

路博邁 ESG 新興市場債券基金

(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)

投資目標

主要投資於全球新興市場國家或地區之美元計價 ESG 債券，將靈活布局於主權債、類主權債、次主權債、國際機構債及公司債等，透過主動式管理達成追求中長期資本增值及收益的總報酬目標。

基金特色

- 透過投資於美元計價的全球新興市場債券，掌握並參與新興市場持續強勁的成長動能投資機會
- 導入獨家ESG(環境、社會、治理)評分系統至投資流程，有效篩選投資標的並有助降低整體信用風險
- 路博邁新興債投資團隊早於市場主流指標投入新興債研究，可謂先驅，多年的經驗淬鍊出堅強實力
- 藉由多元分散的配置與投資團隊的主動式管理，有利適時因應市場變化並能擇機進行動態調整及避險

投資團隊

楊凱甯

基金經理人

基金資料

| | |
|-------------|---|
| 基金成立日 | 2020年9月30日 |
| 基礎貨幣 | 新台幣 |
| 幣別 | 新台幣、美元、人民幣 澳幣、南非幣 |
| 基金規模(百萬新台幣) | 533.64 |
| 風險等級 | RR3 |
| 註冊地 | 台灣 |
| 基金管理費率(每年) | 類股T、N 1.8% |
| 績效指標 | 摩根ESG新興市場全球 多元債券指數(JP Morgan ESG EMBI Global Diversified Index) |

基金代碼

ISIN

| | |
|------------|--------------|
| T累積類股(新台幣) | TW000T5006A9 |
| T月配類股(新台幣) | TW000T5006B7 |
| N累積類股(新台幣) | TW000T5006C5 |
| N月配類股(新台幣) | TW000T5006D3 |
| T累積類股(美元) | TW000T5006E1 |
| T月配類股(美元) | TW000T5006F8 |
| N累積類股(美元) | TW000T5006G6 |
| N月配類股(美元) | TW000T5006H4 |
| T累積類股(人民幣) | TW000T5006J0 |
| T月配類股(人民幣) | TW000T5006K8 |
| N累積類股(人民幣) | TW000T5006L6 |
| N月配類股(人民幣) | TW000T5006M4 |
| T累積類股(澳幣) | TW000T5006N2 |
| T月配類股(澳幣) | TW000T5006P7 |
| N累積類股(澳幣) | TW000T5006Q5 |
| N月配類股(澳幣) | TW000T5006R3 |
| T累積類股(南非幣) | TW000T5006S1 |
| T月配類股(南非幣) | TW000T5006T9 |
| N累積類股(南非幣) | TW000T5006U7 |
| N月配類股(南非幣) | TW000T5006V5 |

聯繫

客戶服務: +886 (02) 8726 8280

網站: www.nb.com/taiwan

第1頁(共2頁)

基金累計報酬%

| | 3個月 | 6個月 | 年初至今 | 1年 | 2年 | 3年 | 5年 | 成立至今 (總回報) |
|----------|------|------|------|-------|-------|--------|----|---------------|
| T累積(新台幣) | 5.91 | 5.79 | 1.93 | 10.62 | 0.22 | -9.40 | - | -10.40 |
| T累積(美元) | 5.65 | 7.30 | 0.67 | 10.60 | -2.07 | -11.01 | - | -10.30 |
| T累積(人民幣) | 4.95 | 6.08 | 0.23 | 7.49 | -5.52 | -11.88 | - | -11.00 |
| T累積(澳幣) | 5.28 | 6.19 | 0.47 | 8.88 | -5.51 | -14.46 | - | -14.20 |
| T累積(南非幣) | 6.52 | 8.97 | 1.22 | 14.35 | 3.53 | -1.58 | - | -0.40 |

資料來源: Morningstar, 計算至2024年02月29日止。本處呈現之資訊為本基金T累積類股, 以原計價幣別計算。T累積類別成立日為2020年09月30日。

前十大持債%

| | 基金 |
|------------------------------------|------|
| 秘魯政府國際債券 PERU 3 3/4 03/01/30 | 3.49 |
| 金魚有限公司(奧地利) SUZANO 7 03/16/47 | 2.82 |
| 阿曼政府國際債券 OMAN 6 3/4 01/17/48 | 2.74 |
| 阿根廷共和國政府國際公債 ARGENT 3 5/8 07/09/35 | 2.64 |
| 巴拿馬政府國際債券 PANAMA 6.7 01/26/36 | 2.60 |
| 薩爾瓦多政府國際債券 ELSALV 7.65 06/15/35 | 2.55 |
| 哈薩克政府國際債券 KAZAKS 6 1/2 07/21/45 | 2.45 |
| 斯里蘭卡政府國際債券 SRILAN 5 3/4 04/18/23 | 2.36 |
| 墨西哥政府國際債券 MEX 5 3/4 10/12/2110 | 2.28 |
| DP環球新月有限公司 DPWDU 3 7/8 07/18/29 | 2.22 |

路博邁 ESG 新興市場債券基金

(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)

前十大國家分佈%

| | 基金 | 績效指標 |
|----------|------|------|
| 巴西 | 7.43 | 3.91 |
| 羅馬尼亞 | 5.96 | 4.03 |
| 秘魯 | 4.85 | 2.94 |
| 阿根廷 | 4.42 | 1.91 |
| 巴拿馬 | 4.29 | 3.16 |
| 哥倫比亞 | 3.88 | 3.32 |
| 斯里蘭卡 | 3.56 | 0.73 |
| 象牙海岸 | 3.45 | 0.52 |
| 智利 | 3.39 | 3.93 |
| 阿拉伯聯合大公國 | 3.38 | 4.59 |

