3077 HK
9077 HK

新資本投資者入境計劃
合資格基金 ^

Premia 美國國庫浮息票據 ETF

(上市分派單位)

2026年10月基金月報

所有數據截至 2026年10月31日

重要通告: 投資涉及風險，包括損失本金。投資者在決定是否適合投資Premia 美國國庫浮息票據ETF（「基金」)時，敬請參閱基金說明書及產品資料概要所載詳情，包括風險因素。投資者不應單靠本文件而作出投資決定。投資者應注意:

- 基金的投資目標是提供在扣除費用及開支前與彭博美國浮動利率國債指數表現緊密相關的投資回報。
- **集中風險 / 美國市場集中風險 -** 基金的投資集中在單一國家（即美國）和單一發行人的債券。與投資組合較多元化的基金相比，基金可能價值較為波動，亦較易受影響美國市場的不利經濟、政治、政策、外匯、流動性、稅務、法律或監管事件影響。
- **浮動利率票據風險 -** 浮動利率證券對利率變動的敏感度可能低於固定利率證券，但價值可能會下跌，對基金的資產淨值造成負面影響，特別當票面利率追不上市場利率的升幅及上升速度時。
- **收入風險 -** 當利率下滑，基金的收入可能下跌，這是由於基金持有的債務工具的利率為浮動或可變。
- **上市類別單位與非上市類別單位之間交易安排差異的風險 -** 上市類別單位和非上市類別單位的投資者須遵守不同的定價和交易安排。由於各類別適用的費用和成本不同，各上市類別單位和非上市類別單位的每單位資產淨值可能有所不同。
- **上市類別單位與非上市類別單位之間費用及成本安排差異的風險 -** 適用於各上市類別單位與非上市類別單位的費用及成本之水平及類別可能不同。因此，各上市類別單位與非上市類別單位的每單位資產淨值亦可能不同。
- **發行量有限的風險 -** 美國財政部發行的FRN相對較新，供應量有限。概無任何擔保或保證：(i)基金將能投資合宜金額的FRN、(ii)基金將能以理想價格購買FRN、(iii)美國財政部將繼續發行FRN或(iv)FRN的交投將會活躍。如果任何或所有上述情況發生，將對基金產生不利影響。
- **信貸評級及下調評級風險 -** 評級機構授予的信貸評級受到限制，並不時刻保證證券及／或發行人的信貸能力。管理人將可能或無法處置被下調評級的債務工具。
- **信貸風險及主權債務風險 -** 債券或其他工具的發行人的財務狀況可能導致該發行人違約、無法支付到期利息或本金或未能履行其他義務，或導致該發行人被視為出現此等情況。此外，基金對政府發行或擔保的證券的投資可能面對政治、社會及經濟風險，可能無法或不願償還到期本金及／或利息，或可能要求基金參與此等債務的重組。基金投資的價值可能會因發行人違約、基金投資組合內投資的信貸評級變動及／或出現相關看法而快速變動，未必會有預警。
- **外匯及其他貨幣分派風險 -** 基金的基礎貨幣為美元，但部分單位以港元（除美元外）買賣。二級市場的投資者在二級市場買賣單位時，可能會由於港元與基礎貨幣匯率波動影響及匯率管制出現變動，因而承擔額外成本或損失。
- **交易時段差異風險 -** 由於指數成份債券的交易平台可能會在基金單位仍未定價時開市，因此基金投資組合中證券的價值，可能會在投資者未能買賣基金單位的日子出現改變。
- **分派政策差異 -** 管理人將向分派單位類別的單位持有人撥付分派，但不向累計單位類別的單位持有人分派。就分派單位類別作出的分派可能導致每單位資產淨值立即減少。累計單位類別收到的收入和資本收益將再投資並反映在每單位資產淨值中。兩個類別的分派政策差異將導致兩個類別之間的淨資產價值出現差異。

投資目標

本基金旨在提供在扣除費用及開支前與彭博美國浮動利率國債指數表現緊密相關的投資回報。概不保證本基金將實現其投資目標。

基金資料

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
上市交易所	香港交易所 - 主板
已發行單位	29,000.00
基金規模	0.17 億美元
基準指數	彭博美國浮動利率國債指數
指數彭博代號	BTFLTRUU 指數
管理費	經常性開支僅為每年 0.15%
基礎貨幣	美元

