

CIO精选保守基金

月度报告 - 2026年02月

该基金是 Amundi Asia Funds 的子基金

重要数据 (资料来源: 东方汇理)

每单位资产净值	121.61 (美元)
基金发行日期	2022年09月30日
币种	美元
基金貨幣	美元
每单位资产净值和基金规模日期	2026年02月27日
基金规模	1068.49 (百万 美元)
管理费	0.75%
总费用率	1.12%
注册国家	盧森堡
ISIN 号码	LU2485621457
彭博代號	AASGIOD LX
基准	无

投资目标与策略

本基金寻求在中长期投资期限内产生收益。本基金是由 Amundi 管理, 结合来自 Standard Chartered 的首席投资办事处 (「CIO」) 及投资管理团队由上而下的宏观观点及由下而上的互惠基金及交易所买卖基金 (「ETF」) 筛选进行管理

风险指标 (资料来源: 基金行政管理人)



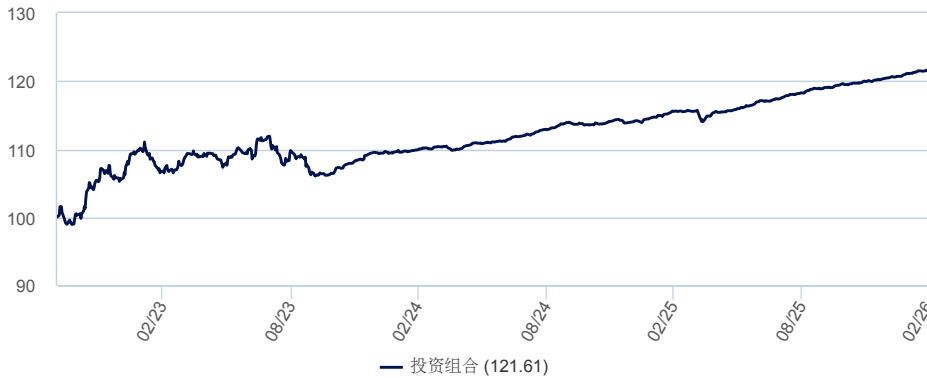
风险较低

风险较高

风险指标代表在关键信息文件 (KID) 中呈现的风险和回报特征。最低类别并不意味着没有风险。风险指标并不保证, 可能会随时间变化。风险指标假设您在五年内持有本产品。风险指标概述带您了解本产品相较于其他产品的风险水平。该指标显示了由于市场波动或者我们无力向您进行偿付, 本产品将会亏钱的可能性有多大。

回报率 (资料来源: 基金行政管理人)

2022年09月30日 - 2026年02月27日 扣除费用前回报率的 投资表现(重新调整以100为基数)



基金统计数据*

持有證券數量	18
投资组合波动率	1.66%
最差表现月	03/2025
最佳表现月	06/2025
投资组合夏普比率	0.62
最大跌幅	-1.45%

截至2026年2月底的数据
(数据为一年期间)

扣除费用前回报率

	年初至今	1个月	3个月	6个月	1年	2年	自成立至今
自	2025年12月30日	2026年01月30日	2025年11月28日	2025年08月29日	2025年02月28日	2024年02月29日	2022年09月30日
资产净值	0.97%	0.45%	1.34%	2.83%	5.26%	10.64%	21.61%

年化回报率*

	2年	3年	自成立至今
自	2024年02月29日	2023年02月28日	2022年09月30日
资产净值	5.19%	4.44%	5.90%

年度表现*

	2025	2024	2023	2022	2021
资产净值	5.68%	4.05%	3.82%	-	-

*来源: Amundi. 以上结果适用于每个日历年完整的12个月期间。所有业绩均以再投资净收益及扣除本子基金的所有费用后的净额计算, 并以四舍五入后的指数表示。过往投资的表现并非未来业绩的可靠指标。投资价值可根据市场情况向上或向下变动

