

本文件只供香港投資者使用

單位信託系列

基金月報 | 2022年6月30日

摩根日本 (日圓) 基金

- 本基金主要 (至少70%) 投資於日本股票證券及其投資表現與日本經濟表現息息相關之其他股票證券。本基金將有限度地投資於人民幣計價相關投資項目。
- 本基金須承受股票、集中、小型公司、貨幣、衍生工具、類別貨幣以及貨幣對沖類別的相關風險。人民幣對沖類別的人民幣貨幣及貨幣對沖類別風險。人民幣現時不可自由兌換。將境外人民幣 (CNH) 兌換為境內人民幣 (CNY) 是一項貨幣管理程序，須遵守由中國政府實施的外匯管制政策及限制。概無保證人民幣不會在某個時間貶值。在極端市況下市場未能提供足夠人民幣作兌換時及獲信託管理人批准後，經理人可以美元支付贖回所得款項及/或分派。
- 投資者可能須承受重大損失。
- 投資者不應單憑本文件作出投資決定。



投資目標

透過主要 (即將其總資產淨值至少70%) 投資於日本股票證券及其投資表現與日本經濟表現息息相關之其他股票證券，為投資者提供長遠資本增值。

投資專才

基金經理

Nicholas Weindling, Miyako Urabe, Shoichi Mizusawa

基金資料 ((累計) 日圓類別)

基本貨幣

日圓

總資產值 (百萬元)

303.0 美元

SEDOL 編號

B426081

ISIN 編號

HK0000055670

Bloomberg 編號

JFJAPNI HK

現時費用

認購費: 5.0% (以資產淨值計)

贖回費: 0%

管理費: 每年1.5%

報價貨幣及每單位資產淨值

(累計) 日圓類別: 43,238 日圓

(累計) 港元對沖類別: 24.83 港元

(累計) 美元對沖類別: 25.59 美元

(累計) 人民幣對沖類別: 19.80 人民幣

12個月之資產淨值

最高: 63,080.00 日圓 (14/09/21)

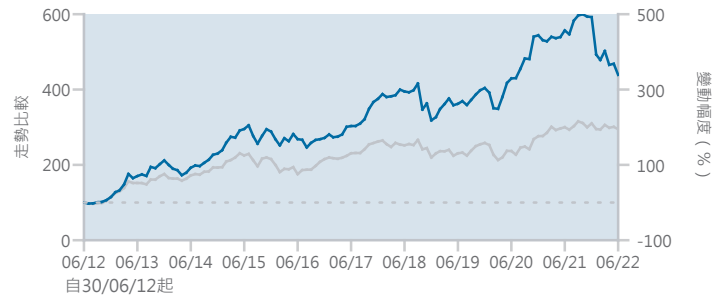
最低: 41,734.00 日圓 (20/06/22)

表現

累積表現 (%)

■ 摩根日本 (日圓) (累計)

■ 東京第一市場淨回報指數¹⁾



	一個月	一年	三年	五年	自成立至今	成立日期
(累計) 日圓類別	-6.3	-21.2	21.2	44.8	8428.0	06/08/69
基準指數 (以日圓計) ¹⁾	-2.1	-1.8	28.0	28.0	2310.0	
(累計) 港元對沖類別	-6.3	-21.2	23.0	50.9	148.3	01/08/13
(累計) 美元對沖類別	-6.3	-21.0	23.3	53.8	155.9	01/08/13
(累計) 人民幣對沖類別	-6.2	-19.1	30.7	66.8	98.0	16/03/15

年度表現 (%)

	2017	2018	2019	2020	2021	年初至今
(累計) 日圓類別	38.2	-15.2	27.0	34.6	8.9	-25.9
基準指數 (以日圓計) ¹⁾	21.8	-16.3	17.7	7.0	12.4	-5.0
(累計) 港元對沖類別	38.9	-14.0	29.5	35.0	9.0	-25.9
(累計) 美元對沖類別	39.6	-13.4	30.3	34.8	9.2	-25.8
(累計) 人民幣對沖類別	45.1	-12.0	30.2	37.7	11.8	-24.9

評級

Morningstar 基金研究評級 **銀獎**

Morningstar 星號評級 **★★★★**

Morningstar 基金組別 日本大型股票

1)再撥作投資之收益已減除預扣稅。自01.01.73起之各年期指數表現，已於01.02.05由「總回報」改為「淨回報」計算。01.01.73以前之數據則為東京第一市場價格 (只反映價格變動，未計股息)。2)除「平均每年回報」外，所有數據均以成立後第一個月月底開始計算。3)投資於任何單一實體或就任何單一實體承擔風險的總投資 (政府證券及其他公共證券除外) 不能超過有關基金總資產淨值的10%。4)頒發機構: Fund Selector Asia，反映30.06.2017至30.06.2020三年期間之波幅、表現一致性及評選結果。5)頒發機構:《彭博商業周刊/中文版》，反映截至2021年9月30日表現。6)頒發機構: Refinitiv Lipper，2022年獎項頒發予 (累計) - 日圓類別，反映截至31.12.2021表現。Refinitiv Lipper Fund Awards，2022 Refinitiv。版權所有。獲許可使用並受美國版權法保障。未經書面許可，不得印製、複印、轉發或轉播本內容。所有資料截至上一個月之最後計值日 (特別列明除外)。資料來源: 摩根資產管理 / RIMES (以報價貨幣資產淨值對資產淨值計算，收益再撥作投資。) 基金評級來源: Morningstar, Inc. 基金研究評級銀獎頒發予 (累計) 日圓類別; 4星號評級頒發予 (累計) 日圓類別。風險評級 (如有) 乃基於摩根資產管理就各類資產之相對風險及基金過去波幅評估而定，並每年 (或適當時候) 作檢討，僅供參考。本基金於任何項目之投資比重如有超越投資限制所指定之限額，乃基於市場變動所致，並會在短期內修正。由於基金註冊地之差別，單位信託系列與SICAV系列基金用作計算公平估值 (如適用) 之估值點可能有所不同。詳情請參閱有關銷售文件。澳元/加元/歐元/英鎊/紐元/人民幣/新加坡元對沖類別 (如適用) 並不適合基本貨幣並非前述貨幣的投資者。

