

駿利亨德森資產管理基金(Janus Henderson Capital Funds plc)
駿利亨德森美國短期債券基金 (Janus Henderson US Short -Term Bond Fund)

投資人須知【第一部分：基金專屬資訊】 刊印日期：2021年1月29日

- (一)投資人申購前應詳閱投資人須知(包括第一部分及第二部分)與基金公開說明書中譯本。
 (二)境外基金係依外國法令募集與發行，其公開說明書、財務報告、年報及績效等相關事項，均係依該外國法令規定辦理，投資人應自行了解判斷。

| 壹、基本資料 | | | |
|----------------|--|----------|--|
| 基金中英文名稱 | 駿利亨德森美國短期債券基金 (Janus Henderson US Short -Term Bond Fund) | 成立日期 | 1998年12月24日 |
| 基金發行機構 | 駿利亨德森資產管理基金 | 基金型態 | 開放式公司型 |
| 基金註冊地 | 愛爾蘭 | 基金種類 | 開放型投資基金／債券型 |
| 基金管理機構 | 亨德森管理公司 (Henderson Management S.A.) | 國內銷售基金級別 | A2美元、A1月配美元、A2歐元避險、B2美元、B1月配美元、I1月配美元、I2歐元避險 |
| 基金管理機構註冊地 | 盧森堡 | 計價幣別 | 美元、歐元 |
| 總代理人 | 駿利亨德森證券投資顧問股份有限公司 | 基金規模 | 289.56百萬美元(2020年12月31日) |
| 基金保管機構 | J.P. Morgan Bank (Ireland) PLC | 國人投資比重 | 1.34%(2020年12月31日) |
| 基金總分銷機構 | 駿利資產管理國際有限公司 | 其他相關機構 | 副投資顧問機構： 駿利資產管理有限公司 (Janus Capital Management LLC) |
| 收益分配 | 月配息；A1月配美元、B1月配美元、I1月配美元 | 基金保證機構 | 無；本基金非保證型基金 |
| 績效指標 benchmark | 彭博巴克萊1-3年期美國政府/信用指數 (Bloomberg Barclays 1-3 Year US Government/Credit Index) | 保證相關重要資訊 | 無；本基金非保證型基金 |

貳、基金投資標的與策略(簡介) (詳細資訊請參見公開說明書中譯文「基金投資目標和政策」一節說明)

一、投資標的：本基金的投資目標是在適於保護資本的情況下盡量尋求高額本期收入。本基金將至少 80% 之淨資產價值投資於美國發行人的短期和中期債權證券。本基金於開發中市場所交易證券的投資總額不得超過該基金淨資產價值的 10%。本基金雖未預設品質標準，但至少 70% 之淨資產價值將投資於投資級的債權證券。預計本基金投資組合的美元加權平均有效償還期將不超過三年。

二、投資策略：本基金參考彭博巴克萊 1-3 年美國政府/信用指數，採主動式管理，績效目標：超越彭博巴克萊 1-3 年美國政府/信用指數(Bloomberg Barclays 1-3 Year US Government/Credit Index)之績效，目標是任五年期間內扣除費用前每年超出 0.75%。本基金得基於投資之目的運用投資技巧及投資工具，例如期貨、選擇權和交換契約，以及其他衍生性金融商品交易；惟須受淨資產價值 10% 之最高投資比重限制，並須符合央行所隨時規定之條件及限制。副投資顧問的前瞻性基本面信用研究設法找出未來的贏家與輸家，以表達其高度確定性的看法。由下而上以基本面主導的投資流程，著重在致力於轉型及改善資產負債表、自由現金流量之創造、經營品質及證券評價之公司，此投資流程是選擇證券的重要依據。此策略背後的信念是部分公司體質健全，與業界同儕相比前景更佳，故即使在充滿挑戰的產業與經濟情勢下，應仍有超越同業的表現。由上而下的動態架構使副投資顧問得以評估信用週期的階段、找出機會及承擔適量的風險。

