

2019年理柏台灣基金獎—債券型團體大獎。

投資經理

西方資產管理

基金基本資料 (2022/10/31)

股份發行日	2007/05/08(累積型美元A股份) (1)
計價幣別	美元
投資地區	美國
基金標的	美國公債貨幣市場工具為主
配息頻率	累積型
基金規模	8億5仟1佰萬(美元)
持有股數	48
投資政策	維持基金之價值，並提供與貨幣市場利率一致的報酬表現
註冊國家	愛爾蘭
管理費用	0.800%
波動風險	0.18%(理柏三年期原幣別)，以累積型美元A股份為準 (2)
ISIN號碼	IE00B19Z6R17
彭博代號	LUMMUAA ID
對應指數	FTSE 1-month US Treasury Bill Index
風險等級	RR1 (3)
基金經理人	S. Kenneth Leech/Kevin Kennedy

投資產業(%) (2022/09/30)

機構債	37.40
附買回協議(REPO)	26.07
公債(當地貨幣)	20.97
貼現票據	15.55

債券配置 (2022/09/30)

最低殖利率 (4)	2.99%
平均存續期間	13 days
平均到期年限	60 days
平均債信評等 (5)	AAA

債信評等(%) (2022/09/30)

AAA	100.00
-----	--------

累積報酬率(%) (各幣別，至2022/10/31止，資料來源：理柏)

期間	三個月	六個月	一年	二年	三年	五年	十年	年初至今
台幣別	8.15	9.98	16.58	13.35	6.90	11.06	15.16	17.18
原幣別	0.49	0.60	0.61	0.62	0.99	3.95	4.40	0.61

註：以累積型美元A股份為準。

單年報酬率(%) (原幣別，截至各年度年底，資料來源：理柏)

年度	12	13	14	15	16
報酬率	0.02	0.01	0.01	0.01	0.02
年度	17	18	19	20	21
報酬率	0.50	1.38	1.57	0.20	0.01

註：以累積型美元A股份為準。

主要投資標的(占總資產%) (2022/09/30)

摩根大通銀行(美國 附買回票據) JP Morgan Securities, LLC 2.9700% Mat 10/03/2022	9.13
匯豐銀行(美國 金融) HSBC Bank USA APPROVED B Mat 10/03/2022	7.30
加拿大皇家銀行(附買回票據) Royal Bank of Canada Repo Mat 10/03/2022	6.09
美國公債浮動利率債券(政府債及國庫券) US TREASURY FRN 3.1481% Mat 01/31/2023	5.85
聯邦住宅貸款銀行(美國 機構短期票券) FEDERAL HOME LOAN BANK 2.3000% Mat 11/01/2022	5.11
聯邦住宅貸款銀行(美國 政府機構債) FED HOME LN DISCOUNT NT 0.0000% Mat 10/19/2022	4.74
加拿大帝國商業銀行(附買回票據) Canadian Imperial Bank of 3.0500% Mat 10/03/2022	3.65
美國公債浮動利率債券(政府債及國庫券) US TREASURY FRN 3.1541% Mat 10/31/2022	2.43
聯邦農業信用銀行融資公司(美國 政府機構債) FEDERAL FARM FRN 02/23 3.0100% Mat 02/17/2023	2.43
聯邦住宅貸款銀行(美國 政府機構債) FHLB FRN 01/17/23 2.9700%	2.43

註：投資人申購本基金係持有基金受益憑證，而非本文提及之投資資產或標的。



基金月報下載

### 成立以來投資成長圖 (期初單筆投資一萬元，原幣計價迄2022/10月底，資料來源：理柏)



註：以累積型美元A股份為準。

- (1) 累積型股份是把配息自動轉入當日淨值，不另行發放，即是將配息轉入再投資。
- (2) 波動風險為過去三年月報酬率的年化標準差。
- (3) 考量本基金主要投資於美國貨幣市場標的及參考過去淨值之波動性，其風險報酬為RR1。風險報酬等級為本公司參酌投信投顧公會「基金風險報酬等級分類標準」編製，該分類標準係計算過去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。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、投資標的產業風險、信用風險、利率風險、流動性風險等），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。投資人應充分評估基金的投資風險，相關資料(如年化標準差、Alpha、Beta及Sharp值等可至中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會網站之「基金績效及評估指標查詢專區」([https://www.sitca.org.tw/index\\_pc.aspx](https://www.sitca.org.tw/index_pc.aspx))查詢。
- (4) 乃到期殖利率有考量債券被提前償還情境時之水準，基金持債殖利率不代表基金報酬率或配息率。
- (5) 資料來源：富蘭克林坦伯頓基金集團，平均債信評等乃依據各持債市值，以簡單加權平均計算投資組合的債信品質。各持債引用不同債信評等機構(標準普爾、穆迪及惠譽)之評等。若三家均有評等取中間級；若兩家有評等取最低級；若只有一家有評等則取該評級；而若均未賦予評級則列入未評等類別。納入計算之資產項目包含債券以及信用型的衍生性金融商品部位。信用評等由AAA(最高級)~D(最低級)。整體信用評等水準愈低，顯示投資組合之債信風險愈高。  
 本基金經金融監督管理委員會核准或申報生效在國內募集及銷售，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。  
 本文提及之經濟走勢預測，不必然代表基金之績效，投資基金所應承擔之相關風險及應負擔之費用(含分銷費用)已揭露於基金公開說明書及投資人須知中，投資人可至境外基金資訊觀測站(<https://www.fundclear.com.tw>)下載，或逕向本公司網站(<https://www.Franklin.com.tw>)查閱。  
 基金過去績效不代表未來績效之保證。  
 獎項資料來源：2019理柏台灣基金獎債券型團體大獎是依據截至2018年12月31日止，過去三年風險調整後的績效所評定。基金過去績效不代表未來績效之保證。  
 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。

富蘭克林證券投資顧問(股)公司 101年金管投顧新字第025號 | 富蘭克林證券投顧獨立經營管理 106台北市大安區忠孝東路四段87號8樓  
 電話:(02)2781-0088 傳真:(02)2781-7788 僅供銷售機構或簽約壽險公司內部使用