

## 普徠仕(盧森堡)系列基金

普徠仕新興市場債券基金(本基金主要係投資於非投資等級之高風險債券且基金之配息來源可能為本金)

T. ROWE PRICE FUNDS SICAV

## Emerging Markets Bond Fund

基金經理人：Samy Muaddi

管理費：A 1.05%；Ax 1.05%

基金規模：2.035億美元

幣別：美元、歐元

註冊地：盧森堡

晨星評級：A★★★；A(歐元)★★；Ax★★

基金淨值：A(美元)20.01；A(歐元)11.24；Ax(美元)6.06

指標：J.P. Morgan Emerging Market Bond Index Global Diversified

績效表現(美元)%(資料來源：晨星；截至2024年5月31日；以主要類股計算同類型基金平均)

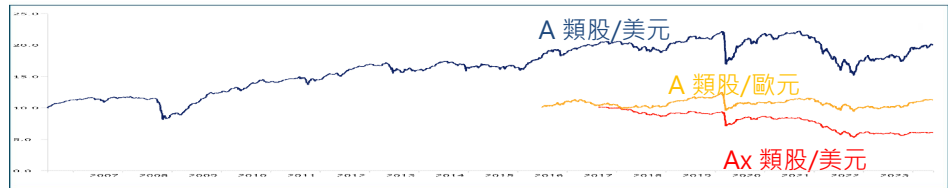
|                    | 成立日期      | 3個月  | 6個月  | 今年以來 | 1年    | 2年    | 3年    | 5年    | 成立日以來  |
|--------------------|-----------|------|------|------|-------|-------|-------|-------|--------|
| A 類股(美元)           | 2006/6/27 | 1.99 | 6.61 | 1.68 | 12.61 | 10.13 | -8.08 | -2.53 | 100.10 |
| A 類股(歐元)           | 2016/6/30 | 2.23 | 6.51 | 1.81 | 12.65 | 10.05 | -8.27 | -2.49 | 9.84   |
| Ax 類股(美元)          | 2017/8/23 | 2.15 | 6.62 | 1.76 | 12.76 | 10.27 | -8.03 | -2.46 | -0.61  |
| 台灣同類型 A 類股基金平均(美元) |           | 1.92 | 6.85 | 2.00 | 12.55 | 9.63  | -9.01 | 0.59  | -      |

基金績效的計算由晨星提供，非基金管理公司。雖然此數據出自於可靠的來源，但基金管理公司並不保證數據的正確性。

## 投資目標

基金淨值走勢圖(成立日以來；資料來源：晨星；截至2024年5月31日)

本基金主要投資標的為多元化的新興市場機構所發行的各種類債券投資組合。基金主要投資於債權證券，包括政府公債、政府機構債、在新興市場區域有登記，或是在新興市場發展業務的跨國性機構與企業所發行的公司債。



## 債信評等分析(資料來源：普徠仕；截至2024年5月31日)

|     | 佔基金% | 基金 vs. 指標 |
|-----|------|-----------|
| AAA | 0.1  | 0.1       |
| AA  | 2.3  | -4.1      |
| A   | 6.8  | -9.5      |
| BBB | 25.1 | -1.6      |
| BB  | 32.3 | 9.1       |
| B   | 19.2 | 2.1       |
| CCC | 6.7  | 0.1       |
| CC  | 0.3  | -0.5      |
| C   | 0.0  | 0.0       |
| 違約  | 4.3  | 1.9       |
| 未評等 | 1.3  | 0.8       |
| 現金  | 1.6  | 1.6       |

註：本基金持有證券的信用評級由穆迪、標準普爾和惠譽三家公司提供，並轉換為標準普爾的命名方式。當所有三個機構的評級都可用時，使用評級中間值。如果有兩個評級可用，則使用較低評級。如果只有一個評級可用，則使用該評級。如果沒有評級可以用，則證券被歸類為未評級(NR)。基礎投資工具的評級用於決定信用違約交換和主權證券的信譽。本基金未經任何信評機構評級。

## 投資地區%(資料來源：普徠仕；截至2024年5月31日)

|        | 佔基金% | 基金 vs. 指標 |
|--------|------|-----------|
| 墨西哥    | 9.0  | 4.0       |
| 印尼     | 6.2  | 1.8       |
| 巴西     | 4.8  | 1.6       |
| 巴拿馬    | 3.9  | 1.3       |
| 哥倫比亞   | 3.8  | 1.0       |
| 阿曼     | 3.6  | 0.5       |
| 印度     | 3.4  | 2.7       |
| 埃及     | 3.3  | 0.6       |
| 安哥拉    | 3.2  | 2.0       |
| 土耳其    | 2.7  | -1.7      |
| 象牙海岸   | 2.7  | 2.0       |
| 智利     | 2.7  | -0.5      |
| 沙烏地阿拉伯 | 2.5  | -2.4      |
| 卡達     | 2.3  | -1.0      |
| 委內瑞拉   | 2.3  | 1.7       |

