



FRANKLIN TEMPLETON

富蘭克林鄧普頓

富蘭克林浮動息率基金

富蘭克林浮動息率基金

環球固定收益

31.03.2024

基金單張

有關基金資料的來源及計算依據，請參閱\*註釋部分。

## 基金概覽

基金貨幣	美元
基金總資產 (美元)	464 百萬
基金成立日期	15.05.2000
投資項目總數	305
基準	晨星 LSTA 美國槓桿貸款指數
晨星基金組別*	其他債券
派息率* - A (派息) 美元	8.68%

## 投資目標摘要

本基金透過將其淨資產的最多100%投資於富蘭克林浮動息率母信託基金(「母基金」)的股份，以尋求為投資者提供高水平的經常性收益和資本保值，而母基金主要投資於具有浮動息率的優先有抵押公司貸款及公司債務證券。

## 基金經理\*

Reema Agarwal, CFA: 美國  
Justin G. Ma, CFA: 美國  
Margaret Chiu, CFA: 美國  
Judy Sher: 美國

## 資產分佈\*

固定收益	89.10%
現金及現金等值	8.80%
股票	2.10%

## 銷售文件



## 股東信函



## 股份類別資料

股份類別	成立日期	單位淨值	總開支比率 (%) 31.01.2024	費用			派息		基金代號 ISIN	
				最高認購費 (%)	最高維持管理費 (%)	最高發行費 (%)	最近派息日期	派息金額*		
A (派息) 美元	15.10.2002	7.11 美元	1.11	5.00	0.59	0.30	不適用	08.03.2024	0.056	IE0032578035
A (累算) 美元	27.02.2004	17.78 美元	1.10	5.00	0.59	0.30	不適用	不適用	不適用	IE00B000C709
A (派息) 歐元-對沖1	27.02.2015	7.35 歐元	1.10	5.00	0.59	0.30	不適用	08.03.2024	0.059	IE00BVFNXR83

## 風險考慮

投資附帶風險。基金價格可反覆波動，投資者有機會損失全部投資金額。過往表現並不預示未來業績。

• 富蘭克林浮動息率基金將其淨資產的最多100%投資於富蘭克林浮動息率母信託基金的股份，以主要投資於具有浮動息率的優先有抵押公司貸款及公司債務證券。

• 本基金主要涉及市場風險、利率風險、信貸風險及主權債務風險、低評級、未被評級或非投資級別的證券風險、流動性風險、新興市場風險、回購協議風險、衍生工具風險、交易對手風險、對沖股份類別風險、貨幣風險及人民幣貨幣及兌換風險。

• 本基金可使用酌情權由本基金的資本或由總收入中支取股息，同時從本基金的資本中支付本基金的全部或部分費用及開支，以致本基金實際上可從資本中支取股息。由資本中支取股息等於退還或取回投資者之部分原投資款項或任何歸屬於原投資款項的資本收益。任何股息分派若涉及由本基金的資本中支取股息或實際上由本基金的資本中支取股息(視乎情況而定)，可導致每股資產淨值即時減少。

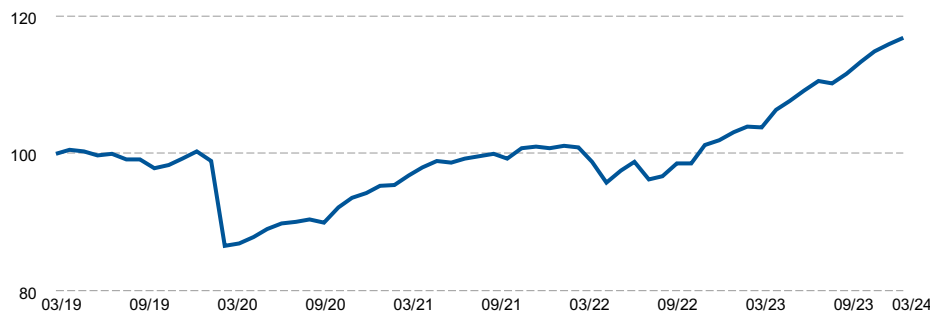
• 投資者不應只依賴本文件而作出投資決定。投資者應閱讀及明白基金銷售文件的詳情，包括風險成份。決定投資前，您應確保銷售中介人已向您解釋本基金適合您。

## 基金表現\*

過往表現不能用於預測未來的回報。

過往5年表現 (根據股份類別貨幣計算) (%)