參、投資本基金之主要風險 (詳請參見公開說明書中譯文「風險因素和特別考慮因素」一節相關風險說明)

本基金風險因素和其他特別考慮因素可能為：投資證券之風險、高收益證券、流動性風險、衍生性金融商品之風險、利率風險和信用風險。本基金未受存款保險或保險安定基金之保障，本基金投資一定有風險，最大可能損失為全部本金，本基金亦涉及匯率風險。

肆、本基金適合之投資人屬性分析

本基金為債券型基金，主要投資於美國投資等級債券，因美國為已開發單一國家，故風險報酬等級為「RR2」（採中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會基金風險報酬等級分類）。更多資訊請參閱本投資人須知第二部份：一般資訊【註一】中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會基金風險報酬等級分類標準。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。

伍、基金運用狀況

一、基金淨資產組成：

1. 依投資類別：資料日期：2020年12月31日

| 類別 | 比重% |
|--------------------|-------|
| 投資等級信貸 | 35.46 |
| 政府債券 | 29.73 |
| 高收益 | 15.94 |
| 資產抵押證券 (ABS) | 6.41 |
| 期貨 | 2.96 |
| 抵押擔保義務 | 2.90 |
| 銀行貸款 | 2.74 |
| 不動產抵押貸款證券 | 1.94 |
| 商用不動產抵押貸款證券 (CMBS) | 1.42 |
| 政府相關 | 0.19 |
| 非美國抵押證券 | 0.10 |
| 期貨賣空 | -0.63 |
| 現金/與現金相等值 | 0.84 |

2. 依投資國家或區域：資料日期：2020年12月31日

| 投資區域 | 比重% |
|------|-------|
| 美國 | 91.76 |
| 法國 | 2.59 |
| 瑞士 | 1.46 |
| 加拿大 | 1.35 |
| 英國 | 1.15 |
| 日本 | 0.32 |
| 愛爾蘭 | 0.20 |
| 盧森堡 | 0.14 |
| 南非 | 0.10 |
| 波蘭 | 0.09 |

3. 依投資標的信評：資料日期：2020年12月31日

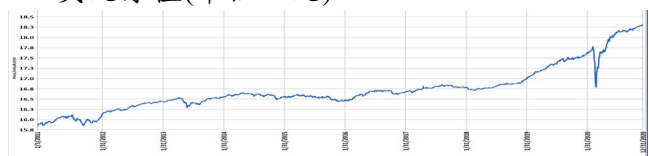
| 信評等級 | 比重% |
|------|-------|
| Aaa | 34.81 |
| Aa | 0.77 |
| A | 8.39 |
| Baa | 32.94 |
| Ba | 14.83 |
| B | 3.41 |
| 未評等 | 4.01 |

二、最近十年度基金淨值走勢圖：

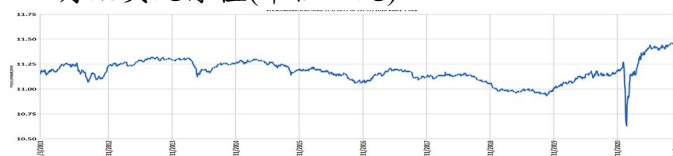
資料日期：2020年12月31日

(僅列示主要銷售級別，投資人得向總代理人要求提供未揭示之在臺銷售級別資訊)

A2 美元淨值(單位：元)



A1 月配美元淨值(單位：元)



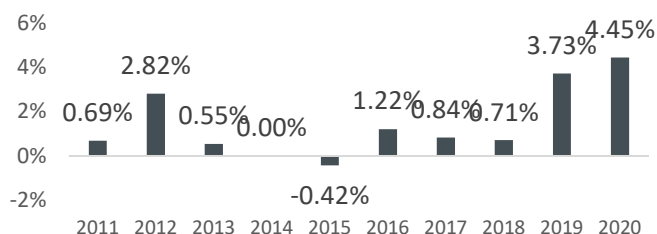
三、最近十年度各年度基金報酬率：

資料日期：2020年12月31日

(僅列示主要銷售級別，投資人得向總代理人要求提供未揭示之在臺銷售級別資訊)

