

 2019 理柏台灣基金獎 - 債券型團體大獎。2019 《指標》台灣年度基金大獎 - 同級最佳 / 最佳表現定期定額大獎：美元固定收益。

## 投資經理

西方資產管理

## 基金基本資料 (2024/02/29)

股份發行日	2010/09/14(累積型美元優股份) (1) 2011/09/29(月配息美元優股份)
計價幣別	美元
投資地區	美國
基金標的	主要投資於高評級美國債券
配息頻率	累積型/月配息 (2)
基金規模	8億1仟5佰萬(美元)
持有股數	1569
投資政策	追求收益及基金價值的成長
註冊國家	愛爾蘭
管理費用	1.000%
波動風險	9.32%(理柏三年期原幣別) · 以累積型美元A股份為準 (3)
ISIN號碼	IE00B241B875 / IE00B241B982
彭博代號	LMWCPAU ID/LMUPDMU ID
對應指數	Bloomberg U.S. Aggregate Index (USD)
風險等級	RR2 (4)
基金經理人	Bonnie Wongtrakool/Julien A. Scholnick/Frederick R. Marki/John L. Bellows/Mark Lindbloom/S. Kenneth Leech

## 投資產業(%) (2024/02/29)

投資等級債	33.32
機構抵押債	33.05
商用不動產抵押債	6.44
非機構房貸抵押債	5.06
公債(當地貨幣)	4.90
新興當地債	4.87
銀行貸款	2.80
新興市場公司債	2.50
擔保貸款憑證	2.11
其他債券	5.62
現金及約當現金	-0.66

註：基金或因有尚未交割的交易活動及/或因使用公開說明書允許的投資政策，導致其分佈

## 累積報酬率(%) (各幣別 · 至2024/02/29止 · 資料來源：理柏)

期間	三個月	六個月	一年	二年	三年	五年	十年	年初至今
台幣別	3.88	1.59	6.93	1.13	-2.82	0.46	13.62	0.89
原幣別	2.66	2.35	3.07	-10.31	-14.37	-2.19	8.91	-2.04

註：以累積型美元A股份為準。

## 單年報酬率(含息%) (原幣別 · 截至各年度年底 · 資料來源：理柏)

年度	14	15	16	17	18
報酬率	6.45	-0.64	2.80	5.48	-2.38
年度	19	20	21	22	23
報酬率	11.26	7.99	-2.56	-18.10	6.18

註：以累積型美元A股份為準。

## 主要投資標的(占總資產%) (2024/02/29)

墨西哥債券 (墨西哥 政府債及國庫券) MEXICO ST 7.75% 11/13/42	1.47
美國國庫債券 (美國 政府債及國庫券) US TREASURY N/B 01/31 4 4.0000%	1.45
墨西哥債券 (墨西哥 政府債及國庫券) MEX BONOS DESARR FIX RT 7.7500% Mat 11/23/2034	1.29
GENNIE MAE房貸抵押債 (美國 機構債) GNMA II TBA 30 YR 5 JUMBOS 5.0000% Mat 03/01/2052	1.12
墨西哥債券 (墨西哥 政府債及國庫券) MEX BONOS DESARR FIX RT 8.0000% Mat 11/07/2047	0.91
美國公債 (美國 政府債) UNITED STATES TREASURY INFLATI 1.1250% Mat 01/15/2033	0.85
聯邦住宅貸款抵押公司 (美國 機構債) FHLMC 30YR POOL RA6694 2.0000% Mat 01/01/2052	0.70
美國國庫債券 (美國 政府債及國庫券) UNITED STATES TREASURY NOTE/BO 4.7500% Mat 11/15/2043	0.68
美國國庫債券 (美國 政府債及國庫券) US TREASURY N/B 02/31 4.25 4.2500%	0.67
GENNIE MAE房貸抵押債 (美國 機構債) GNMA II 30YR POOL MA7192 2.0000% Mat 02/20/2051	0.61

