

參賽編號

E19001

區域

台灣

類別

固定收益ETF

公司名稱

國泰投信

旗艦基金名稱

國泰彭博10年期(以上)BBB美元息收公司債券基金

旗艦基金 ISIN 代碼

TW00000725B1

資料截至季末日

30 06 21

基金規模 (包括所有級別)

43,245,193,259

該基金策略投資組合經理數量

1

該基金策略分析師數量

1

支柱能力1：投資策略**1. 管理風格：該ETF按以下方式管理；請單選。**

被動管理，追蹤指數(包括smart

beta和其他複製任何指數的策略，即使該指數有基本或其他增值的方法 --

重要的是ETF本身是追蹤指數並沒有主動的投資組合管理決策) (Passive, index-tracking (including smart beta and other strategies that replicate any index, even if the index has a fundamental or other value-added approach -- importantly, the ETF itself is index-tracking with no active portfolio management decisions))

2. 指數加權：此問題與您的ETF所依據的指數有關。該指數的權重是基於什麼？請單選。

市值加權 (Market-cap weighted)

3. 競爭優勢：與同類型ETF相比，該ETF對投資者來說有何獨特之處？請選擇適用選項 (多選) 。

對於散戶投資人和小型機構，通過我們的ETF，他們能夠投資於通常僅供大型機構投資者投資的資產，市場或策略。(For retail investors and smaller institutions, our ETF provides access to assets, markets or investment strategies that are usually only available to large, major institutional asset owners)

讓所有投資人都能投資難以接觸的市場或資產 (Access to inaccessible markets, or assets, for all investors)

使用當地時間進行交易，而不是北美或歐洲時間 (Trading in local time, instead of North American or European time)

更有效的執行，帶來更緊密的買賣、較低費用比率等 (Better execution, resulting in tighter bid/ask, lower expense ratios, etc.)

更好的潛在資產流通性，更好的風險管理 (Better liquidity of underlying assets, leading to better risk management)

我們的ETF是基於不同與其他同業的指數，同時帶給我們更好的風險報酬 (Our ETF is based on a different index from competing ETFs, giving our ETF a better risk-return profile)

我們的ETF在3年或更長時間內具有較小的追蹤誤差 (Our ETF has a lower tracking error over 3 years or more)

我們的ETF有較長的歷史紀錄 (Our ETF has a longer track record)

我們的ETF收取較低的管理費用 (Our ETF charges lower management fees)

我們擁有更高的ETF品牌知名度 (Our ETF has a better known brand)

如有附加說明，限250字以內

國泰投資級債券基金主要投資於BBB級別公司債，因其為投資級債券中利差最高，更能抵禦利率上行之價格風險，故為投資人資產配置中債券之核心部位。

基金規模自台幣272億(2020/07)增長至432億台幣(2021/06)，增幅度55%，目前為同類型ETF規模最大。基金在績效表現及追蹤績效上皆有優異表現：

近一年基金含息報酬率為3.75%，表現遠優於同類型ETF。近三年平均TE為1.13%，近一年平均TE為0.69%，皆優於同類基金表現。

4. 指數選擇：當你選擇此ETF的基本指數，您的要求是什麼？請選擇適用選項（多選）。

該指數出自一家以強大的研究和流程而聞名的公司 (The index was produced by a firm reputed for robust research and strong processes)

該指數出自一家擁有超過10年指數追蹤紀錄的公司 (The index was produced by a company with more than 10 years' track record in indexing)

該指數允許以合理的成本和風險進行85-100%的實物複製 (The index allows for 85-100% physical replication at reasonable costs and risks)

該指數的成分在二級市場中具有合理至高程度的流動性 (The index's components have reasonable to high liquidity in the secondary markets)

該指數的成分股的交易可達至成本效益 (The index's components can be traded cost-effectively)

該指數多元化，並非過度著重於單一的證券、行業、國家/地區、信用等級等 (The index is reasonably diversified and is not overly concentrated in any single security, sector, country/region, credit quality, etc.)

該指數的成分具有平均或高於平均的ESG評級 (The index constituents have average or above-average ESG ratings)

指數供應商擁有明確表達和公開的管理法典/框架/實踐 (The index provider has a stewardship code/framework/practices that are clearly articulated, explicit and publicly available)

指數授權的價格具有競爭力 (The index license is competitively priced)

如有附加說明，限250字以內

國泰投資級債券ETF追蹤彭博10年期以上BBB美元息收公司債(中國除外)指數。彭博擁有相當悠久之債券指數編製歷史，始自1992年，其指數編製廣受投資人青睞，指數授權之基金規模更逾6兆美金。基金持有近100%指數成分債共涵蓋71個發行人、橫跨11個產業別，主要以美國為首之已開發國家發行人的投資級債券。為降低集中度並達到分散風險，設有單一產業權重上限20%限制。成分債平均買賣價差為28bps，流動性分數(LQA)達97，流動性優。基金MSCI ESG評級為BBB，基金碳排放量級別為Moderate。