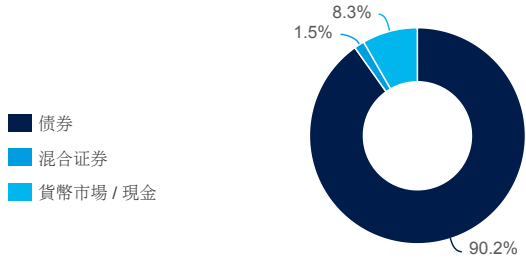


CIO精选保守基金

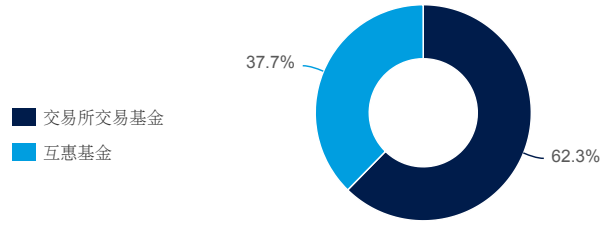
月度报告 - 2026年02月

该基金是 Amundi Asia Funds 的子基金

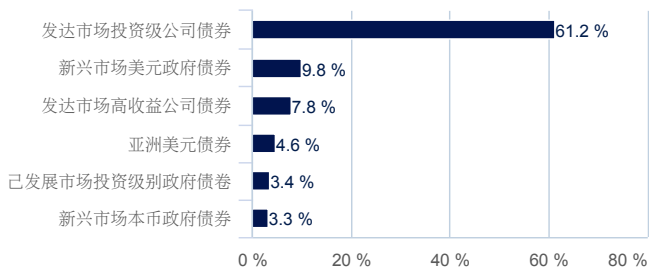
资产类别细分



资产配置



固定收益细分 (资料来源: 东方汇理)



CIO精选保守基金

月度报告 - 2026年02月

该基金是 Amundi Asia Funds 的子基金

特点	AU (C)	AS HGD (C)	AHK (C)	AHK MD (D)	AS HGD MD (D)	AU MD (D)	AE HGD MD (D)
股份类别货币	美元	新加坡元	港元	港元	新加坡元	美元	欧元
股份类别分类	累积	累积	累积	分派	分派	分派	分派
股息支付频率	-	-	-	每月	每月	每月	每月
单位资产净值	121.61	104.77	112.6	100.75	96.29	99.47	95.86
成立日期	2022年09月30日	2023年02月08日	2023年03月07日	2023年12月12日	2023年12月13日	2024年01月02日	2024年02月22日
国际证券识别码代码	LU2485621457	LU2485621531	LU2485621614	LU2627322584	LU2627321420	LU2627318806	LU2627323046
彭博代码	AASGIOD LX	AASCIOD LX	AASCIOC LX	SIGNAHK LX	SIGASMD LX	SIGNAUM LX	SIGNAEM LX
每股股息	-	-	-	0.4358	0.3679	0.4337	0.4284
最后股息支付日期	-	-	-	2026年02月03日	2026年02月03日	2026年02月03日	2026年02月03日
扣除费用前回报率							
1个月	0.45%	0.27%	0.62%	0.61%	0.28%	0.45%	0.33%
3个月	1.34%	0.67%	1.83%	1.83%	0.68%	1.34%	0.89%
6个月	2.83%	1.39%	3.18%	3.18%	1.41%	2.83%	1.78%
1年	5.26%	2.56%	5.88%	5.88%	2.58%	5.26%	3.02%
3年	4.44%	2.34%	-	-	-	-	-
5年	-	-	-	-	-	-	-
自成立以来	5.90%	1.56%	4.28%	5.35%	3.04%	5.00%	3.25%
扣除费用后回报率*							
1个月	-4.33%	-4.51%	-4.17%	-4.18%	-4.50%	-4.34%	-4.44%
3个月	-3.48%	-4.12%	-3.02%	-3.02%	-4.11%	-3.49%	-3.92%
6个月	-2.06%	-3.43%	-1.73%	-1.74%	-3.42%	-2.06%	-3.06%
1年	0.25%	-2.32%	0.84%	0.84%	-2.30%	0.25%	-1.89%
3年	-0.53%	-2.53%	-	-	-	-	-
5年	-	-	-	-	-	-	-
自成立以来	0.86%	-3.28%	-0.68%	0.33%	-1.87%	0.00%	-1.67%