債券部位區域分佈%

| | 基金 | 績效指標 |
|-------|-------|-------|
| 拉丁美洲 | 43.40 | 37.26 |
| 中東及非洲 | 21.60 | 32.41 |
| 新興歐洲 | 18.93 | 18.72 |
| 新興亞洲 | 11.23 | 11.61 |
| 其他區域 | 4.84 | 0.00 |

信用評級分佈%

| | 基金 | 績效指標 |
|--------------|-------|-------|
| AA | 4.04 | 6.82 |
| A | 3.21 | 13.91 |
| BBB | 45.45 | 32.55 |
| BB | 16.21 | 25.29 |
| B | 9.04 | 13.62 |
| CCC(含)以下 | 12.52 | 7.80 |
| 現金及等價物(含保證金) | 9.53 | 0.00 |
| 債券部位平均信用評級 | BB+ | BBB- |

信評資料來源：彭博，摩根大通。決定投資標的的信用評級方式：債券直接投資是依據主要國際信評機構評級的最高評等，共同基金則採用資產管理公司於月報中所揭露之平均信用評級視為該檔基金之信用評級。納入計算之資產項目：包括債券直接投資及債券型共同基金部位(如適用)，故不包含現金及約當現金。平均信用評級之計算方式：針對各信用評等分別給予一個分數，並依據基金所持有之各別信用評等的比重(排除現金部位)進行加權平均，取得分數所對應之信用評級。

路博邁證券投資信託股份有限公司獨立經營管理 臺北市信義區忠孝東路五段68號20樓 電話(02) 8726 8280。

本基金會經管核准或同意生效，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，不負責本基金會之盈虧，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本基金會之績效，有關基金應負擔之費用及投資風險等已揭露於基金公開說明書或基金簡式公開說明書，投資人可至公開資訊觀測站<http://mops.twse.com.tw>或本公司網站www.nb.com/taiwan查詢。本基金會相當比重投資於非投資等級之高風險債券，適合能承受高風險之非保守型投資人。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，故本基金會可能因利率上升、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。本基金會不適合無法承擔相關風險之投資人。本基金會最高可投資基金總資產15%於美國Rule 144A債券，該債券屬私募性質，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之風險。投資人投資以非投資等級債券為訴求之基金不宜占其投資組合過高之比重。基金配息率不代表基金報酬率，且過去配息率也不代表未來配息率；基金淨值可能因市場因素而上下波動。本基金會配息前未先扣除應負擔之相關費用，基金的配息及相關費用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。有關基金由本金支付配息之配息組成項目表已揭露於本公司網站www.nb.com/taiwan。投資遞延手續費N類型級別受益權單位之受益人，其手續費之收取將於買回時支付，且該費用將依持有期間而有所不同，其餘費用之計收與前收手續費類型完全相同，亦不加計分銷費用，投資未達(含)1、2、3年，遞延手續費率分別為3%、2%、1%，滿3年後即零遞延手續費，請詳閱基金公開說明書。投資新興市場可能比投資已開發國家有較大的價格波動及流動性較低的風險；其他風險可能包含必須承受較大的政治或經濟不穩定、匯率波動、不同法規結構及會計體系間的差異、因國家政策而限制機會及承受較大投資成本的風險。當該基金投資地區包含中國大陸及香港，投資人須留意中國市場之特定政治、經濟與市場等投資風險。投資於以外幣計價的基金，或要承擔匯率波動的風險，本基金會包含新臺幣、人民幣、美元、澳幣、南非幣計價級別，如投資人以非本基金會計價幣別之貨幣換匯後申購本基金會者，須自行承擔匯率變動的風險。本基金會將 ESG 投資納入主要投資重點，相關風險包括：永續投資主題基金之相關風險、ESG投資重點之集中度風險、目前 ESG 評鑑方法及資料之限制、投資缺乏標準之分類法、選擇主觀判斷之風險。前述相關風險說明請詳見公開說明書。本基金會之投資策略類型、投資策略與方法、排除政策、ESG實際投資比重等資訊，可至【FUND CLEAR基金資訊觀測站，境內基金資訊公告平台-ESG基金專區】或至【路博邁投信官網-ESG基金專區】查詢。有關基金之ESG資訊，投資人應於申購前詳閱基金公開說明書所載之基金所有特色或目標等資訊。投資人申購本基金會係持有基金受益憑證，而非本文提及之投資資產或標的。所提及公司及個股僅供說明之用，不代表任何金融商品之投資推介或建議。本基金會主要投資債券，投資風險包括債券發行人違約之信用風險、利率變動之風險、流動性風險及投資符合美國Rule 144A規定之債券風險及匯率變動風險。故本基金會風險報酬等級為RR3。風險報酬等級為本公司依照投信投顧公會「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：基金計價幣別匯率風險、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之風險。請投資人注意申購基金前應詳閱公開說明書，充分評估基金投資特性與風險，更多基金評估之相關資料(如年化標準差、Alpha、Beta及Sharpe值等)可至投信投顧公會網站之「基金績效及評估指標查詢專區」(https://www.sitca.org.tw/index_pc.aspx)查詢。

概要

| | 基金 | 績效指標 |
|------------|------|------|
| 平均到期殖利率(%) | 7.37 | 7.62 |
| 平均存續期間(年) | 7.36 | 6.95 |
| 債券檔數 | 74 | 759 |

債券類別分佈%

| | 基金 | 績效指標 |
|----------|-------|-------|
| 主權債 | 66.15 | 90.72 |
| 企業債 | 12.75 | 0.00 |
| 類主權債 | 8.37 | 9.28 |
| 超國家組織債券 | 3.20 | 0.00 |
| 現金(含保證金) | 9.53 | 0.00 |