

環球長 / 短倉股票基金

目標與流程

- 尋求長期的資本增值並同時在下跌市場中保持資本。
- 採取的策略是多頭和空頭持有發達市場（摩根士丹利資本國際 (MSCI) 世界指數中的國家）發行人的股票證券。
- 採用定量投資程序來評估多個基本面、統計和技術特徵，包括估價、增長、過往回報、風險流動性和經濟敏感性。
- 本基金可能投資：
 - 於至少三個國家
 - 至少將其總資產的三分之二投資於全球的公司股票證券
 - 高達 100% 的基金資產於多頭持股
 - 高達 50% 的基金資產於空頭持股
 - 通過使用期貨 / 衍生工具進行對沖或有效的投資組合管理

主要風險

市場風險：證券的價值可能會由於一般影響證券市場的因素而下跌，而且股票證券的價格波動通常大於債務證券。**小型公司證券風險：**市值較小的公司的證券波動性往往大於大型公司的證券，且流動性不及大型公司的證券。**全球投資風險：**某些司法管轄區的證券可能會經歷更快、更極端的價值變化，並可能受到不確定性的影響，例如國際政治事件、貨幣波動以及投資所在國家的其他法律法規變化。**衍生工具風險：**使用衍生工具帶來的風險不同於或可能大於直接投資於傳統證券相關的風險。由於標的資產的價格或價值以及指數或利率的不利變動，使用衍生工具可能導致損失，這情況可能因衍生工具的某些特徵而加劇。

整體晨星等評級 - ★ ★ ★ ★

晨星整體評級是三年、五年和十年期（如適用）的加權平均評級，根據截至 2024 年 3 月 31 日的風險調整回報率，對多頭/空頭股票 - 其他類別中 199 支基金的評價。此處包含的資訊為晨星和 / 或其內容提供者的專屬資訊；不得複製或分發；且不保證準確、完整或及時。晨星或其內容供應商均不對因使用本資訊而造成的任何損害或損失負責。過往的業績並不能保證未來的結果。© 2024 晨星。保留所有權利。

日曆年表現 (%)

過往業績並非未來業績之指標。

	2023	2022	2021	2020	2019	2018
IP 類股 (美元) (2017 年 7 月 31 日)*	4.36	-4.52	17.72	1.85	7.89	-9.06
基準指數 ¹	14.50	-7.91	10.63	8.91	14.56	-3.12

表現 (%)

	年化							
	1 個月	3 個月	年初迄今	1 年	3 年	5 年	10 年	成立以來
IP 類股 (美元) (2017 年 7 月 31 日)*	4.13	8.69	8.69	15.75	6.73	5.58	—	4.58
基準指數 ¹	1.81	5.05	5.05	15.10	6.14	7.50	—	6.74

過往業績並非未來業績之指標。業績計算已扣除所有適用費用，按資產淨值對資產淨值基準計算（收益再投資）。所示表現僅適用於指定類別和貨幣；回報可能會因貨幣波動而增加或減少。*股份類別成立日期。

投資者應注意，相對於 *Autorité des Marchés Financiers* 的期望，該基金在其投資政策中，對非金融標準的考慮顯示出不相稱的溝通。

1. 該基金的業績基準為 50% MSCI 全球 / 50% ICE BofA 美國 3 個月期國庫券，並基於該基金的目標波動性比 MSCI 世界指數低 50%。在 2023 年 5 月 1 日之前，業績基準為 50% MSCI 全球 / 50% 3 個月倫敦同業拆借利率 (LIBOR)。摩根士丹利資本國際 (MSCI) 世界指數是經自由流通量調整的市值加權指數，旨在衡量發達市場的股市表現。您不能直接投資於指數。ICE BofA 美國 3 個月國庫券指數是衡量國庫券表現的指標，剩餘期限至最終期限少於 91 天。國庫券由美國政府擔保，如果持有至到期日，將提供固定的投資報酬率與固定的本金價值。版權所有 2023 年。ICE Data Indices, LLC。保留所有權利。您不能直接投資於指數。本基金使用 MSCI 全球指數作為選擇投資的參考，並使用 MSCI 全球指數的 50% 加上 ICE BofA 美國 3 個月國庫券指數的 50% 來計算績效與業績比較。分基金的投資可能會大大偏離基準的組成部分及其各自的權重。



