

台新摩根大通新興市場投資等級美元債券ETF

證券投資信託基金

簡式公開說明書

刊印日期：114年10月

- (一)本簡式公開說明書係公開說明書之重點摘錄，相關名稱及文字定義與公開說明書完全相同。
(二)投資人申購本基金後之權利義務、經理公司之權利義務及本基金應揭露之事項皆詳述在公開說明書，投資人如欲申購本基金，建議參閱公開說明書。

壹、基本資料

基金名稱	台新摩根大通新興市場投資等級美元債券 ETF 證券投資信託基金	成立日期	107年5月18日
經理公司	台新證券投資信託股份有限公司	基金型態	開放式
基金保管機構	臺灣銀行股份有限公司	基金種類	指數股票型
受託管理機構	無	投資地區	投資國內外
國外投資顧問公司	無	存續期間	不定期限
收益分配	季配	計價幣別	新臺幣
績效指標 benchmark	本基金之標的指數為摩根大通新興市場投資等級債核心指數，本標的指數為客製化指數，非屬 Smart Beta 指數，相關資訊請詳閱本基金公開說明書第22頁	保證機構	無；本基金非保證型基金
		保證相關重要資訊	無

貳、基金投資範圍及投資特色

一、投資範圍：

- (一)本基金主要投資於國內外由國家或機構所保證、發行、承銷或註冊掛牌之政府公債、普通公司債(含無擔保公司債)、金融債券，及從事衍生自債券之期貨交易。本基金係採用指數化策略，以追蹤標的指數《摩根大通新興市場投資等級債核心指數》之績效表現為目標，自上櫃日起，投資於標的指數成分債券總金額不得低於本基金淨資產價值之百分之七十(含)，另為符合本基金之貼近指數操作與資金調度需要，本基金得投資於其他有價證券及證券相關商品交易，以使本基金投資組合之整體曝險，能貼近本基金淨資產價值之百分之一百。
- (二) 本基金以追蹤摩根大通新興市場投資等級債核心指數的績效表現為管理目標，該標的指數的母指數為摩根大通新興市場美元債指數(JP Morgan EMBIG Diversified Index)，為全球最多機構法人追蹤的新興市場債指數，其成分債券涵蓋全球新興市場主權或類主權美元計價債券。
- (三) 本基金係屬於客製化指數，非屬 Smart Beta 指數，相較於傳統指數包含投資等級及非投資等級債券，本標的指數係專注於傳統指數中的投資等級債券，故本指數與傳統指數有可能因沒有非投資等級債券部位，發生績效有所差異之風險。
- (詳細之投資範圍及策略請參考本基金完整公開說明書。)

二、投資特色：

- (一) 追蹤摩根大通新興市場投資等級債核心指數，全面參與投資等級新興債券市場。
- (二) 投資標的透明，管理有效率。
- (三) 交易方式便利且成本低廉。

參、投資本基金之主要風險

- 一、本基金無受存款保險、保險安定基金或其他相關保障機制之保障。故投資本基金可能發生部分或全部本金之損失，最大可能損失則為全部投資金額。
- 二、本基金為指數股票基金，以追蹤「摩根大通新興市場投資等級債核心指數」表現為基金投資組合管理之目標，主要為追求新興市場國家投資等級債券表現之投資產品，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，本基金風險報酬等級為 RR3(風險報

酬等級係計算過去 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，更多基金評估之相關資料(如年化標準差、Alpha、Beta 及 Sharp 值等)可至中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會網站之「基金績效及評估指標查詢專區」(https://www.sitca.org.tw/index_pc.aspx)查詢。

- 三、標的指數走勢波動之風險：本基金因採被動式管理方式，因此基金之投資績效將視其追蹤之標的指數之走勢而定。當其追蹤之指數價格波動劇烈時，基金之淨資產價值將有波動之風險。
- 四、基金未能完全緊貼標的指數表現之風險：由於本基金可能因應申贖或維持所需曝險比例等因素需每日進行調整，故基金淨值將受到所交易之有價證券或期貨成交價格、交易費用或其他相關費用(如經理費、保管費、上櫃費)等，將造成基金淨值無法完全緊貼標的指數。
- 五、本基金追蹤之標的指數為客製化指數，傳統指數包含投資等級及非投資等級債券，本標的指數係專注於傳統指數中的投資等級債券，故本指數與傳統指數有可能因沒有非投資等級債券部位，發生績效有所差異之風險，使本基金績效表現未必適宜與傳統指數之表現比較。不保證該客製化指數績效在任何時候的表現優於市場行情，指數績效亦可能落後市值加權指數或其他績效指標，且持續時間未知。追蹤客製化指數相較於追蹤市值加權指數之基金，可能有相當比例持債投資於市值較小之公司債券。客製化指數與傳統指數之差異及差異導致之風險，請詳閱本基金公開說明書第 25 頁。

