

資產池

	基金名稱	註冊地	計價幣別	成立日期	基金規模	風險報酬等級	基金類型	年化標準差	Sharpe	Beta
26	法巴百利達美元貨幣市場基金C股(美元)	盧森堡	美元	1990/07/26	455.25 百萬美元	RR1	全球型基金	0.06	6.68	0.54
27	天達英鎊貨幣基金A	盧森堡	英鎊	1985/01/25	258.00 百萬英鎊	RR1	區域型基金	0.05	0.64	2.61
28	法巴百利達歐元貨幣市場基金C股(歐元)	盧森堡	歐元	1991/02/05	1055.18 百萬歐元	RR1	區域型基金	0.03	-3.90	2.27
29	富達英鎊現金基金(A股累計-英鎊)	盧森堡	英鎊	2016/01/18	70.10 百萬英鎊	RR1	單一國家型基金	0.02	0.81	-0.04
30	富達歐元現金基金(歐元累積)	盧森堡	歐元	2006/09/25	467.76 百萬歐元	RR1	區域型基金	0.01	-16.34	1.55
31	富達美元現金基金	盧森堡	美元	1993/09/20	1214.47 百萬美元	RR1	區域型基金	0.08	3.12	0.91
32	富達美元現金基金(美元累積)	盧森堡	美元	2006/09/25	1214.47 百萬美元	RR1	區域型基金	0.08	3.12	0.91
33	摩根基金-美元貨幣基金(美元)(累計)	盧森堡	美元	2014/06/06	464.00 百萬美元	RR1	單一國家型基金	0.07	4.67	0.72
34	富達澳元現金基金(A股累計-澳元)	盧森堡	澳幣	2016/01/18	123.91 百萬澳幣	RR1	單一國家型基金	0.02	16.70	0.07
53	美盛布蘭迪全球固定收益基金A類股美元累積型	愛爾蘭	美元	2007/05/09	1334.00 百萬美元	RR2	全球型基金	6.66	0.18	0.59

以上資訊取自MoneyDJ理財網

關鍵字搜尋

境內基金

基金名稱	計價幣別	基金類型	主要投資區域	年化標準差	Sharpe	Beta
未來資產全球大消費基金	台幣	跨國投資股票型全球市場	全球	10.65	0.51	0.75
聯邦全球高息策略基金-A不配息(台幣)(本基金之配息來源可能為本金)	台幣	跨國投資股票型全球市場	全球	N/A	N/A	N/A
聯邦全球高息策略基金-B月配息(台幣)(本基金之配息來源可能為本金)	台幣	跨國投資股票型全球市場	全球	N/A	N/A	N/A
聯邦全球高息策略基金-A不配息(美元)(本基金之配息來源可能為本金)	美元	跨國投資股票型全球市場	全球	N/A	N/A	N/A
聯邦全球高息策略基金-B月配息(美元)(本基金之配息來源可能為本金)	美元	跨國投資股票型全球市場	全球	N/A	N/A	N/A

Show 5 entries

Previous 1 2 3 4 5 ... 58 Next

境外基金

基金名稱	註冊地	計價幣別	基金類型	投資區域	投資標的	年化標準差	Sharpe	Beta
安本環球世界資源股票基金X累積	盧森堡	美元	全球型基金	全球	原物料	13.75	0.40	0.95
安本環球世界資源股票基金A累積	盧森堡	美元	全球型基金	全球	原物料	13.74	0.39	0.95
安本環球科技股票基金X累積	盧森堡	美元	全球型基金	全球	股票型	10.65	0.38	0.76
安本環球科技股票基金A累積	盧森堡	美元	全球型基金	全球	股票型	10.64	0.36	1.29
安本環球世界責任股票基金X累積	盧森堡	美元	全球型基金	全球	股票型	8.55	0.33	1.13

