3077 HK
9077 HK

新资本投资者入境计划
合资格基金 ^

Premia 美国国库浮息票据 ETF

(上市分派单位)

2026年6月基金月报

所有数据截至 2026年6月30日

重要提示:投资涉及风险，包括损失本金。投资者在决定是否适合投资Premia 美国国库浮息票据ETF（「基金」)时，敬请参阅基金说明书及产品资料概要所载详情，包括风险因素。投资者不应单靠本文件而作出投资决定。投资者应注意：

- 基金的投资目标是提供在扣除费用及开支前与彭博美国浮动利率国债指数表现紧密相关的投资回报。
- **集中风险/美国市场集中风险 -** 基金的投资集中在单一国家（即美国）和单一发行人的债券。与投资组合较多元化的基金相比，基金可能价值较为波动，亦较易受影响美国市场的不利经济，政治，政策，外汇，流动性，税务，法律或监管事件影响。
- **浮动利率票据风险 -** 浮动利率证券对利率变动的敏感度可能低于固定利率证券，但价值可能会下跌，对基金的资产净值造成负面影响，特别当票面利率追不上市场利率的升幅及上升速度时。
- **收入风险 -** 当利率下滑，基金的收入可能下跌，这是由于基金持有的债务工具的利率为浮动或可变。
- **上市类别单位与非上市类别单位之间交易安排差异的风险 -** 上市类别单位和非上市类别单位的投资者须遵守不同的定价和交易安排。由于各类别适用的费用和成本不同，各上市类别单位和非上市类别单位的每单位资产净值可能有所不同。
- **上市类别单位与非上市类别单位之间费用及成本安排差异的风险 -** 适用于各上市类别单位与非上市类别单位的费用及成本之水平及类别可能不同。因此，各上市类别单位与非上市类别单位的每单位资产净值亦可能不同。
- **发行量有限的风险 -** 美国财政部发行的FRN相对较新，供应量有限概无任何担保或保证：（i）基金将能投资合宜金额的FRN，（ii）基金将能以理想价格购买FRN，（iii）美国财政部将继续发行FRN或（iv）FRN的交投将会活跃。如果任何或所有上述情况发生，将对基金产生不利影响。
- **信贷评级及下调评级风险 -** 评级机构授予的信贷评级受到限制，并不时刻保证证券及 / 或发行人的信贷能力。管理人将可能或无法处置被下调评级的债务工具。
- **信贷风险及主权债务风险 -** 债券或其他工具的发行人的财务状况可能导致该发行人违约，无法支付到期利息或本金或未能履行其他义务，或导致该发行人被视为出现此等情况。此外，基金对政府发行或担保的证券的投资可能面对政治，社会及经济风险，可能无法或不愿偿还到期本金及 / 或利息，或可能要求基金参与此等债务的重组。基金投资的价值可能会因发行人违约，基金投资组合内投资的信贷评级变动及 / 或出现相关看法而快速变动，未必会有预警。
- **外汇及其他货币分派风险 -** 基金的基础货币为美元，但部分单位以港元（除美元外）买卖。二级市场的投资者在二级市场买卖单位时，可能会由于港元与基础货币汇率波动影响及汇率管制出现变动，因而承担额外成本或损失。
- **交易时段差异风险 -** 由于指数成份债券的交易平台可能会在基金单位仍未定价时开市，因此基金投资组合中证券的价值，可能会在投资者未能买卖基金单位的日子出现改变。
- **分派政策差异 -** 管理人将向分派单位类别的单位持有人拨付分派，但不向累计单位类别的单位持有人分派。就分派单位类别作出的分派可能导致每单位资产净值立即减少。累计单位类别收到的收入和资本收益将再投资并反映在每单位资产净值中，两个类别的分派政策差异将导致两个类别之间的净资产价值出现差异。

投资目标

本基金旨在提供在扣除费用及开支前与彭博美国浮动利率国债指数表现紧密相关的投资回报。概不保证本基金将实现其投资目标。

基金资料

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
上市交易所	香港交易所 - 主板
已发行单位	32,000.00
基金规模	0.19 亿美元
基准指数	彭博美国浮动利率国债指数
指数彭博代号	BTFLTRUU 指数
管理费	经常性开支仅为每年 0.15%
基础货币	美元

