將依證櫃買賣中心所規定於臺灣證券交易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值之風險，經理公司於臺灣證券交易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。
- ◆ 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/營業標準，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對中國信託投信之唯一關係，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