

聯博-房貸收益基金(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)

AllianceBernstein - Mortgage Income Portfolio

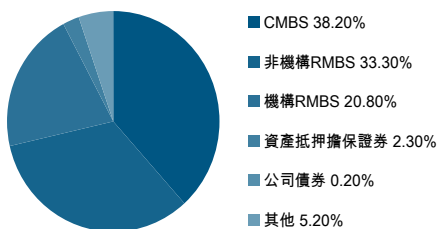
資料截至2014/11/30止

基金目標與策略

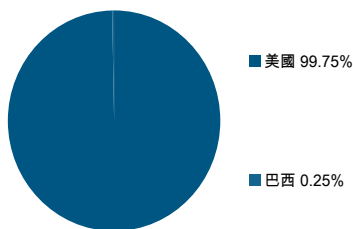
本基金追求較高的風險調整後總報酬。投資組合可布局於投資等級及非投資等級之房貸相關證券及其他資產擔保證券，且投資組合至少2/3的資產將會投資於房貸相關證券。

投資組合配置

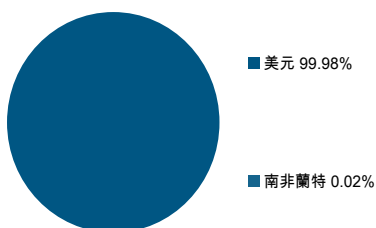
類股分佈



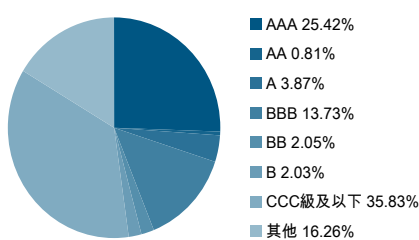
國家分佈



貨幣分佈



信評分佈



累積總報酬(%)

(資料來源: Lipper, 原幣計價, 含息)

	成立日期	3個月	6個月	1年	2年	3年	成立迄今
A2 級別 美元	02/20/2014	-0.13	0.46	-	-	-	2.53
AA 級別 美元	02/20/2014	-0.17	0.39	-	-	-	2.44
AA 澳幣避險級別	02/21/2014	0.41	1.54	-	-	-	4.07
A2X 級別 美元	11/17/2000	-0.09	0.46	2.82	5.60	7.05	14.93
ATX 級別 美元	12/08/2004	-0.12	0.57	2.76	5.67	7.18	5.61
參考指數		0.06	0.12	0.23	0.50	0.97	33.04

參考指數成立迄今係指A2X級別之成立日迄今。AA與ATX級別為含息計算(假設配息滾入再投資)。信用評等以標準普爾、穆迪及惠譽所訂之最高信評作為分類標準。

前十大持債

	比率(%)
FNMA 5.00%, 4/01/19 - 8/01/44	3.25
FNMA 4.00%, TBA	2.86
GNMA 2014 5.00%, 8/20/41	1.35
FNMA 4.00%, 2/01/42	1.34
Morgan Stanley Capital 5.544%, 11/12/49	0.93
Alternative Loan Trust 2005 5.00%, 8/25/35	0.80
Commercial Mortgage Pass Through 2012 4.927%, 10/15/45	0.80
Alternative Loan Trust 2006 6.00%, 8/25/36	0.77
FHLM 2013 7.305%, 7/25/23	0.76
CHL Mortgage Pass-Through 6.50%, 10/25/37	0.74
總計	13.60

基金資料

註冊地點	盧森堡
基金成立日	02/20/2014(A2級別)
基金規模	\$408.91百萬美元
申購/贖回	每日
基準貨幣	美元
其他計價貨幣	無
避險股份類別	澳幣、南非幣
參考指數	3個月期美元倫敦銀行同業拆款利率
下單截止時間	美國東部時間 4:00 p.m.
平均存續期(年)	2
平均信用評等	BB
管理費	1.10% (A2與AA穩定月配級別)
風險報酬等級	RR3*
3年年化標準差	-
基金管理團隊	Douglas J. Peebles Jon Denfeld Michael S. Canter

*本基金為債券型基金，主要投資於美國投資等級及非投資等級的房貸相關證券，故本基金風險報酬等級為RR3。風險報酬等級係依基金類型、投資區域或主要投資標的/產業，由低至高，區分為RR1~RR5五個風險報酬等級。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的風險。房貸避險級別採用避險技術，試圖降低(但非完全消除)避險級別計價貨幣與基金基準貨幣間的匯率波動，期能提供投資人，更貼近基準貨幣級別的基金報酬率。年化標準差來源為Lipper。

基金淨值資訊

	基金淨值	Bloomberg	ISIN
A2 級別 美元	15.38	ASMA2US LX	LU1021288185
AA 級別 美元	14.66	ASMAAUS LX	LU1021288698
AA 澳幣避險級別	14.64	ASMDAAH LX	LU1021288854
A2X 級別 美元	10.93	ALSMPAU LX	LU0102830279
ATX 級別 美元	7.18	ACSMUAT LX	LU0173640490

聯博-房貸收益基金(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)(AllianceBernstein-Mortgage Income Portfolio)在2014年2月20日更名，舊名為聯博-短期債券基金(AllianceBernstein Short Maturity Portfolio Portfolio)。該基金之投資策略及指標也更改，詳細內容請參考基金公開說明書及投資人須知。本基金舊名為聯博-短期債券基金，從2014年2月20日起，原A、A2、AT、B、B2、BT、C、C2、I、I2及S1級受受益憑證變更為AX、A2X、ATX、BX、B2X、BTX、CX、C2X、IX、I2X及S1X級受受益憑證，而且不再開放予新投資者申請，並成立新A、A2、B、B2、AA(穩定月配)、BA(穩定月配)、I2及S1級別。所有在2014年2月20日之前的績效及數值皆屬於聯博-短期債券基金。

聯博基金(AllianceBernstein)在台灣的總代理為聯博證券投資信託股份有限公司。聯博證券投資信託股份有限公司 台北市110信義路五段7號81樓及81樓之1 02-8758-3888 聯博投信獨立經營管理。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。投資人於申購時應謹慎考量。AA穩定月配息級別為配息前未扣除基金應負擔之相關費用的級別。配息可能涉及本金之個別基金最近12個月內配息組成相關資料已揭露於聯博投信網站。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。基金高收益債券之投資占顯著比重者，適合「能承受較高風險之非保守型」之投資人。本基金經金管會核准或同意生效，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。有關基金應負擔之費用(含分銷費用)及投資風險等已揭露於基金公開說明書中譯文及投資人須知，投資人可至境外基金資訊觀測站www.fundclear.com.tw或聯博網站www.alliancebernstein.com.tw查詢，或請聯絡您的理財專員，亦可洽聯博投信索取。© 2014 AllianceBernstein L.P.