

3411 HK 港元櫃台

9411 HK 美元櫃台

## Premia 摩根大通亞洲投資級別美元債券 ETF

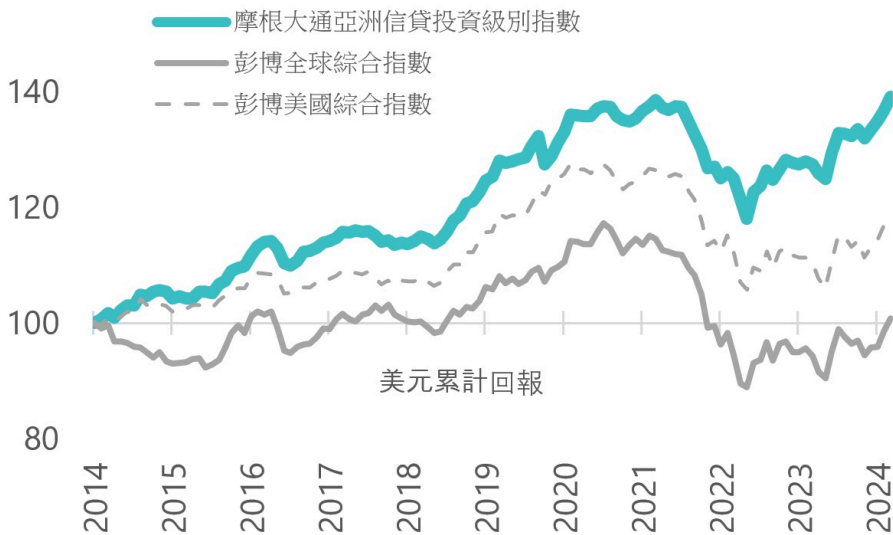
新資本投資者入境計劃合資格基金

### 多元化配置亞洲區(日本除外)的投資級別美元債券



資料來源：摩根大通、睿亞資產，截至2024年08月

### 穿越周期始終保持優異穩健回報



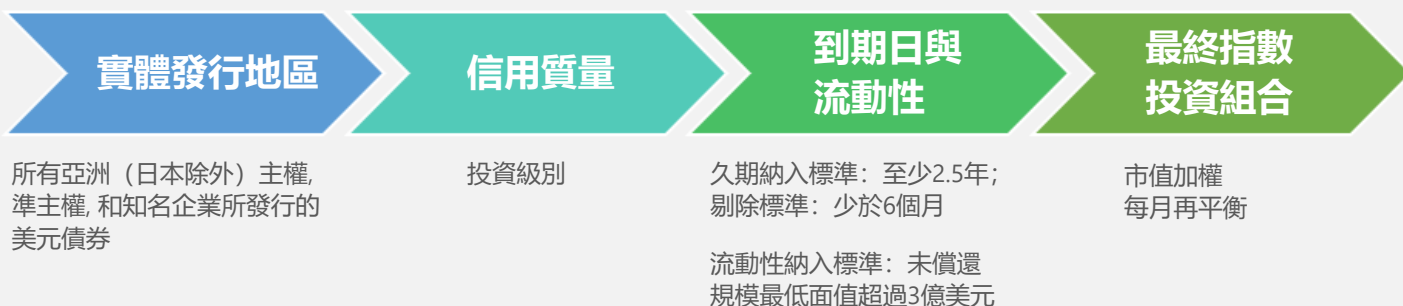
資料來源：摩根大通、彭博、睿亞資產，截至2024年08月31日

### 為什麼投資亞洲(除日本外)投資級別美元債券?

- **多元化投資級別債券：**涵蓋亞洲區內(日本除外)的投資級別主權、準主權及知名企業發行的**高質量美元債券**
- **更有效捕捉利差和收益率溢價：**透過地域多元化，而非以配置風險較高、評級較低債券獲取額外利差和收益率溢價
- **優異的風險調整後回報：**亞洲投資級別美元債券表現穩健，與其他全球及美國投資級別指數、母指數摩根大通亞洲信貸指數及其他新興市場債券指數相比，於過去3年、5年、10年期間**具有更佳風險調整後回報**
- **完善投資組合及高效分離主動及被動策略：**摩根大通亞洲信貸指數為**機構投資者廣泛認可的主流指數**。而通過此ETF交易亞洲投資級別美元債券，投資者可因應市場環境**更便捷靈活調節資產配置獲取收益**