■ 富蘭克林浮動息率基金 A (派息) 美元



基金表現 (根據股份類別貨幣計算) (%)

	累積						
	3 個月	年初至今	1 年	3 年	5 年	10 年	自成立至今
A (派息) 美元	3.01	3.01	13.32	22.38	16.87	31.88	98.44
基準 美元	2.46	2.46	12.47	19.08	30.57	55.97	195.50

年度表現 (根據股份類別貨幣計算) (%)

	2023	2022	2021	2020	2019
A (派息) 美元	15.02	-2.12	7.67	-5.77	1.71
基準 美元	13.13	-0.60	5.20	3.12	8.64

## 十大投資項目\* (佔總數%)

發行機構名稱	佔總數 (%)
FIRST BRANDS GROUP LLC	1.72
CENGAGE LEARNING INC	1.61
FRANKLIN SENIOR LOAN ETF	1.54
ASURION LLC	1.48
UTEX INDUSTRIES INC	1.44
INVESCO SENIOR LOAN ETF	1.36
GLOBAL TEL-LINK CORP	1.19
ALLOY FINCO LIMITED	1.02
PITNEY BOWES INC	1.00
RAND PARENT LLC	0.96

## 基金統計

平均信貸質素*	BB-
平均存續期	0.14 年
加權平均年期	3.86 年
貼現利差	5.69%
調整息率日數	56 日
平均票息	8.29%
加權平均價格	95.98
標準差 (5 年)	6.88%

有關基金資料的來源及計算依據，請參閱\*註釋部分。

### 股份類別資料 (續)

股份類別	成立日期	單位淨值	總開支比率 (%) 31.01.2024	費用				派息		基金代號
				最高 認購費 (%)	管理費 (%)	最高維持 費 (%)	最高 發行費 (%)	最近派息 日期	派息金額*	ISIN
A (派息) 港元	23.09.2019	8.85 港元	1.10	5.00	0.59	0.30	不適用	08.03.2024	0.071	IE00BK6VSP79
A (派息) 人民幣- 對沖1	27.02.2015	91.42 人民幣	1.10	5.00	0.59	0.30	不適用	08.03.2024	0.711	IE00BVFNXS90
A (派息) 新加坡 元-對沖1	27.02.2015	7.78 新加坡元	1.13	5.00	0.59	0.30	不適用	08.03.2024	0.062	IE00BVFNXQ76

本基金向投資者收取一定費用，以支付本基金的營運成本。並且還會產生額外的費用，包括交易費等。這些費用由本基金支付，這將影響到本基金的整體回報。基金費用將以多種貨幣產生，這也代表成本可能因貨幣匯率波動而增加或減少。

### 基金組合\*

行業	佔總數%
健康護理	12.12
科技/資訊系統	11.70
服務	7.69
金融	7.03
運輸	5.95
博彩/悠閒	5.78
航天與國防	5.23
化學品	4.57
零售	3.52
其他	27.61
現金及現金等值	8.80

### 免責聲明

除非另有註明，所有資料截至本文件發行日期。資料來源：富蘭克林鄧普頓。

Copyright © 2024。富蘭克林鄧普頓。版權所有。

本文件之發行人為富蘭克林鄧普頓投資(亞洲)有限公司。本文件只作參考用途，其內容不應被視作投資建議。所有圖表、數據、意見、預測及其他資料以截至本文日期為依據，並可作隨時修改而不會另行通知。本文件不構成投資基金單位之要約或招攬。投資涉及風險，基金價格可升或跌，過往業績不代表或不保證將來的表現。投資收益以資產淨值計算，已考慮股息再投資及資本增長或損失。投資收益以所示貨幣計價，該等貨幣可能是美元/港元以外的貨幣(「外幣」)。因此，以美元/港元交易的投資者需承受美元/港元與外幣之間匯率波動的風險。投資者應仔細閱讀銷售文件，以獲取進一步資料，包括風險因素。

名稱中包含「對沖1」的任何股份類別將嘗試對沖本基金基礎貨幣與股份類別計值貨幣之間的貨幣風險，但不保證可以成功對沖。在某些情況下，投資者可能涉及額外風險。

富蘭克林浮動息率基金(簡稱「基金」)是一家於1999年12月1日在愛爾蘭註冊成立的可變資本投資公司，註冊號為316174。根據2014年公司法第24部分第1395節，本基金已被愛爾蘭中央銀行批准成為指定投資公司。該基金的註冊辦公室為Capital Dock, Sir John Rogerson's Quay, Dublin Ireland。