環球長 / 短倉股票基金

基金資訊

基金經理： Harindra de Silva, Ph.D., CFA;
David Krider, CFA

CFA® 和特許金融分析師 (Chartered Financial Analyst®) 是 CFA Institute 所擁有的商標。

基金成立日期： 2017年7月31日

資產類別： 另類

財政年度截止日期： 3月31日

基金規模： 130,330,000 (美元)

基準貨幣： 美元

基準指數： 50% MSCI 全球 (淨) (美元) /
50% 3M T-Bill (美元)¹

最低投資額 (或同等價值)：

類股 IP : 1,000,000 (美元)

管理方法： 積極管理

可持續財務披露條例： 第 6 條¹

業績費 %*

IP 類股 (美元) : 20%

IP 類股 (歐元) : 20%

IP 類股 (英鎊) : 20%

AP 類股 (美元) : 20%

*續效費等於每個會計年度末每股淨資產價值超過扣除最低標準比率後的高水位時的每股淨資產價值 (在扣除續效費之前) 增值的 20%。高水位是指自基金成立以來，在支付續效費時相關類別的最高會計年度末每股淨資產價值。適用的最低利率為 50% MSCI 全球 (淨) (美元) / 50% 3M T-Bill (美元)。詳情請參閱招股說明書。

地區投資分佈 (%)

	多頭	空頭	索引 ²
美國	60.51	-12.96	49.55
日本	11.37	-3.88	4.29
英國	6.28	-3.30	2.65
丹麥	3.14	-0.12	0.66
加拿大	3.05	-2.38	2.14
義大利	2.72	-0.10	0.51
澳洲	2.68	-1.06	1.32
中國和香港	2.58	—	0.33
德國	2.41	-0.13	1.59
新加坡	1.75	—	0.24

基於月底的最終比重。來源：FactSet。

交易商收市時間⁴

盧森堡：晚上 10 時

美國：東部時間下午 4 時

香港：上午 4 時

新加坡：上午 4 時

行業比重 (%)

	多頭	空頭	索引 ²
通訊服務	7.73	-2.67	5.21
非必需消費品	10.42	-5.36	7.51
必需消費品	11.47	-0.08	4.56
能源	2.23	-1.31	3.12
金融	12.92	-3.66	10.75
醫療保健	11.07	-6.05	8.40
行業	16.04	-3.32	7.86
資訊科技	14.12	-2.20	16.57
原料	4.96	-3.66	2.73
房地產	0.32	-0.90	1.59
公用事業	8.44	-0.20	1.70
現金及約當現金	29.67	0.0	30.00

基於月底的最終比重。來源：FactSet。

十大多頭持股 (%)

	多頭	貝他係數 ³
Novo Nordisk A/S Class B	3.30	0.72
Costco Wholesale Corporation	3.27	0.77
NVIDIA Corporation	3.19	2.53
First Citizens BancShares, Inc. Class A	2.99	0.98
Alphabet Inc. Class A	2.98	1.24
Alphabet Inc. Class C	2.94	1.24
Otis Worldwide Corporation	2.92	1.01
Heidelberg Materials AG	2.88	0.83
Chubu Electric Power Company, Incorporated	2.61	0.16
Molina Healthcare, Inc.	2.58	0.34

