



街口投信
JKO Asset
Management

存債好時光 投資有主張

00992B

街口特選優息非投資等級債券ETF
(基金之配息來源可能為收益平準金且
並無保證收益及配息)

9/14
熱烈開幕

被動追蹤有邏輯
配置更有力

信評把關更給力
風險不失序

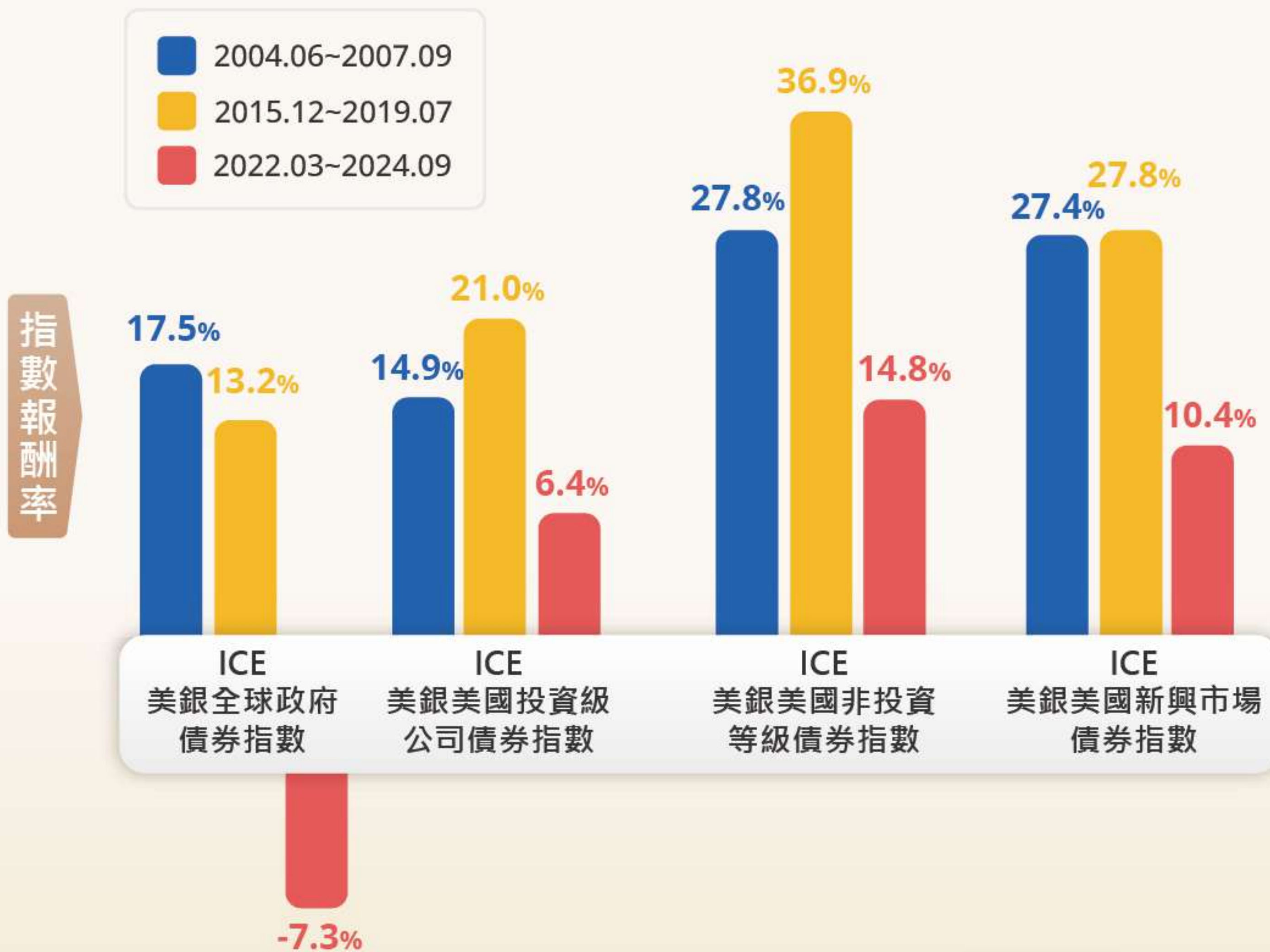
月配機制有節奏
資產長久行

存債好時光 投資有主張

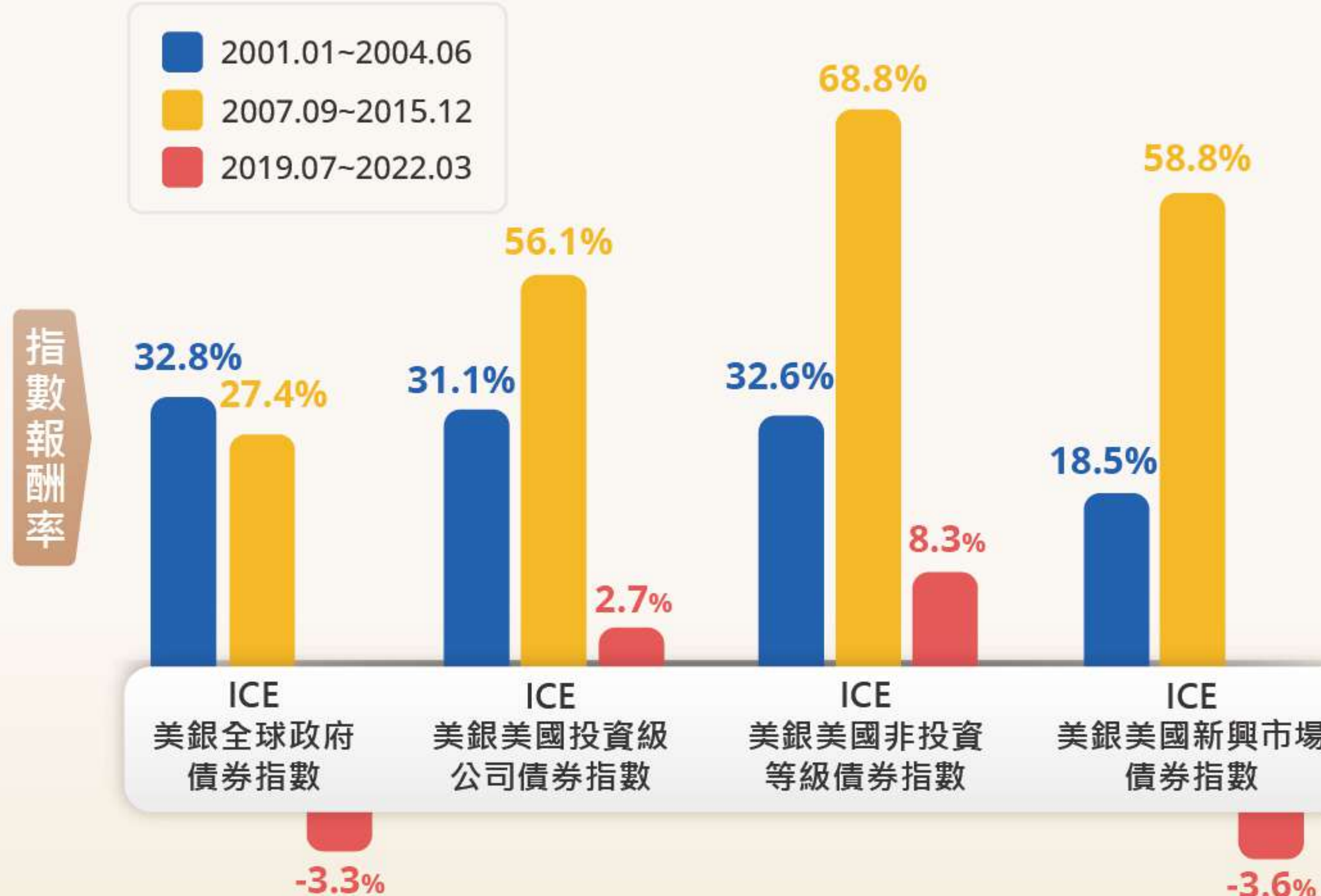
存債佈局，首選非投資等級債

歷史資料顯示，非投資等級債由於存續期短的特性，受利率波動影響輕，有助穿越景氣與利率循環。

▶ 升息循環至降息前



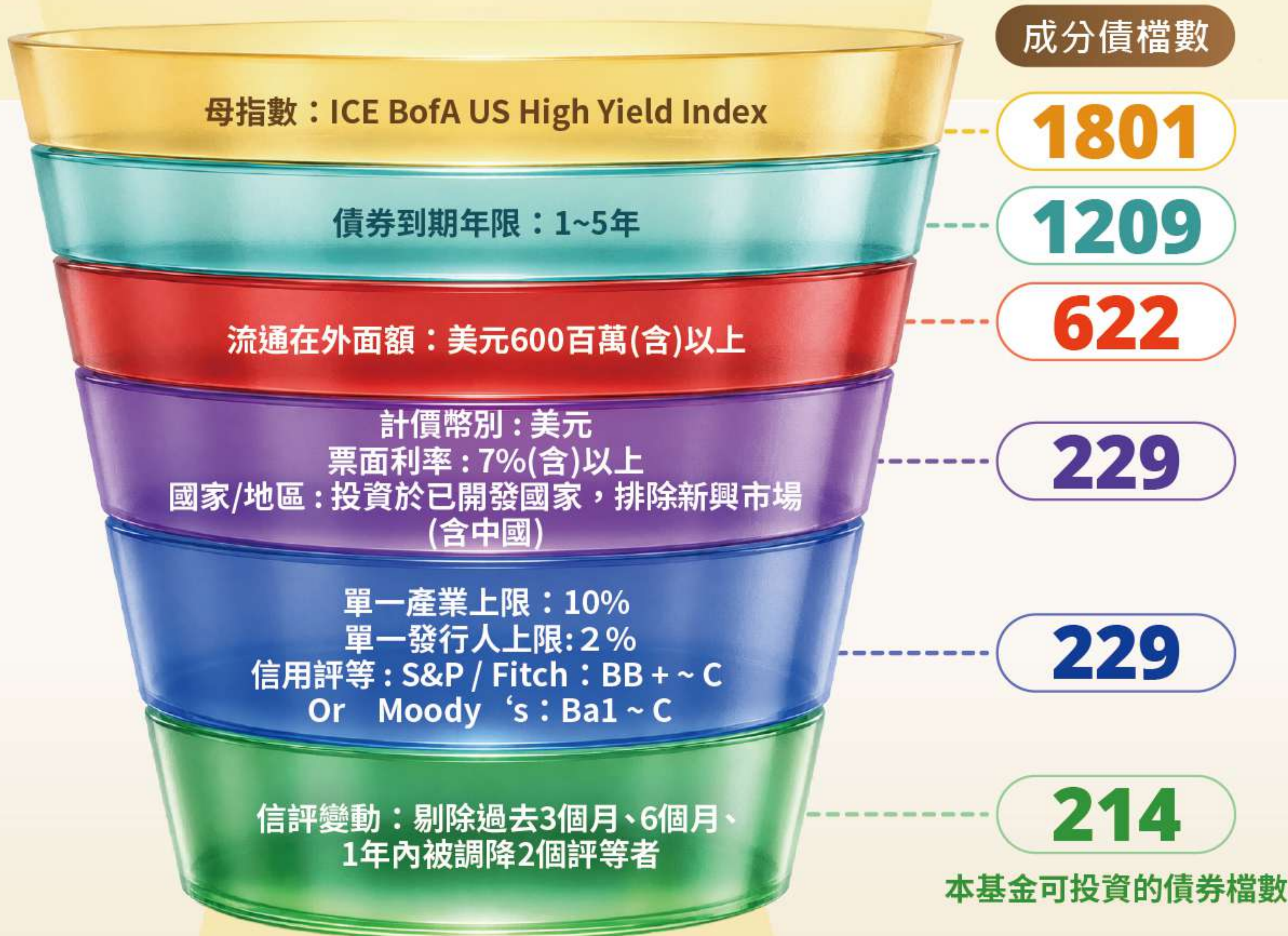
▶ 降息循環到升息前