交易資料

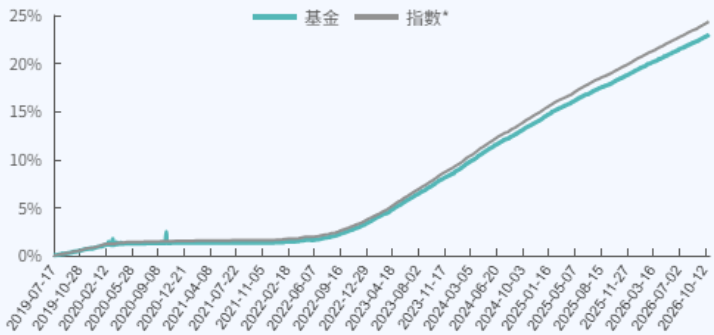
上市日期	2019年7月18日
每手交易數量	5個單位 (港元櫃台) | 5個單位 (美元櫃台)
資產淨值	507.1123 美元
股票代號	3077 HK (港元櫃台) | 9077 HK (美元櫃台)
基金彭博代號	3077 HK Equity 9077 HK Equity
ISIN 代號	HK0000515855

累積表現 (%)

	年初至今	1個月	6個月	1年	自上市
基金	3.2%	0.4%	2.0%	4.0%	23.1%
指數*	3.4%	0.4%	2.1%	4.1%	24.4%

年度表現 (%)

	2016	2017	2018	2019#	2020	2021	2022	2023	2024	2025
基金	-	-	-	0.9%	0.5%	0.0%	2.0%	5.1%	5.3%	4.2%
指數*	-	-	-	0.9%	0.6%	0.1%	2.1%	5.3%	5.5%	4.4%



資料來源：彭博社、 睿亞資產
** 指數為與彭博美國浮動利率國債指數*
 # 從上市日至2019年底

過往業績資料並不代表將來表現。投資者未必能取回全部投資金額。業績表現以歷年末的資產淨值作為計算基礎，股息再作投資。此等數據顯示子基金價值在有關歷年內的升跌幅度。業績表現以美元計算，當中包括持續收費，但不包括閣下可能需繳交的香港聯交所交易成本。若未有列示過往業績，即表示該年度未有足夠數據以提供表現。基金成立日期: 2019年07月16日。

3077 HK
9077 HK

新資本投資者入境計劃
合資格基金 ^

Premia 美國國庫浮息票據 ETF

(上市分派單位) 2026年10月基金月報

十大成份股

US TREASURY FRN TF 0 10/31/27	13.43%
US TREASURY FRN TF 0 04/30/28	13.42%
US TREASURY FRN TF 0 01/31/28	13.42%
US TREASURY FRN TF 0 07/31/27	13.42%
US TREASURY FRN TF 0 04/30/27	13.41%
US TREASURY FRN TF 0 01/31/27	13.40%
US TREASURY FRN TF 0 10/31/26	13.39%
US TREASURY FRN TF 0 07/31/28	4.63%

數據來源: 睿亞資產

基金的特點

平均債券評級	Aa
有效久期	0.00
平均到期收益率 (%)	4.07
債券凸性	0.00

數據來源: 睿亞資產

參與證券商

- Barclays Bank PLC
- 國泰證券（香港）有限公司
- 建銀國際證券有限公司
- 招商證券（香港）有限公司
- 花旗環球金融亞洲有限公司
- 星展唯高達香港有限公司
- 廣發証券（香港）經紀有限公司
- 高盛（亞洲）證券有限公司
- 國泰君安證券（香港）有限公司
- 海通國際證券有限公司
- 韓國投資證券亞洲有限公司
- Merrill Lynch Far East Limited
- 未來資產證券（香港）有限公司
- 元大證券（香港）有限公司

市場莊家

- Flow Traders Hong Kong Limited

* 如子基金的市場莊家名單有任何差異，請參閱香港聯合交易所網站。

關於睿亞資產

睿亞資產是一家於2016年由一群資深金融行業人士在香港創立的資產管理公司，致力開發ETF和智能貝塔等具低成本多元化優勢的投資工具，以幫助投資者更有效地創造長期價值。公司團隊來自於全球和亞太地區的行業領導者，對於ETF行業發展有豐富經驗和深刻體會。公司的理念是 - 集合團隊的專業實戰經驗，以及與世界頂尖專家合作的人脈優勢，為亞洲ETF市場注入新活力，打造國際級的ETF及智能貝塔產品以滿足投資者需求，從而更好地推動亞洲區的市場發展。欲瞭解詳情，請參閱www.premia-partners.com。

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當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2026年10月31日。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。

指數免責聲明 “Bloomberg®”和彭博美國浮動利率國債指數是 Bloomberg Finance L.P. 及其關聯公司（包括指數管理人 Bloomberg Index Services Limited（“BISL”）（統稱“彭博”）的服務商標，並已獲得許可供睿亞資產管理有限公司用於某些目的。 彭博不附屬於睿亞資產管理有限公司，彭博不批准、認可、審查或推薦 PREMIA 美國國庫浮息票據 ETF。 彭博不保證與 PREMIA 美國國庫浮息票據 ETF有關的任何數據或信息的及時性、準確性或完整性。

^ 本基金為香港新資本投資者入境計劃的合資格集體投資計劃。詳情請參閱 香港證監會官方網頁。