



摩根澳洲基金

- 本基金主要 (至少70%) 投資於在澳洲證券交易所上市的股票證券。
- 本基金須承受股票、集中、貨幣、流通性、衍生工具及類別貨幣的相關風險。
- 本基金須承受與根據多重因素(包括價值、質素及動力因素)挑選證券的專有定量流程相關的風險。
- 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%) 投資於在澳洲證券交易所上市的公司股票證券, 為投資者提供長遠資本增值。

投資專才

基金經理

Albert Chuang, Pingyi Lin

基金資料

((累計) 美元類別)

基本貨幣

美元

總資產值 (百萬元)

26.0 美元

SEDOL 編號

B413TL9

ISIN 編號

HK0000055613

Bloomberg 編號

JFAAUTI 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0.75%

報價貨幣及每單位資產淨值

(累計) 美元類別: 35.40 美元

(累計) 澳元類別: 15.28 澳元

12個月之資產淨值

最高: 40.12美元 (16/01/20)

最低: 20.22美元 (23/03/20)

評級

Morningstar 基金組別

澳洲及紐西蘭股票

風險評級

1 2 3 4 5

表現

累積表現 (%)



| | 一個月 | 一年 | 三年 | 五年 | 自成立至今 | 成立日期 |
|---------------------------|-----|-------|-------|------|--------|----------|
| (累計) 美元類別 | 5.0 | -8.0 | -10.1 | 3.0 | 331.8 | 15/06/81 |
| 基準指數 (以美元計) ¹⁾ | 4.8 | -6.1 | 5.3 | 26.1 | 1113.1 | |
| (累計) 澳元類別 | 0.9 | -11.5 | 0.1 | 5.5 | 52.8 | 28/12/12 |

年度表現 (%)

| | 2015 | 2016 | 2017 | 2018 | 2019 | 年初至今 |
|---------------------------|------|------|------|-------|------|-------|
| (累計) 美元類別 | -5.8 | 5.9 | 18.6 | -20.4 | 17.6 | -9.3 |
| 基準指數 (以美元計) ¹⁾ | -8.6 | 11.3 | 20.9 | -12.7 | 23.6 | -8.2 |
| (累計) 澳元類別 | 6.0 | 6.4 | 9.7 | -11.5 | 17.8 | -11.1 |

1)01.04.00以前之數據為澳洲所有普通股價格 (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)頒發機構: AsianInvestor雜誌, 2020年獎項, 反映上年表現。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 / Thomson Reuters Datastream (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. 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。

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) 美元類別)

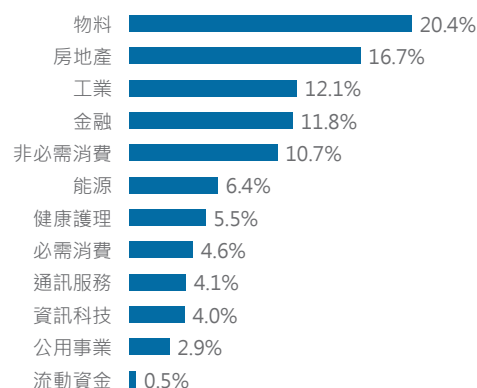
| | 三年 | 五年 | 自成立至今 ²⁾ |
|---------------|-------|-------|---------------------|
| 相關系數 | 0.98 | 0.98 | 0.89 |
| Alpha系數 (%) | -0.43 | -0.34 | -0.16 |
| Beta系數 | 1.08 | 1.03 | 0.95 |
| 年化波幅 (%) | 23.50 | 20.78 | 24.07 |
| Sharpe比率 | - | - | - |
| 年化追蹤誤差 (%) | 4.63 | 4.23 | 10.83 |
| 平均每年回報 (%) | -3.49 | 0.60 | 3.81 |

投資項目 (截至2020年6月底)

| 十大投資項目 | 市場類別 | % |
|-------------------------------------------------|-------------|-----|
| Fortescue Metals Group Ltd | 澳洲 物料 | 1.7 |
| CSL Limited | 澳洲 健康護理 | 1.5 |
| Commonwealth Bank of Australia | 澳洲 金融 | 1.5 |
| BHP Group Ltd | 澳洲 物料 | 1.4 |
| Westpac Banking Corporation | 澳洲 金融 | 1.3 |
| Wesfarmers Limited | 澳洲 非必需消費 | 1.3 |
| Woolworths Group Ltd | 澳洲 必需消費 | 1.3 |
| National Australia Bank Limited | 澳洲 金融 | 1.3 |
| Australia and New Zealand Banking Group Limited | 澳洲 金融 | 1.2 |
| Rio Tinto Limited | 澳洲 物料 | 1.2 |

投資組合分布

類別分布



1)01.04.00以前之數據為澳洲所有普通股價格 (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)頒發機構: AsianInvestor雜誌, 2020年獎項, 反映上年底表現。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 / Thomson Reuters Datastream (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. 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。

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。