資料來源：Bloomberg，2001年~2025年，街口投信整理。本資料所稱升息／降息循環，係依美國聯準會（Fed）聯邦基金利率政策調整期間劃分。本資料所示之指數係為說明或舉例之目的，並非推薦投資，且未必為街口投信所管理基金之對比指數或持有之部位。本文提及之升息、降息循環表現係歷史資料回溯分析，僅供參考，不保證未來市場環境將重現相同結果。

指數規則 層層精選債券

本基金追蹤指數「ICE TPEX 1-5年期已開發市場高票息美元非投資等級債券指數」編製規則



資料來源：ICE Data，資料日期：2026.04.30，本基金以追蹤標的指數報酬為目標，指數報酬可能發生偏離，標的成分債券價格之波動亦將影響本基金標的指數之走勢，然本基金追求標的指數報酬之目標，不因標的指數發生劇烈波動而改變。本基金得投資符合美國Rule 144A規定之債券，該債券屬於私募性質，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。本基金可投資之債券檔數及投資配置將隨追蹤指數及市況而改變。

選債有方法 打造多元債券 配置

本基金追蹤指數「ICE TPEX 1-5年期已開發市場高票息美元非投資等級債券指數」

聚

聚焦票面利率7%以上的債券

多

投資多元性
單一產業投資上限設定10%，
單一發行人投資上限設定2%

強

動態精選汰弱留強
信評遭調降2個評等，
自指數汰除

本基金採被動管理方式，以追蹤標的指數報酬為目標，基金的投資績效表現將視其追逐的標的指數走勢而定，而標的成分債券價格之波動(包括但不限於利多、利空、流動性不足、交易對手信用風險、利率風險等因素影響)將影響本基金標的指數之走勢，然本基金追求標的指數報酬之目標，不因標的指數發生劇烈波動而改變。本基金投資配置將隨市況而改變。本頁所指票面利率僅反映投資組合債券之票息水準，不代表基金實際配息率、報酬率或未來績效表現，不同時間進場投資，其結果將可能不同，且並未考量交易成本。

