

# 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—多空策略基金

## 投資人須知【第一部分：基金專屬資訊】

刊印日期：108年8月2日

- (一)投資人申購前應詳閱投資人須知（包括第一部分及第二部分）與基金公開說明書中譯本。  
 (二)境外基金係依外國法令募集與發行，其公開說明書、財務報告、年報及績效等相關事項，均係依該外國法令規定辦理，投資人應自行了解判斷。

壹、基本資料			
基金中英文名稱	富蘭克林坦伯頓全球投資系列—多空策略基金/Franklin Templeton Investment Funds – Franklin K2 Alternative Strategies Fund	成立日期	2014年9月15日
基金發行機構	富蘭克林坦伯頓全球投資系列基金	基金型態	開放式公司型
基金註冊地	盧森堡	基金種類	平衡型
基金管理機構	富蘭克林坦伯頓國際服務有限公司 (Franklin Templeton International Services S. à.r.l.)	國內銷售基金級別	美元A(acc)股
基金管理機構註冊地	盧森堡	計價幣別	美元
總代理人	富蘭克林證券投資顧問股份有限公司	基金規模	22億7仟萬美元 (2019年6月30日)
基金保管機構	摩根大通銀行	國人投資比重	0.10% (2019年6月30日)
基金總分銷機構	富蘭克林坦伯頓國際服務有限公司	其他相關機構	無
收益分配	無	基金保證機構	無；本基金非保證型基金
績效指標 benchmark	ICE美銀美林美國三個月國庫券指數 (ICE BofAML US 3-Month Treasury Bill Index)-本指數追蹤於美國當地市場發行之剩餘到期期限低於3個月以美元計價之美國國庫券的績效表現。HFRX全球對沖基金指數(HFRX Global Hedge Fund Index)-本指數包括所有合格的對沖基金策略，主要的四個策略與本基金相同。此兩種指數僅為提供本基金績效額外參考資訊。基金並不依循該指標進行投資組合配置。	保證相關重要資訊	無；本基金非保證型基金
貳、基金投資標的與策略（簡介）			
(投資人請詳細閱讀本基金公開說明書中譯本「投資標的、主要投資政策與實務」章節之相關資訊。)			
<p>一、投資標的：本基金之投資目標在於追求資本增值，並且相對於廣泛的股票市場有較低的波動性。本基金為尋求達成其投資目標，配置其淨資產藉由多個非傳統或“另類投資”策略，包括但不限於部份或全部以下策略：股票對沖、相對價值、事件驅動，以及全球宏觀策略。</p> <p>二、投資策略：本基金得投資於廣泛的可轉換證券、衍生性金融商品工具以及其他合格證券。本基金得投資於全球各地之各類規模的股票及股票相關有價證券。債券投資也可廣及各類的固定或浮動利率、各種天期、各種債信等級債券(包括投資級、非投資級、低評級、沒有評級、以及/或是違約債券)、各類發行人債券(企業、政府)，也可能包括高收益級(垃圾級)債券和違約風險較高的不良債權債券(指可能瀕臨組織重整、財務重整或破產等事件的企業債券)。本基金也得為避險、效率投資組合管理以及/或是投資目的而運用金融衍生性商品。使用金融衍生性商品也可能導致本基金槓桿水準的實質性增加。</p>			
參、投資本基金之主要風險			
(投資人請詳細閱讀本基金公開說明書中譯本「主要風險」章節之相關資訊。)			
<p>本基金特有風險包括資產分配風險、股份等級避險風險、商品相關曝險風險、可轉換及混合證券風險、交易對手風險、信用風險、信用連結證券風險、違約債權證券風險、衍生性金融商品風險、股權風險、浮動利率公司債投資風險、外幣風險、避險策略風險、利率證券風險、流動性風險、低評等或非投資等級證券風險、市場風險、共同經理公司管理風險、績效費用風險、投資組合周轉率風險、提前還款風險、重整公</p>			

司風險、證券化風險、中小型公司風險、主權債券風險、結構型商品風險、顯著槓桿風險、互換交易協定風險等。基金之淨值可能因市場因素而產生波動，當基金淨值突然大幅滑落時，則變現或贖回所發生的虧損有可能很高（包含投資的所有損失）。境外基金係以外幣計價，基金所持有之證券亦可能用不同於基金的基本計價幣別來計價，匯率變動會影響基金股份的價值，也會影響配息的價值、基金所賺取得利息以及基金所實現的利得與虧損，投資人須承擔匯兌風險。本基金無受存款保險、保險安定基金或其他相關保障機制之保障。

