

中信特選金融 (股票代號：00917)

追蹤指數：ICE FactSet 特選金融及數據指數

2024年5月

基金特色

- 投資組合表彰高度參與金融產業股票
- 選股邏輯納入市值要求及流動性條件
- 交易方式便利，交易成本低廉、資訊取得容易

基金小檔案

成立日期	2022/8/18
類型	指數股票型
經理人	張苡琿
保管銀行	永豐銀行
經理費	0.90%
保管費	0.20%
風險等級	RR4註
基金淨值(元)	18.75
總資產規模(台幣)	6.94 (億元)
彭博代碼	00917 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

公司名稱	產業類別	比重
摩根大通銀行	金融	10.01%
美國銀行	金融	8.32%
標準普爾全球公司	金融	6.07%
富國銀行	金融	5.96%
摩根士丹利	金融	5.19%
貝萊德公司	金融	5.00%
匯豐控股	金融	4.68%
高盛集團	金融	3.88%
黑石公司	金融	3.76%
芝加哥商品交易所集團	金融	3.40%

基金績效(%)

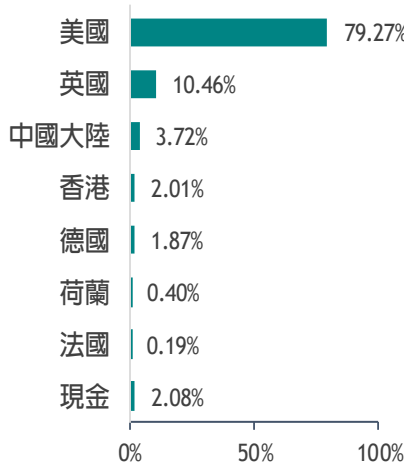
期間	3個月	6個月	1年	2年	3年	5年	今年以來	成立以來
報酬率	8.51	27.15	26.47	NA	NA	NA	9.61	27.15

淨值走勢

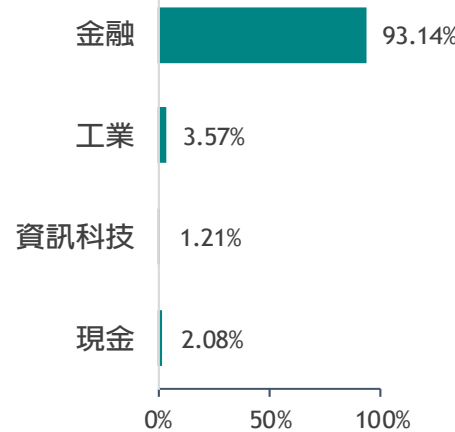


國家配置

註：國家為曝險國別



產業配置



經理人評論

- 回顧4月，受聯準會對市場升息或降息與否的言論，市場較為震盪。隨美國3月通膨數據普遍高於預期，預期降息時點延後，美國10年期公債殖利率攀高，使金融股承壓，而後Fed釋放鴿派訊號，不願意進一步升息，維持利率不變，利率決議尚符合預期。展望未來，在Powell多次重申利率已達峰值下，公債利率大幅上行風險有限，銀行業1Q24財報開出，美國大型銀行普遍表現優於中小型銀行，惟因淨利息收入受存款成本上升和貸款成長放緩，而影響獲利表現。短期金融股前景保守，重點關注淨利息收入(NII)前景，預計淨利差將於第二季度擴大，有望推動金融股發展，建議續抱或等拉回加碼佈局。

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

中信特選金融 (股票代號：00917)

追蹤指數：ICE FactSet 特選金融及數據指數

2024年5月

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	0.2900	1.69%	--

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。1

【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。**基金上市日前(不含當日)，經理公司不接受基金受益權單位數之買回。**
- ◆ 本基金可能面臨之風險包含但不限於類股過度集中風險、產業過度集中或產業景氣循環之風險、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，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。
- ◆ 本基金以追蹤「ICE FactSet特選金融及數據指數」(即標的指數)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。
- ◆ 本基金為指數股票型基金，基金核准成立後將向臺灣證券交易所股份有限公司(以下簡稱臺灣證交所)申請上市交易，本基金資產主要投資於與標的指數相關之有價證券及證券相關商品，投資人交易本基金除需承擔匯率波動風險外，應特別注意標的指數成分國家之證券市場交易時間與臺灣證券市場交易時間可能有所不同，因此本基金集中市場交易可能無法完全即時反應標的指數之價格波動風險。
- ◆ 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) 本基金可能因應申購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，可能使基金報酬將與投資目標產生偏離。(3) 本基金以新臺幣計價，而本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，由於本基金暫不從事匯率避險，因此本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。
- ◆ 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，**本基金上市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。**基金受益憑證上市後之買賣成交價格無升降幅度限制，並應依臺灣證交所有關規定辦理。
- ◆ 本基金於上市日後將依臺灣證交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外幣計價之有價證券或期貨，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。**

【ICE指數免責聲明】

- ◆ 經許可使用來源 ICE Data Indices, LLC(以下稱 ICE Data)。ICE FactSet特選金融及數據指數(以下稱「系列指數」)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針對特選金融及數據基金(以下稱「基金」)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。

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