註：投資人申購本基金係持有基金受益憑證，而非本文提及之投資資產或標的。

暫時呈現負值。

### 債券配置 (2024/02/29)

最低殖利率 (5)	5.85%
平均存續期間	6.93 years
平均到期年限	13.19 years
平均債信評等 (6)	A

### 債信評等 (%) (2024/02/29)

AAA	47.36
AA	5.05
A	17.83
BBB	21.21
BB	5.29
B	1.43
CCC	1.86
CC	0.45
C	0.04
D	0.13
現金及約當現金	-0.66

註：基金或因有尚未交割的交易活動及/或因使用公開說明書允許的投資政策，導致其分佈暫時呈現負值。

### 投資國家 (%) (2024/02/29)

美國	84.42
墨西哥	4.12
法國	1.50
巴西	1.40
瑞士	1.39
英國	0.95
加拿大	0.56
荷蘭	0.53
其他國家	5.78
現金及約當現金	-0.66

註：基金或因有尚未交割的交易活動及/或因使用公開說明書允許的投資政策，導致其分佈暫時呈現負值。

### 主要幣別分配 (%) (2024/02/29)

美元	94.48
墨西哥披索	3.08
日圓	2.24
澳幣	1.30
巴西里拉	0.80
挪威克朗	0.76
加拿大幣	0.68
印度盧比	0.68
其他貨幣	-4.02

註：基金或因有尚未交割的交易活動及/或因使用公開說明書允許的投資政策，導致其分佈暫時呈現負值。



基金月報下載

### 成立以來投資成長圖 (期初單筆投資一萬元，原幣計價迄2024/02月底，資料來源：理柏)



註：以累積型美元A股份為準。

- (1) 累積型股份是把配息自動轉入當日淨值，不另行發放，即是將配息轉入再投資。
- (2) 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，投資人於獲配息時，宜一併注意基金淨值之變動。
- (3) 波動風險為過去三年月報酬率的年化標準差。
- (4) 考量本基金主要投資於美國投資等級債券及參考過去淨值之波動性，其風險報酬等級為RR2。風險報酬等級為本公司參酌投信投顧公會「基金風險報酬等級分類標準」編製，該分類標準係計算過去5年基金淨值波動度標準差，以標準差區間予以分類等級，分類為RR1-RR5五級，數字越大代表風險越高。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（如：基金計幣別匯率風險、投資標的產業風險、信用風險、利率風險、流動性風險等），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。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](https://www.sitca.org.tw/index_pc.aspx))查詢。

- (5) 乃到期殖利率有考量債券被提前償還情境時之水準，基金持債殖利率不代表基金報酬率或配息率。
- (6) 資料來源：富蘭克林坦伯頓基金集團，平均債信評等乃依據各持債市值，以簡單加權平均計算投資組合的債信品質。各持債引用不同債信評等機構(標準普爾、穆迪及惠譽)之評等。若三家均有評等取中間級；若兩家有評等取最低級；若只有一家有評等則取該評級；而若均未賦予評級則列入未評等類別。納入計算之資產項目包含債券以及信用型的衍生性金融商品部位。信用評等由AAA(最高級)~D(最低級)。整體信用評等水準愈低，顯示投資組合之債信風險愈高。
- ◎ 本基金經金融監督管理委員會核准或申報生效在國內募集及銷售，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，投資人申購前應詳閱基金公開說明書。
  - ◎ 本文提及之經濟走勢預測，不必然代表基金之績效，投資基金所應承擔之相關風險及應負擔之費用(含分銷費用)已揭露於基金公開說明書及投資人須知中，投資人可至境外基金資訊觀測站(<https://www.fundclear.com.tw>)下載，或逕向本公司網站(<https://www.Franklin.com.tw>)查閱。
  - ◎ 基金過去績效不代表未來績效之保證。
  - ◎ 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。部分基金進行配息前未先扣除應負擔之費用。由本金支付配息之相關資料已揭露於本公司網站，投資人可至本公司網站(<https://www.Franklin.com.tw>)查閱。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，投資人於獲配息時，宜一併注意基金淨值之變動。
  - ◎ 獎項資料來源：理柏，乃依據截至2018年12月31日止過去三年風險調整後的績效所評定。獎項資料來源：Benchmark，A類股美元累積型，績效結算至2019年9月30日。基金過去績效不代表未來績效之保證。
  - ◎ 投資人因不同時間進場，將有不同之投資績效，過去之績效亦不代表未來績效之保證。