

2020年中期报告

汇丰集合投资信托 - 汇丰亚洲高入息债券基金



HSBC Global Asset Management
汇丰 环球投资管理

汇丰集合投资信托 -
汇丰亚洲高入息债券基金

中期报告
截至 2020 年 9 月 30 日止期间

目录	页数
资产负债表(未经审计)	1 - 3
全面收益表(未经审计)	4 - 5
份额持有人应占资产净值变动表(未经审计)	6 - 13
现金流量表(未经审计)	14
投资组合报表(未经审计)	15 - 37
投资组合变动表(未经审计)	38
衍生金融工具详情(未经审计)	39 - 43
业绩表现记录(未经审计)	44 - 50
分派披露(未经审计)	51 - 55
行政	56

资产负债表

2020年9月30日

	2020年9月30日 (未经审计) 美元	2020年3月31日 (经审计) 美元
资产		
以公允价值计入损益账的金融资产	1,376,240,154	1,014,453,751
应收利息	13,891,908	13,128,416
应收申购款	12,554,424	3,020,912
应收经纪商款项	22,177,806	6,892,543
其他应收款	420,000	3,270,000
现金和现金等价物	7,183,836	4,710,872
	<u>1,432,468,128</u>	<u>1,045,476,494</u>
负债		
以公允价值计入损益账的金融负债	115,081	5,371,530
银行透支	-	38,643
应付赎回款	12,471,601	6,530,414
应付经纪商款项	28,795,649	49,878
应付分派	6,143,094	4,372,987
应付税项	19,865	19,074
其他应付款	4,418,990	8,632,847
	<u>51,964,280</u>	<u>25,015,373</u>
份额持有人应占资产净值	<u>1,380,503,848</u>	<u>1,020,461,121</u>
相当于：		
金融负债	<u>1,380,503,848</u>	<u>1,020,461,121</u>

资产负债表

2020年9月30日(续)

	2020年9月30日 (未经审计) 美元	2020年3月31日 (经审计) 美元
已发行份额总数		
– AC类 – 美元	1,171,341	1,158,554
– AM2类 – 美元	63,964,975	52,175,222
– AM2类 – 人民币	8,667,426	7,796,336
– AM3O类 – 人民币	59,733,064	25,623,313
– AM2类 – 港元	318,391,034	279,565,471
– AM2类 – 欧元	825,364	841,900
– AM3O类 – 欧元	480,140	456,547
– AM2类 – 澳元	2,172,784	1,922,663
– AM3O类 – 澳元	11,052,190	11,530,474
– AM2类 – 加元	863,212	538,456
– AM3O类 – 加元	6,496,536	5,241,159
– AM3O类 – 英镑	4,576,623	3,232,896
– AM3O类 – 新加坡元	968,529	447,875
– BC类 – 港元	470,046	-
– BC类 – 人民币	614,053	-
– BC类 – 美元	360,043	-
– BCO类 – 人民币	886,084	-
– BM2类 – 港元	295,031	-
– BM2类 – 人民币	853,467	-
– BM2类 – 美元	716,380	-
– BM3O类 – 澳元	117,721	-
– BM3O类 – 人民币	1,810,541	-
– IM2类 – 美元	125,932	-

资产负债表

2020年9月30日(续)

	2020年9月30日 (未经审计) 美元	2020年3月31日 (经审计) 美元
份额净值		
– AC类 – 美元	11.131	10.090
– AM2类 – 美元	9.776	9.094
– AM2类 – 人民币	1.426	1.326
– AM3O类 – 人民币	1.421	1.264
– AM2类 – 港元	1.260	1.172
– AM2类 – 欧元	10.329	9.606
– AM3O类 – 欧元	11.216	9.775
– AM2类 – 澳元	7.455	6.947
– AM3O类 – 澳元	6.881	5.464
– AM2类 – 加元	7.421	6.905
– AM3O类 – 加元	7.176	6.263
– AM3O类 – 英镑	12.343	11.019
– AM3O类 – 新加坡元	7.032	6.274
– BC类 – 港元	1.397	-
– BC类 – 人民币	1.536	-
– BC类 – 美元	10.829	-
– BCO类 – 人民币	1.618	-
– BM2类 – 港元	1.367	-
– BM2类 – 人民币	1.504	-
– BM2类 – 美元	10.599	-
– BM3O类 – 澳元	7.614	-
– BM3O类 – 人民币	1.567	-
– IM2类 – 美元	9.943	-

