

2021年2月28日

目標與策略

目標：本基金投資主題聚焦全球 ESG 與信用評級較佳之企業與國家機構債券，為投資人同時兼顧信用評等優質債券投資機會，與環境保護(E)、社會責任(S)以及公司治理(G)等聯合國永續發展目標。

策略：本基金運用量化模組，分析追求全球 ESG 企業與國家機構發行之債券中較佳的投資機會，並藉由風險控管工具審慎監控投資組合波動度，以期達到長期較佳的風險報酬結果。

基本資料

成立日期	2020/1/30
幣別	新台幣、人民幣、美元、澳幣及南非幣
基金屬性	債券型
參考指標	無
註冊地	台灣
成立價格	10元新台幣
基金淨值	10.1412元新台幣(不配息A類型) 9.7036元新台幣(月配息B類型) 9.7038元新台幣(月配息N類型) 10.4384元新台幣(不配息I類型) 10.5381元人民幣(不配息A類型) 9.8873元人民幣(月配息B類型) 9.8874元人民幣(月配息N類型) 10.4748元美元(不配息A類型) 10.0298元美元(月配息B類型) 10.0298元美元(月配息N類型) 10.2384元澳幣(不配息A類型) 9.8543元澳幣(月配息B類型) 9.8544元澳幣(月配息N類型)

風險級數	RR2
資產總規模	235.06億元新台幣
總持債數	191
平均殖利率	2.42%
平均存續期間	5.76年
基金管理費	1.35%
基金保管費	0.20%
經理公司	柏瑞證券投資信託股份有限公司
投資顧問公司	PineBridge Investments LLC
保管機構	台北富邦商業銀行
基金經理人	施宜君
彭博代碼	PIEQBAT TT(新台幣A類型) PIMDBTI TT(新台幣B類型)
年化配息率	4.88%
(新台幣B類型)	月報酬率-1.42%，月配息率 0.41%



柏瑞證券投資信託股份有限公司

柏瑞證券投資信託股份有限公司 本基金會經金融監督管理委員會核准，惟不表示絕無風險。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。...

◎基金基本資料來源：柏瑞投信，除特別標明外，所有資料日期皆截止於 2021/2/28。 ◎本文件所載意見可能改變而不另行通知。本公司無意藉此作任何徵求或推薦。 ◎柏瑞投信由旗下多家國際公司組成，並致力為世界各地之客戶提供專業投資建議、投資產品及資產管理服務。◎柏瑞投信乃是 PineBridge Investments IP Holding Company Limited 之註冊商標。 ◎風險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之風險。...

柏瑞 ESG 量化債券基金 (本基金有一定比重得投資於非投資等級之高風險債券且配息來源可能為本金)

PineBridge Global ESG Quantitative Bond Fund

績效表現-累積 (%)

期間	3個月	6個月	年初至今	一年	二年	三年	五年	成立以來
新台幣 A 類型	-1.84	-0.74	-2.20	0.95	-	-	-	1.41
美元 A 類型	-1.09	1.04	-1.95	4.25	-	-	-	4.75

資料來源：Lipper；2021/2/28

主要持債

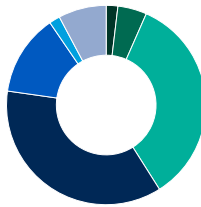
名稱	國家	產業	持債比率
UAL 5 7/8 10/15/27	美國	循環性消費	2.12%
MS 3.622 04/01/31	美國	金融	1.86%
DELL 8.35 07/15/46	美國	科技	1.47%
SANTAN 2 1/8 02/08/28	西班牙	金融	1.45%
NWG 3.622 08/14/30	英國	金融	1.44%
總計			8.34%

資產配置

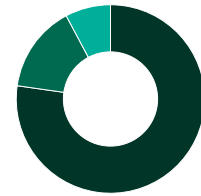
● 幣別配置 美元 54.74%、歐元 31.35%、英鎊 10.31%及其他 3.60%

● 信評 (依 Standard & Poor's Corporation 之評等)

● 類別



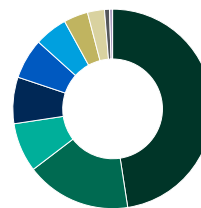
AAA	1.89%
AA	4.70%
A	34.44%
BBB	36.22%
BB	13.21%
B	1.76%
約當現金	7.78%



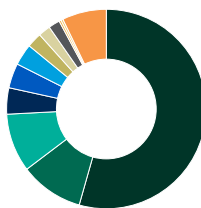
投資級債	77.25%
高收益債	14.97%
約當現金	7.78%

● 產業

● 國家



金融	43.87%
循環性消費	15.73%
能源	7.36%
原物料	6.95%
科技	6.03%
工業	4.92%
非循環性消費	3.62%
通訊	2.54%
多元控股公司	0.75%
公用事業	0.45%



美國	50.16%
英國	9.50%
法國	8.74%
德國	3.93%
荷蘭	3.70%
中國	3.21%
瑞士	2.24%
愛爾蘭	1.81%
澳洲	1.70%
丹麥	0.31%
義大利	0.31%
其他	6.61%

註：因小數點後位數四捨五入之故，總合可能不完全等於 100.0% 本基金持有受任一信評機構評等或未評等之債券，本圖表以 S&P 評比為主