

NB 美國股票多空基金

US LONG SHORT EQUITY FUND



路博邁

2021 年 03 月 31 日

投資目標

主要透過投資於市值超過 2.5 億美元的美國股票證券之做多及做空部位，從而追求增值機會。

本基金可廣泛投資於：

- 於美國股市上市或買賣的股票及股票連結型證券，包括指數型產品
 - 於 MSCI 所有國家世界指數成分內的全球股市上市或買賣的股票及股票連結型證券，包括指數型產品
 - 金融衍生工具以建立合成做空部位
 - 政府或企業債券
 - 銀行存款及類似貨幣市場類別工具
- 本基金有系統地運用環境、社會及治理(ESG)準則篩選證券。

投資團隊

Charles Kantor

資深投資組合經理

Marc Regenbaum

資深投資組合經理

基金資料

成立日期	2014 年 2 月 28 日
基礎貨幣	美元
計價幣別(股份類別)	美元
基金規模(百萬美元)	439.47
註冊地	愛爾蘭
UCITS	是
計價方式	每日
監管機構	Central Bank of Ireland
基金管理費率(每年)	類股 T、B、C2、E 2.40%
晨星基金組別™	另類投資 - 長短倉 - 美國股票
基準指標	S&P 500 Index (Total Return, Net of Tax, USD)

基金代碼

USD I 累積類別

ISIN

IE00BJTCX997

基金績效表現%



此圖表顯示在本基金成立日投資 100 美元 於本基金之表現。

基金累計報酬%

	3 個月	6 個月	年初至今	1 年	2 年	3 年	5 年	成立至今 (總回報)
類股 I	0.29	4.87	0.29	18.64	20.59	21.11	37.39	40.00

資料來源: Morningstar, 為提供長期資料供參考之用, 以 I 類股淨資產價值, 加計收益分配後之累積報酬率, 計算至 2021 年 03 月 31 日止。本處呈現之資訊為本基金 USD I 累積類別之績效。投資人應詳閱公開說明書內關於本基金各類股費用及開支之相關資訊。

股票產業比重%(按淨值)

	做多部位(%)	做空部位(%)
通訊服務	6.08	0.00
非民生必需品	13.92	2.93
民生必需品	6.00	0.95
能源	2.30	0.22
金融	7.79	0.74
健康護理	6.89	0.20
工業	13.07	0.51
資訊科技	24.59	1.86
原物料	3.69	0.00
不動產	0.62	0.25
公用事業	5.05	0.71
其他(ETF、期貨、選擇權及固定收益)	2.15	32.25

聯繫

客戶服務: +886 (02) 8726 8280

網站: www.nb.com/taiwan

第 1 頁(共 2 頁)

僅供 OBU/OSU 使用

NB 美國股票多空基金

US LONG SHORT EQUITY FUND



路博邁

2021 年 03 月 31 日

前十大做多部位持股%(按淨值)

		投資主題
Alphabet Inc. Class A	2.36	資本增長
Amazon.com, Inc.	2.35	資本增長
Duck Creek Technologies, Inc.	2.26	資本增長
Microsoft Corporation	2.21	資本增長
McDonald's Corporation	2.04	總回報
Adobe Inc.	2.04	資本增長
NextEra Energy, Inc.	1.95	資本增長
Home Depot, Inc.	1.90	總回報
Salesforce.com, Inc.	1.88	資本增長
IHS Markit Ltd.	1.84	資本增長

資料截至 2021 年 03 月 31 日。

前五大做空部位持股%(按市場價值)

	基金
Kroger Co	0.54
Consolidated Edison Inc	0.51
SAP AG-Sponsored ADR	0.48
Carvana Co	0.46
Domino's Pizza Inc	0.46

資料截至 2021 年 03 月 31 日。

風險評等

	3 年
Alpha 係數	-1.39
Beta 係數	0.44
夏普指數	0.61
標準差	8.62

做多部位組成%(按淨值)

	基金
資本增長	78.87
總回報	17.20
機會型	3.93

做空部位組成%(按淨值)

