

駿利平衡基金

A 級別 · 截至 2017 年 10 月 31 日

駿利亨德森投資

全方位的核心解決方案結合駿利對股票和固定收益型商品之最佳研究

我們相信，利用我們由下而上、基本的股票和固定收益研究，並以動態的模式來進行資產配置，長期而言，我們的績效將超越基本指標或同類型商品。我們股票和固定收益之整合研究團隊，在各市場循環期間，尋求各類資產類別所帶來機會之最佳平衡。

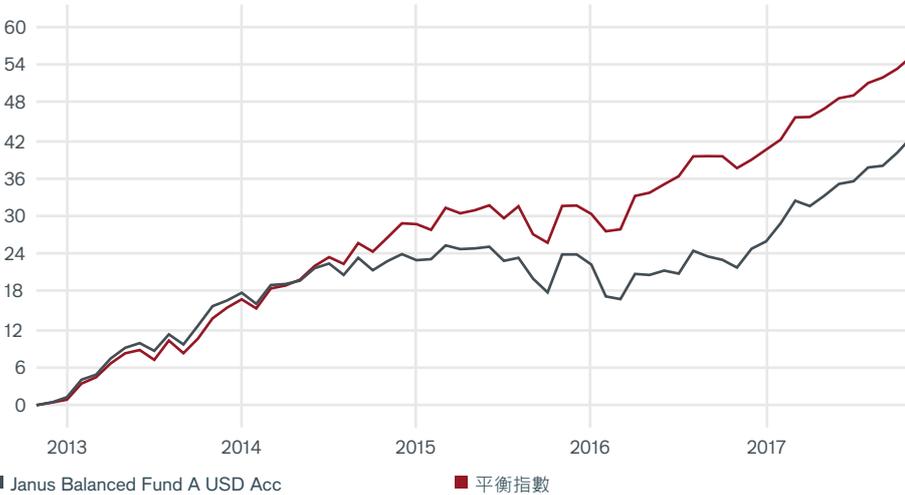
年度化表現 (%)

	1年	3年	5年	10年	2016	2015	2014	2013	2012	成立至今	
										A 美元 累計	A 歐元 累計對 沖
A 美元累計	17.03	5.09	7.35	5.14	3.01	-0.56	4.39	16.39	11.45	5.35	-
A 歐元累計對沖	14.55	3.69	6.34	4.34	1.39	-1.18	4.22	15.86	10.73	-	4.69
基準指數	12.93	7.08	9.22	6.32	7.84	1.25	10.23	15.81	10.72	5.79	-
類別平均值 A 美元累計	10.56	3.85	4.94	2.11	4.43	-2.83	2.09	9.76	9.73	3.85	-
百分位排名 A 美元累計	6	28	8	2	72	22	29	12	31	-	-

累積報酬率 (%)

	1個月	3個月	年初至今	1年	3年	5年	10年	成立至今	
								A 美元累計	A 歐元累計 對沖
A 美元累計	1.79	3.52	13.17	17.03	16.07	42.56	65.00	167.30	-
A 歐元累計對沖	1.63	2.96	11.17	14.55	11.48	35.97	53.01	-	126.36
基準指數	1.31	2.83	10.57	12.93	22.78	55.39	84.58	189.12	-
百分位排名 A 美元累計	16	12	20	6	28	8	2	-	-

累積績效表現 (%)



過去業績並非未來績效之保證。基金表現資料來源：晨星。計算基準：總報酬率、淨值對淨值及原幣計算，收益再投資。
駿利美國平衡基金(Janus US Balanced Fund)已更名為駿利平衡基金(Janus Balanced Fund)，並自 2011 年 12 月 1 日生效。基金之投資目標與策略不變。英國晨星有限公司(Morningstar UK Limited)，版權所有©2017。保留所有權利。本文此處所含資訊為：(1)晨星公司和/或其內容供應商專屬資料；(2)禁止翻印或傳閱；且(3)不保證其正確、完整和即時性。任何使用本資訊所產生之損害或虧損，晨星公司及其內容供應商一概不承擔責任。若該基金成立期少於三年，或評級低於三顆星，則不表列晨星之評等。平衡指數(The Balanced Index)為綜合指數，其組成為：S&P 500 指數佔 55%、巴克萊美國綜合債券指數(Barclays US Aggregate Bond Index)佔 45%。駿利美國平衡基金的投資目標已於 2010 年 4 月 27 日有所更動，詳情請參考公開說明書。該基金管理團隊維持不變。

僅供機構法人使用

要點

- 將資產有策略性地配置到股票和固定收益等資產類別
- 利用駿利對股價和固定收益性商品的整合研究流程
- 以由下而上、基本的股票和信用研究來鎖定投資對象

主要風險

- 投資風險
- 利率和信用風險
- 高收益債券
- 外人直接投資風險

基金資料

基金經理人	Marc Pinto, CFA; Darrell Watters; Jeremiah Buckley, CFA; Mayur Saigal
管理基金日期	1 May 2005; 31 Dec 2015; 31 Dec 2015; 31 Dec 2015
基本貨幣	美元
註冊地點	愛爾蘭
基準指數	平衡指數
類別	美元平衡型股債混合
基金規模 (百萬美元)	\$693.3
(百萬歐元)	€595.2
交易日	每日

