

東方匯理系列基金有型資產目標收益基金

月報

29/05/2026

多元資產 ■

1. 本基金主要（即至少51%的資產淨值）透過投資於世界任何地方（包括新興市場）的股票及任何信貸質素的政府及公司債券以持有實質資產。
2. 投資於本基金或會承受外匯／貨幣風險、集中風險、實質資產風險、新興市場風險、股票風險和股票掛鉤工具風險，同時亦涉及與動態資產配置策略相關的風險、中小型公司風險、歐洲主權債務危機風險、以及與特定市場／地區的監管／交易所規定／政策相關的風險，和債務證券相關風險。
3. 本基金可運用金融衍生工具作對沖，作有效投資組合管理及作為取得參與投資（長倉或短倉）於各種資產、市場或其他投資機會的方式。運用金融衍生工具可涉及額外風險如信貸/交易對手風險、波動及流動性風險、估值風險和場外交易風險。本基金可能具有槓桿比率，並會在運用金融衍生工具時蒙受損失。
4. 人民幣現時並未可自由兌換，須受限於外匯管制及限制。在特殊情況下，以人民幣支付贖回所得及／或股息可能因適用於人民幣的外匯管制和限制而有所延誤。
5. 就對沖類別而言，概不保證基金經理運用的對沖技巧會充分而且有效地達至理想的結果和效用。此外，對沖類別的波動可能高於以子基金數貨幣計值的同等類別。如用作對沖的投資工具的手續違約，對沖類別的投資者或須承受相關計值貨幣的非對沖貨幣匯率風險，並可能因此蒙受進一步的損失。
6. 就派息股份類別而言，本基金可酌情決定以本基金的收入或資本或實際上從本基金的資本中支付股息。從資本支付股息及／或實際上從資本中支付股息相當於退還或提取投資者部分原有之投資或任何歸屬於該原有投資的資本收益。任何涉及從本基金的資本中支付股息或實際上從本基金的資本中支付股息（視情況而定）均可導致本基金每股資產淨值即時減少。
7. 本基金的價值可能會非常波動，且可能在短時間內大幅下跌，令投資者蒙受損失。
8. 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：86.93 (美元)
基金規模：192.41 (百萬美元)
每單位資產淨值和基金規模截至：29/05/2026
基金貨幣：美元
基準：無
ISIN 號碼：LU1883866441
彭博代號：ARATA2U LX

投資目標

提供收益，其次是為閣下的投資增值。
本基金主要（即至少51%的資產淨值）透過投資於世界任何地方（包括新興市場）的股票及任何信貸質素的政府及公司債券以持有實質資產。

基金資料

子基金成立日期：28/03/2014
股份類別：累算
管理費 (最高每年)：1.50%
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

31/05/2021 - 29/05/2026



基金統計數據

| | 基金 |
|--------|------|
| 經修訂存續期 | 1.21 |
| 投資項目數量 | 513 |

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 | 9.77% |
| 追蹤誤差 | 不適用 |
| 資訊比率 | 不適用 |
| 夏普比率 | 11.34 |

統計資料來源：東方匯理資產管理
所有統計資料均依據A2美元(C)類別之資產淨值計算。



多元資產 ■

累積表現*

| | | 每單位資產淨值 | 1個月 | 3個月 | 6個月 | 1年 | 3年 | 5年 | 成立至今 | 年初至今 |
|------------------|-----|---------|-------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| A2 美元 (C) | 美元 | 86.93 | 1.89% | 0.45% | 13.50% | 29.77% | 38.80% | 32.43% | 73.86% | 12.63% |
| A2 美元 MTI (D) | 美元 | 55.47 | 1.89% | 0.44% | 13.49% | 29.77% | 38.76% | - | 42.91% | 12.63% |
| A2 港元 MTI (D) | 港元 | 52.89 | 1.95% | 0.64% | 14.26% | 29.70% | 38.94% | - | 31.60% | 13.42% |
| A2 人民幣對沖 MTI (D) | 人民幣 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| A2 澳元對沖 MTI (D) | 澳元 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

年度表現*

| | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 成立日期 | ISIN號碼 |
|------------------|--------|--------|---------|--------|--------|------------|--------------|
| A2 美元 (C) | 13.30% | -6.38% | 3.59% | -0.46% | 18.94% | 28/03/2014 | LU1883866441 |
| A2 美元 MTI (D) | - | 3.46%^ | 3.60% | -0.47% | 18.92% | 11/07/2022 | LU2462611646 |
| A2 港元 MTI (D) | - | - | -1.67%^ | -1.00% | 19.19% | 23/01/2023 | LU2498475776 |
| A2 人民幣對沖 MTI (D) | - | - | - | - | - | 有待成立 | LU2538405874 |
| A2 澳元對沖 MTI (D) | - | - | - | - | - | 有待成立 | LU2538405957 |

* 所有表現資料以有關類別的貨幣、資產淨值對資產淨值、股息再投資計算。

^ 表現資料由類別成立日至有關公曆年的12月31日計算。

最近一次派息及年率化派息率**

| | 月份 | 派息 | 除息日 | 年率化派息率** |
|------------------|---------|------------|------------|----------|
| A2 美元 MTI (D) | 05/2026 | 美元 0.27350 | 26/05/2026 | 6.1% |
| A2 港元 MTI (D) | 05/2026 | 港元 0.25900 | 26/05/2026 | 6.0% |
| A2 人民幣對沖 MTI (D) | 05/2026 | 人民幣 - | - | - |
| A2 澳元對沖 MTI (D) | 05/2026 | 澳元 - | - | - |