鎖定7%票面利率 解鎖收益潛力

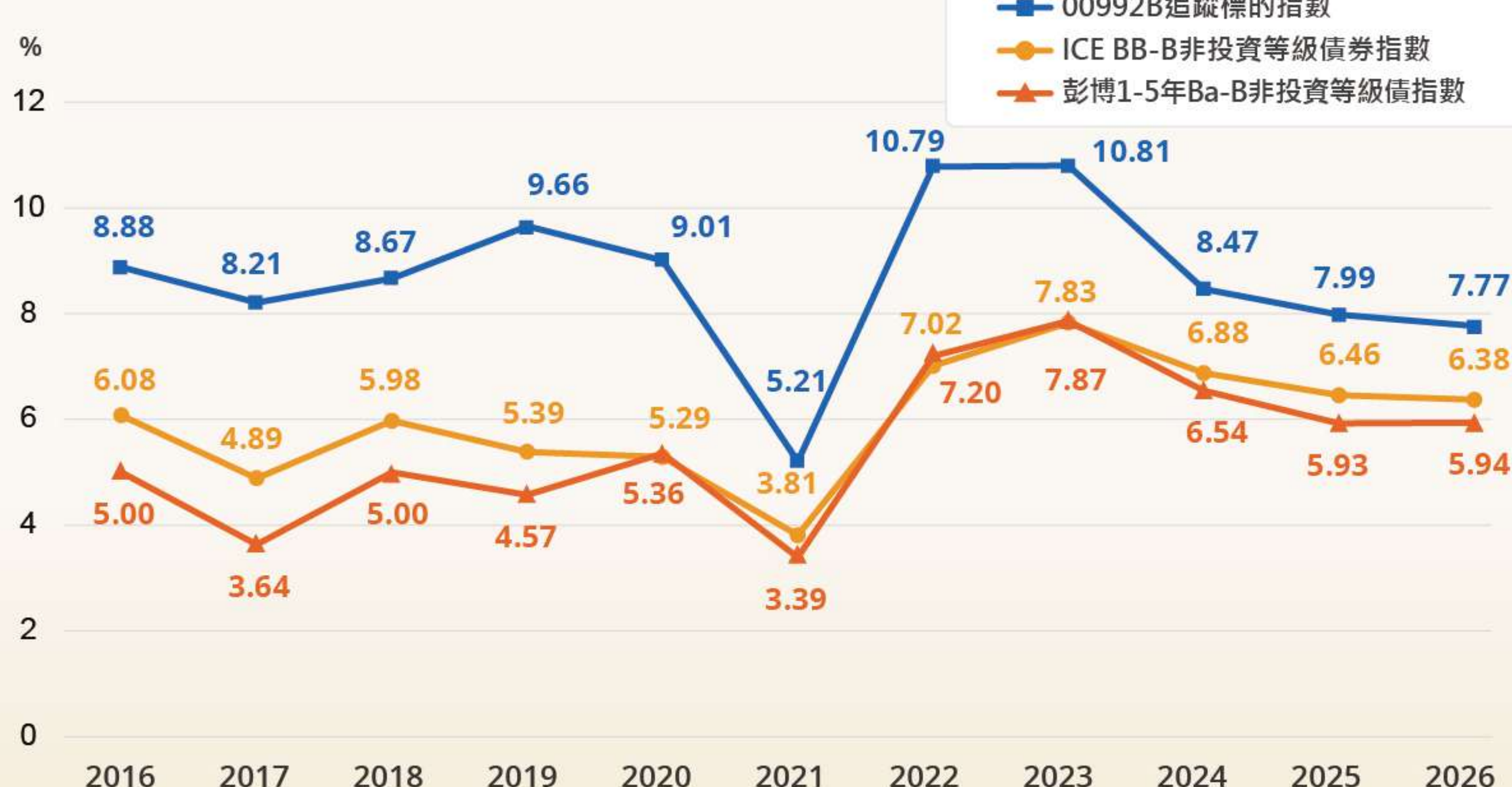
聚焦高殖利率，存債才有力

00992B追蹤標的指數近十年來平均殖利率約為8.74%，資產配置更具存債感。

近10年平均殖利率(%)



各年度平均殖利率(%)



資料來源：Bloomberg，2016/1-2026/4月底殖利率平均數；街口投信整理。00992B追蹤標的指數為「ICE TPEX 1-5年期已開發市場高票息美元非投資等級債券指數」。本資料所示之指數係為說明或舉例之目的，並非推薦投資，且未必為街口投信所管理基金之對比指數或持有之部位。本資料係依歷史市場資料統計分析，僅供參考，不代表未來市場走勢、基金績效或報酬之保證。本基金追蹤指數績效或殖利率之表現，不代表本基金之實際報酬率或配息率及未來績效保證，不同時間進場投資，其結果將可能不同，且並未考量交易成本。債券殖利率不代表基金報酬率，亦不代表基金配息率，且目前殖利率不代表未來殖利率；基金淨值可能因市場因素而上下波動。投資人需留意，基金追蹤標的指數殖利率高的同時，標的成分債券之信用風險亦相對較高。投資人因不同時間進場，將有不同之投資績效，過去之績效亦不代表未來績效之保證。本頁所指之殖利率指最差殖利率(Yield to Worst)，係指到期殖利率、買回殖利率或贖回換券殖利率的最低殖利率，上述指數和追蹤指數之平均殖利率為計算區間的簡單平均。