#### 肆、本基金適合之投資人屬性分析

一、**本基金之風險程度：**本基金投資範圍廣及股票及債券，投資區域為全球，實際配置乃以美國等已開發國家為多，並且利用衍生性金融商品之多空配置，期使能夠達成其投資目標，故本基金風險報酬為RR3。此等級分類係基於一般市場狀況反映市場價格波動風險，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。本基金之主要風險包括信用風險及市場風險等，請詳閱基金公開說明書及投資人須知所載之主要風險資訊（有關基金風險報酬之相關說明，請詳第二部分：一般資訊第54至55頁）。

二、**適合的投資人類型：**藉由投資廣泛的合格證券以及衍生性金融商品工具來達成資本增值機會的投資人。預計持有投資時間為中長期。

#### 伍、基金運用狀況

##### 一、基金淨資產組成：

資料日期：2019年6月30日

##### 1.依投資類別：

投資類別	比重%
股票	34.52%
固定收益	22.87%
現金與受限制用途現金 <sup>註</sup>	42.61%

註：係指留存做為交易的保證金，或提供擔保等之用途

##### 依投資策略：

投資策略	比重%
股票對沖	31.87%
相對價值	22.81%
事件驅動	19.64%
全球宏觀	25.68%

##### 2.依投資國家或區域：

國家/區域	比重%
美國	44.81
德國	2.28
加拿大	1.58
英國	1.24
中國(註)	0.84
阿根廷	0.69
俄羅斯	0.64
南非	0.61
丹麥	0.53
荷蘭	0.47
其他國家、現金與受限制用途現金	46.31

註：涵蓋大陸、香港（紅籌股及H股）、新加坡和美國等地區證券市場掛牌上市的中國相關股票，其中大陸地區證券市場掛牌上市有價證券總金額並不超過基金淨資產價值之20%。

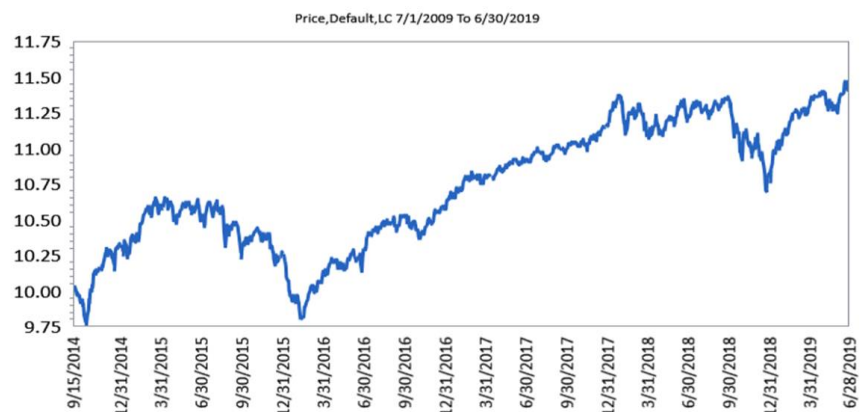
##### 3.依投資標的信評：

資料日期：2019年6月30日

信評等級	比重%
AAA	2.74%
AA	0.34%
A	1.34%
BBB	2.13%
BB	2.55%
B	4.97%
CCC	1.63%
CC	0.12%
C	0.06%
DDD級(含)以下	0.82%
其他(註)	4.06%

