

環球小型市值股票基金

目標與流程

- 尋求長期資本增值
- 至少三分之二的資產投資於位於世界各地的小市值公司的股本證券
- 投資於不少於三個國家/地區，並且可能在任何一個國家/地區投資超過 25%
- 尋求確定管理完善、資產負債表靈活、現金流充裕且相對於內在價值估值偏低的公司
- 根據 ESG 風險敞口，使用負面篩選排除公司發行的證券。
- 主要投資於全球小市值公司的股本證券（購買時處於 MSCI 全球小盤股指數市值範圍以內），但可在新興市場（在 MSCI 新興市場指數中的國家/地區營運的公司）投資高達 10%
- 可能利用期貨/衍生性金融商品以進行避險或高效的投資組合管理

主要風險

市場風險：證券可能由於普遍影響證券市場的因素而貶值，並且股本證券的價格波動通常比債務證券更大。**全球投資風險：**某些司法管轄區的證券可能會經歷更快速和極端的價值變化，並且可能受到諸如國際政治發展、貨幣波動和投資所在國家/地區法律法規的其他發展等不確定性的影響。**小公司證券風險：**市值較小的公司的證券往往比大公司的證券波動性更大，流動性更差。**ESG 風險：**應用企業永續目標 (ESG) 篩選挑選證券可能會導致失去某些證券或行業機會，因而可能導致業績表現低於同業。因為 ESG 篩選必須依賴第三方資料，而資料的錯誤可能導致不正確地包含或排除某種證券。

日曆年表現 (%)

過往業績並非未來業績之指標。

	2023	2022	2021
I 類股 (美元) (2020 年 2 月 20 日)*	14.81	-23.03	21.93
MSCI 全球小盤股指數 (淨值) ¹	15.76	-18.75	15.75

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
I 類股 (美元) (2020 年 2 月 20 日)*	-5.59	-2.26	-4.19	5.51	-3.78	—	—	3.55
MSCI 全球小盤股指數 (美元) ¹	-5.16	1.82	-1.00	10.00	-1.76	—	—	5.41

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。



環球小型市值股票基金

基金資訊

基金經理： James M. Tringas, CFA; Oleg Makhorine; Bryant VanCronkhite, CFA, CPA; Stephen Giggie, CFA; Brian Martin, 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： 2020年2月20日

資產類別： 全球股票

財政年度截止日期： 3月31日

基金規模： 32,150,000 (美元)

基準貨幣： 美元

基準指數： MSCI 全球小盤股指數 (淨值)¹

最低投資額 (或同等價值)：

類股 I: 1,000,000 (美元)

管理方法： 積極管理

可持續財務披露條例： 第 8 條[†]

重要統計資料

	基金
阿爾法係數	-2.10
貝他係數	0.95
夏普比率	-0.35
標準差	18.92%
平方值	0.92
資訊比率	-0.37
向上捕獲率	84.37%
向下捕獲率	97.95%
追蹤誤差	5.45%
相關係數	0.96
崔諾比率	-0.07

基於業績表中所示的股份類別在 36 個月期間的淨回報率。

地區投資分佈 (%)

		與基準相比 ¹	
北美	58.47		-5.59
歐洲	24.57		+6.82
日本	8.78		-3.50
亞太地區 (日本除外)	3.59		-1.27
非洲 / 中東	0.00		-1.05
現金及約當現金	4.59		+4.59

基於月底的最終比重。來源：FactSet。

交易商收市時間²

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 (%)

行業	28.50	與基準相比 ¹	+8.07
資訊科技	18.69		+7.63
原料	10.58		+2.88
必需消費品	9.92		+5.20
醫療保健	9.27		-0.26
非必需消費品	7.14		-5.98
金融	4.30		-10.73
能源	2.60		-2.69
房地產	2.60		-5.19
通訊服務	1.81		-1.02
現金及約當現金	4.59		+4.59

基於月底的最終比重。來源：FactSet。

投資組合特徵

	基金	基準指數 ¹
加權平均市值	29.9 億美元	44.4 億美元
加權中間值市值	29.4 億美元	36.4 億美元
每股收益增長率 (3 至 5 年 預測)	11.18%	12.29%
前瞻市盈率	15.38倍	16.08倍
市帳率	2.17倍	1.82倍
市銷率	1.52倍	1.70倍
持股數目	85	4,130

