

2024年3月31日

# 台新摩根大通新興市場投資等級 美元債券ETF基金

## 基金特色

- 本基金為一開放式指數股票型基金(ETF)，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。
- 摩根大通新興市場投資等級債核心指數區域分散，且投資等級信評佳。100%投資主權債與國營企業債。

## 基本資料

成立時間	2018/5/18
幣別	新台幣
基金類型	指數股票型
證券代號	00734B
追蹤指數	摩根大通新興市場投資等級債核心指數
風險等級	RR3
經理人	黃鈺民
經理費	0.35%/年
保管費	0.16%/年
保管銀行	臺灣銀行
收益分配	季配息
贖回付款日	T+6
基金規模	台幣5.40億

## 累積報酬(%)

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(%)	2.8	7.1	8.0	4.1	-6.0	-7.8	2.8	2.4

## 年度績效(%)

期間	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023
報酬率(%)	-	-	-	-	-	11.9	-0.3	-5.3	-15.7	7.2

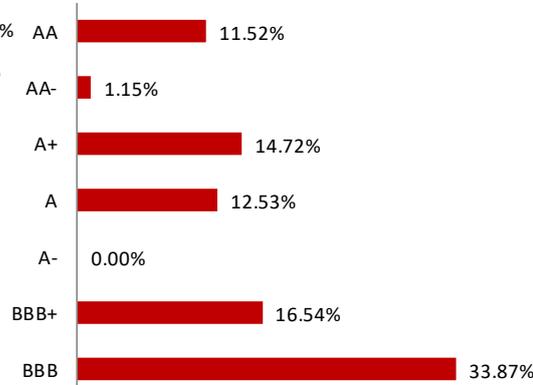
## 前十大持債

公司名稱	國家別	債券種類	比重
KSA 2.9 10/22/25	沙烏地阿拉伯	政府公債	3.20%
CDEL 3 09/30/29	智利	公司債	2.84%
KSA 3 3/4 01/21/55	沙烏地阿拉伯	政府公債	2.59%
MEX 5 04/27/51	墨西哥	政府公債	2.57%
HAOHUA 5 1/8 03/14/28	中國大陸	公司債	2.38%
COLOM 7 3/8 09/18/37	哥倫比亞	政府公債	2.37%
PHILIP 3.7 02/02/42	菲律賓	政府公債	2.16%
QATAR 4.4 04/16/50	卡達	政府公債	2.15%
SINOPE 2.3 01/08/31	中國大陸	公司債	2.06%
INDON 4.2 10/15/50	印尼	政府公債	2.05%

## 國家配置



## 信評分佈



台新證券投資信託股份有限公司 網址：www.TSIT.com.tw 客服專線：0800-021-666 【台新投信 獨立經營管理】

台北總公司：104台北市中山區德惠街9-1號1樓  
電話：(02)2501-3838  
傳真：(02)2518-0202

台中分公司：403台中市西區英才路530號21樓之3  
電話：(04)2302-0858  
傳真：(04)2302-0528

高雄分公司：806高雄市前鎮區中山二路2號7樓之2  
電話：(07)536-2280  
傳真：(07)536-6220

# 台新摩根大通新興市場投資等級 美元債券ETF基金

## 經理人評論

本基金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，參考標的指數編制之權值比例分散投資於各指數成分債券，標的指數也會逐月調整成份券配置內容，讓投資人完整參與新興市場的成長與變化，免除選債壓力，投資決策單純化。本基金持債部位主權債佔66.34%、類主權債佔31.27%；前三大持債國家包含(1)墨西哥10.8% (2)沙烏地阿拉伯10.33% (3)印尼8.26%。操作策略以貼近指數為目標，視基金申贖狀況進行部位調整。

2024年3月份摩根大通新興市場投資等級債核心指數上漲2.65% (已轉換為台幣報酬)，投資組合加權平均票面利率4.50%，殖利率5.46%，存續期間為8.57年。

【追蹤指數報酬與殖利率(YTM)僅供參考，不代表本基金之實際報酬或未來績效保證。】

以上資料來源：台新投信、Lipper。資料截至日期：2024/3/31。經理人評論所提之基金配置為月初規劃，未來實際投資將視當時投資環境調整。經理人評論提及公司或標的僅為市場狀況或標的指數說明舉例，無特定推薦之意圖。指數統計資料僅供參考，不代表本基金之實際報酬及未來績效保證。

本公司參酌投信投顧公會之「基金風險報酬等級分類標準」編制基金風險報酬等級，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，分類為RR1-RR5五級，數字越大代表風險越高。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，投資人仍應注意所投資基金個別之風險。基金其他主要風險及風險報酬等級歸屬原因請詳閱公開說明書。本基金經金管會核准或同意生效，惟不表示絕無風險。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；基金經理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，投資人申購前應詳閱基金公開說明書(或簡式公開說明書)及風險預告書。有關基金應負擔之費用及相關投資風險已揭露於基金之公開說明書中，投資人可向本公司及基金銷售機構索取，或至本公司網站及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基金之績效，本基金投資風險請詳閱基金公開說明書。投資人申購本基金係持有基金受益憑證，而非本文提及之投資資產或標的。

基金投資地區涉及新興市場之部分，部份國家或地區可能因證券市場尚屬初期發展階段，其波動性與風險程度可能較高或有較大匯率波動、投資於資本市場較小的國家之風險、不穩定價格和外國投資限制等，且其政治與經濟情勢穩定度亦可能低於已開發國家，而使資產價值受不同程度影響。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，投資人於獲配息時，宜一併注意基金淨值之變動。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前一個營業日止，經理公司不接受本基金受益權單位之申購或買回。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。J.P. Morgan未贊助、保證、銷售或發起本基金。J.P. Morgan未以任何明示或默示方式，向本基金所有權人或任何公眾聲明或保證一般證券或特定本基金的投資適當性或是標的指數追隨一般債券市場績效的能力。相關J.P. Morgan之指數免責聲明請見基金公開說明書。