

公告日期：中華民國 107 年 4 月 10 日

公告文號：第一金投信(107)字第 204 號

主旨：本公司經理之「第一金全球高收益債券證券投資信託基金」（本基金主要係投資於非投資等級之高風險債券且配息來源可能為本金）變更績效參考指標，並配合修正公開說明書乙案，業經金融監督管理委員會(以下簡稱「金管會」)核予備查，謹此公告。

說明：

- 一、依金管會中華民國 107 年 4 月 10 日金管證投字第 1070308859 號函及基金信託契約第 30 條辦理。
- 二、旨揭基金變更績效參考指標，由巴克萊全球高收益債券指數(扣除 CMBS 與 EM，發行者 2%限制)(Barclays Global High Yield Excl CMBS and EMB 2% cap Index)更換為彭博巴克萊全球高收益債券指數(Bloomberg Barclays Global High Yield Index)，並配合修正公開說明書，公開說明書修正對照表請詳如下表。
- 三、本公告可至中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會(<http://www.sitca.org.tw>)及本公司網站(<http://www.fsitc.com.tw>)查詢；基金公開說明書查詢網站為公開資訊觀測站(<http://mops.twse.com.tw>)及本公司網站。

第一金全球高收益債券基金公開說明書修正對照表

項次	修正後	修正前
壹、 十、 (二)、5. 第 5 頁	5. 基金指標： <u>彭博巴克萊全球高收益債券指數(Bloomberg Barclays Global High Yield Index)</u> ，為 <u>彭博(Bloomberg)向巴克萊資本(Barclays Capital)收購的高收益債券指數，其中包含約3,400支高收益債券，範圍包含已開發以及新興市場國家。由於涵蓋範圍最廣，涵蓋區域更加均衡，可忠實反應整體市場狀況。</u>	5. 基金指標： <u>巴克萊全球高收益債券指數(扣除 CMBS與EM，發行者2%限制)(Barclays Global High Yield Excl CMBS and EMB 2% cap Index)</u> ，為 <u>巴克萊資本(Barclays Capital)所編製的高收益債券指數，其中包含約1700支高收益債券，接近1000個發行主體。與其它投資銀行所編製的指數不同的是，此指數不包含證券化商品與新興市場高收益債券，且每個發行者占指數的權重不會超過2%限制，可適當反應市場狀況。</u>
壹、 十、 (三) 第 5 頁	(三)持有固定收益證券部位之加權平均存續期間管理策略： 高收益債券通常內含選擇權(投資人及發行者可以選擇提前買回或賣回)，券的存續期間也會因此受影響；但高收益債券與一般債券不同，	(三)持有固定收益證券部位之加權平均存續期間管理策略： 高收益債券通常內含選擇權(投資人及發行者可以選擇提前買回或賣回)，券的存續期間也會因此受影響；但高收益債券與一般債券不同，與利率的連動性較低，反而

項次	修正後	修正前
	<p>與利率的連動性較低，反而是受與公債間之利差的影響較大，因此在存續期間的管理上本基金將採取較為被動的操作策略。<u>本基金之指標為彭博巴克萊全球高收益債券指數(Bloomberg Barclays Global High Yield Index)</u>其存續期間為4~5年，本基金也會以指標為基準，配置後加權平均存續期間以指標存續期間的加減兩年為主。但若因系統性風險而降低持債比重時，則不受此限。</p>	<p>是受與公債間之利差的影響較大，因此在存續期間的管理上本基金將採取較為被動的操作策略。<u>本基金之指標為巴克萊全球高收益債券指數(扣除 CMBS 與 EM，發行者 2%限制)(Barclays Global High Yield Excl CMBS and EMB 2% cap Index)</u>其存續期間為 4~5 年，本基金也會以指標為基準，配置後加權平均存續期間以指標存續期間的加減兩年為主。但若因系統性風險而降低持債比重時，則不受此限。</p>
<p>肆、 八、 (二) 第 21 頁</p>	<p>(二)高收益債券市場，簡要說明： (略) 以本基金之指標<u>彭博巴克萊全球高收益債券指數(Bloomberg Barclays Global High Yield Index)</u>，至 2018/2/28止，本指數共含括3,409支債券，市值共2.5兆美元，債券存續期間約4.47年，票面利率約6.09%。以債券發行區域來分，其中北美占49%，中南美洲占13%，亞洲占5%，歐洲占27%，非洲與中東占6%。該指數過去十年(2008~2017)以來，平均年化總報酬率約8.34%。</p>	<p>(二)高收益債券市場，簡要說明： (略) 以本基金之指標<u>巴克萊全球高收益債券指數(扣除CMBS與EM，發行者2%限制)(Barclays Global High Yield Excl CMBS and EMB 2% cap Index)</u>，至 2013/12/31止，本指數共含括2761支債券，市值共1.5兆美元，債券存續期間約3.87年，票面利率約7.16%。以債券發行國家來分其中北美占了64.7%，南美洲占7%，亞洲占14.5%，歐洲占11%，其餘則為非洲。該指數過去九年(2004~2012)以來，平均年化總報酬率約11.13%。</p>