交易资料

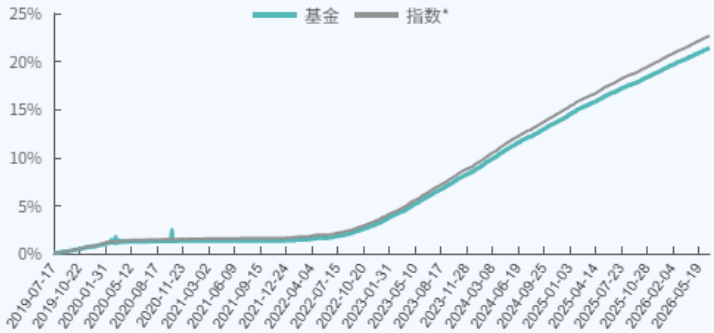
上市日期	2019年7月18日
每手交易数量	5个单位 (港元柜台) | 5个单位 (美元柜台)
资产净值	504.3194 美元
股票代号	3077 HK (港元柜台) | 9077 HK (美元柜台)
基金彭博代号	3077 HK Equity 9077 HK Equity
ISIN 代号	HK0000515855

累积表现 (%)

	年初至今	1个月	6个月	1年	自上市
基金	1.8%	0.3%	1.8%	3.9%	21.4%
指数*	2.0%	0.3%	2.0%	4.1%	22.7%

年度表现 (%)

	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%
指数*	-	-	-	0.9%	0.6%	0.1%	2.1%	5.3%	5.5%	4.4%



数据来源：彭博社、 睿亚资产
** 指数为彭博美国浮动利率国债指数*
 # 从上市日至2019年底

过往业绩资料并不代表将来表现。投资者未必能取回全部投资金额。业绩表现以历年末的资产净值作为计算基础，股息再作投资。此等数据显示子基金价值在有关历年内的升跌幅度。业绩表现以美元计算，当中包括持续收费，但不包括阁下可能需缴交的香港联交所交易成本。若未有列示过往业绩，即表示该年度未有足够数据以提供表现。基金成立日期: 2019年07月16日。

Premia 美国国库浮息票据 ETF

(上市分派单位)

2026年6月基金月报

十大成份股

US TREASURY FRN TF 0 10/31/27	13.56%
US TREASURY FRN TF 0 10/31/26	13.55%
US TREASURY FRN TF 0 01/31/27	13.54%
US TREASURY FRN TF 0 01/31/28	13.54%
US TREASURY FRN TF 0 04/30/27	13.46%
US TREASURY FRN TF 0 07/31/27	13.46%
US TREASURY FRN TF 0 07/31/26	13.45%
US TREASURY FRN TF 0 04/30/28	4.74%

数据来源: 睿亚资产

基金的特点

平均债券评级	Aa
有效久期	0.00
平均到期收益率 (%)	3.77
债券凸性	0.00

数据来源: 睿亚资产

参与证券商

- Barclays Bank PLC
- 国泰证券（香港）有限公司
- 建银国际证券有限公司
- 招商证券（香港）有限公司
- 花旗环球金融亚洲有限公司
- 星展唯高达香港有限公司
- 广发证券（香港）经纪有限公司
- 高盛（亚洲）证券有限公司
- 国泰君安证券（香港）有限公司
- 海通国际证券有限公司
- 韩国投资证券亚洲有限公司
- Merrill Lynch Far East Limited
- 未来资产证券（香港）有限公司
- 元大证券（香港）有限公司

市场庄家

- Flow Traders Hong Kong Limited

* 如子基金的市场庄家名单有任何差异，请参阅香港联合交易所网站。

关于睿亚资产

睿亚资产是一家于2016年由一群资深金融行业人士在香港创立的资产管理公司，致力开发ETF和智能贝塔等具低成本多元化优势的投资工具，以帮助投资者更有效地创造长期价值。公司团队来自于全球和亚太地区的行业领导者，对于ETF行业发展有丰富经验和深刻体会。公司的理念是 - 集合团队的专业实战经验，以及与世界顶尖专家合作的人脉优势，为亚洲ETF市场注入新活力，打造国际级的ETF及智能贝塔产品以满足投资者需求，从而更好地推动亚洲区的市场发展。欲了解详情，请参阅www.premia-partners.com。

重要通告 基金追踪其基础指数的表现，而该指数并没有将环境、社会和管治因素作为其主要投资重点。目前的披露是根据证监会的指引，并遵循管理人的气候相关风险评估而作出。 管理人将就本披露的适用性和程度作定期评估。

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当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2026年6月30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。

^ 本基金为香港新资本投资者入境计划的合资格集体投资计划。详情请参阅 香港证监会官方网页。