00992B追蹤標的指數

本基金追蹤標的指數為「ICE TPEX 1-5年期已開發市場高票息美元非投資等級債券指數」。

指數基本資料

成分債檔數 214

加權平均殖利率 8.44

加權平均票面利率 8.67

存續期間 2.01

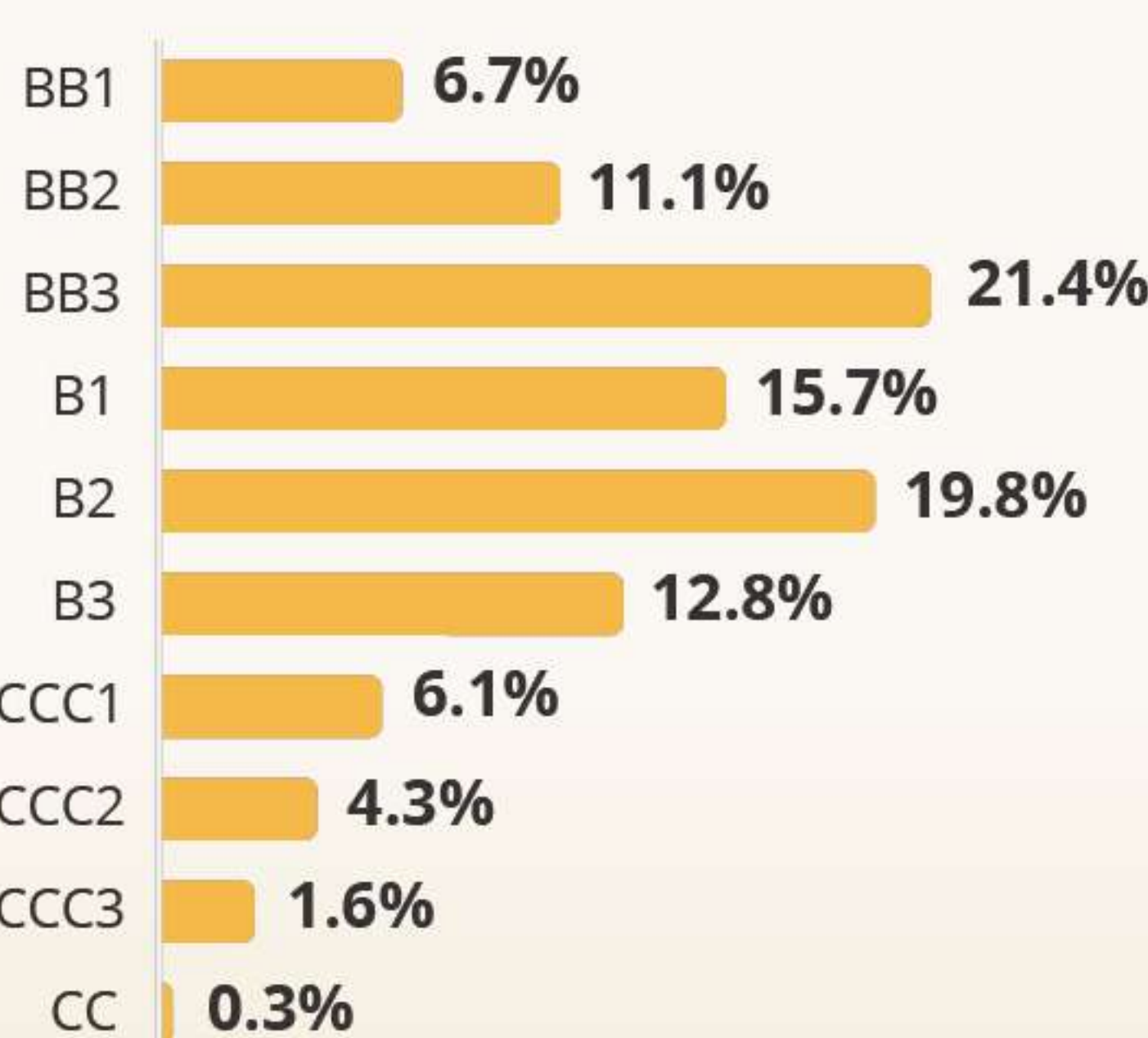
平均信用評等 B1

產業配置



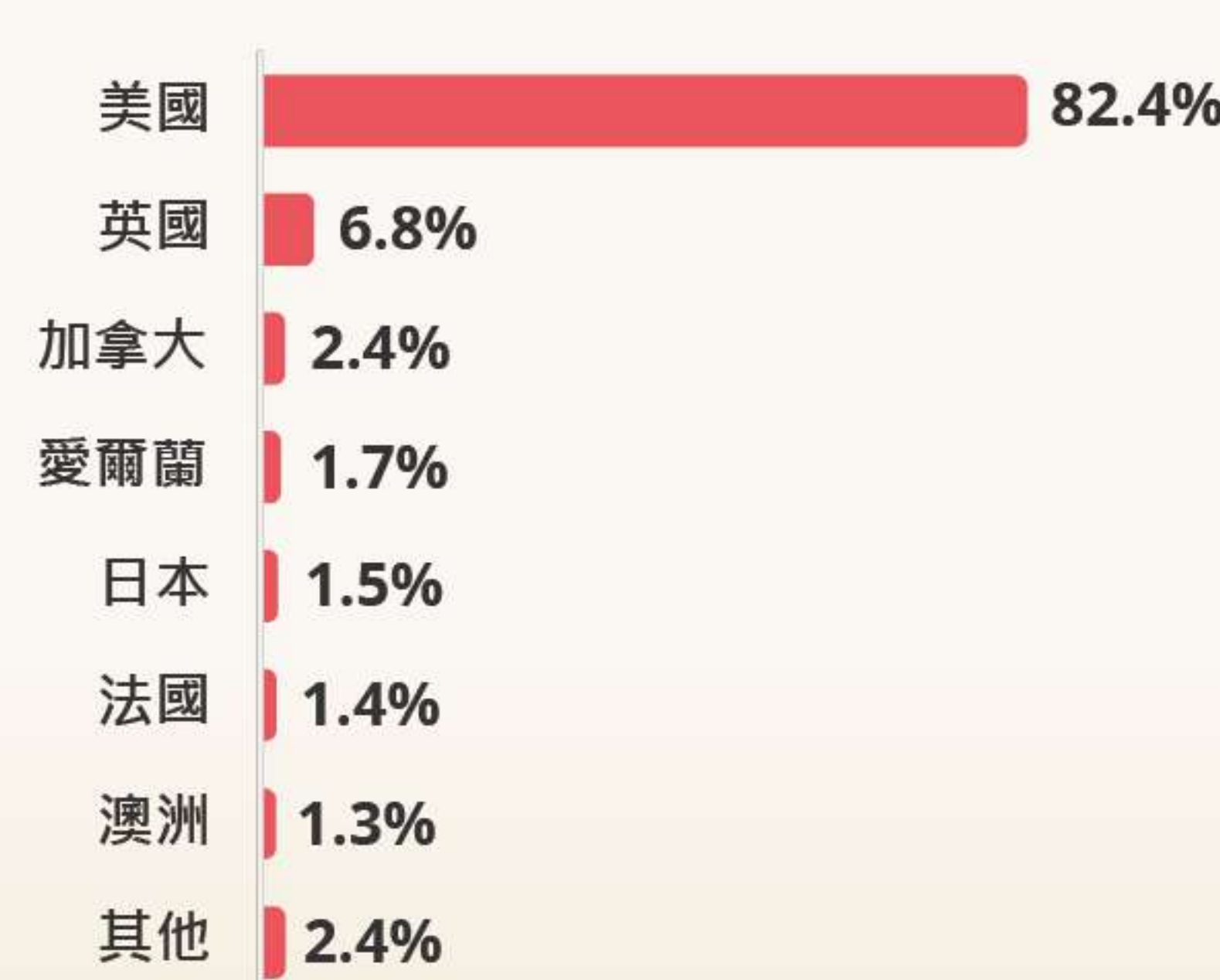
*其他：包含休閒、零售、汽車、公用事業、消費品、不動產及運輸

信評分佈



資料來源：ICE Data，2026.04.30，街口投信整理。本基金可投資之債券檔數及投資配置將隨追蹤指數及市況而改變。

國家配置



ETF追蹤指數績效、殖利率或票面利率之表現，不代表本ETF基金之實際報酬率或配息率及未來績效保證，不同時間進場投資，其結果將可能不同，且並未考量交易成本。平均信評之計算採用三大信評機構(穆迪、標普、惠譽)之評等，計算範圍涵蓋本基金持有之所有債券部位，計算方式為將三大信評機構信評採等級分佈及配分，將對債券進行評級之機構的分數加總取平均值四捨五入至最接近整數，再依信評等級分佈配分表得出平均信評。如有兩家至三家機構對債券進行評級，則平均信評取平均值；如僅一家機構對債券進行評級，則僅取該評級為平均信評。平均殖利率係以基金追蹤標的指數成分債的到期殖利率加權平均計算。平均票面利率係依各成分債票面利率及其持有權重加權平均計算。

