

AMUNDI FUNDS VOLATILITY WORLD

月報

29/05/2026

絕對表現 ■

警告:

本文並沒有得到任何香港監管機構的審閱，亦沒有任何香港監管機構對本文所載之基金的財務資料之完整性、陳述及意見之準確性負責。投資者對有關認購務必加以留意。投資者如對本文之內容有任何疑問，請向專業人士徵求獨立意見。

1. 本基金主要投資於貨幣市場工具和於流動性最強的股票指數的上市衍生工具。
2. 投資於本基金或會承受貨幣、利率、股票和新興市場風險，同時亦涉及管理、投資基金和可持續投資相關的風險。
3. 本基金可大量運用金融衍生工具以減低各種風險、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（包括專注於股票、利率、外匯和股息的衍生工具）。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。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. 本基金的價值可能會波動，且可能在短時間內下跌，令投資者蒙受損失。
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：107.77 (美元)
基金規模：778.74 (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：
100% CAPITALIZED SOFR WITH ONE DAY LAG + 3%
ISIN 號碼：LU1103150824
彭博代號：AMVWA2U LX

投資目標

子基金旨在透過將其大部分資產投資於貨幣市場工具，在任何市況下締造正回報（絕對回報策略）。具體來說，子基金投資於平均期限為一年的美國、歐元區和亞洲指數的交易所買賣期權和方差掉期。

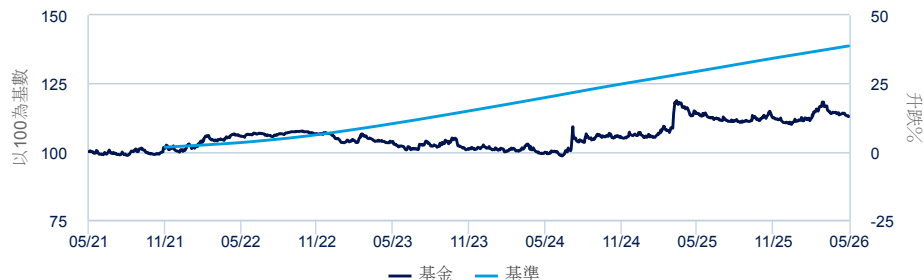
子基金積極管理，並尋求於建議持有期內錄得每年優於 Secured Overnight Financing Rate (SOFR) + 3% 指數（“基準”）的回報（扣除適用費用後），同時控制風險水平。

基金資料

子基金成立日期：20/05/2020
股份類別：累算
管理費（最高每年）：A2美元：1.35%
A美元：1.20%
認購費（最高）：4.50%
轉換費（最高）：1.00%
表現費：
A2美元：無
A美元：任何高於Secured Overnight Financing Rate (SOFR) + 3%指數的回報的20%（每年度支付）
資產淨值計算頻率：每日

基金表現

31/05/2021 - 29/05/2026



風險指標

	3年
基金年波幅率	9.24%
追蹤誤差	9.06%
資訊比率	-0.54
夏普比率	-0.21

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。

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	107.77	-0.92%	0.89%	0.45%	-1.02%	8.78%	12.87%	7.38%	1.86%
基準(以美元計)	-	-	0.52%	1.67%	3.38%	7.19%	25.80%	-	-	2.75%
A 美元 (C)	美元	116.71	-0.90%	0.94%	0.53%	-0.81%	9.33%	12.94%	16.71%	1.93%

年度表現*

	2021	2022	2023	2024	2025	成立日期	ISIN號碼
A2 美元 (C)	-4.17%	6.47%	-4.75%	4.78%	4.12%	20/05/2020	LU1103150824
基準(以美元計)	-	4.84%	8.30%	8.56%	7.51%	30/11/2021	-
A 美元 (C)	-4.10%	5.94%	-4.63%	4.93%	4.34%	15/11/2007	LU0319687124

