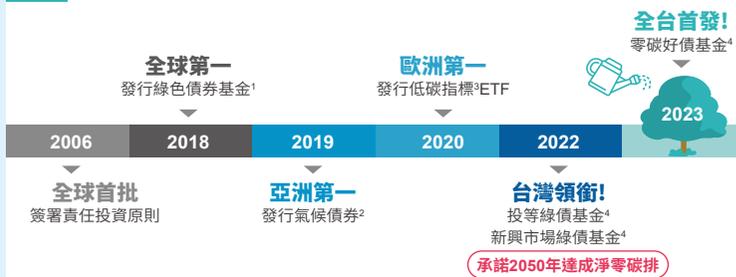


# 鋒裕匯理全球淨零碳排企業債券證券投資信託基金 (本基金有一定比重得投資於非投資等級之高風險債券且配息來源可能為本金)

## 淨零承諾投資好債 減碳升級享收益

### 1 領銜淨零 創造第一 全台首發零碳好債基金



資料來源：鋒裕匯理投信，與國際金融公司合作發行Amundi Planet Emerging Green One (AP EGO)，聚焦於新興市場氣候建設投資，成立時為全球最大的綠債基金。與歐洲投資銀行合作推出「綠色信貸計畫」、攜手亞洲基礎建設投資銀行訂立「氣候變遷投資框架」，發行亞洲氣候債券，用於對抗新興市場因氣候變遷造成的影響。發行歐洲第一完全符合歐盟低碳參考指標(PAB)的ETF，PAB = Paris-Aligned Benchmark。\*投資投顧公會，資料日期：2024/2/29。

### 2 承諾淨零 低違約、排除能源業 品質更優異

#### 淨零企業債券指數之產業分佈及產業違約率



資料來源：鋒裕匯理投信，Solactive，淨零企業債券指數=Solactive Paris Aligned Global Corporate Index，資料日期：2023/9/30。\*資料來源：Moody's，鋒裕匯理投信整理，違約率資料採2013-2022年年度資料，其中，2022年資料不含俄羅斯，資料日期：2022/12/31、報告日期：2023/4/14。

### 3 拒絕高碳 打造低碳排濃度投組



\*每創造百萬美元收入，會排放的二氧化碳公噸數。資料來源：鋒裕匯理投信，參考標=Solactive巴黎協定淨零全球企業債券指數(Solactive Paris Aligned Global Corporate Index)，該指數為本基金的ESG參考指標、非績效參考指標，資料日期：2024/2/29。

### 4 甜蜜買點 在啟動降息前就精準卡位淨零好債



全球投資等級企業債券指數	3個月	6個月	1年	3年
平均持有區間報酬				
降息前1-3個月投入	4.11%	5.25%	6.27%	16.80%
降息當月投入	1.73%	3.30%	2.58%	16.42%

資料來源：彭博，月資料計算，指數採全球投資等級企業債券指數=ICE Bofa Global Corporate Bond Index，該指數成立於1996/12/31，過去共經歷4次降息循環(1998/9-1999/5、2001/1-2004/5、2007/9-2015/11、2019/7-2022/2)，降息前1至3個月投入並持有區間(3個月、6個月及1年)之平均報酬，各持有區間報酬皆含4個樣本平均計算則得平均區間報酬，資料日期：2024/2/29。\*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。

#### 基金小檔案<sup>1</sup>

基金規模	2,198.2百萬新台幣	平均殖利率	4.85%
成立時間	2024/1/18	平均信評*	BBB+
存續期間(年)	6.45	風險收益等級**	RR2
計價幣別	新台幣、美元、人民幣		
前五大資產分布		前五大國家分布	
金融	38.51%	美國	42.13%
通訊服務	12.83%	法國	9.82%
醫療保健	10.36%	西班牙	7.99%
非必需消費	6.22%	英國	7.75%
公用事業	5.50%	荷蘭	5.99%

1.資料來源：鋒裕匯理投信，資料日期：2024/2/29；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權。平均殖利率及存續期間僅計算已投資部位。\*平均信評決定投資標的信用評級方式係採投資標的三大信評機構(S&P、Moody's、Fitch)之中位數評再以加權平均法計算整體投資組合之平均信評；計算範圍包含債券、現金及CDS(X)/CMBS(X)等部分衍生性金融商品。評等未必能完全反應該標的之信用風險且隨時可能改變。信評分布：AAA 0.00%、AA 4.05%、A 30.46%、BBB 60.47%、BB 0.75%、B 0.00%、CCC 0.00%及約當現金4.27%。\*\*鋒裕匯理全球淨零碳排企業債券證券投資信託基金(本基金有一定比重得投資於非投資等級之高風險債券且配息來源可能為本金)與同類型基金比較，以標準差區間予以分類等級，並與同類型基金比較，另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，決定風險報酬等級為RR2。2.資料來源：鋒裕匯理投信與理柏，原幣計價。資料日期：2024/3/31。完整配息紀錄資料，請至鋒裕匯理投信官網中查詢(www.amundi.com.tw)。基金配息之每單位配息金額+除息日前一淨值\*100%=當月配息率；當月配息率係以(月淨值-上月淨值+上月配息金額)÷上月淨值\*100%。資料日期：2024/4/16。

#### 近期基金配息紀錄<sup>2</sup>

新台幣 AD類型				
配息基準日	每單位配息金額	當月配息率	基準日淨值	當月含息報酬率
2024/4/16	0.054800	0.54%	10.15	2.60%

美元 AD類型				
配息基準日	每單位配息金額	當月配息率	基準日淨值	當月含息報酬率
2024/4/16	0.054100	0.55%	9.87	1.20%

