

公告本公司所經理之目標到期債基金 持有俄羅斯受金融制裁債券之處理情形

中華民國 113 年 6 月 11 日

主旨：公告本公司所經理之「大華銀三至六年機動到期先進新興伊斯蘭國家債券證券投資信託基金」、「大華銀四至六年機動到期新興市場優質主權債券基金」及「大華銀四至六年機動到期全球投資等級債券基金」持有俄羅斯受金融制裁債券之處理情形。

公告事項：

- 一、依據 113 年 4 月 10 日金管證投字第 1130381578 號函說明二暨旨揭基金證券投資信託契約（「信託契約」）第 32 條規定辦理公告。
- 二、因俄羅斯與烏克蘭發生軍事衝突及相關國際經濟制裁，致俄羅斯債券被美國 OFAC 限制其交易與交割。截至 2024 年 5 月 31 日止，本公司所經理之目標到期債基金所投資之俄羅斯債券如下：

基金名稱	受制裁債券 ISIN 代碼	基金持有 比重
大華銀大華銀三至六年機動到期先進新興伊斯蘭國家債券證券投資信託基金（本基金有相當比重投資於非投資等級之高	XS1713473608	0.60%

風險債券且配息來源可能為本金)		
大華銀四至六年機動到期新興市場優質主權債券基金(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)	XS2010044381	0.52%
大華銀四至六年機動到期全球投資等級債券基金(本基金有一定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)	XS2010044381	0.58%

三、處理方式:目前受制裁債券評價仍採用信託契約所定義之評價方式進行,若受制裁債券之交易與交割問題於基金信託契約到期日仍未解決,本公司將先行返還截至信託契約到期日止已結算之其餘淨資產價值,就該檔債券將由經理公司基於受益人權益最大保障之原則下,視情形進行該債券相關之處分程序。就相關細節,請以本公司後續公告為準。

四、特此公告。