Schroders
施 羅 德 投 資

施羅德環球基金系列 - 證券化債券
基金之配息來源可能為本金

美元 C 級別 (累積) | 資料截止至 29.02.2024

產品特色

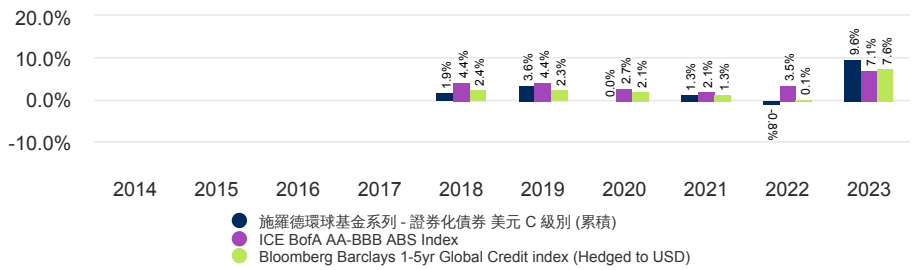
1. 本基金至少2/3資產會投資於ABS, MBS或CMBS之證券化債券，為境外全球債券型基金中以投資證券化債券為主要特色之基金。
2. 本基金將對非美元部位將進行匯率避險，旨在降低匯率風險。
3. 本基金以投資等級債券為主要標的，且證券化債券具有浮動利率與存續期間較短之特色，是利率風險相對較低的債券投資標的之一。

本基金具有環境和/或社會特徵（依永續金融揭露規範(SFDR)第8條定義）。根據投資經理公司的評等系統，本基金維持高於其永續性指標之整體永續性評分。

基金表現 (%)

累積表現	3個月	6個月	年初至今	1年	2 年	3年	5年	自成立日起
本級別	1.8	4.3	1.3	7.8	10.4	10.9	14.9	18.7
目標指標	2.0	3.9	1.4	7.6	12.0	14.3	22.1	29.9
比較指標	0.9	2.6	0.1	6.0	8.5	8.5	13.5	17.8

年度表現



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。
資料來源：晨星。累積報酬率是將配息再做投資且已扣除基金應負擔之相關費用，未扣除首次認購費，僅供參考。

基金資料

基金經理人	Michelle Russell-Dowe
基金管理公司	施羅德投資管理（歐洲）有限公司
註冊地	盧森堡
基金成立日 (日/月/年)	06.09.2017
級別成立日 (日/月/年)	06.09.2017
基金基礎貨幣	美元
資產規模（百萬元）	美元 2,498.91
投資標的數量(月底)	240
目標指標	ICE BofA AA-BBB ABS Index
比較指標	Bloomberg Barclays 1-5yr Global Credit index (Hedged to USD)
基金淨值 (月底)	美元 118.6849
交易頻率	每日
配息率	無配息
配息頻率	無配息
淨值最高 / 最低 (過去十二個月)	美元 118.9143 / 美元 109.7617
風險報酬等級	RR2

