

普信(盧森堡)系列基金

全球新興市場債券型基金

(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

基金規模：美元5.184億

幣別：美元、歐元

基金淨值：A：美元21.62；歐元12.03；Ax：美元9.11；I：美元26.56

基金經理：Michael Conelius

管理費：A 1.25%；Ax 1.25%；I 0.65%

晨星評級：A★★★★；A(歐元)★★★；I★★★★

註冊地：盧森堡

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2020年2月29日；以主要類股計算同類型平均)

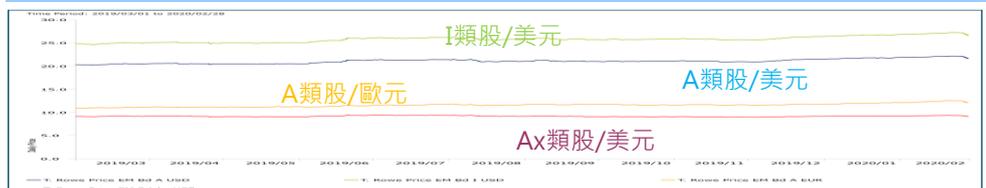
| | 成立日期 | 3個月 | 6個月 | 今年以來 | 1年 | 2年 | 3年 | 5年 | 成立以來 |
|-------------------|-------------|------|------|-------|------|------|-------|-------|--------|
| A類股(美元) | 2006年6月27日 | 3.05 | 2.81 | 0.37 | 6.08 | 6.98 | 10.64 | 29.38 | 116.20 |
| A類股(歐元) | 2016年6月30日 | 3.05 | 3.27 | 0.53 | 6.27 | 7.27 | 10.64 | - | 18.95 |
| Ax類股(美元) | 2017年8月23日 | 3.02 | 2.82 | 0.44 | 6.16 | 7.09 | - | - | 7.33 |
| I類股(美元) | 2004年12月31日 | 3.27 | 3.19 | 0.53 | 6.84 | 8.45 | 12.97 | 33.87 | 165.60 |
| 台灣同類型 基金平均(美元) | | 2.49 | 2.40 | -0.03 | 7.15 | 6.40 | 12.06 | 22.36 | - |

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

本基金主要投資於高度分散的全球投資組合，包含高收益型公司債券、可轉換證券與特別股，為投資人創造最大之總報酬。此基金符合可轉換證券集合投資事業規定之複雜型基金。

基金淨值走勢圖(美元、歐元一年期；資料來源：晨星；截至2020年2月29日)



債信評等分析(資料來源：普信；截至2020年2月29日)

| | 佔基金% | 基金 vs 指標% |
|----------|------|-----------|
| 美國政府代理證券 | 0.1 | 0.1 |
| AA | 0.0 | -6.4 |
| A | 4.5 | -13.0 |
| BBB | 29.5 | -2.6 |
| BB | 23.7 | 9.8 |
| B | 31.5 | 7.2 |
| CCC | 6.7 | 2.6 |
| CC | 0.1 | -0.5 |
| C | 0.2 | 0.2 |
| 違約 | 1.0 | 1.0 |
| 未評等 | 0.7 | -0.3 |
| 現金 | 2.1 | 2.1 |

註：債信評等是以穆迪投資人服務公司的評等為主，如果穆迪並未給予該證券評等，則以標普為第二評等來源。如果穆迪和標普皆未給予該證券評等，則普信會採用惠譽對該證券的評等。普信使用潛在投資工具的評等在信用違約交換上。

投資組合分析(資料來源：普信；截至2020年2月29日)

| | 基金 | 指標 |
|-----------|-------|-------|
| 持股數 | 251 | 793 |
| 平均債信評等* | BB- | BB+ |
| 平均到期期間(年) | 10.97 | 11.76 |
| 存續期間(年) | 7.63 | 7.62 |
| 到期收益率 | 5.31% | 4.98% |
| 平均票面利率 | 6.24% | 5.70% |
| 目前收益率 | 6.68% | - |

註：平均債信評等是通過穆迪加權平均評等和標準普爾加權平均評等的簡單平均(50/50分配)獲得，與這些信評機構各自實際評估的資產佔組合的百分比無關。

投資組合相關數據(資料來源：普信；截至2020年2月29日)

| 5年期 | I類股 | 指標 |
|-----------|--------|-------|
| 年化標準差(%) | 6.34% | 5.35% |
| Alpha值(%) | -0.48% | 0.00 |
| Beta值 | 1.12 | 1.00 |
| R平方 | 0.88 | 1.00 |
| 資訊比率 | 0.01 | 0.00 |
| 夏普值 | 0.77 | 0.90 |
| 追蹤誤差(%) | 2.31% | 0.00% |

投資地區%(資料來源：普信；截至2020年2月29日)

| | 佔基金% | 基金 vs 指標% |
|------|------|-----------|
| 巴西 | 14.2 | 11.2 |
| 墨西哥 | 7.6 | 2.9 |
| 印尼 | 6.8 | 2.4 |
| 烏克蘭 | 5.9 | 3.5 |
| 土耳其 | 4.1 | 0.8 |
| 南非 | 3.7 | 1.3 |
| 埃及 | 3.0 | 0.6 |
| 巴哈馬 | 2.9 | 2.9 |
| 阿根廷 | 2.8 | 1.5 |
| 斯里蘭卡 | 2.7 | 0.7 |
| 中國 | 2.6 | -1.5 |
| 以色列 | 2.5 | 2.5 |
| 哥倫比亞 | 2.5 | -0.4 |
| 奈及利亞 | 2.3 | 0.7 |
| 薩爾瓦多 | 2.2 | 1.2 |

存續期間分析(資料來源：普信；截至2020年2月29日)

| | 佔基金% | 基金 vs 指標% |
|-------|------|-----------|
| 1年以下 | 2.2 | 1.8 |
| 1~3年 | 5.4 | -9.7 |
| 3~5年 | 26.5 | 4.8 |
| 5~7年 | 26.2 | 6.0 |
| 7~10年 | 10.2 | -3.4 |
| 10年以上 | 27.5 | -1.5 |
| 現金 | 2.1 | 2.1 |

【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。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投資網(fund.marbo.com.tw)或境外基金資訊觀測站(www.fundclear.com.tw)查詢。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，且投資人投資以高收益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，本基金配息前未先扣除應負擔之相關費用。本資料僅供專業投資人參考，非投資推薦所用。

此基金屬普信(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，均出自普信。

「T. Rowe Price, Invest with Confidence」及「大角羊」圖樣均為普信集團公司之註冊商標，未經授權不得擅自使用。

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，2020年2月29日。