	基金
基本面做空部位	19.52
市場面做空部位	80.48

概要

	基金
Delta 調整後總投資部位%(做多部位+做空部位)	132.77
Delta 調整後淨投資部位%(做多部位-做空部位)	51.53
淨做多資產(%)	92.15
淨做多資產- 股票 (%)	90.24
淨做多資產- 固定收益 (%)	1.91
淨做空資產(%)	40.62
做多股票檔數	93
做空股票檔數	33

除非另有註明，所有資料截至 2021 年 03 月 31 日，資料來源為路博邁、FactSet、彭博及 Morningstar。

免責聲明

所提供金融商品並未經主管機關審查或核准，亦不適用備查或申報生效之規定。所提供金融商品僅得於銀行國際金融業務分行對中華民國境外客戶為推介及交易對象。本檔及其中包含的資訊由路博邁亞洲有限公司（以下簡稱“NBAL”）編制，NBAL 是一家在香港組建、經香港證券及期貨事務監察委員會（SFC）授權並受 SFC 監管的投資公司，可開展香港證券及期貨條例（第 571 章）（以下簡稱“SFO”）定義的 1、4 和 9 類受監管活動。本檔由 NBAL 在保密的基礎上向“合格投資者”、“機構投資者”、“專業投資者”、“QPI”、“成熟投資者”、“批發投資者”及/或其他合格人士單獨提供，僅以提供資訊和進行討論為目的，且每一情況下，相關人士均根據以下列出之相關轄區的法律進行定義，所有人士均統稱為“成熟投資者”。本檔僅有意面向收到本檔的成熟投資者分發，本檔應嚴格保密，未經 NBAL 事先書面同意，在任何情況下均不得複製或重新分發，亦不得向任何其他人士（該等成熟投資者的代理人或顧問除外）披露本檔的全部或部分內容。就本檔中所提及之任何投資或策略對成熟投資者是否適合而言，我們並未給出任何推薦意見或建議。投資者不應假設對本檔所述之任何證券、公司、行業或市場進行投資將會獲利。投資存在風險，其中包括本金遭受損失的風險。過往業績並不能作為未來回報的保證。本檔及其中所包含的該等資訊並非不構成買入或賣出任何基金、基金單位或股份、證券或其他金融工具（以下簡稱“證券”）、或參與任何投資策略的公開或零售要約或建議。

針對以下地區成熟投資者的重要資訊：台灣：本基金股份並未經台灣主管機關核准或申報生效募集、銷售、發行或提供顧問，本基金並未主動或被動在台灣提供或授權第三人提供任何與募集、銷售、發行、顧問、轉售、移轉、推介、廣告、業務招攬及營業促銷活動相關之服務或投資機會。本基金股份僅提供銀行國際金融業務分行[及國際證券業務分公司]之台灣境外客戶。投資人應注意本基金股份為高度管制商品，所有與本基金與台灣相關之募集、銷售、發行、轉售、移轉、顧問、推介、廣告、業務招攬及營業促銷活動皆受限制，本基金股份相關資料僅為提供資訊之目的，並未在台灣境內構成要約、推介或引誘，且不可為台灣境內為募集、銷售、發行、轉售、移轉、顧問、推介、廣告、業務招攬及營業促銷活動本基金股份之目的而流通、發行或散布。NBAL、其管理人員、雇員或聯屬實體均不得針對本檔所包含之任何資訊的公允性、正確性、準確性、合理性或完整性做出任何明示或暗示的表述或保證（其中包括但不限於從非關聯協力廠商處獲得的該等資訊），並特此明確免除其與本檔所包含之資訊或遺漏之資訊相關的任何及所有責任或義務，其中包括但不限於任何與該等資訊相關的任何暗示的表述或保證。過去表現不能作為未來業績的保障。有關更多投資風險的詳情，請參閱最新的招股章程。銀行國際金融業務分行客戶不適用「金融消費者保護法」之金融消費爭議處理機制。Neuberger Berman Investment Funds plc（“本基金”）獲愛爾蘭央行（“央行”）根據愛爾蘭歐體 2011 年條例（2011 年 S.I.352，經修訂），授權為可轉讓證券集體投資計畫（“UCITS”）。©2021 路博邁亞洲有限公司版權所有

僅供 OBU/OSU 使用