

## Fidelity Funds - Sustainable Strategic Bond Fund

# 富達基金 - 永續發展策略債券基金 (本基金有相當比重投資於非投資等級之高風險債券) 原名為富達基金 - 全球策略債券基金

2021年3月31日

### 基本資料

基金經理人	Timothy Foster, Claudio Ferrarese
計價貨幣	美元
基金規模	637.13 (百萬美元)
每年管理費	1.0% (A 股級別)
風險報酬等級	RR3
富達通代碼	2310

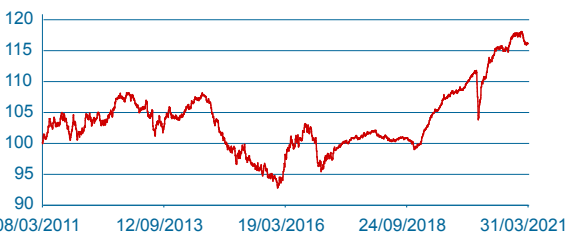
### 基金組別

全球債券 - 靈活策略

### 投資目標

本基金主要(即至少 70%之資產)透過全球不同類型固定收益證券的靈活配置,以追求資本增值與收益極大化為目標。本基金屬於富達永續發展型基金家族並採用永續重點策略,根據該策略,如「1.3.2(b)富達永續發展型基金家族」一節所述,基金淨資產至少 70%將投資於被視為具有永續發展特色之證券。該基金將持續考慮多種環境及社會特色。環境特色包括但不限於緩解並適應氣候變遷、水資源及廢棄物管理及生物多樣性,而社會特色包括但不限於產品安全、供應鏈、健康及安全以及人權。涉及環境及社會特色之爭議受定期監控。環境及社會特色由富達基礎分析師分析並透過富達永續發展評級進行評級,該基金透過遵循富達永續發展型基金家族框架以提升該等特色。本基金將採取主動式的資產配置策略,資產可涵蓋但不限於高收益債券與新興市場。投資標的並無最低的信用評等要求限制。本基金可將其淨資產直接投資於在中國認可市場掛牌上市或交易的中國境內固定收益證券。本基金採主動式管理,僅於進行績效比較時參考 ICE BofA Q945 Custom Index (政府、投資等級及高收益公司債券指數的定製混合) (「指數」)。股東應注意,指數並未整合環境及社會考慮因素;而係如上文所述,該基金透過遵循富達永續發展投資框架提升環境及社會特色。

### 指數化績效走勢 A 股-累計-美元



註:圖形顯示以基金成立日起重新修訂為基數 100 的表現

### 累計表現 (%)

股份類別	年初至今	3 個月	6 個月	1 年	2 年	3 年	5 年	成立至今
A 股-累計-美元	-1.27	-1.27	1.04	8.80	11.20	15.05	17.34	16.20
A 股-累計-歐元(避險)	-1.39	-1.39	0.59	7.70	6.93	7.41	8.67	20.30
Y 股-累計-歐元(避險)	-1.25	-1.25	0.96	8.38	8.19	8.93	11.03	26.80
A 股-歐元(避險)	-1.41	-1.41	0.57	7.77	6.93	7.16	8.58	20.29

資料來源:晨星,按資產淨值或買入價變化(以原幣計算),以及假設所有股息作再投資計算。基金淨值與收益可漲可跌,過去績效不代表未來績效之保證。有關個別股份類別的成立日期,請參閱「股份類別及代碼」。