費用

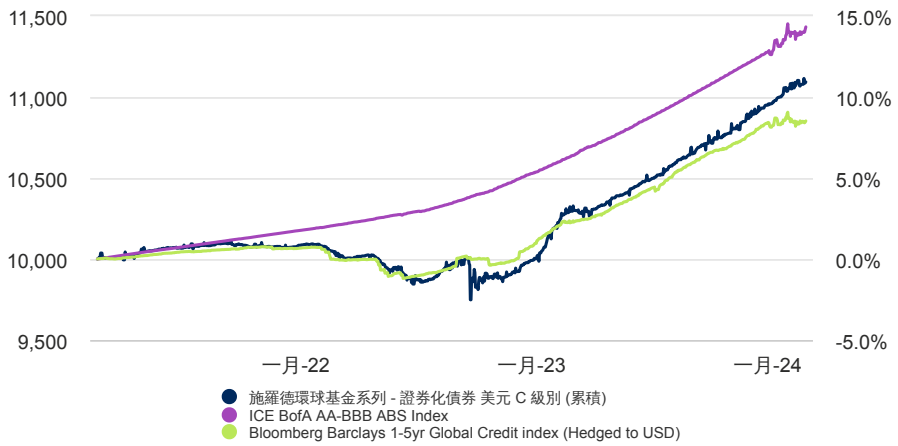
管理年費(%)	0.350%
經常性費用(%)	0.48%

代碼

ISIN	LU1662754669
彭博代碼	SCHICCA LX

施羅德環球基金系列 - 證券化債券
基金之配息來源可能為本金
美元 C 級別 (累積) | 資料截止至 29.02.2024

基金過去績效走勢



按該基金級別之計價幣別，以本金一萬元的累積三年表現為例，係將配息再做投資且已扣除基金應負擔之相關費用，未扣除首次認購費，僅供參考。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。
資料來源：晨星。

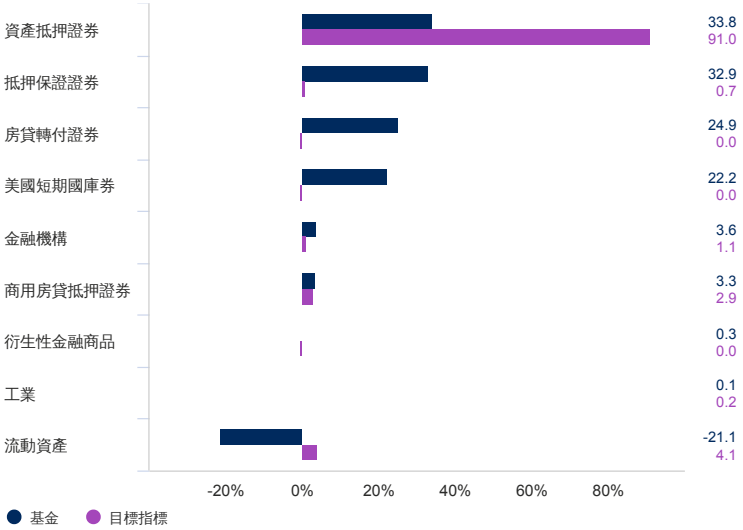
風險統計數據及財務比率

	基金	目標指標
年化波動率 (%) (3 年)	1.9	0.9
平均存續期間 (年)	0.4	-
平均當期收益率 (%)	5.3	-
平均到期殖利率 (%)	7.1	-

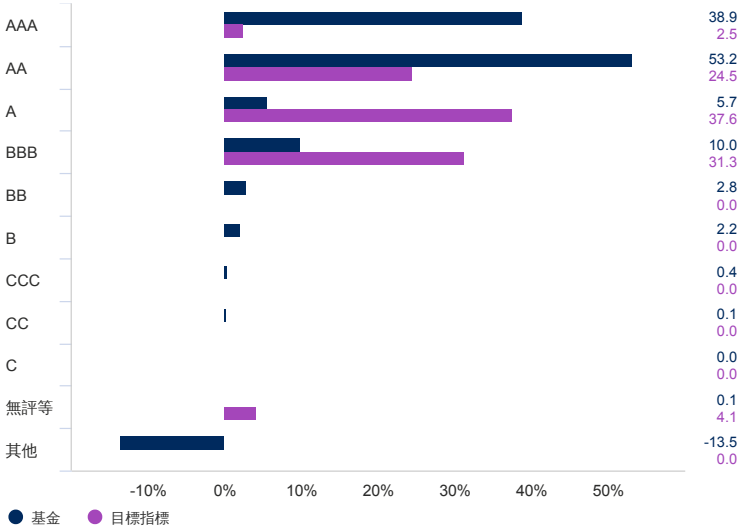
平均當期收益率與平均到期殖利率分別係指在資料日期當日所持有債券之當期收益率與到期殖利率之平均值，未涉及未來收益率的預估。 資料來源：晨星。