一年(365天基础)以上时期的回报予以年化。
计算回报率时假设所有股息和分派都已作再投资，并考虑了这些再投资应付的所有费用。

*扣除费用后回报率包含5%的假设销售费，该费用可能会或不会向投资者征收。

CIO精选保守基金于2023年10月2日更新。2023年10月2日之前的业绩数据是根据之前的多资产策略。

股份类别列表

基金名称	基金规模	货币	ISIN 号码	彭博代码	基金发行日期	每单位资产净值	对冲/ 非对冲	股份类别分类	每月/ 季度股息	年度派息率
AG HGD	0.14 M	英镑	LU2627322667	SIGNAGC LX	2025年02月27日	102.71	对冲	累积	-	-
AHK	111.63 M	港元	LU2485621614	AASCIOC LX	2023年03月07日	112.6	非对冲	累积	-	-
AS HGD	18.93 M	新加坡元	LU2485621531	AASCIOD LX	2023年02月08日	104.77	对冲	累积	-	-
AU	94.33 M	美元	LU2485621457	AASGIOD LX	2022年09月30日	121.61	非对冲	累积	-	-
SC Invest S	1.37 K	新加坡元	LU2840097898	SIGCOFS LX	2024年07月17日	102.38	非对冲	累积	-	-
ARH HGD	0.1 M	人民币	LU2708336677	SIGCAHC LX	2024年07月17日	100.04	对冲	累积	-	-
AG HGD MD	19.1 M	英镑	LU2627322741	SIGAGMD LX	2024年05月14日	99.94	对冲	分派	0.44	5.39%
ANZ HGD MD	2.94 M	新西兰元	LU2627322154	SIGNANZ LX	2025年12月01日	99.65	对冲	分派	0.44	5.41%
SC Invest S MD	122.96 M	新加坡元	LU2840097971	SIGCONS LX	2024年07月17日	93.77	非对冲	分派	0.44	5.79%
AA HGD MD	11.45 M	澳元	LU2627323632	SIGNCNS LX	2024年06月13日	99.33	对冲	分派	0.44	5.41%
ACA HGD MD	3.35 M	加拿大元	LU2627323129	SIGACAD LX	2024年03月20日	97	对冲	分派	0.43	5.49%
AS HGD MD	180.72 M	新加坡元	LU2627321420	SIGASMD LX	2023年12月13日	96.29	对冲	分派	0.37	4.69%
AE HGD MD	22.16 M	欧元	LU2627323046	SIGNAEM LX	2024年02月22日	95.86	对冲	分派	0.43	5.51%

CIO精选保守基金

月度报告 - 2026 年 02 月

该基金是 Amundi Asia Funds 的子基金

股份类别列表

基金名称	基金规模	货币	ISIN 号码	彭博代码	基金发行日期	每单位资产净值	对冲/ 非对冲	股份类别分类	每月/ 季度股息	年度派息率
AC HGD MD	9.09 M	瑞士法郎	LU2627323475	SIGACMD LX	2025年01月16日	95.84	对冲	分派	0.44	5.63%
ARH HGD MD	0.76 M	人民币	LU2741928522	SCCAMMD LX	2024年07月18日	95.67	对冲	分派	0.43	5.55%
AU MD	348.91 M	美元	LU2627318806	SIGNAUM LX	2024年01月02日	99.47	非对冲	分派	0.43	5.38%
AJ HGD MD	4590.9 M	日元	LU2627322402	SIGAJMD LX	2024年02月23日	92.71	对冲	分派	0.24	3.12%
AHK MD	1471.56 M	港元	LU2627322584	SIGNAHK LX	2023年12月12日	100.75	非对冲	分派	0.44	5.34%