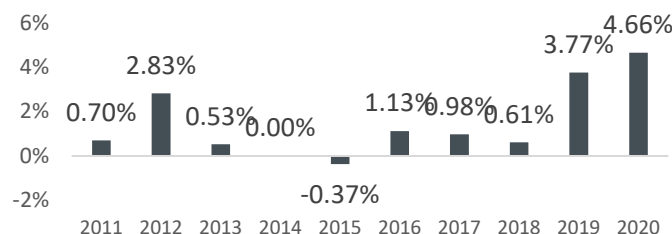
A2 美元

報酬率(%)



A1 月配美元報酬率(%)

報酬率(%)



註：資料來源：Lipper 1.年度基金報酬率：指本基金淨資產價值，以1~12月完整曆年期間計算，加計收益分配後之累計報酬率。2.收益分配均假設再投資於本基金。

四、基金累計報酬率：(僅列示主要銷售級別，投資人得向總代理人要求提供未揭示之在臺銷售級別資訊)

資料日期：2020年12月31日

| 期間 | 主要銷售級別 | 最近三個月 | 最近六個月 | 最近一年 | 最近三年 | 最近五年 | 最近十年 | 基金成立日*起算至資料日期日止 |
|-------|---------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-----------------|
| 累計報酬率 | A2 美元 | 0.88% | 1.55% | 4.45% | 9.11% | 11.37% | 15.44% | 83.20% |
| | A1 月配美元 | 0.88% | 1.73% | 4.66% | 9.27% | 11.58% | 15.72% | 82.55% |

註：資料來源：Lipper。1. 累計報酬率：指至資料日期日止，本基金淨資產價值最近三個月、六個月、一年、三年、五年、十年及自基金成立日起算，加計收益分配之累計報酬率。2. 收益分配均假設再投資於本基金。*本基金 A2 美元與 A1 月配美元皆成立於 1998 年 12 月 24 日。

五、最近十年度各年度每受益權單位收益分配之金額/幣別：(在臺銷售之所有分配收益級別分別列示)

| 級別/幣別 (配息) | 年度 | 100 | 101 | 102 | 103 | 104 | 105 | 106 | 107 | 108 | 109 |
|---------------|-----------------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|----------|----------|
| A1 月配美元 | 收益分配 金額(元/ 單位受 益權) | 0.11838 | 0.13304 | 0.11921 | 0.07033 | 0.05905 | 0.08485 | 0.13832 | 0.19651 | 0.209109 | 0.15978 |
| B1 月配美元 | | 0.03992 | 0.05524 | 0.04571 | 0.00238 | 0.00013 | 0.00000 | 0.01926 | 0.07037 | 0.082114 | 0.028913 |
| I1 月配美元 | | 0.17443 | 0.18786 | 0.17809 | 0.12953 | 0.11513 | 0.11725 | 0.16078 | 0.21893 | 0.231653 | 0.186763 |

六、最近五年度各年度基金之費用率：(在臺銷售之所有級別分別列示)

| 年度 | 級別/幣別(配息) | 105 | 106 | 107 | 108 | 109 |
|----------|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 費用率 % | A2 美元 | 1.04% | 0.94% | 0.95% | 0.90% | 0.87% |
| | A1 月配美元 | 1.04% | 0.93% | 0.95% | 0.92% | 0.87% |
| | A2 歐元避險 | 1.03% | 0.93% | 0.95% | 0.93% | 0.85% |
| | B2 美元 | 2.10% | 2.10% | 2.10% | 2.10% | 2.10% |
| | B1 月配美元 | 2.10% | 2.10% | 2.10% | 2.10% | 2.10% |
| | I1 月配美元 | 0.76% | 0.74% | 0.75% | 0.73% | 0.61% |
| | I2 歐元避險 | 0.75% | 0.73% | 0.75% | 0.70% | 0.62% |

