

歐義銳榮日本債券基金

晨星基金評等(台灣)：★★ 晨星基金組別：日圓債券 基準指標：JPM Japan Government Bond in euro

投資策略及目標

此檔基金主要投資於貨幣市場證券、政府或高評等私人機構所發行之日圓計價債券。資產組合之平均存續期間介於4到8年。本基金的主要投資目標，是尋找中長期的資本增值，使資產配置維持相對於指數中立的貝塔值，並承擔一定程度的主動風險。其資產佈局與日本政府證券相連動的部位，將會依照總體經濟訊號、政府財政狀態、及各標的間的相對價值做評估。

基本資料

計價幣別	歐元
基金規模	2億7100萬歐元
R股每股淨值	102.12 歐元
基金成立日期	1998 年 10 月20 日
基金經理人	Luigi Fallanca
有效存續期間	7.90
平均債信評級	AA-

績效表現(R股)

資料時間：2012/06/30 資料來源：Lipper，原幣別

近三月	近半年	近一年	近兩年	近三年	年初至今
-9.50%	-11.52%	-23.68%	-9.23%	-16.98%	-11.52%

R股統計數據(3年)

阿法	-1.73%	年化標準差	13.85%
貝塔	0.97	追蹤誤差波動度	2.45%
夏普值	-0.43	資訊比率	-0.66

基金核准銷售國家

智利(I,IH,R,RH,Z,ZH)	葡萄牙(R,RH)
匈牙利(R)	西班牙 (R)
義大利(R,RH,Z,ZH)	台灣 (R,RH,Z,ZH)
盧森堡(I,IH,R,RH,Z,ZH)	

信評等級	%比重	信評等級	%比重	前十大持股	%比重
AA	81.82	BBB	17.94	Japan GV#10 1,1% 3/33	3.83
A	0.29	其他	-0.03	Jgb 1.6 06/20/32	3.37
				Japan 1.3% 03/20	3.22
				Japan GV#33 2% 9/40	3.11
				Japan 1.4% 12/22	2.94
				Japan Govt 1.3% 12/19	2.73
				Japan Govt 0.8% 6/23	2.54
				Jgb 1.8% 09/31	2.53
				Japan GV#90 2.2% 9/26	2.49
				Japan 2% 03/27	2.46
				前十大持股比例	29.22
				總持股數	59

幣別比重	%比重	債種比重	%比重
日圓	100.01	政府債	98.02
歐元	-0.1	公司債	2.04

基金代碼(R股)

ISIN	LU0090978643
Bloomberg	SPBJYEN LX
Fitzrovia	19620
Lipper	60018321
Reuters	LU0090978643.LUF
Telekurs	949196