投资顾问评论

基金表现

Signature CIO Conservative Fund 在 2 月录得正回报。

由于宏观背景总体稳定，当月固定收益板块普遍取得积极的绝对表现。Principal Unconstrained EM Fixed Income、iShares USD Floating Rate Bond 和 Capital Group EM Bond Fund 在证券挑选方面做出的贡献最大。现金和 ICE BofA 0-5 Year EM USD Government Bond UCITS ETF 对回报做出的贡献相对较弱。

基金头寸配置

我们的投资组合配置依然具有很强的风险意识和防御性。Signature CIO Conservative Fund 秉持力争实现具有连续性和可持续性的收益流目标，继续保持由久期普遍较短的固定收益资产、现金和货币市场基金组成的优质投资组合的布局。

CIO精选保守基金

月度报告 - 2026年02月

该基金是 Amundi Asia Funds 的子基金

基本投资组合 - 证券及资产类别分布 (资料来源: 东方汇理)

	投资组合	投资工具类别 (ETF / 互惠基金)
债券	90.2%	-
发达市场投资级公司债券	61.2%	-
ISHARES \$ FLOATING RATE BD UCITS ETF USD	18.7%	ETF
AM FLOAT RAT US CORP UC ETF (C)	9.3%	ETF
ALLIANZ GLOBAL FLOAT RT NTS + WT USD	8.8%	互惠基金
ISHARES \$ ULTRASHORT BOND UCITS ETF USD	7.3%	ETF
ISHARES CORP BD 0-3YR ESG SRI ETF ACC	7.0%	ETF
VANGUARD USD CORPO 1-3 YEAR BD UCITS ETF	6.4%	ETF
PIMCO GIS INCOME INSTITUTIONAL USD ACC	3.6%	互惠基金
新兴市场美元政府债券	9.8%	-
PRINCIPAL GI FIN UNCON EM FX INC I2 ACC	8.8%	互惠基金
STT STRT SPDR ICEBOFA 0-5YR EMGOVTBDETF	1.0%	ETF
发达市场高收益公司债券	7.8%	-
ISHARES \$ SHT DURATION HY CRP BD UCITS E	7.8%	ETF
亚洲美元债券	4.6%	-
BGF ASIAN TIGER BOND I2 USD	2.6%	互惠基金
PIMCO GIS ASIA STRATINTSBD INS USD ACC	2.0%	互惠基金
已发展市场投资级政府债券	3.4%	-
INVESCO US TRS BD 1-3 YR ETF USD ACC	3.4%	ETF
新兴市场本币政府债券	3.3%	-
CAPITAL GROUP EM LOCAL DEBT LUX P	3.3%	互惠基金
混合证券	1.5%	-
次级金融债务	1.5%	-
ALGEBRIS FINANCIAL CREDIT I USD ACC	1.5%	互惠基金
货币市场 / 现金	8.3%	-
货币市场 / 现金	8.3%	-
AMUNDI MON MKT SHT TERM (USD)-OV	3.3%	互惠基金
BNP PARIBAS INSTICASH USD	2.8%	互惠基金
THE UNITED ST TBIP % 30APR26	1.0%	
THE UNITED ST TBIP % 26MAR26	0.9%	
现金	0.3%	-