註：費用率：指由基金資產負擔之費用占平均基金淨資產價值之比率。(如：交易直接成本—手續費、交易稅；會計帳列之費用—經理費、保管費、保證費及其他費用等)

七、基金前十大投資標的及占基金淨資產價值之比率

資料日期：2020 年 12 月 31 日

| 投資標的名稱 | | 票面利率 | 到期日 | 比重% | 投資標的名稱 | | 票面利率 | 到期日 | 比重% |
|--------|----------------------------------|-------|----------|------|--------|----------------------------------|-------|---------|------|
| 1 | United States Treasury Note/Bond | 1.75 | 7/15/22 | 5.07 | 6 | Fannie Mae or Freddie Mac | 2.00 | 2/11/21 | 1.94 |
| 2 | United States Treasury Note/Bond | 1.75 | 6/15/22 | 4.64 | 7 | United States Treasury Note/Bond | 1.75 | 7/31/21 | 1.85 |
| 3 | United States Treasury Note/Bond | 2.25 | 3/31/21 | 3.39 | 8 | United States Treasury Note/Bond | 0.375 | 4/30/25 | 1.69 |
| 4 | United States Treasury Note/Bond | 2.625 | 12/15/21 | 3.17 | 9 | United States Treasury Note/Bond | 2.75 | 8/15/21 | 1.58 |
| 5 | United States Treasury Note/Bond | 1.75 | 11/30/21 | 2.98 | 10 | United States Treasury Note/Bond | 0.25 | 4/15/23 | 1.51 |

陸、投資人應負擔費用之項目及其計算方式(詳細資訊請參見公開說明書中譯文「收費和費用」一節說明)

| 項目 | 計算方式或金額 | | | | | | | | | | | | | | |
|-----------------------|---------------|---|---------------|------|--------|----|--------------|----|--------------|----|--------------|----|-----------|----|---|
| | A 級別 | B 級別 | I 級別 | | | | | | | | | | | | |
| 投資管理費(經理費)* | 最高 0.50% | 最高 0.65% | 最高 0.50% | | | | | | | | | | | | |
| 初次銷售費(申購手續費) | 申購金額之最高 5.00% | 無 | 申購金額之最高 2.00% | | | | | | | | | | | | |
| 股份交易費(或有遞延銷售手續費 CDSC) | 無 | 下表百分比乘以原始購入成本與贖回日每股淨值兩者中之較低者**： <table border="1" style="margin-left: 20px;"> <thead> <tr> <th>購買後所經過之年數</th> <th>CDSC</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>不滿 1 年</td> <td>4%</td> </tr> <tr> <td>滿 1 年但不滿 2 年</td> <td>3%</td> </tr> <tr> <td>滿 2 年但不滿 3 年</td> <td>2%</td> </tr> <tr> <td>滿 3 年但不滿 4 年</td> <td>1%</td> </tr> <tr> <td>已滿 4 年及以上</td> <td>0%</td> </tr> </tbody> </table> | 購買後所經過之年數 | CDSC | 不滿 1 年 | 4% | 滿 1 年但不滿 2 年 | 3% | 滿 2 年但不滿 3 年 | 2% | 滿 3 年但不滿 4 年 | 1% | 已滿 4 年及以上 | 0% | 無 |
| 購買後所經過之年數 | CDSC | | | | | | | | | | | | | | |
| 不滿 1 年 | 4% | | | | | | | | | | | | | | |
| 滿 1 年但不滿 2 年 | 3% | | | | | | | | | | | | | | |
| 滿 2 年但不滿 3 年 | 2% | | | | | | | | | | | | | | |
| 滿 3 年但不滿 4 年 | 1% | | | | | | | | | | | | | | |
| 已滿 4 年及以上 | 0% | | | | | | | | | | | | | | |
| 分銷費* | 無 | 至多 1.00% | 無 | | | | | | | | | | | | |
| 股東服務費* | 最高 0.20% | 最高 0.50% | 無 | | | | | | | | | | | | |

