

## 基金月报

截至 30/11/2023

## 重要数据

- 博时—安本标准精选新兴市场债券基金（「子基金」）为博时投资基金旗下的子基金，博时投资基金是遵照香港法例并根据日期为 2012 年 1 月 5 日的信托契据（「信托契据」）成立为伞子基金的单位信托基金。
- 安本标准投资（香港）有限公司（「副管理人」）已根据其与管理人（「管理人」）订立的副管理协议获管理人委任为子基金副管理人。根据副管理协议，副管理人将管理子基金的部分资产。管理人将负责中国及香港的投资组合配置，以及子基金的整体投资组合配置。副管理人将管理中国及香港以外的投资组合配置。有关进一步详情，请参阅销售文件。
- 投资于基金须承受正常市场波动及子基金资产所涉及的其他固有风险。因此，阁下须承受无法取回于基金的最初投资款项或可能损失绝大部分或全部投资款项的风险。
- 子基金将投资于新兴市场，所承受的风险（例如流动性风险、货币风险、政治风险、监管风险及经济风险）及波幅均高于成熟市场。部分新兴市场证券可能须缴付经纪佣金或政府徵收的股票转让税，可能会增加投资成本，并于出售证券时减少变现收益或增加亏损。
- 子基金的投资货币一般有别于子基金的基础货币（美元），故带来外币风险。子基金的表现可能受美元兑所持资产货币汇率的不利走势影响。
- 子基金于投资固定收益工具承受的风险包括利率风险，信贷风险及信贷评级下调的风险，估值风险，投资于无评级或较低评级债券的风险和主权债风险。
- 子基金可能利用金融衍生工具作投资、对冲、风险管理及效率组织者用途。流动性低的市场可能对此等工具的价格构成不利影响，从而影响到子基金的价值，尤其是场外衍生工具市场的流动性往往低于交易所买卖的衍生工具。
- 投资涉及风险。过去的投资业绩未必预示将来的表现。投资者不应只凭此材料所载的资料决定投资，应详细阅读本基金的有关注释备忘录及产品数据概（包括当中所载之产品特色及风险因素）。
- 子基金为根据《香港互认基金管理暂行规定》（中国证监会公告 [2015]12 号）经中国证券监督管理委员会（「中国证监会」）注册后在内地公开销售的香港互认基金。
- 子基金于 2019 年 11 月 12 日经中国证监会证监许可 [2019][2256] 号文注册。但中国证监会对本基金的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

## 投资目标

子基金的投资目标是通过主要投资于全球新兴市场债券及新兴市场货币，以获得利息收入及资本增值。

## 主要资料

基金管理人	博时基金（国际）有限公司
基金副管理人	安本标准投资（香港）有限公司
成立日期	09/05/2016
基金净值首日计算日期	类别 A — 12/10/2016 类别 I — 10/05/2016 北上互认 A 类人民币 — 14/04/2020 北上互认 I 类人民币 — 15/04/2020
基础货币	美元
基金总值（美元百万）	2.36
基金净值	类别 A — 9.3207 类别 I — 9.5651 北上互认 A 类人民币 — 0.9180 北上互认 I 类人民币 — -
派息政策	酌情派发（如有）
管理费	类别 A — 1.00% 类别 I — 0.75%
认购费	不高于 5%
彭博代码	类别 A 美元 — BOSEOBA HK 类别 I 美元 — BOSEOBI HK 北上互认 A 类人民币 — BOSEPCA HK 北上互认 I 类人民币 — BOSEPCI HK
ISIN 代码	类别 A 美元 — HK0000284007 类别 I 美元 — HK0000284015 北上互认 A 类人民币 — HK0000552163 北上互认 I 类人民币 — HK0000552171