注：中期报告采用了与本基金年度报告相同的会计政策和计算方法。

全面收益表

截至2020年9月30日止期间

	2020年4月1日 至2020年9月30日 美元	2019年4月1日 至2019年9月30日 美元
现金和现金等价物的利息收入	650	87,567
以公允价值计入损益账的金融资产和负债的利息收入	28,603,161	24,632,216
股息收入	8,377	-
以公允价值计入损益账的金融资产和负债的收益净值	86,515,694	27,582,283
汇兑收益/(亏损)净值	17,469,903	(5,492,689)
其他收入	37,165	15,946
收入总额	132,634,950	46,825,323
管理费 ^{注2}	6,829,605	5,929,757
交易费用 ^{注1}	9,826	9,687
受托人费用 ^{注1}	415,725	360,942
审计师酬金	7,813	7,786
过户代办费用 ^{注1}	75,922	56,590
专业人员费用	9,084	13,829
保管费、银行手续费及杂费 ^{注1}	331,539	77,380
总经营开支	7,679,514	6,455,971
税前经营净利润	124,955,436	40,369,352
税项	-	1,884
收益分配前经营净利润	124,955,436	40,371,236
向份额持有人作出收益分配	(31,081,471)	(26,686,719)

全面收益表

截至 2020 年 9 月 30 日止期间(续)

	2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日 美元	2019 年 4 月 1 日 至 2019 年 9 月 30 日 美元
份额持有人应占资产净值增加及 期间内全面收益总额	<u>93,873,965</u>	<u>13,684,517</u>

注¹ 在截至 2020 年 9 月 30 日和 2019 年 9 月 30 日止期间内，除交易费用、受托人费用和过户代办费用外，支付给受托人/受托人的关联人士的金额分别为：

	2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日 美元	2019 年 4 月 1 日 至 2019 年 9 月 30 日 美元
保管费、银行手续费及杂费	<u>34,320</u>	<u>32,243</u>

注² 在截至 2020 年 9 月 30 日和 2019 年 9 月 30 日止期间内，除支付给管理人的管理费外，没有向管理人/管理人的关联人士支付任何款项。

份额持有人应占资产净值变动表 截至2020年9月30日止期间

	2020年4月1日 至2020年9月30日 美元	2019年4月1日 至2019年9月30日 美元
期初余额	1,020,461,121	830,526,536
份额持有人应占资产净值增加及 期间内全面收益总额	93,873,965	13,684,517
份额认购		
– AC类 – 美元	5,828,813	5,433,892
– AM2类 – 美元	281,116,424	392,878,002
– AM2类 – 人民币	3,807,225	10,335,715
– AM3O类 – 人民币	56,536,740	43,355,381
– AM2类 – 港元	138,130,851	326,797,752
– AM2类 – 欧元	559,038	9,350,626
– AM3O类 – 欧元	2,166,310	4,806,193
– AM2类 – 澳元	4,641,011	15,244,380
– AM3O类 – 澳元	34,567,997	64,413,786
– AM2类 – 加元	3,148,091	2,068,829
– AM3O类 – 加元	21,340,713	24,439,462
– AM3O类 – 英镑	33,157,335	39,897,874
– AM3O类 – 新加坡元	3,650,992	-
– BC类 – 港元	1,191,348	-
– BC类 – 人民币	1,331,060	-
– BC类 – 美元	4,119,076	-
– BCO类 – 人民币	1,665,236	-
– BM2类 – 港元	408,933	-
– BM2类 – 人民币	1,460,019	-
– BM2类 – 美元	7,934,287	-
– BM3O类 – 澳元	856,767	-
– BM3O类 – 人民币	2,821,403	-
– IM2类 – 美元	1,264,362	-
	611,704,031	939,021,892

