

鋒裕匯理基金新興市場當地貨幣債券 (基金之配息來源可能為本金)

月報

29/02/2024

債券型 ■ 境外基金

基金資訊

每單位資產淨值：74.66 (美元)

ISIN 號碼：LU1882459784

彭博代號：AELCAUC LX

基金規模：812.83 (百萬美元)

股別成立時間：09/12/2009

績效指標：100% JP MORGAN GBI-EM GLOBAL DIVERSIFIED 指數

管理費率：最高 1.35%

成立至今表現走勢(以100為基點)



其他資訊

風險收益等級：RR3

計價幣別：美元、歐元

投資目標

本子基金致力於在中、長期內締造資本增值的績效與提供收益。我們建立多元化的投資組合，主要投資於新興市場國家發行且以當地貨幣計價的債務與債務相關工具，或其他國家發行但信用風險與新興市場連動的債務工具。如發行者為其他國家之政府或公司，且以可自由兌換的貨幣計價，則此類債務與債務相關工具，亦可能成為本子基金之標的。

累積績效

	年初至今 29/12/2023	3個月 30/11/2023	6個月 31/08/2023	1年 28/02/2023	2年 28/02/2022	3年 26/02/2021	成立以來 09/12/2009
基金	-2.42%	1.26%	1.81%	8.79%	-1.28%	-10.18%	0.76%

年度績效

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
基金	12.27%	-12.48%	-9.34%	2.52%	12.19%	-7.95%	14.41%	9.80%	-14.98%	-6.49%

前十大債券標的(投資人申購本基金係持有本基金受益憑證，而非本文提及之投資資產或標的。)

SAGB 8.25% 3/32	2.81%
MGS 3.757% 05/40 0519	2.66%
CZGB 2.5% 8/28	2.61%
CZGB 0.25% 2/27	2.12%
MGS 3.844% 4/33	1.98%
COLTES 7% 6/32	1.78%
ROMGB 5% 02/29 10Y	1.76%
COLTES 6% 4/28	1.75%
BRAZIL NTN-F 10% 1/25	1.74%
BRAZIL NTN-F 10% 01/27	1.74%

風險指標

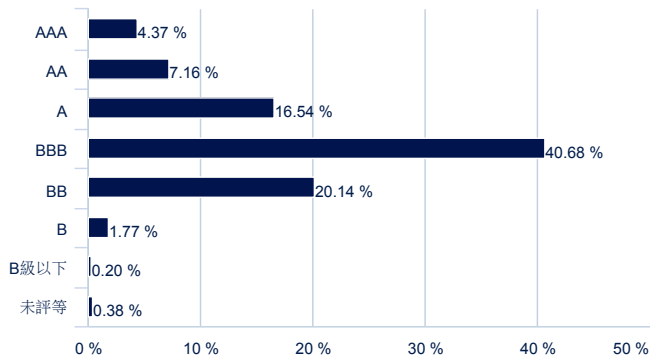
	1年	2年	3年
年化標準差	11.00%	12.94%	11.39%
年化夏普值	0.31	-0.35	-0.55

主要銷售級別資訊

	A 美元	A 美元 (月配息)	A USD MTD3 (D)	T USD MTD3 (D)	U 美元 (月配息)	U USD MTD3 (D)	B USD MTD3 (D)
計價貨幣	美元	美元	美元	美元	美元	美元	美元
銷售級別	累積級別	月配級別	月配級別	月配級別	月配級別	月配級別	月配級別
每單位淨值	74.66	27.56	19.45	18.31	29.37	18.3	18.17
ISIN號碼	LU1882459784	LU1882460014	LU1882459941	LU1882462069	LU1882462499	LU1882462226	LU1882460105
彭博代號	AELCAUC LX	AELAUMG LX	AEAUMD3 LX	AETUMD3 LX	AELUUMD LX	AEUUMD3 LX	AEBUMD3 LX

債券型 ■ 境外基金

信評分布

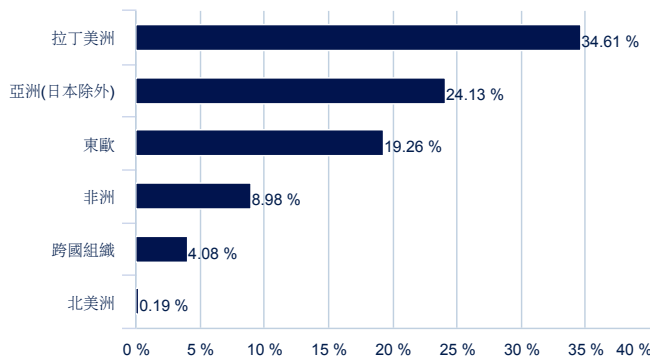


*包括信用與總報酬交換合約，根據現金債券、信用違約交換與總報酬交換合約，但不納入其他衍生性商品。評等中位數來自於三大評等機構：惠譽、穆迪、標準普爾。

基金統計數據

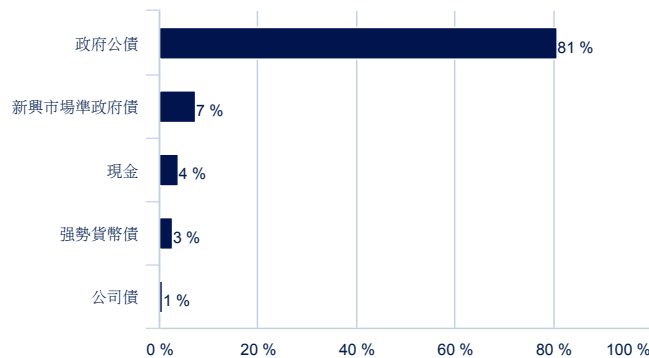
項目	基金
殖利率	6.84 %
修正存續期間	5.90
總持有檔數	160
持有發行機構數	50

