中國信託投信
CTBC INVESTMENTS

中國信託證券投資信託股份有限公司

公告

中華民國 115 年 11 月 4 日
中信(投信)字 11510231004 號

主　旨：**中國信託六年到期新興主權債券基金**(本基金持有相當比重於非投資等級之高風險債券)、**中國信託 2024 年到期新興主權債券基金**(本基金有相當比重投資於非投資等級之高風險債券且基金之配息來源可能為本金)，其持有受金融制裁債券最新狀況。謹依善良管理人注意義務持續積極追蹤其本息支付情形。

說　明：

一、 **中國信託六年到期新興主權債券基金**(本基金持有相當比重於非投資等級之高風險債券)持有受金融制裁債券最新狀況

基金 到期日	債券名稱/ 國際代碼	近期相關市場訊息	二次給付帳戶 (是否完成交割)
2023/8/4	VEBBNK 5.942 11/21/23(俄羅斯國家開發銀行) XS0993162683	自 2022 年 3 月起，因俄羅斯入侵烏克蘭引發俄烏戰爭，俄羅斯陸續受國際金融制裁，因俄羅斯國家開發銀行遭列入制裁名單，國際代理銀行及清算機構均無法交割俄羅斯相關債券。 債券發行人為國營企業，目前於俄羅斯境內仍正常營運、且宣稱其有償債能力及意願，惟因制裁而無法達成。 考量制裁之特殊性，研判須待戰爭結束、制裁解除並待各相關機構全面鬆綁後方能恢復流動性，後續將持續關注戰爭發展。	否

二、 **中國信託 2024 年到期新興主權債券基金**(本基金有相當比重投資於非投資等級之高風險債券且基金之配息來源可能為本金)持有受金融制裁債券最新狀況

基金 到期日	債券名稱/ 國際代碼	近期相關市場訊息	側袋帳戶 (是否完成交割)
2024/6/3	VEBBNK 6.025 07/05/22(俄羅斯國家開發銀行) XS0800817073	自2022年3月起，因俄羅斯入侵烏克蘭引發俄烏戰爭，俄羅斯陸續受國際金融制裁，因俄羅斯國家開發銀行遭列入制裁名單，國際代理銀行及清算機構均無法交割俄羅斯相關債券。 債券發行人為國營企業，目前於俄羅斯境內仍正常營運、且宣稱其有償債能力及意願，惟因制裁而無法達成。 考量制裁之特殊性，研判須待戰爭結束、制裁解除並待各相關機構全面鬆綁後方能恢復流動性，後續將持續關注戰爭發展。	否，本基金已於2024年5月23日設立側袋帳戶，並訂定側袋機制基準日為2023年10月4日，目前問題資產尚未取得返還。

三、 特此公告

【中國信託投信獨立經營管理】

中國信託證券投資信託股份有限公司/

- **台北總公司：115 台北市南港區經貿二路 188 號 12 樓 (02)2652-6688**
- **台中分公司：403 台中市西區忠明南路 499 號 9 樓之 1 (04)2372-5199**
- **高雄分公司：802 高雄市苓雅區新光路 38 號 9 樓之 7 (07)269-1788 (本分公司暫不受理交易)**
- **客服專線：(02)2652-6699**
- **網址：http://www.ctbcinvestments.com**