

把握市场波动机会， 赢得正数绝对回报

MAMG Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund



人性化金融服务。



Maybank

Asset Management

宏观因素和市场波动为市场带来不确定性，但股票价格的起伏也为我们提供更多机会以善用这些市场波动来获取收益。

MAMG Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund（简称“本基金”）在动态市场环境中蓬勃发展，凭借先进技术解析复杂数据，精准捕捉市场低效带来的投资机会，从而通过股价的涨跌变动获利，达成正数绝对回报。

基金主要特点



01 绝对回报

该策略专注于实现与大盘走势无关的正数回报，并灵活善用价格波动获利。



02 亚太地区商机

本基金覆盖亚太地区各个市场超过4,500只本地股项，力求捕捉多元化的市场机遇。



03 系统化方法

本基金运用人工智能尖端技术，能够迅速应对瞬息万变的市场环境。



04 小资本+大资本股

巧妙运用我们的系统化方法，拓展投资领域，捕捉各类规模公司中的市场低效机会以获取收益。

01 绝对回报： 管理风险的投资策略

此另类基金采用平衡策略，结合做多与做空，以实现与大盘走势无关的正数回报。

只做多策略

买入并持有，因预期价格将上涨，从而实现盈利。

只做空策略

卖出期权，因预期价格将下跌，之后再买入股票以获利。

50/50 多空策略组合

本基金的平衡策略旨在实现与大盘走势无关的正数回报，并善用价格波动来获取收益和专注于股项选择。

	上涨市场		下跌市场		持平市场	
	A股	B股	A股	B股	A股	B股
价格变动	+24%	+4%	-3%	-25%	+12%	-8%
配置	50%	50%	50%	50%	50%	50%
策略	多头	空头	多头	空头	多头	空头
组合变动	24.0%	-4.0%	25.0%	-3.0%	12.0%	8.0%
		10.0% 获利		11.0% 获利		10.0% 获利

无论市场状况如何，始终获得正数回报。

02 亚太地区商机： 理解亚太地区独特的本地数据

本基金聚焦于亚太地区不同国家、语言、监管机构和关键数据点的市场差异。凭借先进科技，从独特的宏观经济因素逐步深入到个股筛选，全面考虑这些因素，从而捕捉原本隐藏的投资机会。