資產配置

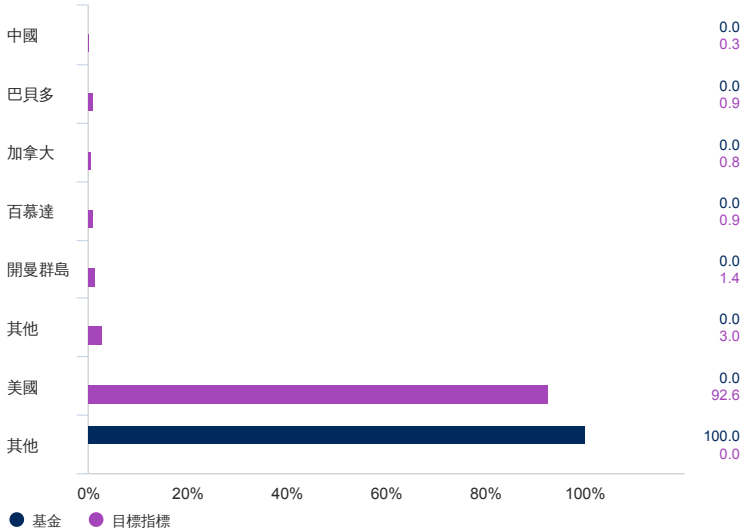
產業 (%)



信用評級 (%)



地區分佈 (%)



主要投資標的 (%)

名稱	%
TREASURY BILL 0.0000 26/03/2024 SERIES GOVT	7.8
TREASURY BILL 0.0000 05/03/2024 SERIES GOVT	5.5
FNCL 5.5 3/24 5.5000 13/03/2024	5.4
G2SF 6 3/24 6.0000 20/03/2024	5.3
FNCL 6 3/24 6.0000 13/03/2024	4.4
TREASURY BILL 0.0000 23/04/2024 SERIES GOVT	3.2
TREASURY BILL 0.0000 16/04/2024 SERIES GOVT	2.5
G2SF 6.5 3/24 6.5000 20/03/2024	2.4
TREASURY BILL 0.0000 02/04/2024 SERIES GOVT	1.8
FN CB7859 5.5000 01/01/2054	1.8

資料來源: 施羅德投資。
僅作為舉例說明，不代表任何金融商品之推介或投資建議。 衍生工具在適用的情形下係依照標的資產之名目基礎表示。由於對各類型衍生工具的處理不同，各圖表之間對流動資產的分配可能有所差異。 資料來源: 施羅德投資。
僅作為舉例說明，不代表任何金融商品之推介或投資建議。

可認購級別

	美元 C 級別 (累積)	美元 C 級別 (配息)
配息頻率	無配息	每季
ISIN	LU1662754669	LU1662755120
彭博代碼	SCHICCA LX	SCHICCU LX

指標和公司行動信息

本文件中的基準指標名稱可能經縮寫處理。完整的基準指標名稱請參閱基金法律文件。 指標: （如果適用）
部分基金績效與指標間的差異，可能源自於指標並未納入不同的估值點計算調整。選擇目標指標是因為它代表了基金可能投資的投資類型，因此，它是與基金旨在提供的回報相關的適當目標。選擇比較指標是因為投資經理人認為，考慮到基金的投資目標和政策，該指標適合作為以績效比較為目的之用。投資經理斟酌情況進行投資，基金的投資組合和績效偏離指標的程度沒有限制。投資經理將投資未納入指標的公司或產業，以利用特定的投資機會。

施羅德環球基金系列 - 證券化債券
基金之配息來源可能為本金
美元 C 級別 (累積) | 資料截止至 29.02.2024

重要事項

本資訊由施羅德投信提供，僅供參考，未經本公司許可，不得逕行抄錄、翻印、剪輯或另作派發。本公司當盡力提供正確之資訊，所載資料均來自我們相信可靠之來源，惟並未透過獨立之查核；對其完整性、即時性和正確性不做任何擔保，內容所載之資料與數據可能隨時變更，如有錯誤或疏漏，本公司或關係企業與其任何董事或受僱人，並不負任何法律責任。