CIO精选保守基金

月度报告 - 2026年02月

该基金是 Amundi Asia Funds 的子基金

重要和法律信息

本文件包含有关 AMUNDI ASIA FUNDS CIO精选保守基金（“本基金”）的信息，该基金是 Amundi Asia Funds 的子基金，后者是根据 2010 年 12 月 17 日卢森堡法律第一部分而存在的可转让证券集合投资计划，属于开放式共同投资基金（“fonds commun de placement”），于卢森堡商业和公司登记处注册，注册号为 K2187，注册办事处位于 5, Allée Scheffer, L-2520 Luxembourg。本基金的管理公司为 Amundi Luxembourg S.A.（地址为 5, allée Scheffer, L-2520 Luxembourg），本基金的新加坡代表处为东方汇理资产管理新加坡有限公司（注册号为 198900774E）（地址为 80 Raffles Place, UOB Plaza 1, #23-01, Singapore 048624）（Amundi Luxembourg S.A. 和/或其附属公司（包括但不限于东方汇理资产管理新加坡有限公司）在下文各称或合称“东方汇理”）。东方汇理资产管理新加坡有限公司受新加坡金融管理局监管。

本文件为营销通信。在决定投资于本基金前，投资者应细阅新加坡公开说明书和产品介绍清单。在新加坡向零售公众发售的本基金份额类别/类别已载列于新加坡公开说明书和产品介绍清单，两者连同最新的全年和半年报告（如有）可于本基金的新加坡代表处的注册办事处、网站 www.amundi.com.sg 或本基金的授权分销商免费索取。

本文件仅供参考，并非推荐、金融分析或建议，也不构成在这类要约、招揽或邀请可能不合法的任何司法管辖区就买卖本基金进行的招揽、邀请或要约。本信息不得发布，也不构成在美国或受其司法管辖权管治的任何领土或属地，或出于任何美国人士（定义参见美国证券交易委员会《1933 年美国证券法》S 条例和本基金的新加坡公开说明书）的利益而卖出任何证券或服务的要约或买入任何证券或服务的要约招揽。本基金并未根据《1940 年投资公司法》在美国注册，本基金的份额/单位也并未根据《1933 年证券法》在美国注册。因此，本文件仅在获准的司法管辖区和向在不违反适用法律或法规要求的情况下可能收到本文件的人士派发或使用，或东方汇理或其附属公司必需在该等国家注册才可派发或使用本文件。

过往业绩和所做的任何预测不代表本基金的未来表现。请注意，除非新加坡公开说明书所载的相关份额类别/类别的股息政策另有列明，否则概不保证会做出分派/派息（如适用）。投资者应审阅载列于网站 www.amundi.com.sg 的相关股息披露报告（如适用）。提出的任何观点或意见有可能随时进行更改，恕不另行通知。有关本文件的信息旨在用于广泛传阅，并未考虑任何特定投资者的具体投资目的、财务状况或特定需求。投资者在承诺购买本基金的份额/单位前，应就本基金的适用性寻求财务顾问的建议，并在接受投资建议时考虑任何人士的具体投资目标、财务状况或特定需求。

在适用且在新加坡公开说明书拟定的情况下，本基金可投资于金融衍生品，将其作为投资策略的一部分，而大部分回报可能来自金融衍生品策略。在该等情境下，正如新加坡公开说明书所详列，本基金将涉及与该等投资相关的风险。新加坡公开说明书载有更多关于风险因素的陈述。投资于本基金需承受投资风险，包括可能损失投资本金。该等活动可能不适合所有人。本基金份额/单位的价值和份额/单位的累计收益（如有）可能上涨或下跌。任何预测、推测或目标仅供说明，并非任何形式的保证。该等信息仅供说明，可不时予以更改。提及特定证券仅为说明我们投资理念的应用，不得视为东方汇理的建议。

投资者有责任细阅有效的法律文件，特别是本基金现有的新加坡公开说明书。接纳本基金的认购申请时，只会以本基金的最新公开说明书（英文版）和/或产品介绍清单为基础。有关投资者权益和集体赔偿机制的信息摘要（英文版），已载列于监管网页：<https://about.amundi.com/Metanav-Footer/Footer/Quick-Links/Legal-documentation>。

有关可持续性的信息（如适用），已载列于：<https://about.amundi.com/Metanav-Footer/Footer/Quick-Links/Legal-documentation>。

