

法盛盧米斯賽勒斯新興市場債券基金 R/D (美元)

(本基金有相當比重投資於非投資等級之高風險債券)

2019年10月

類股：R/D (USD)

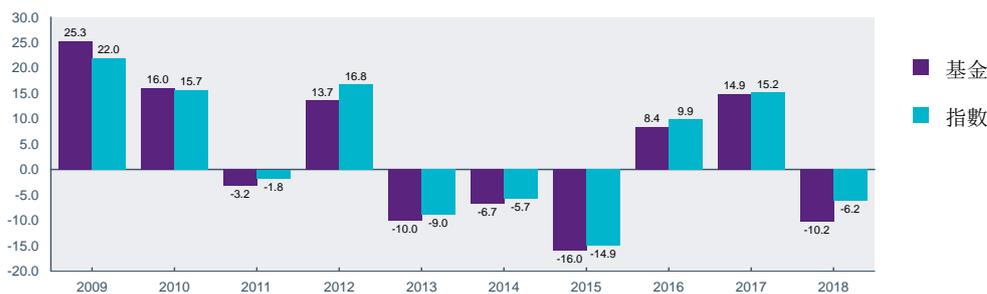
基金近況說明

- 主要投資全球新興市場政府、企業所發行之債券與其他固定收益商品。
- 遵循價值原則。
- 吸納原設計市場不同年期債券，充分展現債券基金特色。
- 運用盧米斯賽勒斯新興市場主權債研究資源進行由上而下債市配置，同時發揮其公司債專長，精準掌握公司債投資機會

每10,000 元的投資報酬 (USD) *



會計年度報酬率 %



總報酬 (月底)

| 總報酬 (月底) | 基金 % |
|----------|-------|
| 3 個月 | -2.90 |
| 6 個月 | 3.35 |
| 年初迄今 | 6.26 |
| 1 年 | 10.48 |
| 2 年 | -0.99 |
| 3 年 | 3.80 |
| 5 年 | -6.93 |
| 10 年 | 9.16 |
| 自發行日起算 | 34.31 |

風險衡量指標

| 風險衡量指標 | 3 年 | 5 年 | 10 年 |
|---------|-------|-------|-------|
| Alpha係數 | -3.20 | -2.22 | -1.73 |
| Beta係數 | 1.07 | 1.02 | 1.00 |
| R 平方值 | 0.98 | 0.98 | 0.98 |
| 夏普指數 | -0.06 | -0.24 | 0.00 |
| 基金標準差 | 10.91 | 11.34 | 11.51 |
| 指數標準差 | 10.10 | 11.06 | 11.43 |
| 資訊比率 | -1.82 | -1.50 | -1.17 |
| 追蹤誤差 | 1.69 | 1.50 | 1.53 |

資金概述

投資目標

配息收益與資本增值雙管齊下，提高總報酬

參考指數

JPMorgan GBI - Em Mkts Global Diversified Index TR USD

Morningstar 評級™

★★★ | 31/10/2019

Morningstar 類別™

全球新興市場當地幣別債券基金 (Global Em Mkts Bd - Local Ccy)

基金特性

| | |
|--------|--|
| 基金架構 | SICAV子基金 |
| 類股發行日 | 08/04/2011 |
| 計價週期 | 每個盧森堡交易日 |
| 保管銀行 | Brown Brothers Harriman (Lux) S. C. A. |
| 幣別 | USD |
| 截止時間 | 中歐時間當日13:30 |
| 基金規模 | USDm 0.32 |
| 建議投資期間 | 3年以上 |
| 投資人類別 | 一般投資人 |

本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；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。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中，投資人可至公開資訊觀測站或境外基金資訊觀測站中查詢。各銷售機構備有基金公開說明書（或中譯本）及投資人須知，歡迎索取。投資涉及新興市場部份，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。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。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。由於高收益債券之信用評等未達投資等級或未經驗信用評等，且對利率變動的敏感度甚高，故本基金可能會因利率上升、市場波動下降，或債券發行機構違約不支付本金、利息或破產而蒙受虧損。本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占其投資組合過高之比重。本基金可投資於美國Rule 144A債券，該債券屬私募性質，較可能發生流動性不足、財務資訊揭露不完整或因價格不透明導致波動性較大之風險。投資人申購前應詳閱基金公開說明書。中國信託投信 獨立經營管理。

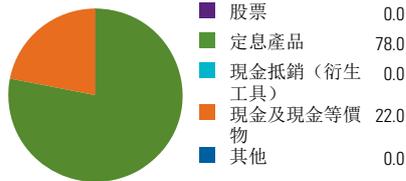
資料來源：績效資料來自Morningstar，其餘資料來自法盛投資管理公司，資料日期為此月報月份之該月底（月報月份揭露於本頁左上角）。