基於月底的最終比重。此處所示資訊並非也不應被視為購買或出售個別證券的建議。

1. 該基金的業績基準為 50% MSCI 全球 / 50% ICE BofA 美國 3 個月期國庫券，並基於該基金的目標波動性比 MSCI 世界指數低 50%。在 2023 年 5 月 1 日之前，業績基準為 50% MSCI 全球 / 50% 3 個月倫敦同業拆借利率 (LIBOR)。摩根士丹利資本國際 (MSCI) 世界指數是經自由流通量調整的市值加權指數，旨在衡量發達市場的股市表現。您不能直接投資於指數。ICE BofA 美國 3 個月國庫券指數是衡量國庫券表現的指標，剩餘期限至最終期限少於 91 天。國庫券由美國政府擔保，如果持有至到期日，將提供固定的投資報酬率與固定的本金價值。版權所有 2023 年。ICE Data Indices, LLC。保留所有權利。您不能直接投資於指數。本基金使用 MSCI 全球指數作為選擇投資的參考，並使用 MSCI 全球指數的 50% 加上 ICE BofA 美國 3 個月國庫券指數的 50% 來計算續效費與業績比較。分基金的投資可能會大大偏離基準的組成部分及其各自的權重。

2. 自訂的 70% MSCI 全球 / 30% ICE BofA 美國 3 個月國庫券基準用於國家/部門比較，以反映該基金的目標淨市場敞口。

3. 摩根士丹利資本國際 (MSCI) 世界指數乃自由浮動調整之市值加權指數，旨在衡量發達市場之股票市場表現。閣下無法直接投資於此指數。本基金使用 MSCI 世界指數作為選擇投資的參考以及進行業績比較。本基金的投資可能嚴重偏離基準的組成部分及其各自的權重。

4. 除非董事會酌情另行決定，股東應注意，直接發給並由註冊處和轉帳代理接獲的所有申購、贖回與交換申請之交易處理的最後期限為紐約證券交易所 (NYSE) 正常交易時間結束 (通常是紐約時間下午 4 點和盧森堡時間晚上 10 點)。香港交易處理最後期限適用於發給並由香港代表接獲的所有此類申請，且此類申請將參考於估價日當天稍晚 (若當天並非估價日，則於下一個估價日) 紐約證券交易所正常交易時間結束時 (通常是紐約時間下午 4 時和盧森堡時間晚上 10 時) 確定的相關子基金相關類別之每股淨資產價值進行處理。於此類香港交易處理最後期限之後 (或者於某個香港非工作日) 發給並由香港代表接獲的申購、贖回與交換申請，將於香港的下一個工作日轉發給註冊處和轉帳代理，以便於下一個估價日生效。工作日應指盧森堡的銀行及紐約證券交易所的正常開放營業日。為避免造成疑惑，盧森堡的銀行半天工作日將視同為非營業日。

¹雖然上方列出的次級基金可以參與內部和外部 ESG 研究，並將財務上的重大可持續性風險納入投資決策過程，ESG 相關因素會予以考慮，但並非決定性因素，因此相關次級投資經理可以投資不接受 ESG 的發行人；因此，可持續性風險可能會對次級基金的中長期投資價值產生更重大的影響。這些次級基金的投資沒有考慮到歐盟環境可持續經濟活動的標準。



環球長 / 短倉股票基金

投資組合特徵

	多頭	空頭	摩根士丹利資本國際 (MSCI) 世界指數 (淨值) ³
貝他係數	0.93	1.43	1
市值中間值	256.4 億美元	117.9 億美元	1,258.4 億美元
市帳率	2.18倍	3.08倍	3.44倍
前瞻市盈率	12.35倍	120.00倍	18.81倍
股息收益	2.34%	1.14%	1.81%
每股收益增長率預測	11.05%	8.94%	12.75%
持股數目	157		1,465

來源：FactSet 和 Allspring Global Investments。

重要統計資料

	基金
阿爾法係數	1.17
夏普比率	0.36
標準差	11.14%
平方值	0.54
資訊比率	0.10
向上捕獲率	112.49%
向下捕獲率	106.98%
追蹤誤差	7.65%
相關係數	0.74
崔諾比率	0.04