	A 美元累計	A 歐元累計對沖
成立日期	1998 年 12 月 24 日	1999 年 12 月 31 日
資產淨值	\$26.73	€27.48
ISIN 代碼	IE0004445015	IE0009514989
SEDOL	0053543	B7VCVD3
彭博	JANBAA1	JABAA1E
晨星星號評級	★★★★★	★★★★★

風險特點

	A 美元累計	基準指數
阿爾法系數 (Alpha)	-2.07	-
貝他系數 (Beta)	1.03	-
R 平方值	83.35	-
年度化標準偏差 (Standard Deviation)	6.20	5.46
追蹤誤差	2.53	-
夏普比率 (Sharpe Ratio)	0.78	1.22
信息比率	-0.79	-

基金特點

持股總數	612
投資組合周轉率	78%
加權平均市值 (十億美元)	\$163.9
(十億歐元)	€140.7
市值中位數 (十億美元)	\$56.4
(十億歐元)	€48.4
活躍股份	76.77

[†]來源：晨星(Morningstar) 三年追蹤，以花旗(Citigroup)三個月美國國庫券指數來作為無風險率收益率
[‡]來源：駿利亨德森投資

資產分佈(%)

股票	63.51
美國普通股	62.30
非美國普通股	1.08
美國特別股	0.13
固定收益	35.95
投資等級信貸	15.70
不動產抵押貸款證券	9.14
政府債券	4.86
高收益	2.63
資產抵押證券 (ABS)	1.69
商用不動產抵押債券 (CMBS)	1.41
銀行貸款	0.52
現金/與現金相等值	0.54

行業分佈(%)

股票	63.51
資訊科技	16.99
非核心消費	9.78
工業	8.81
金融	7.75
健康護理	7.60
核心消費	6.83
房地產	2.51
原物料	2.16
能源	1.08
固定收益	35.95
美國工業	11.25
不動產抵押貸款證券	9.14
美國金融	5.34
政府/機構	4.86
資產抵押證券 (ABS)	1.69
商用不動產抵押債券 (CMBS)	1.41
非美國工業	1.40
美國公用事業	0.70
非美國金融	0.16
現金/與現金相等值	0.54

前十大國家分佈(%)

美國	96.83
加拿大	1.33
比利時	0.47
英國	0.30
荷蘭	0.19
法國	0.18
愛爾蘭	0.16

市值分佈(%)

1,000 億美元或以上	27.28
500 至少於 1,000 億美元	18.09
100 至少於 500 億美元	15.91
50 至少於 100 億美元	1.11
10 至少於 50 億美元	0.99
不適用	0.13

10 大持股(%)

Microsoft Corp	3.7
Mastercard Inc	3.0
Boeing Co	2.7
Alphabet Inc	2.3
Adobe Systems Inc	2.0
Altria Group Inc	1.9
CME Group Inc	1.9
LyondellBasell Industries NV	1.9
Apple Inc	1.9
Amgen Inc	1.8
總計	23.1

來源：駿利亨德森投資

重要資訊

本文內容僅供資料參考或一般使用，而非就任何個別客戶的要求而訂制。並(a)於歐洲由英國金融行為監管局認可及監管的 Janus Capital International Limited ("JCIL")發行；及(b)於杜拜由杜拜金融服務局認可及監管為代表辦事處的 Janus Capital International Limited ("JCIL")發行。駿利資產管理基金乃根據愛爾蘭法律成立的可轉讓集體投資企業，基金之間各負獨立責任。駿利資產管理基金(以下簡稱「本基金」)之持股可能無法直接或間接向美國人士發行或出售，也可能無法在禁止發行或出售該股份的轄區發行或銷售。針對美國人士之定義，請參見最新之基金公開說明書。該說明書本暨相關的主要投資人資訊文件(KIID)，可於下列網站下載：<https://en-us.janushenderson.com/offshore>。部分轄區已經核准本基金之公開銷售，但有些轄區則可能僅能以私募豁免形式發行。本基金持股經註冊為公開分銷之所在國家清單，請瀏覽 <https://en-us.janushenderson.com/offshore>。若您不確定您的客戶所在轄區是否銷售本基金，請洽詢您的駿利代表。任何意欲分銷和/或購買本基金持股之人士，有責任遵循該基金持股或任何相關文獻預期分銷或販售之轄區內所有適用法令和規章。本文件並不構成法律、稅務或投資建議，也不具邀約或銷售本基金持股之目的，且不一定遵照所有適用行銷資料之當地法律。基金投資隱含風險，相關風險詳見基金公開說明書和主要投資人資訊文件(KIID)。金融顧問應負責決定所投資的基金和哪些股份類別是否適合他們的客戶。基金內持股之價值和其進帳收入有所波動，投資人可能無法全額回收投資本金。過往績效並非未來表現之保證。本基金投資未投保美國聯邦存款保險公司(FDIC)保險，並不可能出現虧損，銀行也未提供擔保。Janus Capital Management LLC, Janus Capital Singapore Limited, INTECH Investment Management LLC 和 Perkins Investment Management LLC 為 Janus Capital International Limited 基金的投資顧問。只供專業投資者專用

查詢詳情

☎ 800.668.0434

✉ investmentprofessional@janushenderson.com

📄 或請與財務顧問/中機構聯絡