

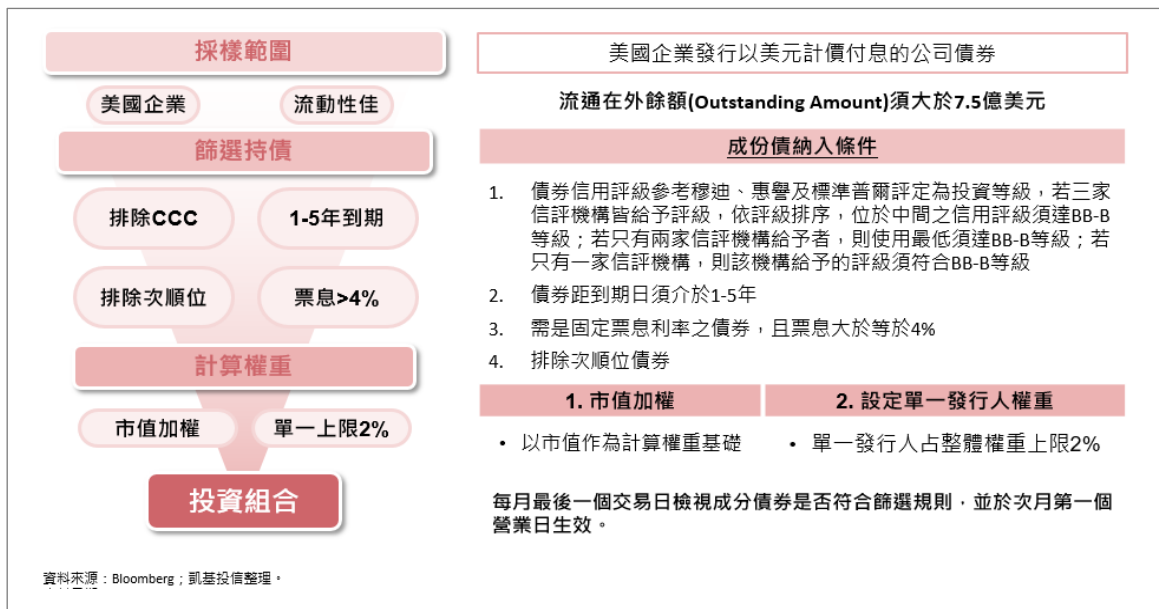


00945B/凱基美國非投等債 凱基美國優選收益非投資等級債券 ETF 基金

■ 凱基美國優選收益非投資等級債券 ETF 基金(以下簡稱本 ETF)，依金管會民國 112 年 9 月 28 日金管證投字第 1120140025 號函辦理，發行 ETF 應加強資訊揭露事項：

一、本 ETF 標的指數為「彭博美國企業非投資等級 1-5 年 Ba 至 B 債券指數(Bloomberg US Corporate High Yield 1-5 Yr Ba/B 4% Cpn Senior Index)」為客製化指數。

二、本 ETF 指數編製規則：



三、本 ETF 標的指數-彭博美國企業非投資等級 1-5 年 Ba 至 B 債券指數，其與代表性指數-彭博全球非投資等級債券指數(Bloomberg Global High Yield Index)差異及風險說明：

與代表性指數主要差異	差異說明	可能導致之風險
國家差異	本指數僅納入單一國家(美國)，與代表性指數不同。	當不同國家債券報酬差異出現差異時，本指數與代表性指數的報酬表現兩者亦會出現差異。
債種差異	本指數僅納入由企業所發行之公司債券，與代表性指數不同。	當不同債種債券報酬差異出現差異時，本指數與代表性指數的報酬兩者亦會出現差異。
信用評等差異	本指數僅納入信用評等為 BB 至 B 級之間債券，與代表性指數不同。	當不同信用評等債券報酬出現差異，本指數與代表性指數的報酬兩者亦會出現差異。
年期差異	本指數僅納入到期年限 1-5 年區間之債券，與代表性指數不同。	當不同年期債券報酬差異出現差異時，本指數與代表性指數的報酬兩者亦會出現差異。



與代表性指數主要差異	差異說明	可能導致之風險
票面利息差異	本指數僅納入票面利息大於 4% 之債券，與代表性指數不同。	當不同票面利息債券報酬出現差異時，本指數與代表性指數的報酬表現兩者亦會出現差異。
權重差異	本指數單一發行人初始權重上限為 2%，與代表性指數不同。	當單一發行人權重與代表性指數權重出現差異時，本指數與代表性指數的報酬表現兩者亦會出現差異。

資料來源：凱基投信整理

凱基證券投資信託股份有限公司 | 107年金管投信新字第003號 | 104台北市中山區明水路698號 | 服務專線：(02)2181-5678 | www.kgifund.com.tw

- 一、**凱基投信獨立經營管理** | 本基金經金融監督管理委員會核准或同意生效，惟不表示絕無風險。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。本基金不適合無法承擔相關風險之投資人。投資人投資以非投資等級債券為訴求之基金不宜占其投資組合過高之比重。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。
- 二、本基金適合尋求固定收益之潛在收益且能承受較高風險之非保守型投資人。
- 三、本基金為投資於標的指數之成分證券或因應標的指數複製策略所需，得投資符合美國 Rule 144A 規定之債券，該債券屬私募性質，較可能發生流動性不足、財務訊息揭露不完整或因價格不透明導致波動性較大之風險，投資人於投資前須留意相關風險。
- 四、**本基金自成立日起至上市日前(不含當日)，經理公司不接受本基金受益權單位數之申購或買回。本基金受益憑證之上市買賣，應依證券交易所市場有關規定辦理。**
- 五、本基金自成立日起，即運用本基金資產進行投資組合佈局，本基金投資組合成分價格波動會影響本基金淨值表現。**投資人於本基金成立日(不含當日)前參與申購所買入的本基金每受益權單位之發行價格，不等同於本基金掛牌上市之價格，參與申購投資人需自行承擔本基金自成立日起至掛牌日止期間之本基金淨資產價格波動所產生折 / 溢價之風險。本基金受益憑證上市後之買賣成交價格無升降幅度限制，並應依臺灣證券交易所所有有關規定辦理。**
- 六、指數免責聲明：「Bloomberg®」及本協議所授權的指數(「彭博美國企業非投資等級 1-5 年 Ba 至 B 債券指數(Bloomberg US Corporate High Yield 1-5 Yr Ba/B 4% Cpn Senior Index)」)，為 Bloomberg Finance L.P.及其關係企業，包括彭博指數服務公司(「BISL」)，以及指數管理人等(統稱「彭博」)的服務標章，業已授權凱基投信(「被授權人」)為特定目的使用之。彭博並非被授權人的關係企業，且彭博未核准、背書、審查、或推薦本協議所述金融產品(「凱基美國優選收益非投資等級債券 ETF 基金」)。彭博不保證有關該指數或該金融產品中任何資料或資訊的及時性、正確性、或完整性。(完整版警語請詳閱公開說明書)
- 七、**本基金投資無受存款保險、保險安定基金或其他相關保障機制之保障，投資人須自負盈虧。基金投資可能產生的最大損失為全部本金。**