註：其他不適用評等之證券

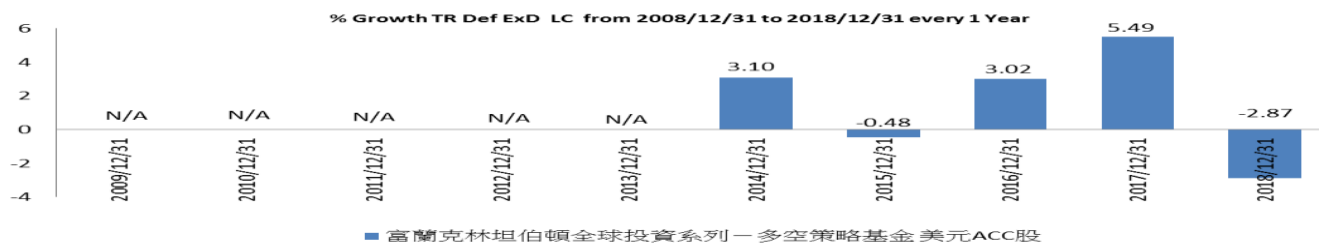
##### 二、最近十年度基金淨值走勢圖：（僅列示主要銷售級別，投資人得向總代理人要求提供未揭示之在臺銷售級別資訊）



— 富蘭克林坦伯頓全球投資系列-多空策略基金 美元A(acc)股\* \* Contains estimated data.

### 三、最近十年度各年度基金報酬率：

(僅列示主要銷售級別，投資人得向總代理人要求提供未揭示之在臺銷售級別資訊)



註：資料來源：理柏資訊

1.年度基金報酬率：指本基金淨資產價值，以1-12月完整曆年期間計算，加計收益分配後之累計報酬率。2.收益分配均假設再投資於本基金。美元A(acc)股成立於2014年9月15日，2014年度揭露成立日至當年年底績效。

### 四、基金累計報酬率：

(僅列示主要銷售級別，投資人得向總代理人要求提供未揭示之在臺銷售級別資訊)

期 間	最近三個月	最近六個月	最近一年	最近三年	最近五年	最近十年	基金成立日(累積型股份2014年9月15日)起算至資料日期日止
美元A(acc)股	2.56%	7.11%	4.23%	7.63%	N/A	N/A	18.67%

註：(1)資料來源：理柏資訊，美元A(acc)股的台幣計價累積報酬率截至2019年6月30日，其他股份類別的報酬率不盡相同。(2)累計報酬率：指至資料日期日止，本基金淨資產價值最近三個月、六個月、一年、三年、五年、十年及自基金成立日起算，加計收益分配之累計報酬率。(3)收益分配均假設再投資於本基金。

### 五、最近十年度各年度每受益權單位收益分配之金額/幣別：(在臺銷售之所有分配收益級別分別列示)

本基金美元A(acc)股為配息累積股份。前揭股份不會發放配息，但其可分配的淨收益將反映在股份淨值的增加。

### 六、最近五年度各年度基金之費用率：(在臺銷售之所有級別分別列示)

年度	103	104	105	106	107
美元A(acc)股	N/A	2.75%	2.74%	2.75%	2.75%

註：截至6月30日止之年度

費用率：基金截至6月30日止上表所揭各年度內之總費用與該基金平均淨資產的比率。總費用包括投資經理費、行政及股務代理費、保管費和其他費用，彙總於「營運及淨資產變動報表」。

### 七、基金前五大投資標的及占基金淨資產價值之比率(截至2019年6月30日)

投資標的名稱(多頭曝險)	比重%	投資標的名稱(空頭曝險)	比重%
1. Tribune Co.(美,媒體)	1.31%	1. Harris Corp.(美,通訊設備)	-1.05%
2. Red Hat Inc.(美,軟體)	1.19%	2. Fidelity National Information Services Inc.(美,消費金融)	-0.87%
3. L3 Technologies Inc.(美,科技)	1.16%	3. Fiserv Inc.(美,科技)	-0.75%
4. RWE AG(德,公用事業)	1.15%	4. Bristol-Myers Squibb Co.(美,生物製藥)	-0.38%
5. Anadarko Petroleum Corp.阿納達科石油(美,能源)	0.99%	5. Invitation Homes Inc.(美,不動產)	-0.30%

### 陸、投資人應負擔費用之項目及其計算方式

項目	計算方式或金額
經理費	每年基金淨資產價值之 <u>2.05%</u>
保管費	每年基金淨資產價值之 <u>0.01~0.14%</u>
A股基金申購手續費	最高不超過投資總額 5.75%，投資人應以銷售機構實際收取之申購手續費為準。
買回費	無