請詳細閱讀本基金公開說明書第 23 頁到第 27 頁，投資本基金應注意之相關風險。

肆、本基金適合之投資人屬性分析

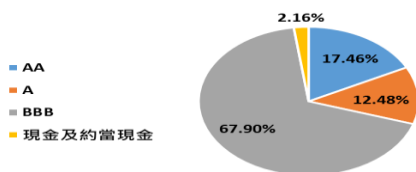
本基金為指數股票型基金，以追蹤「摩根大通新興市場投資等級債核心指數」表現為基金投資組合管理之目標，主要為追求新興市場國家投資等級債券表現之投資產品，適合能承受較高風險之投資人。詳情請參閱公開說明書。

伍、基金運用狀況

一、基金淨資產組成： 資料日期：114 年 9 月 30 日

投資類別	投資金額 (新台幣百萬元)	佔基金淨資產 價值比重(%)
買賣斷債券	435.21	96.29
銀行存款	10.75	2.38
其他資產減負債	5.99	1.33

基金淨資產組成 - 依投資標的信評

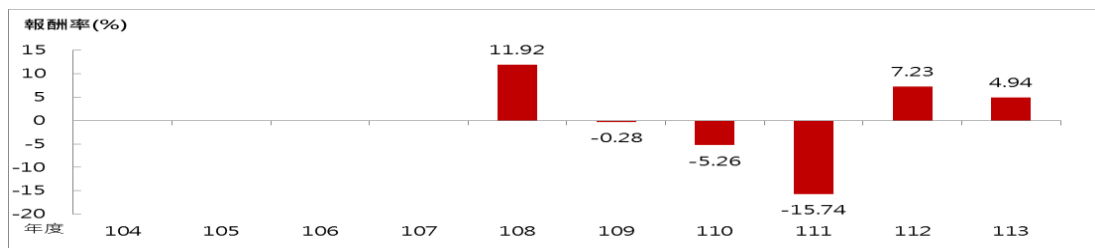


二、最近十年度基金淨值走勢圖：

資料日期：114 年 9 月 30 日 淨值(單位:元)



三、最近十年度各年度基金報酬率：



資料來源：Lipper

註：1.年度基金報酬率：指本基金淨資產價值，以1~12月完整曆年期間計算，加計收益分配後之累計報酬率。
2.收益分配均假設再投資於本基金。

四、基金累計報酬率：

資料日期：114年9月30日

期 間	最近三個月	最近六個月	最近一年	最近三年	最近五年	最近十年	基金成立日(107年5月18日) 起算至資料日期日止
累計報酬率(%)	8.42	-2.47	-2.99	23.42	-4.26	N/A	5.72

註：

資料來源：Lipper

1.累計報酬率：指至資料日期日止，本基金淨資產價值最近三個月、六個月、一年、三年、五年、十年及自基金成立日起算，加計收益分配之累計報酬率。

2.收益分配均假設再投資於本基金。

基金表現與標的指數表現之差異比較：

期 間	三個月	六個月	一年	三年	五年	十年	成立以來
基金績效表現(%)	8.42	-2.47	-2.99	23.42	-4.26	N/A	5.72
標的指數績效表現(%)	7.31	-2.37	-2.68	25.50	-1.82	N/A	9.57

註：標的指數報酬以新臺幣計算之。

五、最近十年度各年度每受益權單位收益分配之金額：

年度	104	105	106	107	108	109	110	111	112	113
收益分配金額	N/A	N/A	N/A	N/A	11.92	-0.28	-5.26	-15.74	7.23	4.94

單位：元/每受益權單位

六、最近五年度各年度基金之費用率：

年度	109	110	111	112	113
費用率(%)	0.74	0.98	0.86	0.90	0.88

註：費用率：指依證券投資信託契約規定基金應負擔之費用（如：交易直接成本-手續費、交易稅；會計帳列之費用-經理費、保管費、保證費及其他費用等）占平均基金淨資產價值之比率。

