

# RBC 加拿大債券指數基金

## 投資目標

基金通過投資於RBC加拿大債券指數ETF的單位，追蹤其基準的表現，致力提供包含入息和適度資本增長的總回報。

## 基金詳情

系列	收費結構	貨幣	基金代號
A	免佣	CAD	RBF700

成立日期	1999年11月
總資產(\$百萬)	33.5
系列 A 單位的資產淨值\$	11.45
系列 A 管理開支比率%	0.81
基準	FTSE TMX 加拿大環球 + 楓葉債券指數

入息分派	每季
資本增值分派	每年

銷售狀況	公開發售
最低投資額 \$	500
隨後的投資額 \$	25

基金組別	加拿大固定入息
------	---------

管理公司	RBC 環球資產管理公司
------	--------------

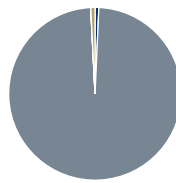
網址	www.rbcgam.com
----	----------------

## 附註

基金的投資目標和名稱於2017年6月30日更改。

## 組合分析 截至 2018年6月30日

### 資產組合



資產類別	佔資產%
現金	0.7
固定入息	98.5
加拿大股票	0.0
美國股票	0.0
國際股票	0.0
其他	0.8

### 固定入息組合成份

成份	佔固定入息組合%
政府債券	65.8
公司債券	33.9
其他債券	0.0
按揭證券	0.0
短期投資(現金及其他)	0.2
抵押證券	0.0

### 債券評級摘要

評級	%	到期期限	%
現金/現金等值	0.2	1 年以下	0.4
AAA	33.7	1 - 5 年	44.8
AA	38.8	5 - 10 年	23.5
A	14.7	10 年以上	31.3
BBB	12.5		
BBB以下	0.1	平均到期期限 (年)	10.2
按揭	0.0	平均持續期(年)	7.5
未予評級/不適用	0.0	到期收益率	2.7