国家数量

14

使用语言

5

股项数量

逾 4,500

领域数量

11



资料来源：《世界人口评论》（国家）·《亚太地区数码评论》（语言）·贝莱德，2024
无法保证研究能力会带来积极的投资成果。

03 系统化方法： 善用科技驱动的智能

通过使用人工智能（“AI”）支持的高科技方法，并结合人类投资专长，本基金能够在根据以下因素挑选股票时提升其预测能力。

具吸引力的基本面

包括收入增长、盈利预期上调、强劲的资产负债表和现金流，以及具吸引力的估值。

正面市场情绪

考虑分析师、其他投资者等市场参与者的观点，以及流动性效应带来的交易机会。

宏观主题

包括国内经济状况、出口商的宏观背景以及政策导向。

04 小资本+大资本股： 开辟更广阔的领域，从市场低效中获利

本基金的投资组合在小资本股和大资本股之间保持平衡。通过使用人工智能技术，本基金能够识别并捕捉这些公司中的市场低效，并将其转化为在亚太地区广泛股票投资中的优势。



亚太地区大资本股
(>\$3 亿美元)
~ 2,000 股项



亚太地区小资本股
(<\$3 亿美元)
~ 2,500 股项

资料来源：贝莱德

基金主要资料

基金名称	MAMG Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund				
经理	Maybank Asset Management Sdn Bhd (简称“MAM”或“经理”)				
推介日期	2024年1月8日	目标基金经理	BlackRock (Luxembourg) S.A.		
基金种类	积资汇注基金 (批发)	资产类别	股票		
基金类型	成长	财政年截止日期	11月30日		
目标基金名称	BSF BlackRock Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund	基础货币	美元		
类别	令吉类别	令吉 (对冲类别)	美元类别	新元 (对冲类别)	澳元 (对冲类别)
初始发售价	0.50令吉	0.50令吉	0.50美元	0.50新元	0.50澳元
投资目标	本基金通过投资在目标基金，以提供资本增值。				
投资者类型	本基金适合具备以下条件的成熟老练投资者： ·寻求中长期资本增值；并且 ·愿意承担投资在目标基金相关的风险。				
投资策略	本基金力图通过将至少 90% 的资产净值 (“NAV”) 投资于目标基金的美元计价A2 级别股份来实现其投资目标。 目标基金是BlackRock Strategic Funds的子基金，成立于2017年2月22日，注册地为卢森堡。 本基金可采用货币对冲策略，完全或部分对冲外币风险，以管理货币风险。 尽管本基金为被动管理型基金，基金经理将确保基金得到适当和高效的管理，以满足单位持有人的赎回要求。 此外，基金经理可在咨询受托人并获得单位持有人的批准后，认为目标基金不再符合投资目标时，将其替换为另一只具有相似目标的基金。				
表现基准	3个月有担保隔夜融资利率 (“SOFR”)，按后置复利计算并加上26.1个基点。				
资产配置	·至少 90% 的基金资产净值将投资于目标基金。 ·最多 10% 的基金资产净值将投资于流动资产。 注：“流动资产”包括金融机构存款和货币市场工具。				
	令吉类别	令吉 (对冲类别)	美元类别	新元 (对冲类别)	澳元 (对冲类别)
最低初始投资额*	1,000令吉	1,000令吉	1,000美元	1,000新元	1,000澳元
最低额外投资额*	100令吉	100令吉	100美元	100新元	100澳元
最低单位持有量*	1,000 单位				
分利政策	如有分利，将视为附带性质，并由经理全权决定。				
分利模式	所有收入分配将再投资于基金的额外单位。额外单位将根据收入再投资日 (即分利除权日后 10 天内) 的每单位资产净值创建。 注：基金单位持有人无需为再投资新额外基金单位而支付任何费用。				
销售费**	最高为每单位资产净值的 6.50%。				
赎回费	无				
每年管理费	每年按每个类别资产净值 (NAV) 不超过1.80%的比例向MAM支付管理费，以基本货币每日计算并累积，每月支付。 注：每年管理费已包括目标基金收取的管理费。本基金和目标基金不得重复收取管理费。				
每年信托费	TMF Trustees Malaysia Berhad, 基金资产净值的每年0.04% (不包括外汇托管相关费用)，以基本货币每日计算并累积，每月支付给信托人。				

*或 MAM 不时确定的其他较低金额或单位数量。我们的分销商可根据其投资条款及条件，为通过分销商进行的投资设定较上述为低的最低初始及/或额外投资额。

**经理保留不时酌情豁免或降低销售费的权利。投资者可协商降低销售费。销售费将四舍五入至小数点后两位，并由经理保留。投资目标基金不收取初始销售费。因此，销售费仅在基金层面收取。

免责声明：此产品说明手册只是本基金的简要描述，并不详尽。投资者决定投资前，须索取、阅读并理解信息备忘录。MAMG Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund 日期为2024年1月8日的信息备忘录及补充文件 (若有) (统称为“信息备忘录”) 已向马来西亚证券监督委员会 (简称“证监会”) 登记/寄存，惟后者不对其内容负责。您可向我们的办事处或经销商分行索取一份信息备忘录。再次提醒，投资者投资前须阅读并了解信息备忘录的内容。其中，投资者须考虑相关费用。单位价格与可支付分利 (若有) 会下跌或上涨。基金以往的表现不可作为未来表现的指引。

证监会批准或授权或登记、寄存或呈交此信息备忘录，并不等于或显示证监会推荐或支持本基金或其广告或已审查此手册。

欲了解 MAMG Systematic Asia Pacific Equity Absolute Return Fund, 的更多信息，请联系客户经理或马来西亚银行资产管理的客户服务团队，电话：[+603 2297 7888](tel:+60322977888)，或访问网站 www.maybank-am.com.my

Maybank Asset Management Sdn. Bhd. (公司注册编号：199701006283 (421779-M))

Level 12, Tower C, Dataran Maybank, No. 1 Jalan Maarof, 59000 Kuala Lumpur Malaysia.

电话 +603 2297 7888 传真+603 2715 0071 www.maybank-am.com.my