此外，投資者權利摘要可從<https://www.franklintempleton.com.hk/en-hk/about-us/summary-of-investor-rights>獲得。該摘要有英文和中文版本。

根據AIFMD指令，基金/子基金被通知在不同地區進行營銷。基金/子基金可以使用AIFMD指令第32a條中包含的程序隨時終止任何股份類別和/或子基金的此類通知。

為避免疑問，如果您決定投資，即代表您將購買該基金/子基金的單位/股份，並不是直接投資於該基金/子基金的相關資產。

本文件可能只限於在若干司法權區內派發。在任何不准分發有關資料或作出任何要約或招攬之司法權區內，或向任何人士分派有關文件或作出要約或招攬即屬違法之情況下，本文件並不構成該等分派或要約或招攬。持有本文件的人士須就有關詳情諮詢意見及注意該等限制(如有)。本文件並未為香港證監會所審閱。

### \*註釋

自2024年3月1日生效起，基金將其基準調整為Morningstar LSTA US Leveraged Loan Index。

基於系統設定，最近派息金額僅顯示四捨五入至小數點後三位數值。請查閱[www.franklintempleton.com.hk](http://www.franklintempleton.com.hk)內之「過往派息摘要」文件以獲取實際每股派息金額的資料。

基金表現：表現資料僅為所示股份類別之表現，以基金貨幣及資產淨值計算，已考慮股息再投資及資本損益。

當投資組合或其基準的表現被轉換，有可能於投資組合與其基準間使用不同的外匯收盤利率。

晨星基金組別：Copyright © Morningstar, Inc.。版權所有。本資料為(1) Morningstar, Inc.及其資料提供者特許持有；(2) 非經許可，有關資料不得複印、複製、轉載或分發；(3) 僅作參考用途。過往業績不代表或不保證將來的表現。

派息率：派息率指年息率。派息率基於最近期的派息月份，並以年化百分比顯示，數據截至所顯示日期，並不包括任何初步費用，投資者可能需要就派息繳付稅項。資料為過往數據，或不反映目前或將來的派息。派息率計算程式為 $(nr/p) \times 100$ ，按所顯示股份類別之最新派息(r)和月結單位淨值(p)，以及派息頻率(n)而計算。每月派息： $n = 12$ ；每季派息： $n = 4$ ；每年派息： $n = 1$ 。

基金經理：如投資經理為特許金融分析師，CFA®及Chartered Financial Analyst®為特許金融分析師協會擁有的商標。

十大投資項目：這些證券並不代表所有買入及售出的證券，亦非對客戶的建議。投資者不應假設投資於這些證券曾經或將會獲利。

基金統計：平均信貸質素(ACQ)可能隨時間改變。投資組合本身未獲得獨立的評級機構評級。字母評級可能基於不同機構的債券評級(或未評級債券、現金和等價物的內部評級)，用來指示投資組合的相關投資的平均信貸評級，一般從AAA(最高)到D(最低)不等。對於未評級債券、現金和等價物，評級可能基於發行人的評級、集合投資工具的持有評級或其他相關因素來分配。ACQ是通過給所有AAA到D的信貸評級分配一個連續的整數來確定的，採用按市值計算的投資的簡單資產加權平均值，並四捨五入到最近的評級。違約風險隨著債券評級的降低而增加，因此提供的ACQ不是對投資組合違約風險的統計測量，因為一個簡單的加權平均值不能衡量較低評級債券的風險水準。如現金和等價物未計入此計算，因此ACQ可能較低。ACQ僅供參考使用。衍生品持倉並未反映在ACQ中。

費用：管理費包括最高費用為富蘭克林浮動息率基金平均每日資產淨值的0.06%(年率)(向富蘭克林浮動息率基金的另類投資基金經理及主要分銷商Franklin Templeton International Services S.à r.l.支付)，加上最高費用為富蘭克林浮動息率母信託基金平均每日資產淨值的0.53%(年率)(向富蘭克林浮動息率母信託基金的投資顧問Franklin Advisers, Inc.支付)。資產分佈/基金組合：因調整至最接近之數值，投資分佈之總和或不等於100%。