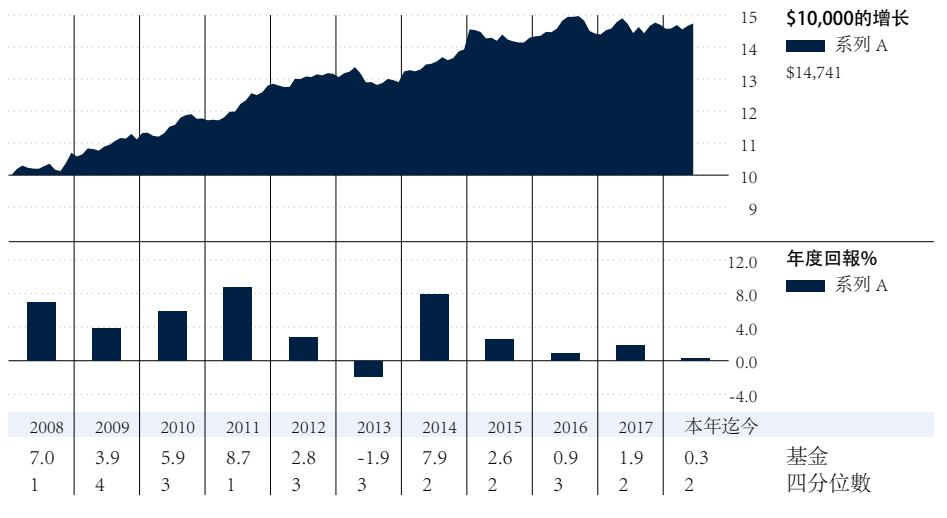
### 主要地區分配

地區	佔資產%
加拿大	100.0
美國	0.0
國際 (不包括新興市場)	0.0
新興市場	0.0

### 二十五項主要投資項目

投資項目	佔資產%
Canada Hsg Tr No 1 3.35% 15-12-2020	2.9
Canada Housing Tr No.1 1.25% 15-06-2021	2.5
Canada (Government of) 3.5% 01-12-2045	2.4
Quebec (Province Of) 9.5% 30-03-2023	2.2
Canada (Government of) 1.5% 01-06-2026	2.1
Canada Hsg Tr No 1 2.35% 15-09-2023	1.8
Ontario (Province Of) 2.6% 02-06-2025	1.7
TCHC Issuer Trust 11-05-2037	1.4
Canada (Government of) 2.75% 01-12-2048	1.4
Royal Bank of Canada 2.03% 15-03-2021	1.2
Canada (Government of) 0.75% 01-08-2019	1.2
Canada (Government of) 1% 01-06-2027	1.1
Quebec (Province Of) 5% 01-12-2041	1.1
Canada (Government of) 0.75% 01-03-2021	1.1
GT Airports Ath 3.04% 21-09-2022	1.0
Canada (Government of) 1% 01-09-2022	1.0
Bank of Montreal 1.88% 31-03-2021	0.9
Loblaw Cos 6.05% 09-06-2034	0.9
Quebec (Province Of) 3.5% 01-12-2045	0.9
Ontario (Province Of) 2.9% 02-12-2046	0.8
Ontario (Province Of) 3.15% 02-06-2022	0.8
Ontario (Province Of) 3.45% 02-06-2045	0.8
Canada (Government of) 1.5% 01-03-2020	0.8
Canada (Government of) 2.25% 01-06-2025	0.8
Ontario (Province Of) 4.2% 02-06-2020	0.8
25項主投資項目總佔%	33.6
持有股票項目總數	0
持有債券項目總數	405
持有其他項目總數	4
持有總數	409

## 基金表現分析 截至 2018年6月30日



期限	一個月	三個月	六個月	一年	三年	五年	十年	成立以來	累積回報 %
回報率	0.5	0.3	0.3	0.1	1.3	2.7	3.8	4.6	基金四分位數
基金四分位數	2	2	2	3	3	2	2	—	基金四分位數
組別基金數目	512	507	502	491	397	320	148	—	組別基金數目



# RBC 加拿大債券指數基金

## 基金經理概覽

### 基金經理履歷

#### State Street 環球顧問公司 (滿地可)

State Street 環球顧問公司 (State Street Global Advisors, 簡稱SSgA) 專注於以高度紀律管理風險的策略在全球市場進行投資。SSgA 在全球各地共設有28個辦事處, 並在波士頓、倫敦、滿地可、慕尼黑、巴黎、香港、悉尼及東京設有駐當地的投資組合管理服務。

### 基金表現分析 截至 2018年6月30日

每單位所得收益分派(\$)	本年迄今*	2017	2016	2015	2014	2013	2012	2011	2010	2009	2008
總收益分派	0.16	0.48	0.34	0.30	0.33	0.35	0.34	0.38	0.41	0.42	0.44
利息	0.16	0.32	0.30	0.30	0.33	0.35	0.34	0.38	0.41	0.42	0.44
股息	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
資本增值	—	0.16	0.04	—	—	—	—	—	—	—	—
資本回報	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

最佳/最差周期%	截至	一年	截至	三年	截至	五年	截至	十年
最佳	2001-10	11.7	2003-5	8.3	2005-1	7.5	2010-1	6.1
最差	2017-9	-3.6	2018-1	0.0	2018-4	1.7	2018-4	3.6
平均		4.7		4.8		4.8		4.9
總周期		212		188		164		104
錄得正數周期%		91.5		100.0		100.0		100.0

\* 收益以不同收入種類在年底分派。

### 季度評語 截至 2018年6月30日

貿易衝突和全球增長有放緩跡象, 限制了加拿大政府債券收益率的升幅, 加拿大債券在季內溫和上升。美國聯邦儲備局在季內調高短期利率, 並縮小其資產負債表規模, 兩個舉措都令收益率傾向上升。加拿大中央銀行 (BoC) 在季內對利率政策按兵不動。雖然BoC在五月份暗示會繼續加息, 但面對與美國貿易局勢緊張, 加上經濟數據疲軟, 意味著加拿大將會進一步押後加息。由於擔心貿易糾紛升級會破壞加拿