Show 5 entries

Previous 1 2 3 4 5 ... 111 Next

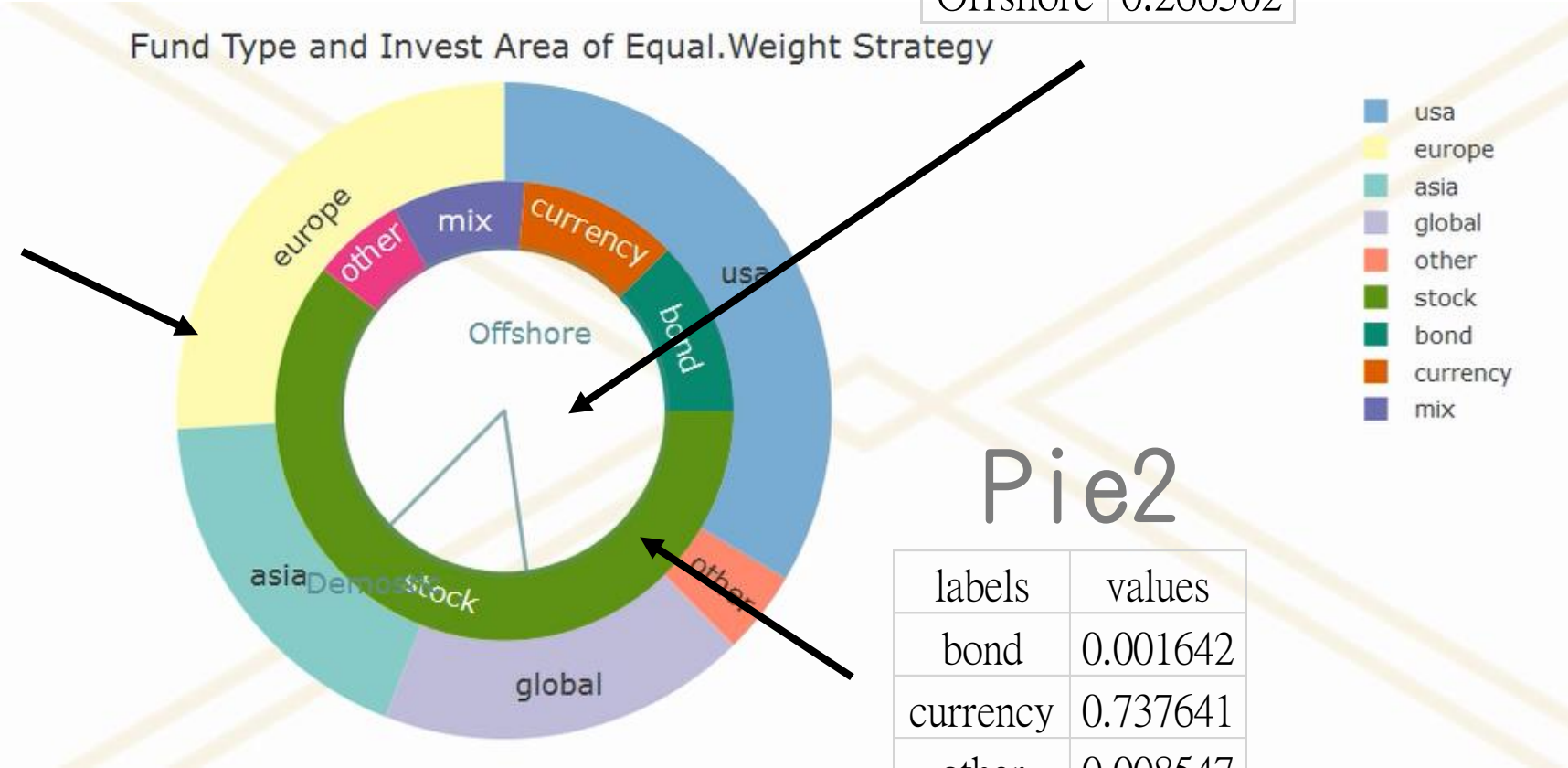
各策略組合的投資分布狀況

Pie1

labels	values
asia	0.204187
europa	0.012342
global	0.736637
other	0.022329
usa	0.024505

Pie3

labels	values
Demostic	0.733498
Offshore	0.266502



Pie2

labels	values
bond	0.001642
currency	0.737641
other	0.008547
stock	0.252169

投資組合配置

Name	Weight(%)	Name	Weight(%)
摩根泰國基金	0.295	摩根基金-美元貨幣基金(美元)(累計)	1.212
駿利亨德森資產管理基金-駿利亨德森英達美國重點基金A美元累計	0.244	兆豐國際人民幣貨幣市場基金	19.813
摩根士丹利美國增長基金A	0.397	兆豐國際美元貨幣市場基金(美元)	14.905
摩根基金-美國企業成長基金(美元)(分派)	0.244	野村環球基金(台幣)	1.382
富蘭克林坦伯頓全球投資系列歐洲基金美元A(acc)	0.161	野村泰國基金	1.137
MFS全盛美國密集成長基金C1(美元)	0.153	安聯人民幣貨幣市場基金(人民幣)	45.548
聯博-房貸收益基金ATX級別美元(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)	0.237	安聯人民幣貨幣市場基金(美元)	9.723
MFS全盛美國密集成長基金I1(美元)	0.153	台新中美貨幣市場基金(美元)	2.84
施羅德環球基金系列-亞太城市房地產股票A1類股份-累積單位(美元)	1.555		

