

3077 HK 港元柜台 | 分派单位类别

9077 HK 美元柜台 | 分派单位类别

9078 HK 美元柜台 | 累计单位类别

Premia 美国国库浮息票据 ETF

动荡市场下的投资选择



信用

您是否面临银行及企业信评降级或违约风险？



久期

您是否会在利率上升环境中承受久期风险？



流动性

您的投资是否具锁定期？是否得到充分补偿？



税务

您是否正在缴纳美国预扣税？它降低有效收益



费用

资产净值结构不变，您是否有被收取隐性费用？



操作

您是否每天打电话给银行以获取最优惠利率？



为何投资 美国国库浮息票据？

- 美国国库浮息票据等同于美国国债的高信用质量，相较有一定企业信用风险敞口的货币基金而言更为安全
- 美国国库浮息票据流通额已增长至**5,750亿美元**，显示其强劲的投资需求，并在管理债务期限方面具有灵活性
- 美国国库浮息票据具有庞大且可每日**24小时**交易的高流动性市场
- 美国国库浮息票据利率紧随美联储有效利率——**到期年化收益率约0.94%** (相较托管银行或证券帐户接近0%的现金收益率)

您是否正在寻找一个不涉及预扣税、信用及久期风险低、成本费用低，且每天都能在亚洲时区进行交易的美元现金管理工具？

资料来源：彭博（截至2022年5月31日）

彭博美国浮动利率国债指数建构方法



资产类别

美国浮动利率债券 - 期限为2年，每周按最新的3个月美国国库券利率重置息票利率



息票

仅限浮动利率息票



债券流通总额

2.5亿美元或更高；扣除美国联邦公开市场操作帐户(SOMA)中持有的美国国债



到期日

没有最小到期日限制 - 指数持有美国浮动利率国债直到债券到期日

为何投资 Premia 美国国库浮息票据 ETF?

- **低信贷风险**：投资于美国政府发行的一篮子浮动利率票据
- **极小利率风险**：基于3个月美国国库券利率，每周重置相关证券的票面利率
- **具有成本效益**：经常性开支上限定为每年0.05%

关于ETF

所有数据截至2022年5月31日

投资组合

US TREASURY FRN TF 0 01/31/23	14.28%
US TREASURY FRN TF 0 10/31/22	13.99%
US TREASURY FRN TF 0 04/30/23	13.67%
US TREASURY FRN TF 0 07/31/23	13.55%
US TREASURY FRN TF 0 07/31/22	13.17%
US TREASURY FRN TF 0 01/31/24	12.89%
US TREASURY FRN TF 0 10/31/23	12.55%
US TREASURY FRN TF 0 04/30/24	4.95%

基本资料

管理人	睿亚资产管理有限公司
受托人	汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司
基金规模	0.03 亿美元
基准指数	彭博美国浮动利率国债指数
管理费	每年 0.05%
基础货币	美元
上市日期	2019年7月18日

基金特点

平均债券评级	Aaa
有效久期	0.0140
平均到期收益率 (%)	0.9593
债券凸性	0.0003

指数绩效表现



指数	美国浮动利率国债 ¹	美国1-3个月国债 ²	美国0-1年国债 ³	美国1-3年国债 ⁴
年初至今	0.3%	0.1%	0.0%	-2.4%
1年	0.4%	0.1%	0.1%	-3.1%
3年年化	0.7%	0.6%	0.7%	0.6%
5年年化	1.2%	1.1%	1.1%	1.0%
5年波动率	0.2%	0.1%	0.1%	1.1%
最低收益率	0.94%	0.89%	1.24%	2.50%

¹ 彭博美国浮动利率国债指数；² 彭博美国1-3个月国库券指数；³ 彭博美国国债短期债券指数；⁴ 彭博美国1-3年国债指数
绩效按美元计。资料来源：彭博（2014年2月3日至2022年5月31日；以2014年2月3日为基准日，基点为100）

免责声明 本文件由睿亚资产管理有限公司所编制和发行。Premia ETF 系列子基金获香港证券及期货事务监察委员会（「证监会」）认可。证监会的认可并不等如对该计划作出推介或认许，亦不是对该计划的商业利弊或表现作出保证。本文件未经证监会审查，在任何管辖区中并不构成买卖任何证券或订立任何其他交易的要约、推荐或招揽。对于在香港以外的司法管辖区的潜在投资者，请就认购基金的资格寻求专业意见。除非另有说明，所有数据均截至2022年5月31日。数据来源：彭博社和睿亚资产。以上数据仅供参考。过往的业绩数据并不预示未来的业绩表现。投资涉及风险，包括本金亏损的风险。对新兴市场国家的投资可能涉及更高的风险，例如波动性增加和交易量下降，并可能比投资于发达国家的风险更大。在决定投资前，投资者应先阅读基金说明书和产品资料概要，以了解详情，其中包括风险因素。投资者可能无法收回全额本金。个别股票价格/表现不代表基金回报。投资回报和投资本金价值将上下波动，使得投资者将其出售或赎回时的股票价值可能大于或低于原始成本。如本文件的英文版与中文版内容不一致，则以英文版为准。

指数免责声明 "Bloomberg®" 和彭博美国浮动利率国债指数是 Bloomberg Finance L.P. 及其关联公司（包括指数管理人 Bloomberg Index Services Limited ("BISL")）（统称“彭博”）的服务商标，并已获得许可供睿亚资产管理有限公司用于某些目的。彭博不附属于睿亚资产管理有限公司，彭博不批准、认可、审查或推荐 PREMIA 美国国库浮息票据 ETF。彭博不保证与 PREMIA 美国国库浮息票据 ETF 有关的任何数据或信息的及时性、准确性或完整性。