陸、受益人應負擔費用之項目及其計算方式

項目	計算方式或金額	項目	計算方式或金額
經理費	1.淨資產價值於新臺幣 30 億元以下：每年基金淨資產價值之 0.35%。 2. 淨資產價值於新臺幣 30 億元(含)以上至新臺幣 100 億元(含)以下時：每年基金淨資產價值之 0.25%。 3. 淨資產價值超過新臺幣 100 億元時：每年基金淨資產價值之 0.20%。		
保管費	1. 淨資產價值未達新臺幣 30 億元：每年基金淨資產價值之 0.16%。 2.淨資產價值於新臺幣 30 億元(含)以上至新臺幣 100 億元(含)以下時：每年基金淨資產價值之 0.12%。 3. 淨資產價值超過新臺幣 100 億元時：每年基金淨資產價值之 0.10%。		
短線交易買回費用	無	召開受益人會議費用	每次預估新臺幣伍拾萬元
指數授權費	指數授權費計算方式，採美元計價，按季支付。原則上以本基金當季每日平均淨資產價值乘以授權費率計算，惟收取下限為每年 4 萬美元；前述授權費率以經保費率乘以 15%或 0.06%二者較高者計算。		
上櫃費及年費	每年上櫃費用為資產規模之 0.03%，最高額為新臺幣 30 萬元。		
其他費用	運用本基金所生之經紀商佣金、交易結算費、交易手續費等直接成本及必要費用、本基金應支付之一切稅捐、基金財務報告簽證及核閱費用、訴訟或非訴訟費用、清算費用。		
申 透 購 過 買 初 回 級 費 市 用 場	申購手續費	1. 成立日(不含當日)前：最高不得超過發行價格之 2%。 2. 上櫃日起：最高不得超過本基金每申購基數約當淨值之 2% (申購基數為 50 萬個受益權單位數或其整倍數。)	
	申購交易費	實際申購交易費用=實際申購價金×申購交易費率 本基金申購交易費率目前收取標準為以申購日基金持有或交易債券之加權平均價差，前述平均價差，以本基金之最佳報價交易對手之報價減去評價點之基金債券評價除以評價點之基金債券評價，該費率得依投資策略、投資標的、投資組合交易部位需要及證券市場現況調整之。	
	買回手續費	每一買回基數之買回手續費最高不得超過買回總價金之 2%。	

	(買回基數為 50 萬個受益權單位數或其整倍數。)
買回交易費	買回交易費用=買回價金×買回交易費率 本基金買回交易費率目前收取標準為買回日基金持有或交易債券之加權平均價差，前述平均價差，以本基金之最佳報價交易對手之報價減去評價點之基金債券評價除以評價點之基金債券評價，該費率得依投資策略、投資標的、投資組合交易部位需要及證券市場現況調整之。
行政處理費	申購人若發生申購失敗、受益人若發生買回失敗時，應支付行政處理費。

註一：受益人會議並非每年固定召開，故該費用不一定每年發生。

註二：指數授權費用變更時之因應處理程序及影響，請詳閱本基金公開說明書第37頁。

柒、受益人應負擔租稅之項目及其計算

本基金投資國內資本市場之稅賦事項均依財政部有關法令辦理，受益人可能負擔之租稅主要包括本基金所投資商品之各項交易稅及所得稅款等；另本基金如投資國外資本市場，所產生之各項所得，應依各投資所在國或地區相關法令規定繳納各項稅費，且可能無法退回。詳細內容請參見公開說明書第37頁至第38頁。

捌、基金淨資產價值之公告時間及公告方式

一、公告時間：本基金每營業日公告前一營業日每受益權單位之淨資產價值。

二、公告方式：於經理公司台新投信公司網站 (<http://www.tsit.com.tw>) 公告。

玖、公開說明書之取得

一、本基金公開說明書備置於經理公司及其基金銷售機構或參與證券商營業處所，投資人可免費索取。

二、投資人亦可於經理公司網站 (<http://www.tsit.com.tw>) 及公開資訊觀測站 (<http://mops.twse.com.tw/>) 免費取得本基金公開說明書及基金近年度財務報告電子檔。

其他提示事項

一、台新投信服務電話：(02)2501-3838。

1. 本基金經金融監督管理委員會核准或同意生效，惟不表示本基金絕無風險。本公司以往之經理績效不保證本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，不負責本基金之盈虧，亦不保證最低之收益。
2. 投資人於成立日(不含當日)前參與申購所買入的每受益權單位之發行價格，不等同於基金掛牌上櫃後之價格，參與申購之投資人需自行承擔基金成立日起至掛牌上櫃日止期間，基金價格波動所產生折/溢價之風險。本基金自成立日起至上櫃日一個營業日止，經理公司不接受本基金受益權單位之申購或買回。
3. 本基金受益憑證之上櫃買賣，應依證券櫃檯買賣中心有關規定辦理。
4. 本基金以投資於新興國家或市場之投資等級債券為主，但原本為投資等級債券因被調降信用評等而成為非投資等級債券，考量為追蹤或複製標的指數表現所需，本基金得投資於非投資等級債券，並應依相關法令規定辦理。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，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。

投資人申訴管道：

投資人發生金融消費爭議應先向經理公司申訴，投資人如不接受處理結果或經理公司逾 30 日未回覆處理結果，得於 60 日內向金融消費評議中心申請評議。

1. 經理公司

(1) 電話申訴：客服專線 0800-021-666 (營業時間週一至週五 8:30 - 17:30)。

(2) 電子郵件申訴：電子郵件信箱 fundsrv@tsit.com.tw，請載明投資人之姓名、聯絡電話、電子郵件信箱並詳述申訴之內容。

(3) 書面申訴：郵寄地址 104 台北市中山區南京東路二段 167 號 2 樓之 1 台新投信收，請載明投資人之姓名、聯絡電話、聯絡地址並詳述申訴之內容。

2. 中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會/聯絡電話: (02)2581-7288

3. 財團法人金融消費評議中心/金融消費爭議免費服務專線：0800-789885