份额持有人应占资产净值变动表 截至2020年9月30日止期间(续)

	2020年4月1日 至2020年9月30日 美元	2019年4月1日 至2019年9月30日 美元
<i>份额赎回</i>		
– AC类 – 美元	(5,523,309)	(717,491)
– AM2类 – 美元	(165,494,416)	(267,714,396)
– AM2类 – 人民币	(2,467,912)	(1,625,684)
– AM3O类 – 人民币	(10,396,278)	(19,480,571)
– AM2类 – 港元	(87,654,153)	(243,706,853)
– AM2类 – 欧元	(740,701)	(521,476)
– AM3O类 – 欧元	(1,981,805)	(3,152,574)
– AM2类 – 澳元	(2,741,706)	(5,206,131)
– AM3O类 – 澳元	(36,142,090)	(40,370,947)
– AM2类 – 加元	(699,202)	(1,375,445)
– AM3O类 – 加元	(12,415,491)	(14,407,739)
– AM3O类 – 英镑	(16,796,542)	(16,070,212)
– AM3O类 – 新加坡元	(148)	-
– BC类 – 港元	(564,474)	-
– BC类 – 人民币	(428,920)	-
– BC类 – 美元	(290,431)	-
– BCO类 – 人民币	(337,633)	-
– BM2类 – 港元	(5,678)	-
– BM2类 – 人民币	(223,285)	-
– BM2类 – 美元	(458,554)	-
– BM3O类 – 澳元	(53,821)	-
– BM3O类 – 人民币	(118,720)	-
	(345,535,269)	(614,349,519)
与份额持有人的交易价值总额	266,168,762	324,672,373
期末余额	1,380,503,848	1,168,883,426

份额持有人应占资产净值变动表 截至2020年9月30日止期间(续)

	2020年4月1日 至2020年9月30日	2019年4月1日 至2019年9月30日
AC类 – 美元份额		
4月1日的已发行份额数目	1,158,554	276,374
期间内已申购份额	534,778	515,832
期间内已赎回份额	(521,991)	(68,108)
9月30日的已发行份额数目	1,171,341	724,098
AM2类 – 美元份额		
4月1日的已发行份额数目	52,175,222	43,473,562
期间内已申购份额	28,876,673	40,020,326
期间内已赎回份额	(17,086,920)	(27,292,275)
9月30日的已发行份额数目	63,964,975	56,201,613
AM2类 – 人民币份额		
4月1日的已发行份额数目	7,796,336	1,627,164
期间内已申购份额	2,646,712	7,173,033
期间内已赎回份额	(1,775,622)	(1,137,480)
9月30日的已发行份额数目	8,667,426	7,662,717
AM3O类 – 人民币份额		
4月1日的已发行份额数目	25,623,313	13,944,153
期间内已申购份额	41,630,752	30,897,056
期间内已赎回份额	(7,521,001)	(13,977,208)
9月30日的已发行份额数目	59,733,064	30,864,001

份额持有人应占资产净值变动表 截至2020年9月30日止期间(续)

	2020年4月1日 至2020年9月30日	2019年4月1日 至2019年9月30日
AM2 类 – 港元份额		
4月1日的已发行份额数目	279,565,471	247,523,023
期间内已申购份额	109,371,206	258,604,244
期间内已赎回份额	(70,545,643)	(192,528,765)
9月30日的已发行份额数目	318,391,034	313,598,502
AM2 类 – 欧元份额		
4月1日的已发行份额数目	841,900	69,349
期间内已申购份额	54,286	902,468
期间内已赎回份额	(70,822)	(50,179)
9月30日的已发行份额数目	825,364	921,638
AM3O 类 – 欧元份额		
4月1日的已发行份额数目	456,547	45,310
期间内已申购份额	203,514	446,283
期间内已赎回份额	(179,921)	(287,778)
9月30日的已发行份额数目	480,140	203,815
AM2 类 – 澳元份额		
4月1日的已发行份额数目	1,922,663	1,046,447
期间内已申购份额	626,613	2,020,152
期间内已赎回份额	(376,492)	(693,645)
9月30日的已发行份额数目	2,172,784	2,372,954