## 投資組合分析(資料來源：普徠仕；截至2024年5月31日)

|           | 基金    | 指標    |
|-----------|-------|-------|
| 持有債券數量    | 255   | 976   |
| 平均債信評等*   | BB    | BB+   |
| 平均到期期間(年) | 10.24 | 11.21 |
| 存續期間(年)   | 6.97  | 6.50  |
| 到期收益率     | 7.11% | 8.42% |
| 平均票面利率    | 5.57% | 5.42% |
| 當期收益率     | 7.55% | 6.26% |

註：本基金持有證券的信用評級由穆迪、標準普爾和惠譽三家公司提供，並轉換為標準普爾的命名方式。當所有三個機構的評級都可用時，使用評級中間值。如果有兩個評級可用，則使用較低評級。如果只有一個評級可用，則使用該評級。如果沒有評級可以用，則證券被歸類為未評級(NR)。基礎投資工具的評級用於決定信用違約交換和主權證券的信譽。本基金未經任何信評機構評級。

## 投資組合相關數據(資料來源：普徠仕；截至2024年5月31日)

| 5年期       | I 類股 <sup>註</sup> | 指標     |
|-----------|-------------------|--------|
| 年化標準差(%)  | 13.69%            | 11.51% |
| Alpha值(%) | 0.08%             | 0.00%  |
| Beta值     | 1.16              | 1.00   |
| R平方       | 0.95              | 1.00   |
| 資訊比率      | -0.11             | 0.00   |
| 夏普值       | -0.15             | -0.14  |
| 追蹤誤差(%)   | 3.59%             | 0.00%  |

註：數據根據 I 類股月度淨回報來計算。

## 存續期間分析(資料來源：普徠仕；截至2024年5月31日)

|       | 佔基金% | 基金 vs. 指標 |
|-------|------|-----------|
| 1年以下  | 4.6  | 0.5       |
| 1~3年  | 10.9 | -7.7      |
| 3~5年  | 22.7 | 1.8       |
| 5~7年  | 25.1 | 7.2       |
| 7~10年 | 16.0 | 1.3       |
| 10年以上 | 18.4 | -5.3      |
| 現金    | 2.2  | 2.2       |

【萬寶投顧獨立經營管理】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，投資人申購前應詳閱基金公開說明書。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。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。投資人應留意衍生性工具/證券相關商品等槓桿投資策略所可能產生之投資風險(詳見公開說明書或投資人須知)。本基金投資風險及基金應負擔之費用(含分銷費用)已揭露於基金之公開說明書或投資人須知中，投資人可至萬寶基金網(efund.com.tw)或境外基金資訊觀測站([www.fundclear.com.tw](http://www.fundclear.com.tw))查詢。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，故本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。本基金不適合無法承擔相關風險之投資人。本基金適合追求債券較高利息收入及資本利得且能承受較高風險之非保守型投資人，且投資人投資以非投資等級債券為訴求之基金不宜佔其投資組合過高之比重。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。此基金屬普徠仕(盧森堡)系列基金(T. Rowe Price Funds SICAV)之子基金，並符合歐盟法令所賦予「可轉讓證券集合投資計畫」(UCITS)之法規。凡任何持有本說明書及/或申請表格之人士及按本說明指引而欲申請認購之人士，應自行負責留意其國家之相關法律及監管條例。本資料所提及之證券並不代表所有此基金所投資買賣之證券，投資人不應對本文所提及之證券作獲利假設。本資料僅供參考，非提供投資建議所用，且數據會每日變動。所有數據除了另有標示，均出自普徠仕。

註：資料來源：理柏公司(Lipper)；資料日期：2019年3月13日。

晨星星號評級是將基金過去一段時間(三年(含)以上)在同類型基金中的表現，經風險調整後收益之結果，將基金依1至5星進行排序，最高為5顆星評級。該評級依據三大核心原則：1. 同類型基金比較；2. 對基金長期表現的評定；3. 將基金成本和投資人風險厭惡納入考量，並根據基金之MRAR(晨星調整風險後收益)排名而得出。根據MRAR的結果，基金於所屬組別內得分愈高、其所獲的星號評級也愈高。資料來源：晨星，2024年5月31日。

萬寶證券投資顧問股份有限公司

台北市松江路87號4樓 (02)6608-3998 (101)金管投顧新字第007號