本金走勢

	Equal.Weight	Volatility.Weighted	Momentum	Combo	AAA	Top_25
2004/12/30	1	1	1	1	1	1
2004/12/31	0.974621212	1	1	1	1	0.986786
2005/1/3	0.97091767	1	1	1	1	0.984675
2005/1/4	0.96213078	1	1	1	1	0.979956
2005/1/5	0.957480162	1	1	1	1	0.976382
2005/1/6	0.958390277	1	1	1	1	0.97667
2005/1/7	0.954454955	1	1	1	1	0.973169
2005/1/10	0.962232243	1	1	1	1	0.975721
2005/1/11	0.956776397	1	1	1	1	0.973462
2005/1/12	0.955925721	1	1	1	1	0.970689



回測期間：2004-12-31 ~ 2018-10-26。Top_25：回測期間報酬表現前25%的基金以等比方式組成的投資組合。

數據與圖不符，僅作對照使用

每月報酬狀況

	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Year
2005	-1.2	1.4	-1.2	-2	2.5	2.1	5	1.8	3.7	-2.6	3.8	1.5	15.6
2006	2.7	1.5	2	1.7	-3.8	-0.2	1.4	3	1.4	3.5	1.6	2.3	18.3
2007	1.8	0.7	2.1	3.8	2.2	0.3	1	-1	5	3.3	-5.3	-0.2	14.1
2008	-8.8	-0.8	-3.3	4.7	1.1	-7.5	-1.9	0	-10.9	-17.9	-5.2	3.9	-39.4
2009	-4	-2.3	4.4	9.2	9.1	0.4	7.9	2.4	3.3	0.2	2.2	2.1	39.6
2010	-3.9	0.6	4.8	-0.4	-6.6	-0.9	6.4	-2	6.5	0.9	-2.4	0.9	3
2011	-0.1	3.5	0.3	1.2	-1.5	-1.5	0.1	-6.6	-6.2	7.3	-2.8	-1.6	-8.4
2012	4.7	4.4	-0.1	-2	-6.1	3.2	1.2	2	1.1	-0.8	1.2	2.3	11.2
2013	5.2	0	1.7	1.4	0.7	-3.5	3.4	-2	3.7	2.4	1.3	1.7	16.9
2014	-1.6	4.3	0.6	-0.7	1.8	1.8	-0.8	1.3	-2.7	0.3	2.2	0.1	6.6
2015	-1.1	3.1	-1.4	1.1	-0.3	-1.3	0.4	-2.9	-1.7	4	-0.4	-1.1	-2
2016	-4	-0.6	4.3	1	0.8	-1.4	3	0	-0.4	-1.5	-0.1	1.6	2.5
2017	0.5	0.3	0.1	1	2	2	2.5	0.8	1.3	1.1	0.9	0.7	14
2018	2.8	-3.5	-0.7	1.5	1	0.2	1.7	-0.8	-1.1	-6.7	0	0	-5.7

Equal.Weight 的月報酬狀況

近四季報酬率

Equal.Weight	Volatility.Weighted	Momentum	Combo	AAA	Top_25	YQ
-0.014951129	-0.015979143	-0.052728357	-0.0355	-0.09963	-0.00595	2018Q1
0.025983471	0.012014237	0.081738058	0.098678	0.083805	0.049369	2018Q2
-0.00172427	0.000278418	-0.085567335	-0.0874	-0.06505	-0.00592	2018Q3
-0.068712126	-0.03632922	-0.113227101	-0.11273	-0.10374	-0.10862	2018Q4



報酬與風險



報酬與風險

Strategy	MaxDD	Volatility	Cagr	Sharpe
Equal.Weight	-49.78	10.52	4.57	0.46
Combo	-44.98	14.17	7.48	0.56
Momentum	-43.93	12.88	7.04	0.57
Volatility.Weighted	-39.28	7.47	3.48	0.48
Top_25	-34.81	8.37	7.14	0.84
AAA	-27.42	11.36	8.88	0.78

MaxDD：最大回撤；Volatility：年化標準差；Cagr：年化報酬率；Sharpe：夏普比率