份额持有人应占资产净值变动表 截至2020年9月30日止期间(续)

	2020年4月1日 至2020年9月30日	2019年4月1日 至2019年9月30日
AM3O 类 – 澳元份额		
4月1日的已发行份额数目	11,530,474	5,154,197
期间内已申购份额	5,133,669	9,624,489
期间内已赎回份额	(5,611,953)	(6,034,846)
9月30日的已发行份额数目	11,052,190	8,743,840
AM2 类 – 加元份额		
4月1日的已发行份额数目	538,456	423,743
期间内已申购份额	421,886	275,191
期间内已赎回份额	(97,130)	(183,319)
9月30日的已发行份额数目	863,212	515,615
AM3O 类 – 加元份额		
4月1日的已发行份额数目	5,241,159	2,414,152
期间内已申购份额	3,009,501	3,358,556
期间内已赎回份额	(1,754,124)	(2,005,286)
9月30日的已发行份额数目	6,496,536	3,767,422
AM3O 类 – 英镑份额		
4月1日的已发行份额数目	3,232,896	760,294
期间内已申购份额	2,742,379	3,284,261
期间内已赎回份额	(1,398,652)	(1,335,167)
9月30日的已发行份额数目	4,576,623	2,709,388

份额持有人应占资产净值变动表 截至2020年9月30日止期间(续)

	2020年4月1日 至2020年9月30日	2019年4月1日 至2019年9月30日
AM30 类 – 新加坡元份额		
4月1日的已发行份额数目	447,875	100
期间内已申购份额	520,674	-
期间内已赎回份额	(20)	-
9月30日的已发行份额数目	968,529	100
BC 类 – 港元份额		
4月1日的已发行份额数目	-	-
期间内已申购份额	869,042	-
期间内已赎回份额	(398,996)	-
9月30日的已发行份额数目	470,046	-
BC 类 – 人民币份额		
4月1日的已发行份额数目	-	-
期间内已申购份额	1,096,473	-
期间内已赎回份额	(210,389)	-
9月30日的已发行份额数目	886,084	-
BC 类 – 美元份额		
4月1日的已发行份额数目	-	-
期间内已申购份额	386,730	-
期间内已赎回份额	(26,687)	-
9月30日的已发行份额数目	360,043	-

份额持有人应占资产净值变动表 截至2020年9月30日止期间(续)

	2020年4月1日 至2020年9月30日	2019年4月1日 至2019年9月30日
BCO 类 – 人民币份额		
4月1日的已发行份额数目	-	-
期间内已申购份额	894,820	-
期间内已赎回份额	(280,767)	-
9月30日的已发行份额数目	614,053	-
BM2 类 – 港元份额		
4月1日的已发行份额数目	-	-
期间内已申购份额	299,237	-
期间内已赎回份额	(4,206)	-
9月30日的已发行份额数目	295,031	-
BM2 类 – 人民币份额		
4月1日的已发行份额数目	-	-
期间内已申购份额	1,000,266	-
期间内已赎回份额	(146,799)	-
9月30日的已发行份额数目	853,467	-
BM2 类 – 美元份额		
4月1日的已发行份额数目	-	-
期间内已申购份额	759,327	-
期间内已赎回份额	(42,947)	-
9月30日的已发行份额数目	716,380	-

份额持有人应占资产净值变动表 截至2020年9月30日止期间(续)