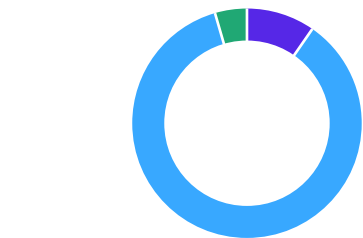
來源：FactSet 和 Allspring Global Investments。

最大持股 (%)

	基金
Innospec Inc.	4.09
Gibraltar Industries, Inc.	3.33
CSW Industrials, Inc.	3.30
Novanta Inc	3.18
Spectris plc	2.57
Ansell Limited	2.46
J & J Snack Foods Corp.	2.37
Hanover Insurance Group, Inc.	2.11
Alten SA	1.99
Enovis Corporation	1.85

基於月底的最終比重。來源：FactSet。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。

持股市值 (%)



- 9.65 - 中型市值 (50 億至 250 億美元)
- 85.85 - 小型市值 (5 億至 50 億美元)
- 4.50 - 微型市值 (5 億美元以下)

基於月底的最終比重。來源：FactSet。

1. 基金在選擇投資時使用 MSCI 全球小盤股指數和 MSCI 際新興市場指數作為參考，並使用 MSCI 全球小盤股指數來比較業績。分基金的投資可能會大幅偏離基準的組成部分及其各自的權重。

2. 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。

[†]促進環境和社會特性，但沒有可持續的投資目標。



環球小型市值股票基金

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) (%)**
I 類股 (美元)	2020 年 2 月 20 日	累計	LU2065732104	WEGSEIU LX	115.74	0.85	0.950

**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。

ESG 指標

所提供數據僅供透明和參考之用。環境、社會及公司治理 (ESG) 指標並不表示基金將如何或是否會使用 ESG 因子。此資訊基於第三方評級，除非在基金投資目標中另有說明，否則不會改變基金投資目標或限制基金可投資範圍。欲詳細了解基金投資策略，請查閱基金公開說明書。請造訪 allspringglobal.com 詳細了解永續性資訊揭露。

MSCI ESG 分數

	基金		基準指數	
	價值	覆蓋範圍	價值	覆蓋範圍
MSCI 整體分數	6.3	98%	6.0	99%

資料源自 MSCI ESG Research，其中公司的等級為 0 — 10 (0 - 最差, 10 - 最佳)。加權平均分數排除未評等證券的影響。

產品 / 活動參與度 (%)

	基金	基準指數 ¹
爭議性武器	0.00	0.12
油砂	0.00	0.04
輕兵器	0.00	0.08
燃料煤	0.00	0.56
煙草	0.00	0.45
UNGC 違規者	0.00	0.09

來源：Allspring Global Investments。此報告包含由 Sustainalytics 所開發的資訊。此類資訊與資料為 Sustainalytics 及 / 或其第三方供應商 (即第三方資料) 的專屬資訊，且僅供參考之用。它們不構成對任何產品或項目的認可，也不構成投資建議，並且我們對其完整性、及時性、準確性或對特定目的之實用性不做任何保證。使用時，必須遵守 <https://www.sustainalytics.com/legal-disclaimers> 上規定的條款。版權所有 © 2024 Sustainalytics。保留所有權利。

SUSTAINALYTICS ESG 風險分數

	價值	覆蓋範圍
基金	22	100%
基準指數	23	98%

ESG 風險評級衡量 ESG 風險敞口和管理。較低的風險評分反映較低的 ESG 風險。Sustainalytics ESG 風險評分以 0-100 等級衡量 ESG 風險 (0 為沒有風險，大於 40 為嚴重風險)。

碳特徵

	基金		基準指數		% 高於 / 低於 指標
	價值	覆蓋範圍	價值	覆蓋範圍	
碳投資價值 (公噸 CO ₂ e/\$1 MM 投資)*	64	100%	134	97%	-52%
(碳投資價值 (公噸 CO ₂ e/\$1 MM 投資))*	107	100%	188	97%	-43%

* 碳排放包括操作和第一層供應鏈溫室氣體排放。
資料來自 S&P Trucost Limited。



環球小型市值股票基金

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。