

摩根基金-環球策略債券基金 基金級別-A股 (本基金有相當比重投資於非投資等級之 高風險債券且配息來源可能為本金)



風險報酬等級：中(RR3)¹⁾

2021年02月28日

產品特色

- 1 多元分散·動態配置：全球視角布局多元債券·因應債市環境變化·靈活調整投資配置·兼顧收益與機會。
- 2 彈性管理利率敏感度：彈性管理債券利率敏感度·存續期間可達0-9年·管控債券價格波動風險。

累積表現(%)

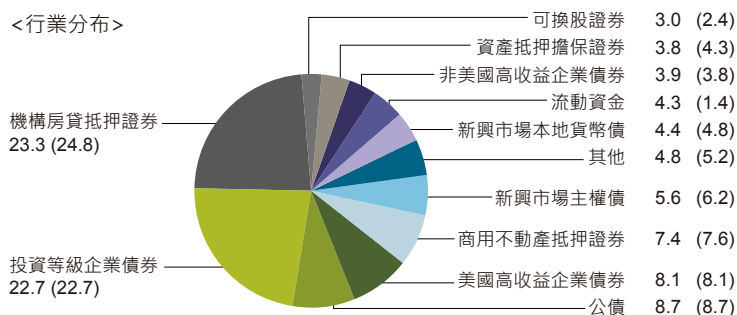
	三個月	六個月	一年	二年	三年	五年	成立至今	成立日期
美元累計perf	0.6	2.3	4.2	8.5	8.8	18.1	34.8	2010.06.03
美元每月派息perf	0.6	2.3	4.2	8.4	8.7	18.1	23.6	2012.06.11
美元累計	0.7	2.5	4.5	8.7	8.6	18.1	15.6	2015.07.06
美元每月派息	0.7	2.5	4.5	8.7	8.6	18.2	15.6	2015.07.06

年度表現(%)

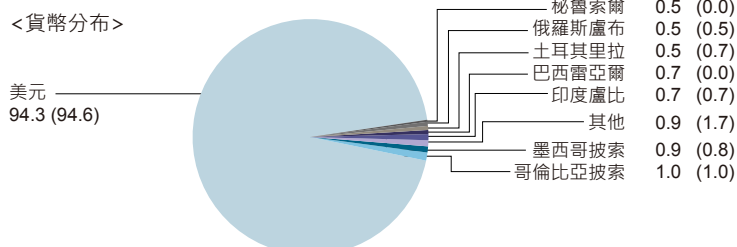
	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	年初至今
美元累計perf	1.2	5.7	2.2	0.8	-0.8	4.0	3.2	-1.8	6.1	5.2	-0.4
美元每月派息perf	-	-	1.5	0.8	-0.8	4.0	3.2	-1.8	6.1	5.2	-0.4
美元累計	-	-	-	-	-	4.1	3.2	-2.1	6.0	5.6	-0.4
美元每月派息	-	-	-	-	-	4.1	3.3	-2.1	6.0	5.6	-0.4

投資組合分析(%) (括弧內為上月數據)

<行業分布>



<貨幣分布>



所有資料截至每月之最後計值日(特別列明除外),最新資訊可至摩根資產管理官方網站(<https://www.jpmorgan.com/tw/am/>)查詢。以上資料來源:摩根投信;債券評級來源:穆迪、標準普爾及惠譽;另累積表現、年度表現、統計分析之數據,資料來源皆為Lipper(以原幣資產淨值價計,收益再撥作投資)。本基金A(perf)得收取績效費,收取標準及計算方式請詳見本公司之境外基金投資人須知附錄。1)本基金主要投資於全球債券及貨幣市場,屬於債券型基金,故本基金風險報酬等級為RR3。有關本基金風險報酬等級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,投資人仍應注意基金個別風險,斟酌個人之風險承擔能力及資金可運用期間之長短後辦理投資。本基金之主要風險包括信用風險及市場風險等,請詳閱基金公開說明書及投資人須知所載之主要風險資訊。2)實質存續期間較存續期間能準確衡量基金對10年期美國公債殖利率的敏感度。註:本基金(每月派息/每月派息perf)配息前未扣除應負擔之相關費用。

摩根證券投資信託股份有限公司 服務專線:0800-045-333 地址:台北市信義區松智路1號20樓《僅供台灣投資人使用》

【摩根投信 獨立經營管理】「摩根」為 J.P. Morgan Asset Management 於台灣事業體之行銷名稱。摩根所作任何投資意見與市場分析結果,係依據資料製作當時情況進行判斷,惟可能因市場變化而更動,投資標的之價格與收益亦將隨時變動。境外基金經金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,亦不必然為未來績效表現;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。本文提及之經濟走勢預測不必然代表本基金之績效,本基金投資風險請詳閱基金公開說明書。此外,匯率走勢亦可能影響所投資之海外資產而使資產價值變動。另,內容如涉新興市場之部分,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亦可低於已開發國家,而使資產價值受不同程度影響,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(境外基金含分銷費用)已揭露於基金之公開說明書或投資人須知,本公司及銷售機構均備有公開說明書(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查詢。基金到期收益率不代表基金報酬率。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。本基金配息前未先扣除應負擔之相關費用。投資人可至摩根資產管理官方網站(<https://www.jpmorgan.com/tw/am/>)查詢本基金配息組成項目。由於高收益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,故以高收益債券為訴求之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。高收益債券基金不適合無法承擔相關風險之投資人,投資人投資以高收益債券為訴求之基金不宜佔其投資組合過高之比重。

基金資料

基金經理人	Bob Michele/Iain Stealey/Lisa Coleman/ Andrew Headley/Diana Kiluta Amoa/Jeff Hutz			
投資目標	透過發掘債券及貨幣市場等投資機會,並於適當時運用衍生性商品,以期獲得超過指標之報酬。			
基金規模	2,294.0百萬元(美元)			
報價貨幣及單位資產淨值				
美元累計perf / 美元每月派息perf	134.82美元 / 87.50美元			
美元累計 / 美元每月派息	115.58美元 / 94.67美元			
經理費	A(perf) 1.00% / A 1.20%(以資產淨值計)			
廣告申購手續費	3.00%			
Bloomberg Ticker				
美元累計perf / 美元每月派息perf	JPGSBAU LX / JPGSBAD LX			
美元累計 / 美元每月派息	JPMGSAA LX / JPMGSAI LX			
註冊地/信託保管機構	盧森堡 / 摩根銀行			
年化標準差(%)				
美元累計perf	三年	3.08	五年	2.59
美元每月派息perf	三年	3.08	五年	2.59
美元累計	三年	3.21	五年	2.71
美元每月派息	三年	3.21	五年	2.70
存續期間(年)	2.9			
實質存續期間(年) ²⁾	0.74			
到期收益率(%)	2.3			
信評分布(%)	AAA:37.1 / AA:3.0 / A:11.1 / BBB:22.6 / <BBB:18.6 / 未評級:3.3 / 流動資金:4.3			
上次配息及基準日				
美元每月派息perf / 美元每月派息	0.187美元 / 0.202美元(2021.03.08)			

基金主要持股

公司	百分比
Government of Australia 5.5% 21/04/23	6.4
Government National Mortgage Association 2.5% 20/11/50	1.8
Government of Italy 1.65% 01/12/30	1.0
FNMA 2% 01/02/36	1.0
FHLM 3% 01/04/33	0.7
FNMA 4% 01/04/59	0.6
Government of Italy 1.35% 01/04/30	0.6
FNMA 3.5% 01/05/58	0.5
Government of Italy 1.8% 01/03/41	0.5
BX Trust 0.783% 15/03/37	0.5