00992B基金小檔案

標的指數

ICE TPEX 1-5年期已開發市場高票息美元非投資等級債券指數

發行價格

新台幣10元

基金風險報酬等級

RR3

基金保管機構

上海商業儲蓄銀行

經理費

新台幣30億(含)以下：0.4%；
新台幣30億以上：0.3%

保管費

新台幣30億(含)以下：0.16%
新台幣30~100億(含)：0.10%
新台幣100億以上：0.08%

投資標的

海外美元計價的非投資等級債

追蹤方式

最佳化複製法指數化策略

投資範圍

排除新興市場(含中國)的已開發區域國家等

收益分配

月配，本基金成立滿45日後

收益平準金機制

有

成分債定期審核調整

每個月對指數進行一次成分證券審核，
於每月最後一個日曆日生效

最低申購金額

新台幣10,000元或其整數倍數

註：本基金風險報酬等級為RR3，風險報酬等級為本公司經依基金之投資策略等因素整體綜合考量後，並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(風險報酬等級係計算過去5年基金淨值波動度標準差，以標準差區間予以分類等級，分類為RR1~RR5五級，數字越大代表風險越高)。惟此等級分類係基於一般市場狀況反映市場價格波動風險，無法涵蓋所有風險，不宜作為投資唯一依據，投資人仍應注意所投資基金個別的風險。投資人申購基金前應詳閱公開說明書，更多基金評估之相關資料可至投信投顧公會網站之「基金績效及評估指標查詢專區」查詢。本基金可投資之國家以美國、英國、加拿大、愛爾蘭、日本、澳洲、法國、荷蘭、奧地利、瑞士及其他已納入與即將納入標的指數成分債之國家或地區，並排除中國(不含港澳)，以上投資比例將根據市場情況而隨時更改。