## 累积表现—基金



## 基金表现<sup>1, 2, 3</sup>

	1 个月	3 个月	6 个月	1 年	3 年	自成立至今
类别 A	0.09%	-0.26%	-1.01%	-1.17%	-17.67%	-6.79%
类别 I	0.11%	-0.20%	-0.88%	-0.93%	-17.06%	-4.35%
北上互认 A 类人民币	-2.65%	-2.15%	-0.81%	-1.27%	-10.54%	-8.20%
北上互认 I 类人民币	-	-	-	-	-	-

## 年度表现—类别 A<sup>1</sup>

年份	一月	二月	三月	四月	五月	六月	七月	八月	九月	十月	十一月	十二月	年度
2023	-0.33%	-0.22%	-0.19%	-0.17%	-0.31%	-0.25%	-0.29%	-0.22%	-0.20%	-0.15%	0.09%	-	-2.21%
2022	-1.84%	-3.66%	-3.54%	0.15%	-1.15%	-3.73%	-1.59%	0.05%	-0.43%	-0.41%	1.84%	1.06%	-12.65%
2021	0.55%	-0.10%	-1.23%	0.48%	0.63%	-0.49%	-1.44%	1.79%	-1.91%	-3.18%	-0.89%	-0.26%	-5.97%
2020	0.93%	-0.51%	-14.75%	1.93%	2.22%	1.73%	1.98%	1.07%	-1.60%	0.85%	2.92%	2.51%	-1.59%
2019	2.88%	1.13%	1.44%	0.17%	0.19%	1.72%	0.91%	-1.29%	0.57%	0.79%	0.03%	0.62%	9.57%
2018	0.09%	-0.73%	0.07%	-0.37%	-0.68%	-1.19%	1.52%	-1.23%	0.95%	-0.84%	-0.58%	-0.68%	-2.34%
2017	0.71%	1.41%	0.30%	0.69%	0.39%	4.51%	0.75%	1.02%	0.37%	0.46%	0.30%	0.36%	11.88%
2016 <sup>1</sup>	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.10%	-2.00%	0.51%	-1.40%

## 年度表现—类别 I<sup>2</sup>

年份	一月	二月	三月	四月	五月	六月	七月	八月	九月	十月	十一月	十二月	年度
2023	-0.31%	-0.20%	-0.16%	-0.15%	-0.29%	-0.22%	-0.27%	-0.20%	-0.18%	-0.13%	0.11%	-	-1.99%
2022	-1.82%	-3.64%	-3.52%	0.17%	-1.12%	-3.71%	-1.57%	0.07%	-0.41%	-0.39%	1.85%	1.08%	-12.43%
2021	0.57%	-0.08%	-1.20%	0.50%	0.65%	-0.47%	-1.42%	1.81%	-1.89%	-3.16%	-0.87%	-0.23%	-5.74%
2020	0.98%	-0.48%	-14.71%	1.95%	2.24%	1.75%	2.00%	1.10%	-1.59%	0.87%	2.94%	2.53%	-1.31%
2019	3.04%	1.16%	1.50%	0.17%	0.26%	1.82%	0.94%	-1.18%	0.6%	0.85%	0.08%	0.67%	10.41%
2018	0.18%	-0.72%	0.18%	-0.36%	-0.55%	-1.19%	1.67%	-1.19%	1.02%	-0.82%	-0.46%	0.65%	-1.63%
2017	0.78%	1.45%	0.48%	0.66%	0.56%	-0.09%	0.84%	1.02%	0.55%	0.46%	-0.09%	0.36%	7.19%
2016 <sup>2</sup>	-	-	-	-	0.20%	1.30%	1.58%	1.07%	0.38%	-0.29%	-1.82%	0.49%	2.90%

## 年度表现—北上互认 A 类人民币<sup>3</sup>

年份	一月	二月	三月	四月	五月	六月	七月	八月	九月	十月	十一月	十二月	年度
2023	-3.36%	2.62%	-1.40%	0.64%	0.62%	1.84%	-2.09%	1.67%	0.06%	0.26%	-2.65%	-	0.15%
2022	-2.00%	-4.32%	-3.00%	4.87%	-0.72%	-3.42%	-1.03%	0.08%	2.27%	2.08%	-0.12%	-1.42%	-4.51%
2021	0.12%	0.17%	0.01%	-1.16%	-0.85%	1.02%	-1.49%	1.80%	-1.70%	-4.51%	-1.01%	-0.34%	-4.62%
2020 <sup>3</sup>	-	-	-	1.12%	3.47%	0.35%	0.89%	-0.98%	-2.12%	-0.92%	0.87%	1.45%	4.11%