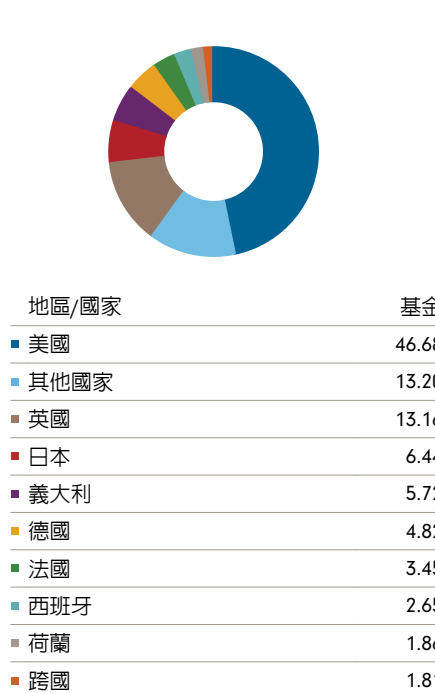
### 前十大持債 資料日期 2021年3月31日

基金	金額
USTN 2.625% 12/15/21	17.50
USTN .875% 11/15/30	7.67
JAPAN GOVT 0% 06/16/21	4.95
USTN 1.125% 02/15/31	3.31
USTN .625% 05/15/30	2.56
USTN 2.25% 04/30/24	2.10
JAPAN GOVT .1% 12/20/29	1.49
UK GILT 4.75% 12/07/30 RGS	1.25
IBRD 1.25% 02/10/31	1.17
KFW (UNGTD) 0% 06/15/26 RGS	1.13

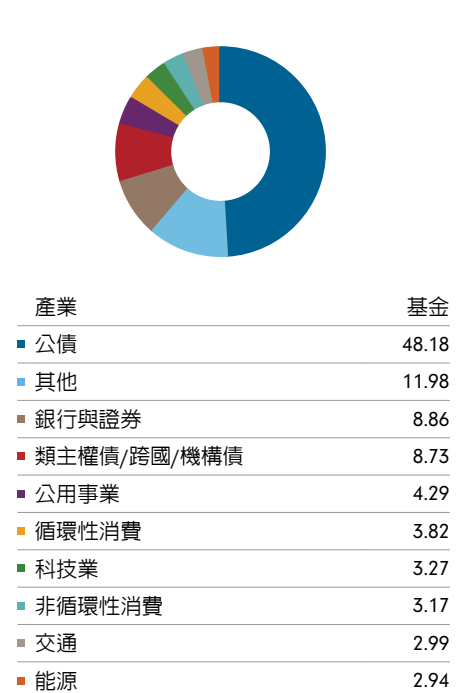
### 前五大持債量最高之發債者(%) 資料日期 2021年3月31日

基金	金額
(T) United States of America	35.67
(JTDB) JAPAN GOVT 0% 06/16/21	4.95
(UKT) United Kingdom Of Great Britain	2.47
(TII) United States of America	1.99
(BTPS) Buoni Poliennali Del Tes	1.61

### 地區/國家分佈(%) 資料日期 2021年3月31日



### 產業分佈(%) 資料日期 2021年3月31日



上述投資組合為前十大國家或產業分佈

晨星星號評級之資料來源為 Morningstar 截至 31/03/2021。晨星基金績效綜合星號評等: 將至少成立 36 個月報酬率、且同類組別基金超過五支的基金提供三年、五年和十年的星號評級,再以此三個年期的加權評級結果,計算出綜合星號評級。  
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,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,不宜作為投資唯一依據,投資人仍應注意所投資基金個別風險。

# Fidelity Funds - Sustainable Strategic Bond Fund

## 富達基金 - 永續發展策略債券基金 (本基金有相當比重投資於非投資等級之高風險債券)原名為富達基金 - 全球策略債券基金

2021年3月31日

### 衡量指標

年化標準差 (3年) %	4.13
貝他係數 (3年)	-
夏普比率 (3年)	0.82
到期收益率 %	1.92
目前收益率 %	2.63
有效存續期	3.70
平均信用評級 (線性)	A
資產類別- 投資級別 (國庫券除外) %	30.26
資產類別- 高收益債券 %	21.32

### 對比指數

ICE BofAML Q944 Custom Index Hedged to USD

### 股份類別及代碼

股份類別	成立日期	基金淨值	彭博代碼	ISIN 基金代碼
A 股-累計-美元	08/03/2011	11.62	FFGSAAU LX	LU0594300849
A 股-累計-歐元(避險)	08/03/2011	12.03	FFGSAE LX	LU0594300682
Y 股-累計-歐元(避險)	08/03/2011	12.68	FFGSYAE LX	LU0594301144
A 股-歐元(避險)	08/03/2011	10.52	FFGSAEH LX	LU0594301060

