

群益ESG 20年期以上BBB投資等級公司債ETF(本基金之配息來源可能為收益平準金)

Capital ICE ESG 20+ Year BBB US Corporate Exchange Traded Fund

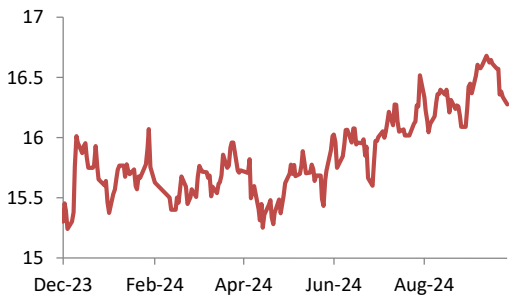
01.基金特色

1. 愛地球現金流月月入袋，且有收益平準金。聚焦投資等級債，只納入票面利率大於4.5%債券。
2. ESG債券ETF發行價15元，小資好入手。
3. ESG嚴選企業+產業上限10%，投資更安心。

02.基金小檔案

基金成立日	2023/11/27	基金經理人	曾盈甄
ETF上市日	2023/12/5	掛牌交易所	證券櫃買中心
彭博代碼	00937B TT	股票代碼	00937B
基金型態	指數股票型	基金屬性	RR2
基金規模	合計2251.61億新台幣 單月日均量 93306張		
經理費	新台幣100億元(含)以下：0.30% / 年		
	新台幣100億(不含)~200億元(含)：0.28% / 年		
	新台幣200億(不含)~300億元(含)：0.25% / 年		
	新台幣300億元(不含)以上：0.20% / 年		
保管費	新台幣30億元(含)以下：0.10% / 年		
	新台幣30億(不含)~200億元(含)：0.08% / 年		
	新台幣200億(不含)~300億元(含)：0.06% / 年		
	新台幣300億元(不含)以上：0.05% / 年		
是否配息	是·月配	保管銀行	彰化商業銀行
投資標的	本基金係採用指數化投資策略，主要投資追蹤標的指數「ICE ESG 20年期以上BBB級成熟市場大型美元公司債(單一產業10%上限)指數」之成分債券		
基金淨值	16.2756元新台幣	ETF收盤價	16.31元新台幣
計價幣別	新台幣	追蹤指數	C84LESG Index

03.基金淨值走勢圖



04.前十大持債

排序	發行公司	名稱	市值(萬美元)	比例(%)
1	甲骨文	ORCL 6.9 11/09/52	19,132.2	2.69
2	義大利聖保羅銀行	ISPIM 7.8 11/28/53	15,985.4	2.25
3	美國歐尼克能源公司	OKE 6 5/8 09/01/53	14,439.7	2.03
4	義大利聖保羅銀行	ISPIM 7.778 06/20/54	14,269.2	2.01
5	Aon怡安保險公司	AON 5 3/4 03/01/54	13,823.7	1.94
6	加拿大能源輸送公司	ENBCN 6.7 11/15/53	13,391.6	1.88
7	瑞典壽險控股公司	ATH 6 1/4 04/01/54	12,755.5	1.79
8	義大利公有國家電力商	ENELIM 7 3/4 10/14/52	12,033.0	1.69
9	法國電力公司	EDF 6.9 05/23/53	11,894.1	1.67
10	美國特許通訊	CHTR 6.484 10/23/45	11,822.8	1.66
小計				19.61

05.發行機構國別及產業別

國別	比例%	產業別	比例%
美國	75.52	科技	10.53
義大利	7.22	醫療保健	10.53
法國	5.75	能源	10.48
加拿大	3.52	通訊	10.11
英國	2.30	公用事業	10.01
西班牙	2.04	媒體	9.50
德國	1.79	銀行	9.04
愛爾蘭	1.14	保險	7.98
荷蘭	0.91	零售	6.10
		消費財	4.48
		基本金屬	3.00
		運輸	2.86
		汽車	2.09
		金融服務	1.54
		資本財	1.14
		服務	0.78
合計	99.36	合計	99.36

06.持債信評及到期年限權重

信評	權重(%)	到期年限	權重(%)
AAA	0.00	0~5年	0.00
AA	0.00	5~10年	0.00
A	9.99	10~15年	0.00
BBB	90.21	15~20年	0.19
非投資等級	0.00	20~25年	30.51
無信用評等	0.00	25年以上	68.66
持債比	99.36	持債比	99.36

07.基金績效(%)

	一季	半年	一年	二年	三年	五年	成立以來	標準差(12月)
淨值報酬	5.49	5.22					13.16	
市價報酬	4.35	4.89					8.66	

1. 年化標準差為衡量報酬率波動程度，數值愈低，代表報酬穩健，波動程度較低，本資料取較長評估期間，即12個月

2. 資料來源：Morningstar、群益投信

3. 資料整理：群益投信 數據資料：截至2024/9/30止

群益ESG 20年期以上BBB投資等級公司債ETF(本基金之配息來源可能為收益平準金) Capital ICE ESG 20+ Year BBB US Corporate Exchange Traded Fund

08.參與券商及流動量提供券商

參與券商名稱	流動量提供券商
群益金鼎證券 永豐金證券	群益金鼎證券 永豐金證券
統一綜合證券 富邦綜合證券	富邦綜合證券 元大證券
元大證券 凱基證券	台新綜合證券
中國信託綜合證券 台新綜合證券	
元富證券 國票綜合證券	
康和綜合證券 玉山綜合證券	
國泰綜合證券 兆豐證券	
臺銀綜合證券 第一金證券	
合作金庫證券 華南永昌綜合證券	

