

國泰富時中國5年期以上政策金融債券ETF基金

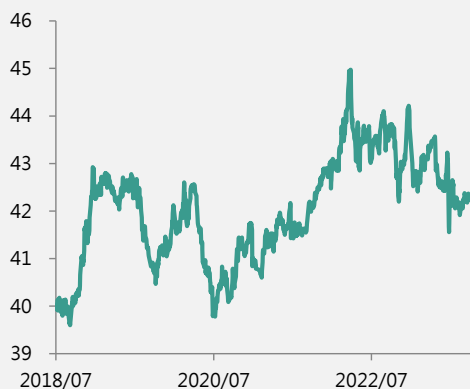
中國債市加速開放，納入大型國際債券指數，將吸引近5,000億美元的被動資金投入；政策金融債受惠一帶一路政策主導優勢，加上三大標普信評A+級銀行支持，表現將更勝公債。

基金基本資料

經理人	鍾郁婕	
成立時間	2018/7/25	
基金型態	固定收益ETF	
基金規模(註)	新台幣	.73億元
基金淨值 2023/10/31	新台幣	42.2513
Bloomberg Ticker 00744B TT		
經理費	基金規模新台幣30億元(含)以下：0.40%；新台幣30~60億元(含)：0.30%；超過新台幣60億元：0.27%	
保管費	新臺幣30億元(含)以下：0.15%；超過新臺幣30億元時：0.12%	
保管銀行	華南銀行	
平均信評	NR	
投資標的	本基金係採用指數化策略，以追蹤標的指數報酬表現為目標。	

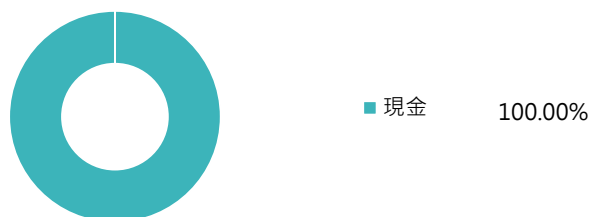
註：基金規模為月底(最後日曆天)數據

成立以來基金淨值走勢



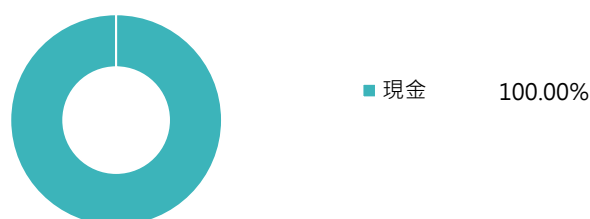
資料來源：國泰投信

區域配置



註：為增進投資人了解，區域配置依照投資標的發行國

產業分布



信評估比



註：成分債之發行人信評為A+

註：基金之平均信評取各投資標的之三大信評機構(惠譽、穆迪及標準普爾)中最高評等，以具備上述三大信評機構(其中一家或多家以上)之債券納入計算之資產項目，再依各信評於前述資產之配置比重加權平均計算。信用評等未必能完全反應該標的之信用風險且隨時可能改變

前十大持股

名稱	比率
-	-
-	-
-	-
-	-
-	-
-	-
-	-
-	-
-	-

資料來源：國泰投信

【請詳閱末頁警語】



累積原幣報酬率，%

報酬期間	近三月	近六月	近一年	近二年	近三年	近五年	近十年	今年以來	成立以來	成立日
新台幣	-0.36	0.16	1.14	8.30	16.78	23.63	-	2.18	24.28	2018/7/25

資料來源：投信投顧公會基金績效評比表，2023/10/31

經理人報告

配合下櫃流程，基金已於112年10月24日完全處分部位，僅持有現金，並於清算前不再新增部位。月初十一长假過後，市場主要關注第四季中國債券供給量大增，推升收益率整體呈上行走勢，惟月中之後，因應繳稅高峰期、政府債券發行繳款等因素，市場流動性偏緊，人行加大逆回購操作呵護市場流動性，壓抑收益率上行幅度。經濟數據方面，中國10月公布的幾項經濟數據有所回暖，包括通膨有所持穩、第三季GDP增幅優於市場預期等，但整體對債市影響不大。截至月底，10年國債230018收報2.6925%，當月上行1.89bps。10Y國開債230210收報2.76%，上行2.26bps。

配合下櫃流程，基金已於112年10月24日完全處分部位，僅持有現金，並於清算前不再新增部位。本基金於112年10月24日持有指數成分證券檔數未達標的指數成分證券檔數之25%且未滿15檔，以及基金持有指數成分證券曝險率低於70%，已達重訊發布門檻。係因本基金已於112年9月26日取得金管會終止契約核准函，將於112年11月20日終止櫃檯買賣，並以112年11月21日為信託契約終止日。基金因應下櫃流程所需處分部位，依據公開說明書，信託契約終止前一個月時基金對應調整投資組合，得不受曝險率70%之限制，故本基金自112年10月24日至112年11月20日覆蓋率將低於25%且未滿15檔，以及曝險率低於70%。

注意：本公司基金經金管會核准或同意生效，惟不表示基金絕無風險。本公司以往之經理績效不保證基金之最低投資收益；本公司除盡善良管理人之注意義務外，不負責基金之盈虧，亦不保證最低之收益，投資人申購前應詳閱基金公開說明書。投資人可向本公司及基金之銷售機構索取基金公開說明書或簡式公開說明書，或至本公司網站(www.cathayholdings.com/funds)或公開資訊觀測站自行下載。有關基金應負擔之費用已揭露於基金之公開說明書中，投資人可至公開資訊觀測站中查詢。本文提及之經濟走勢預測不必然代表本公司基金之績效，本公司基金投資風險請詳閱各基金公開說明書。基金投資地區包含大陸地區，可能因產業循環或非經濟因素導致價格劇烈波動，另由於大陸地區市場機制不如已開發市場健全且對外匯管制較嚴格，政經情勢或法規變動亦較大，可能對基金報酬產生直接或間接影響。由於高收益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，故本基金可能會因利率上升、市場流動性下降，或債券發行機構違約不支付本金、利息或破產而蒙受虧損。本基金不適合無法承擔相關風險之投資人。



<國泰投信獨立經營管理>

- 國泰證券投資信託股份有限公司
- 網址：www.cathayholdings.com/funds
- e-mail：net080@cathaysite.com.tw

- 台北總公司 | 地址：106台北市大安區敦化南路二段39號6樓
- | 電話：(02)2700-8399 傳真：(02)2701-3770