國家分布



*未反映實際部位總和可能不等於100%(包括衍生性商品與現金)。

資產分布



*未反映實際部位總和可能不等於100%(包括衍生性商品與現金)。

資料來源

成立至今績效走勢、累積績效、年度績效及風險指標均來自Lipper，美元計價，鋒裕匯理基金新興市場當地貨幣債券 (基金之配息來源可能為本金)；其他資料來自於Amundi Asset Management。資料日期：2024年02月29日。本月報基金投資組合包含衍生性商品或信用違約交換等各類資產，總和可能不等於100%。

本基金風險報酬等級係計算過去5年基金淨值波動度，以標準差區間予以分類等級，並與同類型基金比較，另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，決定風險報酬等級為RR3。以上評估係考量基金主要投資市場、策略，亦考量該基金註冊地採用之SRRI。本基金之SRRI為5、風險等級為RR3，相除為1.67，倍數在2以下，係屬合理範圍，故本次維持前一季之RR等級。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)查詢。

警語

鋒裕匯理證券投資信託股份有限公司 | 台北市信義路5段7號台北101大樓32樓之一 | 總機：+886 2 8101 0696
 基金經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。有關基金應負擔之費用(含分銷費用)已揭露於基金公開說明書及投資人須知，本公司及銷售機構均備有基金公開說明書(或中譯本)或投資人須知，投資人亦可至境外基金資訊觀測站(www.fundclear.com.tw)中查詢。本文提及之經濟走勢預測不必然代表基金之績效，基金投資風險請詳閱公開說明書。基金的配息可能由基金的收益或本金中支付。任何涉及由本金支出的部份，可能導致原始投資金額減損。基金配息率不代表基金報酬率，且過去配息率不代表未來配息率；基金淨值可能因市場因素而上下波動。基金進行配息前，未先扣除行政管理相關費用。基金配息前未先扣除應負擔之相關費用，最近12個月內由本金支付配息之相關資料，投資人可向總代理人查詢；會參考本公司網站(<https://www.amundi.com.tw>)。配息資料來源：Amundi Asset Management, Lipper, 原幣計價。基金投資涉及投資新興市場部份，因其波動性與風險程度可能較高，且其政治與經濟情勢穩定度可能低於已開發國家，也可能使資產價值受不同程度之影響。依中華民國相關法令及金管會規定，基金直接投資大陸地區有價證券僅限掛牌上市有價證券及銀行間債券市場，且不得超過該基金淨資產價值20%，故基金非完全投資在大陸地區有價證券，另投資人亦須留意中國市場特定政治、經濟與市場等投資風險。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。基金不適合無法承擔相關風險之投資人，投資人投資非投資等級債券基金不宜占其投資組合過高之比重。惟新興市場與非投資等級債市仍會因市場干擾而波動，投資人須個人風險承受度衡量相關商品比重。可轉換公司債具有股價雙重特性，因此，投資人需同時考量股價雙重風險，包括市場風險、利率風險、流動性風險、股價波動風險、匯率風險、信用或違約風險等。B、U、T級別受益權單位銷售時不須銷售費用(手續費)，然受益人依其持有期間內買回受益權單位有遞延銷售費且係自買回款項中扣除。遞延銷售費用係依擬買回單位之現行市價及申購價格，兩者較低者計算。手續費雖可遞延收取，惟每年仍需支付1%的分銷費，可能造成實際負擔費用增加。依公開說明書規定，分銷費係按月累計，以相關子基金之相關級別日平均淨資產價值為計算基準，每年最高1%。過去績效並不保證未來表現。除非另行指明，則本文件所含資訊均得自Amundi Asset Management，或本文件內所有評論純為Amundi Asset Management之意見。所有意見均可能隨時因市場或其他狀況而變更，且無法保證國家、市場或產業之預期表現。本文件並非基金公開說明書，亦不構成買賣基金單位或服務之要約或請求，凡於任何管轄地區向任何對象提出前述要約或請求，若提出該要約及請求之人士或其對象不符法定資格，均屬違法行為。基金風險報酬等級係計算過去5年基金淨值波動度，以標準差區間予以分類等級，並與同類型基金比較，另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。鋒裕匯理證券投資信託股份有限公司為鋒裕匯理基金在臺灣之總代理及投資顧問。鋒裕匯理證券投資信託股份有限公司為Amundi Group之成員【鋒裕匯理證券投資信託股份有限公司獨立經營管理】