

# 摩根菲律賓基金

單位信託系列

2017年8月

- 本基金主要投資於以菲律賓為基地或在當地經營之公司之證券。
- 本基金須承受新興市場、分散投資、流通性、貨幣及股票風險。
- 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

主要投資於業務重點集中在菲律賓的上市公司，以提供長期資本增值。

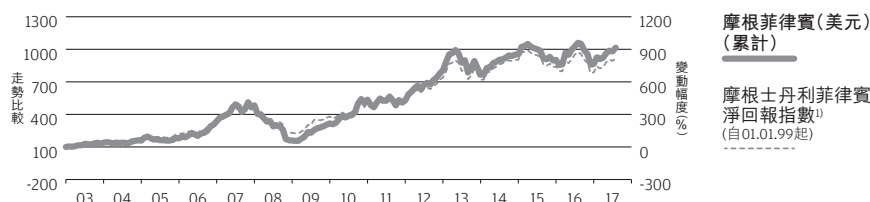
## 基金資料

基金經理	王長祺/梁素芬(新加坡)	
成立日期	29.07.74	
總資產值	102.0 百萬美元	
報價貨幣及每單位資產淨值	122.60 美元	
12個月之資產淨值：	最高	130.98 美元 (10.08.16)
	最低	100.22 美元 (22.12.16)
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%
SEDOL 編號	B42HY15	
ISIN 編號	HK0000055779	
Bloomberg 編號	JFPHIL HK	

## 統計分析

	三年	五年	自成立至今 <sup>2)</sup>
相關系數	0.99	0.99	-
Alpha系數(%)	0.18	0.07	-
Beta系數	0.96	1.00	-
年化波幅(%)	14.44	16.75	29.87
Sharpe比率	0.23	0.46	-
年化追蹤誤差(%)	2.39	2.56	-
平均每年回報(%)	3.83	7.98	6.88

## 31.12.02至31.07.17表現 (以報價貨幣計)



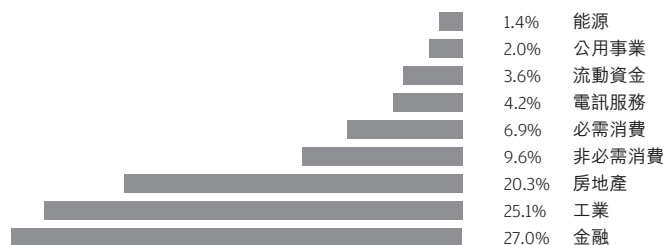
## 累積表現(%) (以報價貨幣計)

	一個月	一年	三年	五年	自成立至今
(累計)美元類別基準指數 <sup>1)</sup>	+3.5	-4.3	+11.9	+46.8	+1,654.5
基金淨值 <sup>1)</sup>	+2.2	-6.1	+5.1	+40.9	-

## 年度表現(%) (以報價貨幣計)

	2012	2013	2014	2015	2016	年初至今
(累計)美元類別基準指數 <sup>1)</sup>	+52.5	-4.8	+24.1	-5.1	-4.3	+17.4
基金淨值 <sup>1)</sup>	+46.4	-2.7	+25.6	-6.8	-6.6	+16.2

## 投資組合分析



## 五大投資項目 (截至2017年6月底)

項目	類別	地區	百分比
BDO Unibank, Inc.	金融	菲律賓	9.9
Ayala Land Inc.	房地產	菲律賓	9.2
Ayala Corp.	金融	菲律賓	6.6
SM Prime Holdings, Inc.	房地產	菲律賓	6.4
JG Summit Holdings Inc.	工業	菲律賓	6.2

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計，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。投資者務請在投資前向我們的投資顧問查詢。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。如有需要可提供十大投資項目詳情。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。1)再撥作投資的收益已減除預扣稅。01.01.99以前之數據為摩根士丹利菲律賓總回報。01.01.88以前之數據為菲律賓交易所價格指數。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：財資雜誌，2017年獎項，反映上年度表現。

**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。

查詢請聯絡閣下之  
銀行、財務顧問或瀏覽  
[www.jpmorganam.com.hk](http://www.jpmorganam.com.hk)