除非另有指明，否则本文件所载信息截至本文件的刊发日期。本文件所载信息获取自据信可靠但未经独立验证的来源，不过东方汇理及其附属公司认为内容公正且不具误导性。由于凑整所致，百分比相加的总和可能不等于 100%。东方汇理概不承担任何因使用本文件所载信息而直接或间接引致的责任。东方汇理及其联营公司、董事、关联方和/或雇员可能不时对本文件提及的投资拥有权益和/或承销承诺。东方汇理概不保证已经识别与本文件提及交易相关的所有风险，也不就阁下应否进行任何该等交易提供建议。东方汇理并未就本文件提及的任何该等交易的优点、合适性、预期成功或盈利能力做出任何陈述。

根据欧洲证券及市场管理局 (ESMA) 于 2019 年 6 月 20 日就跨境分销基金颁布的《欧盟条例 2019/1156》(Regulation (EU) 2019/1156) 的新营销通信指引，在欧洲注册的基金将无需就少于 12 个月的业绩回报做出汇报。

此广告或出版物未经过新加坡金融管理局审查。

未经东方汇理事先书面批准，不得复印、复制、修改、翻译或分发所载信息。

本文件中用于说明目的的所有商标和标识均为其各自所有者的财产。

关于渣打银行的进一步免责声明

渣打银行根据《1853 年皇家特许令》（参考编号 ZC 18）在英格兰以有限责任公司形式注册成立。公司的主要办事处位于英格兰，地址为 1 Basinghall Avenue, London, EC2V 5DD。渣打银行获审慎监管局（Prudential Regulation Authority）认可，并受金融市场行为监管局（Financial Conduct Authority）和审慎监管局监管。渣打银行的最终母公司渣打集团有限公司（Standard Chartered PLC）连同其子公司及附属公司（包括各个分行或代表处）组成渣打集团。渣打私人银行是渣打的私人银行部门。渣打集团内各分行、子公司及附属公司（合称为“渣打集团”，各称为“渣打集团实体”）可根据当地监管要求在全球开展银行活动。请就本文件所引致或与本文件有关连的任何事宜联络阁下的私人银行家/客户经理。任何司法管辖区的收件人应就本文件所引致或与本文件有关连的任何事宜联络当地的渣打集团实体。并非所有产品及服务都由各渣打集团实体提供。

新加坡

本文件由渣打银行（新加坡）有限公司（注册编号 201224747C/GST 集团登记编号 MR-8500053-0；“SCBSL”）在新加坡分发。新加坡的收件人应就本文件所引致或与本文件有关连的任何事宜联络渣打银行（新加坡）有限公司。渣打银行（新加坡）有限公司是渣打银行的间接全资子公司，根据 1970 年《新加坡银行法》获发牌在新加坡经营银行业务。在新加坡，渣打私人银行是渣打银行（新加坡）有限公司的私人银行部门。

本文件中说明的产品并非存款，根据 2011 年《存款保险和保单持有人保障计划法令》或任何机关的任何其他存款保障计划，均不符合受保存款的资格。

渣打银行（新加坡）有限公司担任本基金的分销商兼本基金投资管理人的投资顾问

渣打银行（新加坡）有限公司担任本基金的分销商（本基金是渣打银行（新加坡）有限公司担任分销商的所有基金的一部分）兼本基金投资管理人的投资顾问。在适用法律和法规允许的范围内，渣打银行（新加坡）有限公司收取费用，包括就其分销的本基金收取的尾随佣金以及就其向投资管理人提供的本基金相关顾问服务收取的投资顾问费。在适用法律和/或法规允许的范围内，渣打银行（新加坡）有限公司及/或一家关联公司可随时投资于本文件中提及的任何证券、货币或金融工具，或在任何该等证券或相关投资中拥有重大利益，或可能成为与该等投资有关的唯一做市商，或可能向该等投资的发行人提供或已提供建议、投资银行服务或其他服务。因此，渣打集团、其附属公司和/或子公司可能有利益冲突，该等利益冲突可能会影响本文件的客观性。