	2020年4月1日 至2020年9月30日	2019年4月1日 至2019年9月30日
BM30 类 – 澳元份额		
4月1日的已发行份额数目	-	-
期间内已申购份额	124,719	-
期间内已赎回份额	(6,998)	-
9月30日的已发行份额数目	117,721	-
BM30 类 – 人民币份额		
4月1日的已发行份额数目	-	-
期间内已申购份额	1,890,542	-
期间内已赎回份额	(80,001)	-
9月30日的已发行份额数目	1,810,541	-
IM2 类 – 美元份额		
4月1日的已发行份额数目	-	-
期间内已申购份额	125,932	-
期间内已赎回份额	-	-
9月30日的已发行份额数目	125,932	-
总额		
4月1日的已发行份额数目	390,530,866	316,757,868
期间内已申购份额	203,219,731	357,121,891
期间内已赎回份额	(108,138,081)	(245,594,056)
9月30日的已发行份额数目	485,612,516	428,285,703

现金流量表

截至2020年9月30日止期间

	2020年4月1日 至2020年9月30日 美元	2019年4月1日 至2019年9月30日 美元
已收利息	27,840,319	21,616,920
已收股息	8,377	-
已付管理费	(6,709,992)	(5,556,505)
已付受托人费用	(408,435)	(351,872)
购买投资的付款	(1,320,342,442)	(1,266,850,901)
出售投资的所得款项	1,050,183,982	1,012,551,528
退回税项	791	704
其他已收/(已付)经营开支	18,673,934	(4,299,224)
经营活动使用的现金	(230,753,466)	(242,889,350)
融资活动		
份额发行所得款项	602,170,519	927,200,499
份额赎回付款	(339,594,082)	(612,384,300)
已付分配	(29,311,364)	(25,914,271)
融资活动产生的现金	233,265,073	288,901,928
现金和现金等价物增加净额	2,511,607	46,012,578
期初现金和现金等价物	4,672,229	6,616,593
期末现金和现金等价物	7,183,836	52,629,171

投资组合报表(未经审计) 2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券			
上市投资			
ABJA INVESTMENT CO 4.45% 2023 年 7月24日	1,123,000	1,113,848	0.08
ABJA INVESTMENT CO 5.45% 2028 年 1月24日	3,000,000	2,912,580	0.21
ABJA INVESTMENT CO 5.95% 2024 年 7月31日	1,682,000	1,735,235	0.13
ADANI GREEN ENERGY UP 6.25% 2024 年 12 月 10 日	4,710,000	5,073,659	0.37
ADANIREN KODSOPAR WARSOM 4.625% 2039 年 10 月 15 日	3,000,000	2,808,386	0.20
雅居乐集团控股有限公司 可变债券 2049 年 12 月 29 日	1,543,000	1,572,518	0.11
雅居乐集团控股有限公司 可变债券 永续 债券 2049 年 12 月 31 日	3,550,000	3,578,767	0.26
ALAM SYNERGY PTE LTD (REG S) 11.5% 2021 年 4 月 22 日	2,250,000	1,101,417	0.08
AXIATA SPV5 LABUAN LTD 3.064% 2050 年 8 月 19 日	5,986,000	5,689,394	0.41
AYC FINANCE LTD 4.85% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	931,000	927,648	0.07
AZURE POWER ENERGY LTD 5.5% 2022 年 11 月 3 日	6,500,000	6,645,015	0.48
AZURE POWER SOLAR ENERGY 5.65% 2024 年 12 月 24 日	4,898,000	5,116,647	0.37
BANGKOK BANK PCL HONG KONG 可 变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	11,321,000	11,341,604	0.82
BANGKOK BANK PLC 9.025% 2029 年 3 月 15 日	4,718,000	6,620,203	0.48
BANK MANDIRI PT 3.75% 2024 年 4 月 11 日	1,047,000	1,102,470	0.08