大經濟增長, 加拿大政府債券跑贏美國國庫券。

投資組合經理預計債券收益率在未來六個月將會輕微攀升, 鑑於正在收緊的金融環境, 通脹有機會短暫上升, 並預期各中央銀行將逐步加息。投資組合經理並認為短期債券收益率應繼續比長期債券收益率上升較快。

# RBC 加拿大債券指數基金

## 資料披露

RBC基金(RBC Funds)、BlueBay基金(BlueBay Funds)、PH&N基金(PH&N Funds)及RBC公司結構系列基金(RBC Corporate Class Funds)由RBC環球資產管理公司(RBC Global Asset Management Inc.)提供，並經由授權分銷商銷售。

互惠基金投資有可能涉及佣金、尾隨佣金、管理費及相關支出。投資前請參閱基金章程。除非其他指示，所顯示的回報率乃年度複利總回報，並包括單位價格變動，及將全部分派收益再投資，但並未把有關的銷售、回贖、分派收益或選擇性開支、或單位持有人所需付的入息稅計算在內，此等費用及稅項將會減低回報。互惠基金不受加拿大存款保險局(Canada Deposit Insurance Corporation)或任何政府存款保險機構所保障。各項貨幣市場基金不擔保其每單位的資產淨值能維持於一個固定價位，亦不保證您能全數收回在一項基金所投資的全數金額。互惠基金的單位價值經常變動，過往業績未必會重現。

本文件由RBC環球資產管理公司(RBC Global Asset Management Inc.)，簡稱 RBC GAM)根據相信是可靠的資料而撰寫，惟RBC環球資產管理公司、其子公司或任何其他人士就有關資料的準確性、完整性或正確性，均不作

任何明示或默示的聲明或保證。本文件內的所有意見及估計只反映我們截至編訂本文件日期所持的判斷，或會隨時修改，恕不另行通知。我們本著摯誠提供上述資料，但不會承擔任何法律責任。10/25項主要投資項目或會根據基金組合內的交易活動而改變。基金章程及各項基礎投資基金的有關資料已列於 [www.sedar.com](http://www.sedar.com)。

RBC基金、PH&N基金和 BlueBay基金的管理開支比率[MER(%)]以2017年1月1日至2017年12月31日之實際全年開支計算，並以年算化方式表達。

RBC公司結構系列基金的管理開支比率(%)以2017年4月1日至2018年3月31日之實際全年開支計算。

系列H及系列I不再供新投資者購買。現時持有系列H及系列I單位的投資者可繼續添加投資於所持基金的相同系列。

圖表只用作說明複息增長率的效力，並非用作反映任何基金的未來價值，或投資於任何基金可得的回報。

所提供的基金資料，僅供參考之用。具體的

投資及/或交易策略應就個別投資者的投資目標而作出評估。基金資料所包含的信息並非，亦不應被視為投資或稅務意見。您不應在未尋求適當專業人士意見之前，作出任何行動或依賴基金資料包含的信息。

四分位數評級由獨立的研究機構 Morningstar Research Inc. 依據加拿大投資基金標準委員會(Canadian Investment Funds Standards Committee, 簡稱CIFSC)持有的組別而評定。四分位數評級是將某一基金之表現與其對等類別的其他基金進行比較；評級每月或會更改。四分位數把數據分別放在4個等份的組別，並予以評級(1, 2, 3或4)。以上的Morningstar四分位數星號評級反映基金的A系列單位截至2018年6月30日的表現。

®/™加拿大皇家銀行(Royal Bank of Canada)之商標。在牌照許可下使用。©RBC 環球資產管理公司(RBC Global Asset Management Inc.)2018年版權所有。

本中文譯本僅供參考之用，內容以英文原文為準。