- **確保流動性及交易效率：**底層投資級別美元債券須符合未償還規模最低面值至少3億美元要求，以確保更好的交易流動性
- **亞洲時區交易及稅費效率：**ETF交易時區與底層債券吻合，同時享受港交所給予債券類ETF的各種**優惠包括豁免印花稅、交易及結算費用**，亦無香港預扣稅、資本利得稅及股息稅等

資料來源：摩根大通、睿亞資產 (2024年)

### 精準捕捉 – 摩根大通亞洲信貸投資級別指數選債方法



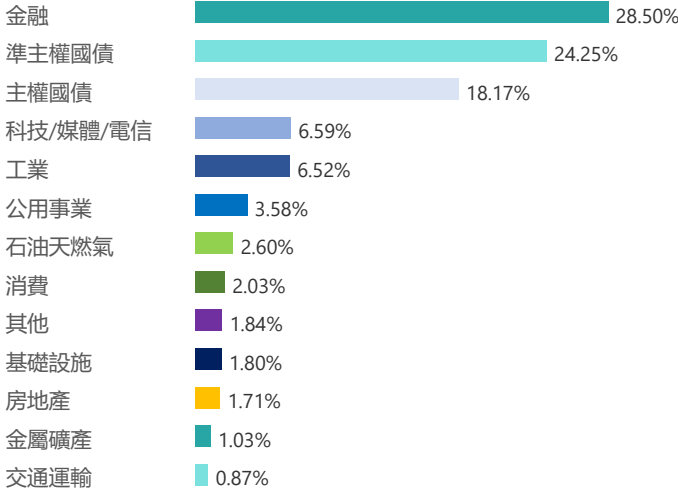
## 為何投資 Premia 摩根大通亞洲投資級別美元債券 ETF

- **多元化配置亞洲（日本除外）投資級別美元債券**: 通過分散配置不同地區優質債券，而非降低信用門坎增加信用風險，更有效通過風險分散策略獲得額外利差和收益率溢價
- **優異歷史表現及風險回報係數**: 相較同類型投資級或其他高息債券，亞洲投資級美元債券表現更穩定，為投資者提供更佳風險調整後回報
- **具有成本效益**: 經常性開支僅為每年 0.23%

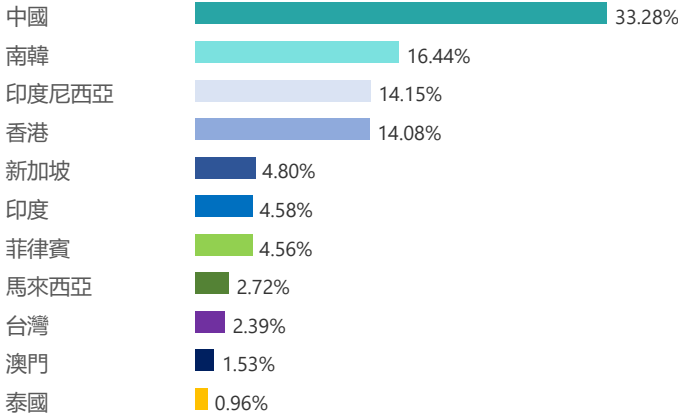
## 關於ETF

所有數據截至2024年9月30日

## 行業配置



## 市場配置



## 指數績效表現



<sup>1</sup> 摩根大通亞洲信貸投資級別指數；<sup>2</sup> 摩根大通亞洲信用指數；<sup>3</sup> 彭博全球綜合債指數；<sup>4</sup> 彭博美國綜合債指數

