

中信ESG投資級債(股票代號：00883B)

追蹤指數：ICE 15年期以上已開發市場ESG美元投資級公司債券指數

2024年3月

基金特色

- 納入ESG篩選機制，尋找優質永續企業。
- 精選信評投資等級以上企業。
- 囊括投等債各主要產業配置。

基金小檔案

成立日期	2021/1/27
類型	指數股票型
經理人	張璩尹
保管銀行	兆豐銀行
經理費	基金淨資產價值 低於30億(含)以下:0.40%/年 30億-200億(含):0.3%/年 200億-300億(不含)以上:0.2%/年 300億(不含)以上:0.18%/年
保管費	基金淨資產價值 30億(含)以下:0.14% 30(不含)-200億(含):0.12% 200億-300億(含):0.08% 300億(不含)以上:0.06%
最差殖利率(%)	5.78
平均存續期間	12.18
風險等級	RR2註
基金淨值(元)	31.9777
總資產規模(台幣)	3.12 (億元)
彭博代碼	00883B 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。

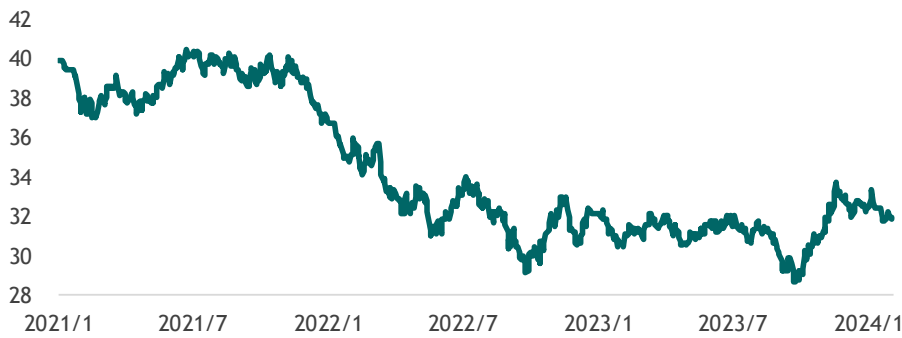
前十大標的

標的	比重	發行公司
CHTR 6.484 10/23/45	4.75%	查特通訊營運有限責任公司
DISCA 4.09/15/55	3.44%	探索傳播有限責任公司
CMCSA 2.937 11/01/56	3.17%	康卡斯特
VIAC 4.95 05/19/50	2.96%	維亞康姆哥倫比亞廣播公司
UNH 4.95 05/15/62	2.84%	聯合健康集團
CVS 5.05 03/25/48	2.78%	CVS Health Corp
EPD 4.45 02/15/43	2.66%	企業產品經營有限責任公司
CARR 3.377 04/05/40	2.39%	開利全球公司
CARR 3.577 04/05/50	2.28%	開利全球公司
T 3.5 09/15/53	2.14%	AT&T公司

基金績效(%)

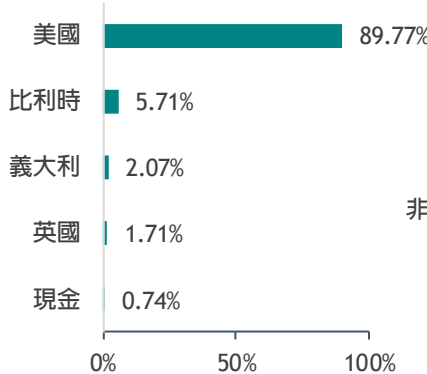
期間	3個月	6個月	1年	2年	3年	今年以來	成立以來
新台幣	3.50	2.92	9.14	-1.44	-6.68	-2.03	-11.26

淨值走勢

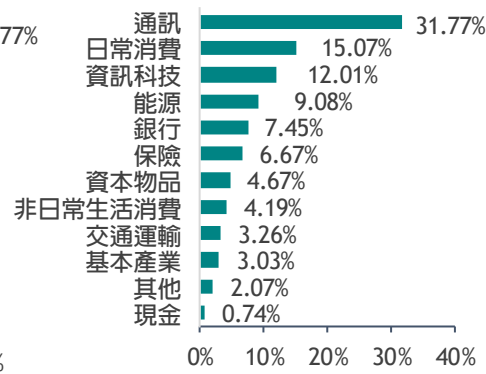


國家配置

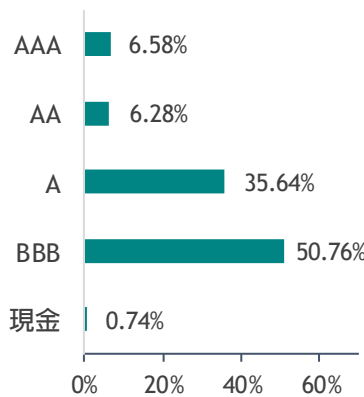
註：國家為曝險國別



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：2024/02/29



中國信託投信
CTBC INVESTMENTS

中信ESG投資級債(股票代號：00883B)

追蹤指數：ICE 15年期以上已開發市場ESG美元投資級公司債券指數

2024年3月

經理人評論

- 中信15年期以上已開發市場ESG投資級美元公司債券ETF追蹤ICE 15年期以上已開發市場ESG美元投資級公司債券指數，並主要投資於已開發市場、債信評等BBB-以上之投資級公司債，並排除爭議性武器、ESG高風險發行人，以ESG永續投資為目標，且發行10年期以上之美元計價債券。截至2月底，基金持有58檔債券，持債比重99.26%，最差殖利率5.78%，最差信用利差1.27%，修正存續期間12.18年。
- 2月份基金淨值下跌2.90%，聯準會1月份會議紀錄顯示，決策者仍然關注通膨軌跡，部份官員擔心通膨朝著2%目標回落的進程可能陷入停滯。總體而言，會議紀要進一步表明聯準會擔憂過快放鬆政策立場的風險，希望看到更多通膨顯示穩步下行的證據，確認通膨向2.0%目標區回落，官員們一致表達目前還不能確定何時啟動降息，視經濟數據而定。另一方面，在 ESG法規相關揭露要求將更多、更廣，以及越來越多企業自願揭露ESG相關作為下，預期ESG相關議題將持續受到關注和青睞，可望吸引資金流入ESG資產。且AI的迅速崛起使其成為幾乎每個行業中未來的核心技術。AI提供社會和環境效益，包括在簡單重複的任務中提高效率，廣泛幫助醫療保健，以及在改善碳排放監測，甚至是森林砍伐和企業脫碳戰略等方面的能力。展望3月，ESG為全球政府支持產業，公司基本面趨穩，信用風險低，後續觀察高利率環境，影響後續實體經濟發展，而美債走勢也將影響投資等級殖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)
2023/11	0.3750	1.11%	8.15%
2023/08	0.3310	1.06%	0.48%
2023/05	0.3200	1.03%	1.28%
2023/02	0.3590	1.15%	-2.93%
2022/11	0.3200	1.00%	2.09%
2022/08	0.2970	0.94%	2.66%

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。

【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)及公開資訊觀測站(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槓桿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，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年期以上已開發市場ESG投資級美元公司債券ETF證券投資信託基金之標的指數為ICE 15年期以上已開發市場ESG美元投資級公司債券指數)。
- ◆ 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。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)所有關規定辦理。
- ◆ 各子基金於上市/上櫃日後將依證券櫃檯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：基金標的指數經計可使用來源ICE Data Indices, LLC(以下稱ICE Data)。ICE 15年期以上已開發市場ESG美元投資級公司債券指數係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



中國信託投信
CTBC INVESTMENTS