轉換費	A 股基金轉換手續費係依轉出基金原始投資成本計算收取 0.5%（外收），每筆轉換費用金額最高不超過新台幣 5 仟元，實際計算基礎依各銷售機構與投資人之約定為準。
短線交易買回費用	無
反稀釋費用	無直接收取反稀釋費用，有關本基金採用擺動定價機制之相關說明，請詳第二部分：一般資訊第 34、47 頁。
A 股維護費用	每年基金淨資產價值之 <u>0.50%</u>
註冊單位等服務費用	每年基金淨資產價值之 <u>0.20%</u>
其他費用（如買回收件手續費、分銷費、召開受益人會議或股東會費用、績效費）	本基金負擔的其他營運成本包括（但不限於）下列各項費用：如證券買賣的成本、政府與法定收費、法律顧問和查帳費用、保險費、利息支出、報告與公告支出、郵資、電話及傳真等費用，每日於估計及計算各基金的資產淨值之時計算之（買回收件手續費：無；召開受益人會議或股東會費用：N/A；績效費：無）。

（投資人請詳細閱讀本基金公開說明書中譯本附錄 E，有關係列基金收費及費用之相關資訊。）

## 柒、受益人應負擔租稅之項目及其計算

### ■ 中華民國境內稅負

(一) 投資人取得境外基金之收益分配、及申請買回/轉讓受益憑證之所得屬海外所得，投資人應檢視是否應依所得基本稅額條例第 12 條規定課徵基本稅額(又稱最低稅負制)。

(二) 投資人申請買回/轉讓受益憑證、或於境外基金解散時，無須繳納證券交易稅。

### ■ 境外稅負

各國稅法規章均持續異動，並可能具有追溯力，投資人應參見基金公開說明書(P.159~162)瞭解相關稅負。

## 捌、基金淨資產價值之公告時間及公告方式

一、公告時間：總代理人應於每營業日公告本基金之單位淨資產價值。

二、公告方式：於向本公司網站 ([www.Franklin.com.tw](http://www.Franklin.com.tw)) 或境外基金資訊觀測站 (<http://www.fundclear.com.tw>) 公告。

## 玖、公開說明書中譯本之取得及境外基金相關資訊網址

一、總代理人、銷售機構及參與證券商募集及銷售境外基金時，應交付本投資人須知及公開說明書中譯本予投資人；但境外指數股票型基金（境外 ETF）於證券交易市場進行交易者，不在此限。

二、投資人可於境外基金資訊觀測站 (<http://www.fundclear.com.tw>) 查詢有關境外基金之淨值、基金基本資料、財務報告、公開說明書、投資人須知、公告訊息、銷售機構及境外基金相關資訊。

**三、投資人可洽總代理人索取有關風險管理措施之資訊。**

## 拾、其他

總代理人依基金性質，載入之其他或有事項，相關說明請詳第二部分：一般資訊第 34 頁至第 56 頁。

本基金經金融監督管理委員會核准或同意生效，惟不表示本基金絕無風險。境外基金管理機構以往之績效不保證基金之最低收益。本投資人須知之內容如有虛偽或隱匿之情事者，應由總代理人及負責人依法負責。

境外基金係以外幣計價，投資人須承擔取得收益分配或買回價金時轉換回新臺幣可能產生之匯率風險。若轉換當時之新臺幣兌換外幣匯率相較於原始投資日之匯率升值時，投資人將承受匯兌損失。

本基金採用『公平價格調整』及『擺動定價機制』，相關說明請詳第二部分：一般資訊第 34、46~47 頁。

**本基金經專案豁免持有衍生性商品部位限制。本基金持有衍生性商品之全球曝險係以絕對風險值衡量，其預期槓桿水準為子基金淨資產價值之 450%，惟可能承受較高的槓桿水平，並且可能造成基金淨值高度波動及衍生其他風險。**

本基金持有新興市場之投資標的，故本基金之主要投資風險除包含一般股票型基金之投資組合跌價與匯率風險外，與成熟市場相比須承受較高之政治與金融管理風險，而因市值及制度性因素，流動性風險也相對較高，新興市場投資組合波動性普遍高於成熟市場。基金投資均涉及風險且不負任何抵抗投資虧損之擔保。投資風險之詳細資料請參閱基金公開說明書。

電話：(02) 2781-0088 傳真：(02) 2781-7788 富蘭克林基金專線：0800-885-888

富蘭克林基金理財網：<http://www.Franklin.com.tw> 【富蘭克林證券投顧獨立經營管理】