基於業績表中所示的股份類別在 36 個月期間的淨回報率。相關測量值與基準 1 進行比較。

股份類別資訊 (股票類別和可用貨幣因司法轄區而異)

	成立日期	配息類型	ISIN 代碼	Bloomberg ID	資產淨值 (NAV)	年度管理費	總持續費用/總開支率 (TER) (%)**
IP 類股 (美元)	2017年7月31日	累計	LU1571399168	WFGLSIU LX	134.79	0.75	1.000

**總持續費用/總開支率 (TER) 反映該類別的年度總營運費用，不包括交易費用，並以資產淨值的百分比表示。顯示的數字來自目前的關鍵資訊文件 (KID)。投資經理做出承諾，當基金的總持續費用超過商定的總開支率 (TER) 時，將會償還子基金。總持續費用可能會隨時間而變化。

1. 該基金的業績基準為 50% MSCI 全球 / 50% ICE BofA 美國 3 個月期國庫券，並基於該基金的目標波動性比 MSCI 世界指數低 50%。在 2023 年 5 月 1 日之前，業績基準為 50% MSCI 全球 / 50% 3 個月倫敦同業拆借利率 (LIBOR)。摩根士丹利資本國際 (MSCI) 世界指數是經自由流通量調整的市值加權指數，旨在衡量發達市場的股市表現。您不能直接投資於指數。ICE BofA 美國 3 個月國庫券指數是衡量國庫券表現的指標，剩餘期限至最終期限少於 91 天。國庫券由美國政府擔保，如果持有至到期日，將提供固定的投資報酬率與固定的本金價值。版權所有 2023 年。ICE Data Indices, LLC。保留所有權利。您不能直接投資於指數。本基金使用 MSCI 全球指數作為選擇投資的參考，並使用 MSCI 全球指數的 50% 加上 ICE BofA 美國 3 個月國庫券指數的 50% 來計算績效費與業績比較。分基金的投資可能會大大偏離基準的組成部分及其各自的權重。

3. 摩根士丹利資本國際 (MSCI) 世界指數乃自由浮動調整之市值加權指數，旨在衡量發達市場之股票市場表現。閣下無法直接投資於此指數。本基金使用 MSCI 世界指數作為選擇投資的參考以及進行業績比較。本子基金的投資可能嚴重偏離基準的組成部分及其各自的權重。



環球長 / 短倉股票基金

香港投資人須知

所提供集體投資計劃已獲香港證券及期貨事務監察委員會（證監會）根據《香港證券及期貨條例》第 104 條授權。公開說明書/資料備忘錄/發售文件（如適用）已向證監會提交並獲授權，可向基金經理或其任何認可分銷商索取。在決定是否認購或購買基金前，潛在投資者應先讀公開說明書/資料備忘錄/發售文件（如適用）詳細了解基金。證監會對公開說明書/資料備忘錄/發售文件（如適用）的內容概不負責，亦不對其準確性或完整性做任何陳述。證監會註冊及授權並不代表推薦或認可基金，亦不保證基金管理人或基金的商業價值。並不意味著基金適合所有投資者，亦不代表認可基金適合任何特定投資者或投資者類別。

Allspring Global Investments (Allspring) 是 Allspring Global Investments Holdings, LLC 資產管理公司之商標名稱，而後者 是一家由 GTCR LLC 和 Reverence Capital Partners, L.P. 某些投資組合公司間接擁有之控股公司。Allspring 包括但不限於 Allspring Global Investments, LLC、Allspring Global Investments (UK) Ltd、Allspring Global Investments (Singapore) Pte. Ltd、Allspring Global Investments (Hong Kong) Limited 和 Allspring Global Investments (Japan) Limited。

有關 Allspring (Lux) Worldwide Fund 及其子基金（以下簡稱「基金」）的更多資訊，包括隱私政策、招股說明書副本或關鍵投資人資料文件，其中包括目標和風險完整資料等詳情，可向您所在地區的 Allspring 聯絡人索取，或造訪基金網站 www.allspringglobal.com。