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
中国银行(香港)有限公司 可变债券 永续 债券 2049年12月29日	6,000,000	6,427,860	0.47
东亚银行有限公司 可变债券 永续债券 2049年12月29日	4,000,000	3,995,400	0.29
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS 2.5% 2024年9月10日	2,765,000	2,846,927	0.21
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS 4.25% 2023年9月4日	2,027,000	2,186,626	0.16
BANK RAKYAT INDONESIA 3.95% 2024年3月28日	445,000	472,799	0.03
BDO UNIBANK INC 2.125% 2026年1 月13日	4,816,000	4,804,345	0.35
BLUESTAR FINANCE HOLDINGS 可 变债券 永续债券 2049年12月29日	5,000,000	5,185,150	0.38
中银航空租赁有限公司 2.625% 2030年 9月17日	15,915,000	15,787,203	1.14
中银航空租赁有限公司 2.75% 2023年 12月2日	6,256,000	6,435,735	0.47
中银航空租赁有限公司 3.25% 2025年 4月29日	5,712,000	5,981,949	0.43
CASTLE PEAK POWER FINANCE CO 2.2% 2030年6月22日	3,630,000	3,700,095	0.27
CDBL FUNDING 1 3.5% 2027年10月 24日	5,000,000	5,364,400	0.39
CELESTIAL DYNASTY LTD 4.25% 2029年6月27日	2,000,000	2,040,380	0.15
CELESTIAL MILES 可变债券 永续债券 2049年12月29日	2,110,000	2,191,847	0.16
建业地产控股有限公司 7.25% 2024年 8月13日	3,000,000	2,913,180	0.21

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
建业地产控股有限公司 7.65% 2023年8月27日	2,529,000	2,545,919	0.18
CFLD CAYMAN INVESTMENT 8.625% 2021年2月28日	1,933,000	1,930,584	0.14
CFLD CAYMAN INVESTMENT 9% 2021年7月31日	2,800,000	2,792,076	0.20
中铝国际香港有限公司 可变债券 永续债券 2049年12月31日	2,700,000	2,744,901	0.20
CHAMPION MTN LTD 2.95% 2030年6月15日	3,227,000	3,257,689	0.24
冠诚控股有限公司 可变债券 永续债券 2049年12月29日	1,791,000	1,875,625	0.14
创光投资有限公司 5% 2024年9月3日	1,000,000	1,120,600	0.08
中国奥园集团股份有限公司 6.2% 2026年3月24日	3,000,000	2,909,940	0.21
CHINA CINDA FINANCE 2017 3.65% 2022年3月9日	3,000,000	3,094,380	0.22
中信银行(国际)有限公司 可变债券 永续债券 2049年12月29日	2,000,000	2,172,720	0.16
中国建设银行股份有限公司 可变债券 2030年6月24日	2,764,000	2,782,325	0.20
中国建设银行股份有限公司 可变债券 2029年2月27日	6,063,000	6,478,316	0.47
CHINA GREAT WALL INTERNATIONAL III 4.375% 2023年5月25日	3,800,000	4,071,662	0.29
CHINA GREAT WALL INTERNATIONAL IV 可变债券 永续债券 2049年12月31日	7,892,000	8,127,182	0.59

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
中国宏桥集团有限公司 7.125% 2022年 7月22日	2,000,000	1,910,040	0.14
中国华电海外发展管理有限公司 可变债 券 永续债券 2049年12月31日	6,096,000	6,316,337	0.46
中国蒙牛乳业有限公司 1.875% 2025年 6月17日	9,867,000	9,895,022	0.72
中油燃气集团有限公司 5.5% 2023年1 月25日	7,988,000	8,206,072	0.59
华润置地有限公司 可变债券 永续债券 2049年12月31日	9,422,000	9,638,989	0.70
中骏集团控股有限公司 5.875% 2022年 3月10日	2,757,000	2,752,644	0.20
中骏集团控股有限公司 8.75% 2021年 1月15日	5,000,000	5,050,450	0.37
华南城控股有限公司 10.75% 2023年4 月11日	1,578,000	1,486,160	0.11
中铝资本控股有限公司 可变债券 永续 债券 2049年12月31日	1,924,000	1,959,017	0.14
创兴银行有限公司 可变债券 永续债券 2049年12月29日	3,991,000	3,997,146	0.29
CICC HK FINANCE 2016 1.75% 2023 年8月10日	2,417,000	2,419,659	0.17
旭辉控股(集团)有限公司 5.95% 2025年 10月20日	2,905,000	2,921,646	0.21
旭辉控股(集团)有限公司 6.7% 2022年 4月23日	39,000,000	5,891,981	0.43
中国中信股份有限公司 4% 2028年1月 11日	5,000,000	5,570,950	0.40
CK HUTCHISON INTERNATIONAL 20 LTD 2.5% 2030年5月8日	10,750,000	11,321,255	0.82