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。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基金公開說明書。本基金或有投資外國有價證券，除實際交易產生損益外，投資標的可能負擔利率、匯率（含外匯管制）、有價證券市價或其他指標變動之風險，有直接導致本金發生虧損，且最大可能損失為投資本金之全部。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或投資人須知中，投資人可至公開資訊觀測站/境外基金資訊觀測站中查詢。本基金如適用於OBU業務，且於OBU銷售時之銷售對象以非居住民為限。各基金因其不同之計價幣別，而有不同之投資報酬率。本基金或有提供非基礎貨幣計價之匯率避險級別及無避險級別。避險級別目的在於降低該級別之計價貨幣匯率波動對基金投資績效所造成的影響，並讓投資該級別之投資人享有接近投資基礎貨幣級別之績效。避險級別之匯率避險操作將由經理團隊視市場狀況彈性調整，避險收益僅為預估值，非獲利之保證。避險操作所需的成本或外幣利差可能影響基金績效。而針對無避險級別，投資人應留意該非基礎貨幣計價級別可能並無從事匯率避險操作，亦即投資人除承擔投資組合之相關市場風險外，亦需承擔基礎計價貨幣與投資組合標的計價貨幣之匯率風險。以本基金計價幣別以外之貨幣換匯後投資須承擔匯率風險，且本公司不鼓勵投資人因投機匯率變動目的而選擇非基礎貨幣計價級別。南非幣一般被視為高波動/高風險貨幣，投資人應瞭解投資南非幣級別所額外承擔之匯率風險。倘若南非幣匯率短期內波動過鉅，將會明顯影響基金南非幣級別之每單位淨值，詳見公開說明書投資風險揭露章節。

本基金具有（歐盟）2019/2088號法規（歐盟永續金融規範中有關永續的揭露）第8條所定義的環境和/或社會特徵。有關本基金的永續性相關資訊，請前往www.schroders.com。 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，投資人於獲配息時，宜一併注意基金淨值的變動；基金淨值可能因市場因素而上下波動。各相關配息時間依基金管理機構通知之實際配息日期為準；實際配息入帳日以銷售機構作業時間為準。固定收益分配類型基金會定期將基金收益分配予投資人，投資人應當了解依其原始投資日期之不同，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。配息可能因利息收入、股息收入、權利金收入或其他可分配收入尚未進帳或短期間不足支付配息，而有部分配息來自於本金的風險。基金配息之年化配息率計算公式為「每單位配息金額÷除息日前一日之淨值×一年配息次數×100%」，且年化配息率為估算值。基金配息組成項目表已揭露於施羅德網站，投資人可至http://www.schroders.com.tw查詢。提醒投資人配息並非固定不變或保證獲利，配息級別除息後淨值將隨之下降，配息可能影響再投資的複利效益。

基金可能投資美國 144A 債券（境內基金投資比例最高可達基金總資產30%；境外基金不限），該債券屬私募有價證券，債券發行機構之財務與營運資訊揭露相對較不透明，且需符合合格投資機構資格者才能進行交易，故易發生流動性不足，財務訊息揭露不完整或價格不透明導致高波動性之風險。市場波動劇烈時，本基金可能面臨前述風險而產生虧損。

任何債市都有匯率、利率與債信三個層面的機會與風險，單一國家與新興市場國家債市波動較大，投資人應衡量本身風險承受情形適度布局。

僅作為舉例說明，不代表任何金融商品之推介或投資建議。

Sharpe ratio – 夏普指數，為一經風險調整後之績效指標，代表投資人每多承擔一分風險，可以拿到較無風險報酬率高出幾分的報酬；若為正值，代表基金承擔報酬率波動風險有正的回饋；若為負值，代表承受風險但報酬率反而不如銀行利率。基金的夏普指數愈高，表示在考慮風險因素後的回報情況愈高，為較佳的基金。

依中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會公布「基金風險報酬等級分類標準 (基金風險報酬等級由低至高區分為 RR1、RR2、RR3、RR4、RR5 五個等級)，故本基金風險報酬等級為 RR2。提醒投資人此等級分類，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，投資人仍應注意所投資基金個別的風險。

施羅德證券投資信託股份有限公司
地址：11047台北市信義區信義路5段108號9樓
電話：02-27221868
網址：http://www.schroders.com.tw
施羅德投信獨立經營管理