基金該類股從 27/09/2006 到 07/04/2011 無任何庫存無交易活動。

Loomis Sayles Emerging Debt & Currencies Fund

31/10/2019日為止之投資組合

資產配置



前10大持股

| 基金 | 基金 % |
|--------------------------------|------|
| TITULOS DE 7.5% 08/26/26/COP/ | 5.6 |
| INDONESIA 8.125% 05/15/24/IDR/ | 4.9 |
| INDONESIA 8.375% 03/15/34/IDR/ | 4.9 |
| RUSSIA GOV 8.15% 02/03/27/RUB/ | 4.8 |
| TURKEY GOVE 9.5% 01/12/22/TRY/ | 3.8 |
| MEX BONOS 7.75% 05/29/31/MXN/ | 3.4 |
| REPUBLIC OF S 7% 02/28/31/ZAR/ | 3.3 |
| NOTA DO TESO 10% 01/01/23/BRL/ | 3.3 |
| NOTA DO TESO 10% 01/01/25/BRL/ | 3.3 |
| MEX BONOS 5.75% 03/05/26/MXN/ | 3.1 |

| | |
|---------------|------|
| 總債券數 | 36 |
| 前10大持股佔總資產百分比 | 40.5 |

券種配置

| 券種 | 基金 % |
|----------|------|
| 主權債券 | 97.5 |
| 公用事業 | 2.5 |
| 工業 | 0.0 |
| 科技、媒體與電訊 | 0.0 |
| 基建 | 0.0 |
| 房地產 | 0.0 |
| 金融 | 0.0 |

| 特質 | 基金 |
|------------|-----|
| 有效存續期間 | 4.7 |
| 有效到期日 (年) | 7.1 |
| 修正存續期間 (年) | 4.6 |
| 平均票面利率 | 7.9 |
| 到期殖利率 | 6.4 |

| 信評 | 基金 % |
|-------|------|
| Aaa | - |
| Aa | - |
| A | 24.3 |
| Baa | 47.8 |
| 低於Baa | 20.6 |
| 未評級 | 7.3 |

信用評等指穆迪、標普或惠譽給予基金個別持債之信用評級中最高者，日後可能調升或調降。

指數數據資料是基於國家信評。

| 到期日區間 (年) | 基金 % |
|-----------|------|
| 低於1年 | 2.1 |
| 1年-3年 | 19.4 |
| 3年-5年 | 17.9 |
| 5年-7年 | 21.4 |
| 7年-10年 | 14.9 |
| 10年-15年 | 16.7 |
| 15年-20年 | 6.1 |
| 20年-30年 | 1.4 |
| 高於30年 | - |

| 幣別配置 | 基金 % |
|------|------|
| BRL | 10.8 |
| MXN | 10.0 |
| IDR | 9.8 |
| THB | 9.1 |
| PLN | 8.7 |
| COP | 7.5 |
| RUB | 7.5 |
| ZAR | 6.8 |
| TRY | 4.6 |
| MYR | 4.0 |
| 其他 | 21.3 |

類股：R/D (USD)

費用與規定

| | |
|--------------------|-----------|
| 總費率 | 1.60% |
| 最高銷售手續費 | 3.00% |
| 贖回手續費 | - |
| 最低投資額 | 1,000 USD |
| 基金每股淨值 (31 Oct 19) | 55.00 USD |
| 每股股利 (01 Oct 19) | 0.966 USD |
| 配股次數 | 每季 |

管理公司

管理公司 Natixis IM S.A.

投資管理集團

盧米斯賽勒斯資產管理公司為機構與一般投資人服務逾 80 年，採主動管理方式，投資風格多元，提供傳統與高度專業之資產類別投資工具。投資手法講求把握市場先機，輔以嚴謹之由下而上研究與計量風險分析，致力於不同資產類別中創造優於平均之報酬率。

總部 Boston
 公司成立日 1926
 管理資產金額 (10億) U.S. \$ 267.4 / € 245.3 (30/09/2019)

投資組合經理人

Edgardo Sternberg: 1990 年進入投資業界，2005 年加入 Loomis Sayles，自本基金成立起便負責操盤，擁有麻省理工學院企管碩士學位。

David Rolley / 特許財務分析師 (CFA): 1980 年進入投資業界，1994 年加入 Loomis Sayles，自本基金成立起便負責操盤，擁有 Occidental College 文學士學位。

本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；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。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中，投資人可至公開資訊觀測站或境外基金資訊觀測站中查詢。各銷售機構備有基金公開說明書（或中譯本）及投資人須知，歡迎索取。投資涉及新興市場部份，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。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。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。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，故本基金可能會因利率上升、市場波動下降，或債券發行機構違約不支付本金、利息或破產而蒙受虧損。本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占其投資組合過高之比重。本基金可投資於美國 Rule 144A 債券，該債券屬私券性質，較可能發生流動性不足、財務資訊揭露不完整或因價格不透明導致波動性較大之風險。投資人申購前應詳閱基金公開說明書。中國信託投信 獨立經營管理。

資料來源：績效資料來自 Morningstar，其餘資料來自法盛投資管理公司，資料日期為此月報月份之該月底（月報月份揭露於本頁左上角）。

資訊 聯絡資料

總代理 中國信託證券投資信託股份有限公司
 電話：(02) 2652-6688
 地址 台北市南港區經貿二路188號12樓
www.ctbcinvestments.com