資料整理：群益投信；數據資料：截至2024/9/30止

09.大額申購/買回規範

項目	大額申購	大額買回
申購/買回方式	參與證券商可接受委託或自行申請	參與證券商可接受委託或自行申請
券商申請時間	營業日 09:00~14:00	營業日 09:00~14:00
申請種類	現金	現金
申購/買回基數	500,000受益權單位	500,000受益權單位
預收申購總價金/買回部位	$[(T-2)日每申購基數約當市值] \times (100\% + 6\%) + 申購手續費 \times 申購基數$	(1)受益人於買回日已有與借入之受益憑證部位 (2)買回日之前一日普通交易之在途受益憑證部位
實際申購/買回總價金	$[(T)日每申購基數約當市值] + 申購手續費 + 交易費用 \times 申購基數$	$[(T)日每買回基數約當市值] - 買回手續費 - 交易費用 \times 買回基數$
申購/買回手續費	不超過申購總價金之2%	不超過買回總價金之2%
申購/買回交割期	T日預收申購款項、T+1多退少補、T+2 ETF受益憑證交付投資人	T+2 ETF註銷、T+10日內支付買回款項

本基金經金融監督管理委員會同意生效，惟不表示本基金之絕無風險。本基金並無受存款保險、保險安定基金或其他相關保障機制之保障，基金投資可能發生部分或全部本金之損失，投資人須自負盈虧。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，過去之績效亦不代表未來績效之保證；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，有關基金應負擔之費用已揭露於基金公開說明書或簡式公開說明書中，投資人可向本公司及基金銷售機構索取，或至公開資訊觀測站(mops.twse.com.tw)及本公司網站(www.capitalfund.com.tw)中查詢。本文提及之經濟走勢預測不必然代表本公司之績效，此外匯率走勢亦可能影響所投資之海外資產價值變動，本基金投資風險詳閱基金公開說明書。本文提及之相關資產配置比重，僅供示意不代表本公司之必然投資配置，本公司之實際配置，基金經理公司將依實際市場狀況進行調整。本基金為被動式管理之基金，採用指數化策略複製追蹤標的指數績效表現為本公司投資組合管理之目標，本公司投資績效表現將視所追蹤標的指數的走勢而定，當標的指數的成分股價格波動劇烈或變化時，本公司之淨資產價值將有大幅波動的風險。本公司上櫃後之買賣成交價格並無升降幅度限制，且應依證券櫃檯買賣中心之相關規定辦理。本公司於上櫃日後將依證券櫃檯買賣中心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。本公司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本公司淨值之計算，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，基金經理公司於臺灣證券交易所時間內提供的盤中估計淨值僅供投資人參考，實際淨值應以基金經理公司最終公告之每日淨值為準。經許可使用來源ICE Data Indices, LLC (「以下稱ICE Data」)。「ICE ESG 20年期以上BBB級成熟市場大型美元公司債(單一產業10%上限)指數 (ICE ESG 20+ Year BBB Large Cap Developed Markets US Corporate Constrained Index)」SM/® (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群益投信針對「群益ESG 20年期以上BBB投資等級公司債ETF證券投資信託基金(本基金之配息來源可能為收益平準金)」使用之。群益投信及本公司均非由ICE Data Indices, LLC、其關係企業或第三人供應商(「ICE Data及其供應商」)贊助、背書、販售或宣傳。ICE ESG 20年期以上BBB級成熟市場大型美元公司債(單一產業10%上限)指數，係由ICE Data、Sustainalytics (以上機構合稱「合作單位」)共同開發，並由ICE Data單獨授權群益證券投資信託股份有限公司使用。「合作單位」並未以任何方式贊助、背書、出售或促銷[金融商品或委任投資業務]，且「合作單位」亦未明示或默示對使用指數之結果及/或指數於任一特定日期之任一特定時間或其他時間之數據提供任何保证或聲明。本公司為被動式管理之基金，採用指數化策略追蹤標的指數績效表現為本公司投資組合管理之目標，本公司投資績效表現將視所追蹤標的指數的走勢而定，當標的指數的成分股價格波動劇烈或變化時，本公司之淨資產價值將有大幅波動的風險。投資人交易前，應詳閱本公司公開說明書並確定已充分瞭解本公司之風險及特性。(1)標的指數可能因成分股的剔除或加入而產生變化，當標的指數成分股發生變化或權重改變時，基金的投資組合內容不一定能及時調整與標的指數相同，可能使基金報酬與標的指數產生偏離。(2)本公司非全數以標的指數成分股建構基金整體投資部位，亦得持有證券相關商品建構投資組合，本公司與標的指數相關性將受到基金持股比重或證券相關商品與標的指數之相關性等因素影響。此外，本公司所持有的證券相關商品部位，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債券，因此當市場出現特定信息時，本公司淨資產價值將同時承受期貨及股票對市場信息反應不一所產生的價格波動影響，可能使基金報酬與標的指數產生偏離。(3)本公司淨資產價值受到所投資有價證券或交易證券相關商品之成交價格、交易費、經理費、保管費、上櫃費、指數授權費等必要費用支出等因素，可能使基金報酬與標的指數產生偏離。(4)本公司以新臺幣計價，而基金所投資的標的指數成分股或證券相關商品可能為新臺幣以外之貨幣計價，因此匯率波動風險可能使基金報酬與標的指數產生偏離。本公司主要持有之外幣為美元，因此當美元相對新臺幣走強時，基金報酬率會增加，將使本公司表現優於標的指數；反之，美元相對新臺幣走弱時，基金報酬率會減少，將使本公司表現弱於標的指數，投資人需留意美元相對新臺幣之強弱將影響基金跟蹤標的指數之效果。