人民幣 AD類型				
配息基準日	每單位配息金額	當月配息率	基準日淨值	當月含息報酬率
2024/4/16	0.041200	0.42%	9.78	1.01%

鋒裕匯理證券投資信託股份有限公司 台北市信義路5段7號台北101大樓32樓之一 總機：+886 2 8101 0696  
 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。有關基金應負擔之費用及投資風險等已揭露於基金公開說明書或基金簡章公開說明書，投資人可至公開資訊觀測站(<http://mops.twse.com.tw>)或本公司網站(<https://www.amundi.com.tw>)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。基金的配息可能由基金的收益或本金中支付。任何涉及由基金支出的部份，可能導致原始投資金額減損。基金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。本基金進行配息前已先扣除應負擔之相關費用，最近12個月內配息組成相關資料，投資人可參考本公司網站(<https://www.amundi.com.tw>)。鋒裕匯理全球淨零碳排企業債券證券投資信託基金(本基金有一定比重得投資於非投資等級之高風險債券且配息來源可能為本金)為投資國內外之債券型基金，考量基金類型、主要投資國家或地區、再參考公會風險報酬等級分類標準，以及過去淨值之變動性，本基金風險報酬等級為RR2。依照KYP風險評估結果，本基金適合風險承受度中或低，不願承擔過多風險的投資人。本基金有一定比重得投資於非投資等級債券，由於非投資等級債券之信用評等未達投資等級或未獲信用評等，故本基金可能因利率上升、市場流動性下降、或債券發行機構違約不支付本金、利息或破產受償虧損。另本基金有一定比重得投資於新興市場債券、新興市場投資組合波動性普遍高於成熟市場，而新興國家的債信等級普遍較低，所以承受的信用風險也相對較高，尤其當新興國家經濟基本面與政治狀況變動時，均可能影響其債信能力與債券信用品質，致本基金產生損失。依金融監督管理委員會規定，本基金投資於符合美國 Rule 144A 規定之債券不受證券投資信託基金管理辦法第十條第一項第一款不得投資於私募之有價證券之限制，其投資總金額不得超過本基金淨資產價值之百分之十。該債券屬私募性質，於次級市場交易時可能因參與者較少，或交易對手出價意願較低，導致產生較大的買賣價差，進而影響本基金之淨資產價值。此外，因較可能發生流動性不足，或因財務資訊揭露不完整而無法定期評估公司債信能力及營運之信用風險，或因信譽不透明導致波動性較大之風險。投資人投資於本基金所產生之投資風險包括：(一) 投資標的之信用風險、利率變動風險、流動性風險、外匯管制及匯率變動風險、政治風險、經濟風險、資產過度集中風險、產業景氣循環風險、投資標的特定投資策略風險、從事證券相關商品交易之風險、基金特色之風險及商品交易對手之信用風險。本基金以淨零企業債券為投資重點，故以ESG主題之基金、相關風險包括：ESG(或永續發展)主題基金之投資限制、自前ESG評等方法及資料之限制、缺乏之分類法、投資選擇之主觀判斷、對第三方資料來源之依賴等。有關基金之ESG資訊，投資人應於申購前詳閱公開說明書所載之基金特色或目標等資訊(<https://announce.fundclear.com.tw/MOPSFundWeb/ESG.jsp>)。本基金包含新臺幣、美元、人民幣、澳幣、南非幣計價對沖單位，如投資人以外幣計價之貨幣兌換後申購本基金者，須自行承擔匯率變動之風險；如以外幣計價之貨幣申購或買回時，其匯率波動可能影響該外幣計價對沖單位之投資績效，投資人應注意因其與銀行進行外匯交易時，投資人須承擔買賣匯差。人民幣目前無法自由兌換，且受到外匯管制及限制。此外，人民幣為管理性貨幣，其流動性有限，且除受市場變動之影響外，人民幣可能受大陸地區法令、政策之變更，進而影響人民幣資金市場之供應，致其匯率波動幅度較大，相關的換匯作業可能產生較高的結匯成本。本基金之新臺幣計價對沖單位對美元不避險，人民幣、澳幣、南非幣計價對沖單位對美元原則採高避險比例策略，不同貨幣計價對沖單位之投資人應留意避險策略之不同，面對之匯率風險亦將不同。本基金得依約將資產進行貨幣兌換，其風險包括交易契約因市場利率之上揚或下跌所產生評價損益變動之風險，由於債券價格與利率成反方向關係，當利率變動向上而使債券價格下跌時，基金資產便可能有損失之風險，進而影響淨值；利率上升亦可能影響利率交換合約的價格，進而影響基金淨值。交易對手無法對其應交付之現金流量履行交割義務之信用風險。本基金得為避險目的從事衍生自信用相關金融商品交易 (即信用違約交換 CDS) 及信用連約交換指數 (CDS index，如CDX系列指數與Itraxx系列指數等)，雖然可利用衍生自信用相關商品以達避險，惟從事此等交易亦可能產生衍生自信用之信用風險、流動性風險及市場風險，且即使為避險操作亦無法完全規避違約造成無法還本的損失以及必須承擔屆時賣方無法履約的風險。本基金N2類型各幣別計價對沖單位及N2類型各幣別計價對沖單位之遞延手續費應於買回時支付，且該費用將依持有期間而有所不同，其除費用之計收與前收手續費類型完全相同，亦不計分銷費用，請詳閱公開說明書。鋒裕匯理證券投資信託股份有限公司為鋒裕匯理基金及鋒裕匯理長鷹系列基金在臺灣之總代理及投資顧問。鋒裕匯理證券投資信託股份有限公司為Amundi Group之成員。  
 [鋒裕匯理投信獨立經營管理]