\* 自基準日期：2014年6月30日。資料來源：彭博（2014年6月30日至30/09/2024，以2014年6月30日為基準，基點為100）

## 十大持倉（發行人集團）

印尼政府國際債券	6.33%
菲律賓政府國際債券	4.56%
渣打集團有限公司	4.31%
出版公司伊斯蘭債券印尼III	2.83%
韓國輸出入銀行	2.54%
韓國產業銀行	2.22%
騰訊控股有限公司	2.14%
中國石化集團海外發展	2.04%
台積電	1.96%
長江和記實業國際	1.84%

## 基本資料

管理人	睿亞資產管理有限公司
受託人	滙豐機構信託服務（亞洲）有限公司
基金規模	50 百萬美元
基準指數	摩根大通亞洲信貸投資級別指數
管理費	每年 0.23%
基礎貨幣	美元
上市日期	2024年9月25日

## 基金特點

平均債券評級	A
有效久期	4.6678
到期收益率 (%)	4.5895
持有債券數量	207

指數	JPM亞洲信用投資級 <sup>1</sup>	JPM亞洲信用 <sup>2</sup>	彭博全球綜合債 <sup>3</sup>	彭博美國綜合債 <sup>4</sup>
年初至今	5.9%	7.2%	3.6%	4.4%
1年	11.9%	13.3%	12.0%	11.6%
3年年化	0.8%	0.2%	-3.1%	-1.4%
5年年化	2.0%	1.4%	-0.8%	0.3%
10年年化	3.4%	3.2%	0.6%	1.8%
自上市*	3.4%	3.2%	0.2%	1.8%
波動率*	3.5%	3.4%	5.5%	4.8%
夏普比率*	0.48	0.42	-	0.02

**重要通告** 基金追蹤其基礎指數的表現，而該指數並沒有將環境、社會和管治因素作為其主要投資重點。目前的披露是根據證監會的指引，並遵循管理人的氣候相關風險評估而作出。管理人將就本披露的適用性和程度作定期評估。

**免責聲明** 本文件由睿亞資產管理有限公司所編制和發行。Premia ETF 系列子基金獲香港證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）認可。證監會的認可並不等如對該計畫作出推介或認許，亦不是對該計畫的商業利弊或表現作出保證。本文件未經證監會審查，在任何管轄區中並不構成買賣任何證券或訂立任何其他交易的要約、推薦或招攬。對於在香港以外的司法管轄區的潛在投資者，請就認購基金的資格尋求專業意見。除非另有說明，所有資料均截至30 August 2024。資料來源：彭博社和睿亞資產。以上資料僅供參考。**過往的業績資料並不預示未來的業績表現。** 投資涉及風險，包括本金虧損的風險。對新興市場國家的投資可能涉及更高的風險，例如波動性增加和交易量下降，並可能比投資於發達國家的風險更大。在決定投資前，投資者應先閱讀基金說明書和產品資料概要，以瞭解詳情，其中包括風險因素。投資者可能無法收回全額本金。個別股票價格/表現不代表基金回報。投資回報和投資本金價值將上下波動，使得投資者將其出售或贖回時的股票價值可能大於或低於原始成本。如本文件的英文版與中文版內容不一致，則以英文版為準。

**免責聲明** 未經摩根大通事先書面批准，不得複製、使用或散佈摩根大通亞洲信貸投資等級指數。J.P. Morgan 和 J.P. Morgan 指數名稱為 J.P. Morgan 旗下公司的服務標記，並已獲亞資產授權本證券、產品或基金的購買者、銷售者或話題，或任何其他個人或實體，均不得使用或引用任何摩根大通商號、商標或服務標誌來贊助、認可、行銷或推廣本金融產品或任何其他產品。在任何情況下，均須摩根大通事先許可，任何個人或實體不得宣稱與摩根大通有任何關聯。是從據信可靠的來源獲得的，但摩根大通不保證其限制或準確性。版權所有2024，摩根大通公司。