投資回報以報價貨幣計算。若基金/類別以外幣報價，以美元/港元為本的投資者可能須承受匯率波動影響。投資涉及風險。過去業績並不代表將來表現。請參閱銷售文件所載詳情，包括風險因素。本文件未經證監會審閱，由摩根基金 (亞洲) 有限公司刊發。

查詢詳情，請聯絡閣下之銀行、財務顧問或瀏覽 am.jpmorgan.com/hk。

投資組合分析 ((累計) 日圓類別)

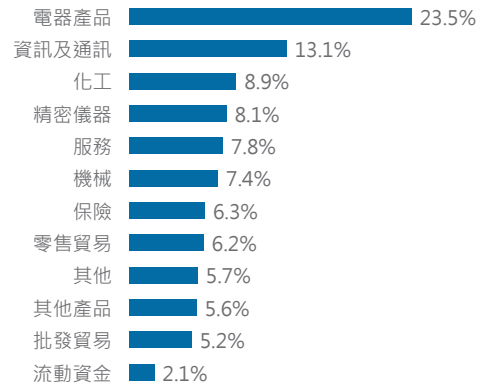
	三年	五年	自成立至今 ²⁾
相關系數	0.77	0.80	0.83
年化Alpha系數 (%)	-0.87	3.10	2.94
Beta系數	0.97	1.02	1.07
年化波幅 (%)	18.68	18.77	22.74
Sharpe比率	0.36	0.41	-
年化追蹤誤差 (%)	11.84	11.26	12.90
平均每年回報 (%)	6.62	7.69	8.76

投資項目³⁾ (截至2022年5月底)

十大投資項目	市場類別	%
Sony Group Corporation	日本 電器產品	7.0
Keyence Corporation	日本 電器產品	6.8
HOYA CORPORATION	日本 精密儀器	5.9
Tokio Marine Holdings, Inc.	日本 保險	5.7
Shin-Etsu Chemical Co Ltd	日本 化工	5.5
Tokyo Electron Ltd.	日本 電器產品	5.1
Recruit Holdings Co., Ltd.	日本 服務	4.2
SMC Corporation	日本 機械	4.1
OBIC Co., Ltd.	日本 資訊及通訊	3.8
Nomura Research Institute, Ltd.	日本 資訊及通訊	3.7

投資組合分布

類別分布



1)再撥作投資之收益已減除預扣稅。自01.01.73起之各年期指數表現，已於01.02.05由「總回報」改為「淨回報」計算。01.01.73以前之數據則為東京第一市場價格 (只反映價格變動，未計股息)。2)除「平均每年回報」外，所有數據均以成立後第一個月底開始計算。3)投資於任何單一實體或就任何單一實體承擔風險的總投資 (政府證券及其他公共證券除外) 不能超過有關基金總資產淨值的10%。4)頒發機構：Fund Selector Asia，反映30.06.2017至30.06.2020三年期間之波幅、表現一致性及評選結果。5)頒發機構：《彭博商業周刊/中文版》，反映截至2021年9月30日表現。6)頒發機構：Refinitiv Lipper，2022年獎項頒授 (累計) - 日圓類別，反映截至31.12.2021表現。Refinitiv Lipper Fund Awards，2022 Refinitiv，版權所有。獲許可使用並受美國版權法保障。未經書面許可，不得印製、複印、轉發或轉播本內容。所有資料截至上一個月之最後計值日 (特別列明除外)。資料來源：摩根資產管理 / RIMES (以報價貨幣資產淨值對資產淨值計算，收益再撥作投資。) 基金評級來源：Morningstar, Inc. 基金研究評級銀獎頒授 (累計) 日圓類別；4星號評級頒授 (累計) 日圓類別。風險評級 (如有) 乃基於摩根資產管理就各類資產之相對風險及基金過去波幅評估而定，並每年 (或適當時候) 作檢討，僅供參考。本基金於任何項目之投資比重如有超越投資限制所指定之限額，乃基於市場變動所致，並會在短期內修正。由於基金註冊地之差別，單位信託系列與SICAV系列基金用作計算公平估值 (如適用) 之估值點可能有所不同。詳情請參閱有關銷售文件。澳元/加元/歐元/英鎊/紐元/人民幣/新加坡元對沖類別 (如適用) 並不適合基本貨幣並非前述貨幣的投資者。

投資回報以報價貨幣計算。若基金/類別以外幣報價，以美元/港元為本的投資者可能須承受匯率波動影響。投資涉及風險。過去業績並不代表將來表現。請參閱銷售文件所載詳情，包括風險因素。本文件未經證監會審閱，由摩根基金 (亞洲) 有限公司刊發。

查詢詳情，請聯絡閣下之銀行、財務顧問或瀏覽am.jpmorgan.com/hk。