ALBANY CREEK
Investment Management (Cayman) Limited

NAV per share
1290.43

澳本利-債券系列基金
Albany Creek Bond Series SP

債券系列的投資目標是中、長遠資本增值

投資管理團隊採用以3大元素組成的投資策略架構及其獨特的數據模型，致力減低投資組合的波動性並提高投資標的的質素，從根本上提高穩定性及構建下跌風險較低的投資組合。

投資策略三大元素

1. 低波動性收益混合策略（LVFI）

- 利用低波動資產對市場不敏感的特點，提高投資組合的抗跌性
- 嚴謹挑選的平衡風險回報最大化的低波動資產，擴大投資組合優勢

2. 週期性資產分配（CAAP）

- 依照復甦、繁榮、緩滯、衰退等四個階段分別尋找最適配之市場及工具，以獲取投資報酬最大化

3. 槓鈴策略（ Barbell Strategy ）

- 透過平衡短年期債券的流動性及長年期債券的高收益，為投資組合提供流動性的同時，起到資本保值的作用

風險管理

風險管理團隊把風險管理機制分為4個步驟執行：1）量化市場數據并套用風險係數模型；2）人工評估及撰寫風險評估報告；3）構建處理方案并由投資委員會進行審核；4）持續監察市場動向和完善解決方案。風管機制有效提升投資組合的穩定性，盡可能把每月平均波動率維持在1%以內。

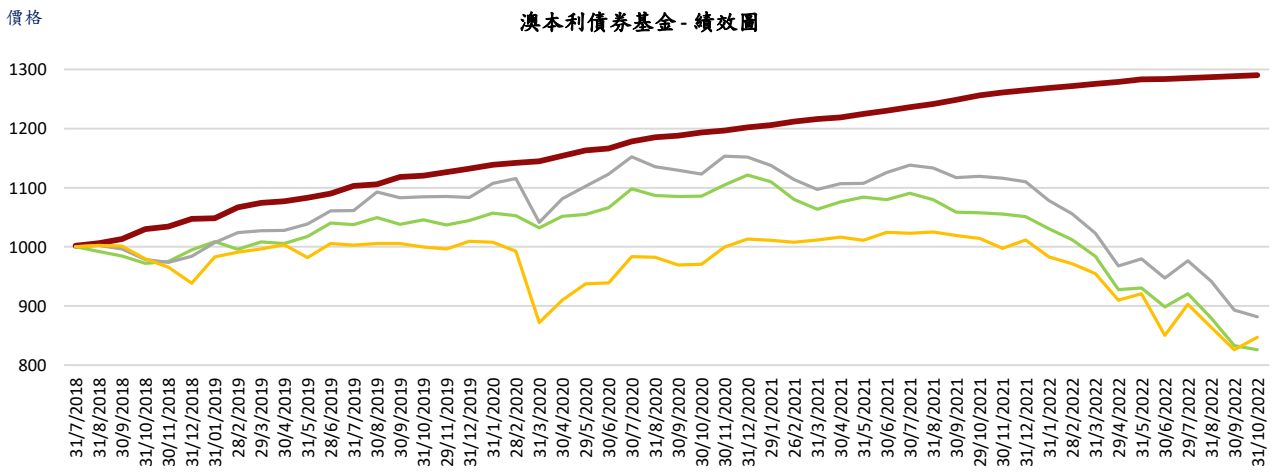
基金資訊

資產類別	固定收益基金
風險等級	低 ~ 中
貨幣	美金
最低申購金額	20,000美元
最低後續投資額/每單位	1,000美元
交易日	每月第1個工作日
估值日	交易日前1個工作日
管理費	1%
申購費	最高1%
閉鎖期	6個月
申購/贖回通知	交易日前6個工作日
首次發行日	2018年7月3日
營業日	香港/新加坡
託管銀行	星展銀行
投資經理	澳本利投資管理有限公司
國際證券識別碼（ISIN）	KYG0200R1011
彭博碼（Bloomberg Code）	ALBCBSA KY EQUITY

如果以上所述日子是公眾假期，請順延至下個工作日。

基金表現

	1個月	3個月	6個月	年初至今	發行至今
澳本利債券系列基金	0.13%	0.38%	0.89%	2.02%	29.04%
彭博巴克萊全球綜合債券指數	-0.79%	-10.27%	-10.97%	-21.40%	-17.39%
ISHARES投資級別企業債券基金	-1.27%	-9.72%	-8.87%	-20.59%	-11.83%
ISHARES高收益企業債券基金	2.59%	-6.16%	-6.88%	-16.27%	-15.28%



風險披露
以上所引用的過去業績只供參考。投資回報和本金價值將會波動，因此基金在售出時可能比原始成本更高或更低。基金表現可能高於或低於所示的預期回報。