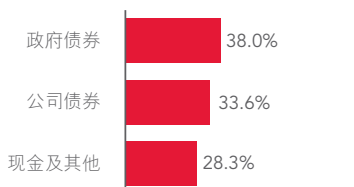
## 基金月报

截至 30/11/2023

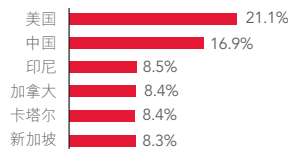
### 年度表现 - 北上互认 I 类人民币<sup>4</sup>

年份	一月	二月	三月	四月	五月	六月	七月	八月	九月	十月	十一月	十二月	年度
2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2022	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2021	0.14%	0.19%	0.03%	-1.14%	-0.83%	1.04%	-	-	-	-	-	-	-1.08%
2020 <sup>4</sup>	-	-	-	0.44%	3.56%	0.37%	0.91%	-0.96%	-2.10%	-0.89%	0.89%	1.48%	3.66%

### 组合配置



### 国家配置



### 债券评级配置<sup>5</sup>

评级	占比
AAA	21.12%
AA	8.43%
A+	16.83%
A	8.47%
A-	8.34%
BBB	8.49%

### 五大投资项目

名称	%
美国国库券 0% 02/01/2024	21.12
印尼政府国际债券 5.875% 15/01/2024	8.49
交银租赁管理香港有限公司 4.375% 22/01/2024	8.47
中海油尼克森金融 (2014) 无限公 4.25% 30/04/2024	8.44
卡塔尔政府国际债券 3.375% 14/03/2024	8.43

### 组合特点

修正久期	0.13 年
期满收益率	4.02%

### 备注

<sup>1</sup> 2016 基金年度表现是从类别 A 美元成立日 12/10/2016 开始计算。

<sup>2</sup> 2016 基金年度表现是从类别 I 美元成立日 10/05/2016 开始计算。

<sup>3</sup> 2020 基金年度表现是从北上互认 A 类人民币成立日 14/04/2020 开始计算。

<sup>4</sup> 2020 基金年度表现是从北上互认 I 类人民币成立日 15/04/2020 开始计算。

<sup>5</sup> 采用彭博综合评级；部分无评级债券有境内债券评级。

### 免责声明

除特别列明外，所有数据截至每月之最后计值日。数据源：博时基金(国际)有限公司，基金表现以资产净值及各自货币计算，已扣除费用，将股息再作投资。有关基金表现图表及数据乃为包含所有已分派的股息而编撰。过去的业绩并不代表将来的表现。投资者可能无法取回原本投资金额。投资附带风险，投资目标亦非保证能达成。投资价值及其收益可跌可升，投资者可能无法取回原本投资于基金的款项。本文件只提供一般性数据，文件内所载的观点，在任何情况下均不应被视为博时国际的促销或建议。博时国际对任何依赖本文而引致的损失概不负责。由博时基金(国际)有限公司刊发。此文件并未经香港证券及期货事务监察委员会批阅。请参阅香港销售文件及产品数据概要以便获取基金的其他数据，包括风险因素。内地投资者还应特别关注以下所述子基金对于内地投资者的特殊风险以及有关子基金作为香港互认基金在内地销售的特定风险，包括境外投资风险，暂停内地销售风险，取消基金互认、终止内地销售的风险，销售安排差异的风险，人民币货币风险，汇率风险，适用境外法的相关风险，内地销售机构、内地代理人或内地登记结算机构的操作风险、技术风险，跨境数据传输和跨境资金交收的系统风险及税收风险。