** 年率化派息率 = (1 + 每單位月度派息/除息日資產淨值)^12-1。年率化派息率可能高於或低於實際全年派息率。正派息率並不代表正回報，基金派息並無保證。

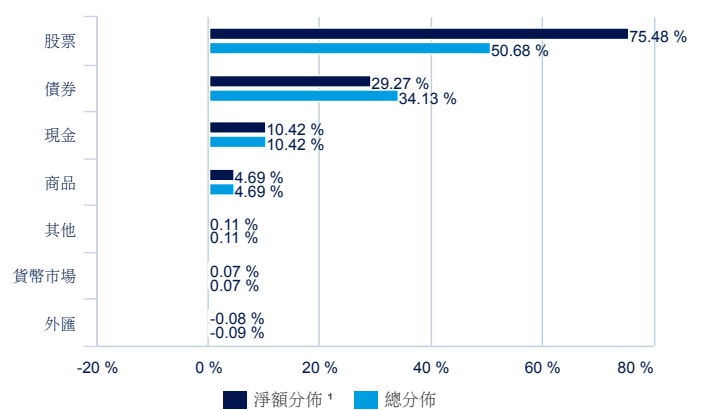
資產分佈

十大投資項目

| | 基金* |
|---|-------|
| US TSY 6.375% 08/27 | 5.66% |
| AMUNDI PHYSICAL GOLD ETC | 3.85% |
| US TSY 6.25 05/30 | 3.73% |
| AMUNDI GOLD STOCK - I (C) | 3.41% |
| INVESCO MORN* US ENRGY INFRA MLP ETF(LSE) | 2.86% |
| US TII 3.375% 04/32 | 2.16% |
| US TSY 4.75% 11/53 | 1.42% |
| TII 1% 02/49 | 1.26% |
| EXXON MOBIL CORP | 1.12% |
| US TII 3.875% 04/29 | 0.99% |

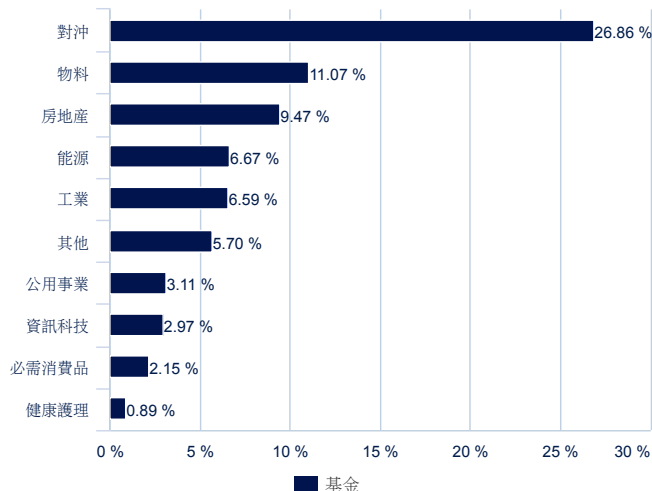
* 以上是基金的主要持股（貨幣市場除外）
所列持股不應被視為買賣任何特定證券的建議。

資產配置

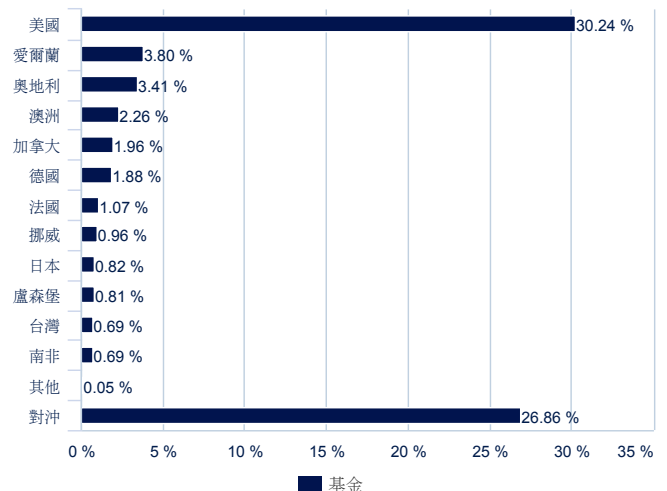


¹ 包括衍生工具

行業分佈 (股票分析)



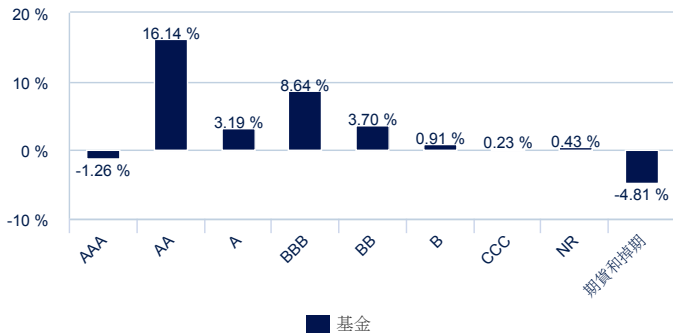
地域分佈 (股票分析)



多元資產 ■

信貸評級分佈 (債券及貨幣市場分析)

佔總資產百分比



所有資料截至本文日期，除非另外申明。

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，方可決定認購有關基金。

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

^^ © Morningstar 2026。版權所有。數據截至30/04/2026。本文所載資料：(1)屬於 Morningstar及/或其資料提供者的專利；(2)不可複印或分發；及(3)不保證準確、完整或適時。Morningstar及其資料提供者不會就使用本資料而引起的任何損害或損失承擔責任。過往表現並不保證將來業績。