【街口投信獨立經營管理】

114金管投信新字第010號

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及風險預告書。銷售機構有本基金公開說明書備索，投資人或可至本公司網站及公開資訊觀測站查詢。**本基金投資無受存款保障、保險安定基金或其他相關機制之保障，投資人需自負盈虧。基金投資可能產生的最大損失為全部本金。**有關投資人及基金應負擔之費用已揭露於基金之公開說明書中，投資人可至本公司官網及公開資訊觀測站查詢。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。本內容提及之相關資產配置比重僅供示意，不代表本基金之必然投資配置，本基金之實際配置，經理公司將依實際市場狀況進行調整。投資人申購本基金係持有基金受益憑證，而非本內容提及之投資資產或標的。投資人因不同時間進場，將有不同之投資績效，過去之績效亦不代表未來績效之保證。本基金風險報酬等級為RR3，為追蹤國外已開發市場債券指數之指數股票型基金，適合了解本基金投資特色及風險，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。RR3係計算過去5年基金淨值波動度標準差，以標準差區間予以分類等級，此等級分類係基於一般市場狀況反映市場價格波動風險，無法涵蓋所有風險(如：基金計價幣別匯率風險、信用風險、流動性風險、利率風險及匯率變動風險等)，不宜作為投資唯一依據，投資人仍應注意所投資基金個別的風險。本基金潛在投資風險可能包含產業景氣循環、流動性不足、外匯管制、投資地區政經變動或其他相關風險。**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。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。**本基金的配息可能由基金的收益平準金中支付。任何涉及由收益平準金支出的部份，可能導致原始投資金額減損。本基金配息率不代表實際報酬率，且過去配息率不代表未來配息率；本基金淨值可能因市場因素而上下波動。配息組成項目揭露於公司網站(www.jkoam.com)。本基金配息將優先參考基金投資組合或指數之平均收益率、票面利率或股息率為目標，盡可能貼近合理之息率範圍，但若發生非經理公司可控之因素，如除息日前基金出現大額買回，導致受益憑證單位數大幅變動，則經理公司將配合調整基金收益分配之配發率(實際分配之收益/經會計師查核後之可分配收益)，以期達到合理貼近之息率範圍。本基金追蹤指數績效或殖利率之表現，不代表本基金之實際報酬率或配息率及未來績效保證，不同時間進場投資，其結果將可能不同，且並未考量交易成本。**本基金為投資於標的指數之成分債券或因應標的指數複製策略所需，可投資具私募性質之美國Rule 144A 債券，該類型債券包含下列風險：債券發行人違約之信用風險、利率風險、流動性風險、交易對手風險等，有關本基金運用限制及風險請詳見公開說明書。**本基金投資於金融機構發行具總損失吸收能力之債券(TLAC)，當金融機構出現資本適足率低於一定水平、重大營運或破產危機時，得以契約形式或透過法定機制將債券減記面額或轉換股權，可能導致債券部分或全部債權減記、利息取消、債權轉換股權、修改債券條件如到期日、票息、付息日、或暫停配息等變動，由於其存在還本不確定性，故其價格波動風險可能較一般債券大。本基金自成立日起，即以買入標的指數成分證券投資建構本基金交易部位及以基金資產進行有價證券之投資，基金投資組合成分價格波動會影響基金淨值表現，投資人於本基金掛牌上櫃前申購所買入的每單位淨資產價值，不等同於基金掛牌上櫃後之價格，投資人需自行承擔自申購日起至上櫃掛牌日止期間之基金價格波動所產生折/溢價的風險。本基金自成立日起至上櫃日前(不含當日)，經理公司不接受本基金受益權單位之申購或買回。本基金受益憑證上櫃後之買賣成交價格無升降幅度限制，並應依財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心有關規定辦理。本基金於上櫃日後，將依財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心規定，於交易時間內提供盤中估計淨值供投資人參考。本基金估計淨值以新臺幣計價，而基金主要投資標的為國外債券，因此匯率波動將影響本基金估計淨值之計算，且盤中估計淨值所使用的即時匯率，因資訊源及評價的時點不同，與本基金實際計算淨值之匯率或有差異，投資人需留意盤中估計淨值與實際基金淨值可能有誤差值的風險，且經理公司於財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心交易時間內提供的估計淨值僅供投資人參考，實際淨值應依經理公司最終公告之每日淨值為準。**本內容如涉及本基金追蹤指數績效或殖利率之表現，不代表本基金之實際報酬率或配息率及未來績效保證。**本基金採被動管理方式，以追蹤標的指數報酬為目標，基金的投資績效表現將視其追逐的標的指數走勢而定，而標的成分債券價格之波動(包括但不限於利多、利空、流動性不足、交易對手信用風險、利率風險等因素影響)將影響本基金標的指數之走勢，然本基金追求標的指數報酬之目標，不因標的指數發生劇烈波動而改變。本基金以追求標的指數報酬為目標，然下列因素可能使本基金報酬偏離標的指數報酬，且偏離方向無法預估：(1)基金可能因應申購或維持一定比例曝險等因素，基金經理人需每日進行投資組合調整而發生之基金交易費用及其他必要費用(如：經理費、保管費、上櫃費、指數授權費等)，可能發生基金追蹤指數表現之偏離風險。(2)為達追求標的指數報酬之目標，本基金需以標的指數成分債券及證券相關商品建構基金整體曝險部位，故基金整體曝險比重、證券相關商品相對於標的指數或成分之單日正逆價差、持有之證券相關商品與現貨之相關性、投資組合成分券價格波動等因素，可能影響基金整體投資組合追蹤標的指數報酬的表現。(3)本基金以新臺幣計價，而所投資標的有價證券可能為新臺幣以外之貨幣計價，於幣別轉換之匯率變化，可能使本基金產生匯率波動風險，造成基金整體投資組合與追蹤標的指數報酬產生偏離風險。街口投信已就可靠資料或來源提供適當之意見與消息，但不保證資料來源之完整性，如有任何遺漏或疏忽，請即通知本公司修正，本公司或關係企業與其任何董事或受僱人，對此不負任何法律責任。

【指數編製公司免責聲明】

「ICE TPEX 1-5年期已開發市場高票息美元非投資等級債券指數 (ICE TPEX 1-5 Year BB-C Developed Market 7+ Coupon US Corporate Constrained Index)」(下稱「指數」)係ICE Data或其關係企業所擁有。「ICE TPEX 1-5 Year BB-C Developed Market 7+ Coupon US Corporate Constrained Index SM/®」為ICE Data或其關係企業之服務商標或商標，該等商標已與指數一併經ICE Data或其關係企業授權予「街口證券投資信託股份有限公司(下稱「街口投信」)」於「街口特選優息非投資等級債券ETF證券投資信託基金」(下稱「本基金」)中使用。但街口投信或本基金均未獲ICE Data、其關聯公司或其第三方供應商(下合稱「ICE Data及其供應商」)之贊助、認可、銷售或推廣。ICE Data及其供應商對於證券投資，尤其本基金之證券投資之合理性、信託或指數追蹤整體市場表現之能力，不作任何聲明或保證。指數過去之表現並不代表或保證未來結果。ICE Data及其供應商不提供任何明示或隱含的保證與聲明，包括關於商品性或適用於特定目的或用途的保證，包含對於指數、指數數據及其中包含、相關或衍生的任何資訊(即「指數數據」)。ICE Data及其供應商對於指數和指數數據的充分性、準確性、及時性或完整性不承擔任何責任或義務，這些資料是以「現況」提供，使用者須自負風險。

街口證券投資信託股份有限公司

105台北市松山區長安東路二段225號C棟9F 電話:(02)2750-5555 客服專線:0800-818-899 網址:<http://www.jkoam.com>