東方匯理系列基金環球債券基金 - A2 美元

月報

30/04/2021

債券 ■

1. 本基金主要投資於由經合組織成員國的發行人所發行的投資級債券。
2. 投資於本基金或會承受利率、流動性、信貸、對手方、預付及匯率的風險。本基金可投資於資產抵押證券(ABS)/按揭證券(MBS)和具有吸收虧損特性的債務工具（「吸收虧損工具」），可能需承受信貸違約掉期風險和降級風險。
3. 本基金可運用金融衍生工具作有效投資組合管理及作為取得參與淨額投資於各種資產、市場或其他投資機會的方式。金融衍生工具也可能大量用於投資用途。本基金的金融衍生工具投資淨額槓桿比率或會超過其資產淨值的100%。運用金融衍生工具可涉及額外風險如對手方風險、波動、流動性和估值風險。本基金可能運用高槓桿及可能因運用金融衍生工具而導致損失。
4. 本基金的價值可能會波動，且可能在短時間內大幅下跌，令投資者蒙受重大損失。
5. 投資者不可單靠本文而作出投資決定。

重要資料

每單位資產淨值 : 31.37 (美元)
基金規模 : 251.02 (百萬 美元)
每單位資產淨值和基金規模截至 : 30/04/2021
基金貨幣 : 美元
基準 : JP Morgan Government Bond Global All Maturities Unhedged in USD 指數
ISIN 號碼 : LU0839533063
彭博代號 : ABDACUA LX

投資目標

透過主要投資於由經合組織成員國的發行人所發行的投資級債券以達到結合收益及資本增長(總回報)為目標。投資可包括按揭證券(MBS)及資產抵押證券(ABS)。子基金主要投資於債券及貨幣(間接透過金融衍生工具(「FDI」))。子基金積極持有的貨幣倉盤未必與子基金的相關資產(即債券)互相對應。

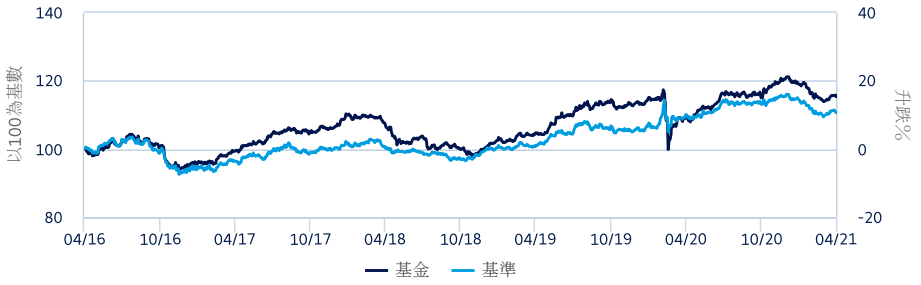
具體而言，子基金至少以67%資產投資於由經合組織成員國政府或超國家機構發行或保證(至少佔資產的60%)或由公司實體發行的投資級債券。這些投資並未設定貨幣限制。

基金資料

子基金成立日期 : 04/01/1993
股份類別 : 累算
管理費 (每年) : 0.90%
認購費 (最高) : 4.50%
轉換費 (最高) : 1.00%
資產淨值計算頻率 : 每日

基金表現

29/04/2016 - 30/04/2021



累積表現 *

自	年初至今 31/12/2020	3個月 29/01/2021	6個月 30/10/2020	1年 30/04/2020	3年 30/04/2018	5年 29/04/2016	自成立日 04/01/1993
基金	-4.82%	-3.18%	0.29%	5.41%	7.28%	15.33%	361.28%
基準	-4.62%	-3.32%	-2.19%	0.45%	9.83%	10.65%	289.17%

年度表現 *

	2016	2017	2018	2019	2020
基金	1.49%	12.10%	-5.66%	12.94%	6.67%
基準	1.57%	6.83%	-0.66%	6.02%	9.68%