职责

CIO精选保守基金

月度报告 - 2026年02月

该基金是 Amundi Asia Funds 的子基金

重要和法律信息

如阁下决定通过渣打银行（新加坡）有限公司投资于本基金，渣打银行（新加坡）有限公司将仅出于按阁下的指示完成本基金相关交易的目的，作为分销商担任阁下的代理人。在任何情况下，渣打银行（新加坡）有限公司都不会担任阁下的投资顾问。

投资于本基金所涉及的风险

阁下不得投资于本基金，除非阁下确信自己适合投资于本基金，并且本人已充分了解于本基金的投资的特点和风险。本基金可能无法向阁下分销，这取决于阁下的身处地、居住地、国籍或阁下与之打交道的渣打集团实体。如欲了解更多信息，请联络阁下的客户经理。如阁下身处或居住的国家/市场的财政调控或外汇管制法规可能会影响境外或离岸投资，则阁下应先征求建议，然后再行动。

阁下应先细阅本基金的相关发行文件来了解详细信息，然后再决定是否投资于本基金，并且阁下应特别注意本基金的相关发行文件中载明的风险因素。我们建议阁下在做出投资决定前先征求独立的专业意见，该等专业意见要考虑到各种因素，例如阁下的财务状况和风险容忍度。请勿投资于投资产品，除非阁下充分了解并且愿意承担与之相关的风险。

本基金可广泛投资于金融衍生工具或新兴市场，并且可能有杠杆化敞口，这可能会导致资本损失风险升高。请阁下在进行投资之前确保自己能够坦然承受所涉及的风险。

参考目的

本文件仅供参考，其内容并非来源于独立研究。本文件仅用作参考工具。本文件并未针对任何特定人士或特定类别的人士编制。

本文件中提及的本基金仅构成可供渣打银行（新加坡）有限公司分销的基金的一部分，本文件中对于本基金的提及并不构成对于可供渣打银行（新加坡）有限公司分销的任何其他基金的建议。

请注意，本文件中包含的投资顾问的评论：(a) 属于渣打集团的财产；(b) 并非意在向任何人士提供财务、法律、会计或税务相关建议，不应就此加以依赖；(c) 未经渣打集团事先同意，不得复制或分发；以及 (d) 基于渣打集团认为可靠的来源，但渣打银行（新加坡）有限公司不就准确性或完整性做任何陈述或保证。

本文件所载信息和数据仅为截至本文件日期的现有信息和数据，投资者阅读时可能不再真实或完整。本文件所载信息和数据有可能随时进行更改，恕不另行通知。对于直接或间接由于阁下使用本文件而不论如何引起的任何损失或损害（包括特殊的、连带的或从属损失或损害），包括（但不限于）由于本文件、其内容或有关服务的任何缺陷、错误、瑕疵、故障、缺失或不准确或由于本文件或其任何部分或任何内容或有关服务无法获提供而引起的任何损失、损害或支出，渣打集团（为免生疑，包括渣打银行（新加坡）有限公司）概不负责并且不会承担任何责任。

阁下的独立投资决定

阁下不得仅凭本文件所载信息做出任何投资决定，阁下同意渣打集团不对阁下投资于本文件中提及的本基金的决定承担责任或义务。

市场滥用法规 (MAR) 免责声明

东方汇理提供的所有投资材料应被视为营销或信息通信，因该等投资材料基于非独立研究。该等投资材料无意成为投资研究，并未根据旨在提升投资研究独立性的法律规定进行编制。提供的营销和信息通信仅供参考，不得被视为买卖或以其他方式交易任何特定投资的建议。阁下应自行独立评估本文件所载信息的相关性和适当性，应征询独立的专业意见来确定本基金是否适合阁下。