* 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。

非香港證券及期貨事務監察委員會認可基金。
僅供專業投資者，不得向公眾傳閱。

絕對表現 ■

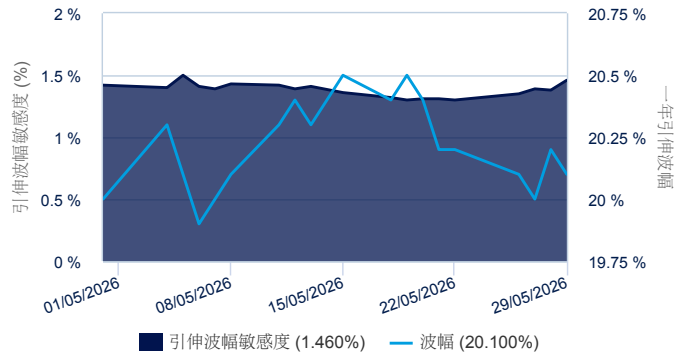
配置標準 (引伸波幅敏感度)

一年引伸波幅	引伸波幅敏感度*
>35%	-1 with +/-1
30%-35%	-0.5 with +/-1
25%-30%	0 with +/-1
20%-25%	+1 with +/-1
15%-20%	+2 with +/-1
<15%	+3 with +/-1

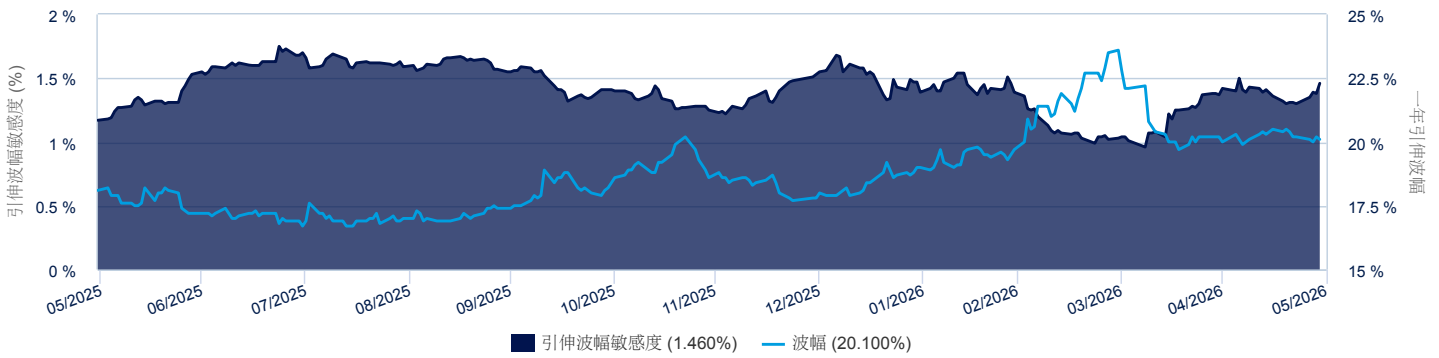
配置標準僅供參考。基金經理對配置標準有+1/-1 的酌情決定權。配置標準或會視乎環境轉變而不時檢討。

* 引伸波幅敏感度配置: 量度基金對引伸波幅每變動1%的敏感度。

月內引伸波幅敏感度及波幅變化



過去12個月內引伸波幅敏感度及引伸波幅變化



所有資料截至本文日期，除非另外申明。

免責聲明

投資涉及風險。本文及所提及之網站乃由東方匯理資產管理香港有限公司編製。過往表現資料並不代表將來表現。本文只能分發予獲准接受之人仕，及任何可能接受本文而沒有違反適用法例及條例之人士。有關本文之資料，不可作任何散播、翻印、複印、更改及全部或部份的傳譯，本文僅供由證券及期貨條例所定義的專業投資者使用而並非零售投資者。本文提及的所有基金並未得到香港證券及期貨事務監察委員會的認可。因此，這些基金不能向香港公眾發行及不可以公開接受認購以及用刊登廣告等形式在香港銷售。

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」。