* 所有表現資料以美元、資產淨值對資產淨值、股息再投資計算。

基金統計數據

	基金	基準
基金經修訂存續期	6.05	8.22

經修訂存續期採用利率與債券價格以相反方向變動的定律來衡量。此量度法用以計算每 1% 的利率變動對債券價格所產生的效應。此指標以經修訂存續期單位顯示。

風險指標

	3年
基金年波幅率	8.28%
追蹤誤差	5.33%
資料比率	-0.11
夏普指數	0.18

統計資料來源：東方匯理資產管理
所有統計資料均根據資產淨值計算

東方匯理系列基金環球債券基金 - A2 美元

月報
30/04/2021

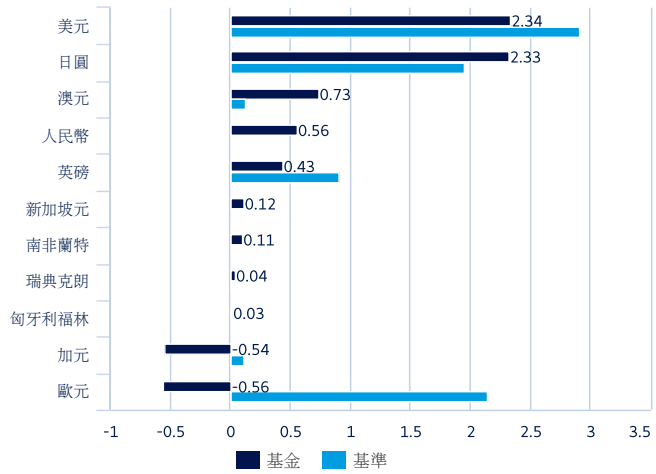
債券 ■

資產分佈

15大發行商

	基金
ITALIAN REPUBLIC	18.55%
FRANCE	12.00%
UNITED STATES OF AMERICA	8.95%
UNITED KINGDOM	5.54%
GERMANY	5.09%
SPAIN (KINGDOM OF)	3.99%
JAPAN	2.46%
INTESA SANPAOLO SPA	2.12%
SOUTH AFRICA	2.00%
ELECTRICITE DE FRANCE SA	1.93%
AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	1.84%
ROMANIA	1.72%
PETROLEOS MEXICANOS	1.57%
VOLKSWAGEN INTL FIN NV	1.57%
TOTAL SE	1.34%

經修訂存續期



包括衍生工具

所有資料截至本文日期，除非另外申明。

從二零一九年十月一日起，Amundi (UK) Limited獲委任接替Amundi Asset Management擔任子基金的投資經理。從二零一八年一月一日起，Pioneer Asset Management S.A. 已取代Amundi Luxembourg S.A. 為子基金的管理公司。在此變更之後，Pioneer Asset Management S.A. 易名為Amundi Luxembourg S.A.。從二零一七年七月三日起，子基金的投資目標及政策被修訂。從二零一四年六月二日起，基金的投資目標、政策及總風險數額釐定方法已被修訂。基金的參考指標亦更改為「J.P. Morgan Government Bond Global All Maturities Unhedged in USD」指數，以代替「JPM Global Government Bond」指數。 從二零一三年二月十二日起，香港股東在子基金的ＡＵ類別之股份已自動轉換至Ａ２Ｕ類別，並採用與ＡＵ類別當時的費用及收費結構。在二零一三年二月十二日前之子基金Ａ２Ｕ類別的表現依據東方匯理系列基金環球債券基金ＡＵ類別之表現計算，而ＡＵ類別已非證監會認可的基金類別及其不能向香港公衆發售。於二零一一年六月二十四日，法興基金／世界債券被併入東方匯理系列基金環球債券基金。二零一一年六月二十四日前之子基金表現依據東方匯理系列基金環球債券基金之表現計算。投資目標曾於二零零七年十一月十五日被修改。東方匯理ＣＡＡＭ系列基金美元債券基金於二零零八年十二月十二日合併至東方匯理ＣＡＡＭ系列基金環球債券基金。

於二零一九年六月一日起，各類別的命名已標準化。東方匯理ＣＡＡＭ系列基金環球債券基金於二零一零年三月二日易名為東方匯理系列基金環球債券基金。

免責聲明

本文乃由東方匯理資產管理香港有限公司編製。本文及所提及之網站並未得到香港證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）的審閱。投資者不可單靠本文而作出投資決定。投資涉及風險。市場、基金經理以及投資的過往表現及任何基金投資的經濟市場、股市、債市或經濟趨勢預測並非將來表現依據。投資回報以非港元或美元為單位可能因匯率波動而令投資總值下跌或上升。投資可跌可升，投資者必須閱讀銷售文件以取得更詳盡資料，尤其當中所列載投資風險之陳述。基金或可能投資於金融衍生工具，作為其投資策略的其中一部份，亦有可能投資於新興市場、小型公司等證券或固定收益證券。這類型投資會涉及較大投資風險，對價格走勢亦會較為敏感。基金價格的波動性相對亦會增加。固定收益證券之發行人可能無法履行其義務及有關基金無法收回其投資。銷售文件內有更多風險因素之陳述。投資者必須留意一些因當時市場情況而產生的新風險，方可決定選購有關基金。

本文不擬提供於美國公民、美國居民或任何根據美國1933年証券法下的規則S或基金說明書中所定義的「美國人士」。