### 歷年表現 (%)

股份類別	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020
A 股-累計-美元	-	5.48	-3.44	-3.88	-5.53	2.25	5.44	-1.87	10.11	7.00
A 股-累計-歐元(避險)	-	6.70	-1.00	2.39	-2.51	2.49	2.16	-4.66	6.83	5.35
Y 股-累計-歐元(避險)	-	7.53	-0.72	2.89	-1.76	2.95	2.43	-4.24	7.35	5.94
A 股-歐元(避險)	-	6.69	-1.13	2.33	-2.44	2.40	2.35	-4.81	6.82	5.35

資料來源：晨星，按資產淨值或買入價變化(以原幣計算)，以及假設所有股息作再投資計算。基金淨值與收益可漲可跌，過去績效不代表未來績效之保證。有關個別股份類別的成立日期，請參閱“股份類別及代碼”。

### 信用評級(%) 資料日期 2021年3月31日

	基金
AAA/Aaa	37.35
AA/Aa	8.33
A	12.10
BBB/Baa	20.65
BB/Ba	13.36
B	6.81
CCC and Below	1.18
未分類	1.36
現金及約當現金	-1.14
合計	100.00

### 貨幣分佈(%) 資料日期 2021年3月31日

	基金
美元	100.30
HUF	0.25
日圓	0.09
其他	0.00
英鎊	-0.04
歐元	-0.60
合計	100.00

因小數點後位數四捨五入之故,總和可能不完全等於 100%

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，投資人應選擇適合自身風險承受度之投資標的。債券價格與利率呈反向變動，當利率下跌，債券價格將上揚；而當利率上升，債券價格將會走跌。投資於避險級別時，須考量如外匯及交易對手違約等其他因素之風險導致避險級別的整體總收益減少。高收益債券基金適合尋求投資固定收益之潛在收益且能承受較高風險之非保守型投資人，投資人投資以高收益債券為訴求之基金不宜占其投資組合過高之比重，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，高收益債券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，投資人應審慎評估。高收益債券基金不適合無法承擔相關風險之投資人。平均債信評等係依據各投資標的之信評機構(標準普爾、穆迪及惠譽)信評，以線性加權平均法計算其發行人的債信品質，每個發行人的債信權重等於其市值權重，所計算之平均最終值都是最接近標準普爾的信用評級。計算範圍包含基金中所有投資標的，還有衍生性金融商品。基金配息率不代表基金報酬率，且過去配息率不代表未來實際的配息率；基金淨值可能因市場因素而上下波動。投資人應注意基金淨值及收益可漲可跌。依金管會規定，境外基金投資大陸地區之有價證券以掛牌上市有價證券及銀行間債券市場為限，且投資前述有價證券總金額不得超過本基金淨資產價值之 20%，當該基金投資地區包含中國大陸及香港，基金淨值可能因為大陸地區之法令、政治或經濟環境改變而受不同程度之影響。各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，不負責各基金之盈虧，亦不保證最低之收益，文中提及之經濟走勢預測不必然代表本基金之績效，以上所提及之個股或公司，僅是作為說明或舉例之用途，並非推薦或投資建議。各基金投資風險投資人申購前應詳閱基金公開說明書。有關基金應負擔之費用(境外基金含分銷費用)已揭露於基金之公開說明書或投資人須知中。投資人索取公開說明書或投資人須知，可至富達投資服務網 <http://www.fidelity.com.tw> 或境外基金資訊觀測站 <http://www.fundclear.com.tw> 查詢，或洽富達投信或銷售機構索取。富達投信獨立經營管理，電話 0800-00-9911。台北市信義區忠孝東路五段 68 號 11 樓。FIL Limited 為富達國際有限公司。富達證券投資信託股份有限公司 為 FIL Limited 在台投資 100% 之子公司。Fidelity 富達, Fidelity International, 與 Fidelity International 加上其 F 標章為 FIL Limited 之商標。