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
CK HUTCHISON INTERNATIONAL 20 LTD 3.375% 2050年5月8日	4,891,000	5,384,404	0.39
CLP POWER HK FINANCE LTD 可变 债券 永续债券 2049年12月31日	6,182,000	6,342,299	0.46
CLP POWER HK FINANCING 2.5% 2035年6月30日	4,880,000	5,053,240	0.37
招银国际租赁管理有限公司 1.875% 2025年8月12日	7,013,000	6,937,470	0.50
招银国际租赁管理有限公司 2.75% 2030年8月12日	2,743,000	2,705,092	0.20
中国华能集团香港财资管理控股有限公 司 3% 2029年12月10日	4,056,000	4,329,942	0.31
CN OVERSEAS FINANCE KY VIII 3.05% 2029年11月27日	7,500,000	7,852,950	0.57
中国农化(香港)峰桥有限公司 3.375% 2024年6月19日	3,959,000	4,120,923	0.30
中国农化(香港)峰桥有限公司 4.625% 2023年3月14日	2,000,000	2,123,020	0.15
中国农化(香港)峰桥有限公司 4.875% 2025年3月14日	3,000,000	3,320,700	0.24
CNOOC FINANCE 2003 LTD 5.5% 2033年5月21日	929,000	1,255,757	0.09
CNOOC FINANCE 2013 LTD 3.3% 2049年9月30日	3,814,000	4,107,831	0.30
CNOOC PETROLEUM NORTH 5.875% 2035年3月10日	2,000,000	2,864,880	0.21
时代瑞鼎发展有限公司 1.875% 2025年 9月17日	6,348,000	6,332,701	0.46

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
时代瑞鼎发展有限公司 2.625% 2030年 9月17日	2,878,000	2,860,531	0.21
碧桂园控股有限公司 6.15% 2025年9 月17日	571,000	630,847	0.05
星展集团控股有限公司 可变债券 永续 债券 2049年12月31日	6,727,000	6,728,211	0.49
DEVELOPMENT BANK OF MONGOLIA 7.25% 2023年10月23 日	1,723,000	1,808,254	0.13
EASY TACTIC LTD 5.75% 2022年1 月13日	2,000,000	1,829,880	0.13
EASY TACTIC LTD 7% 2021年4月 25日	1,000,000	973,530	0.07
EASY TACTIC LTD 8.75% 2021年1 月10日	1,475,000	1,463,938	0.11
ELECT GLOBAL INVESTMENT LTD 4.85% 永续债券 2049年12月31日	2,153,000	2,187,749	0.16
EMIRATES NBD BANK PJSC 4.48% 2024年5月7日	8,000,000	1,222,593	0.09
ENN CLEAN ENERGY 7.5% 2021年2 月27日	1,720,000	1,735,119	0.13
花样年控股集团有限公司 7.95% 2022 年7月5日	3,000,000	2,896,440	0.21
花样年控股集团有限公司 8.375% 2021 年3月8日	2,085,000	2,076,952	0.15
花样年控股集团有限公司 9.25% 2023 年7月28日	4,548,000	4,335,517	0.31
远东宏信有限公司 3.375% 2025年2月 18日	2,683,000	2,649,194	0.19

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
远东宏信有限公司 4.9% 2021年2月 27日	11,710,000	1,734,439	0.13
FORTUNE STAR BVI LTD 5.375% 2020年12月5日	2,000,000	2,005,680	0.14
FORTUNE STAR BVI LTD 5.95% 2023年1月29日	400,000	407,320	0.03
FORTUNE STAR BVI LTD 6.85% 2024年7月2日	9,071,000	9,448,807	0.68
FORTUNE STAR BVI LTD 6.875% 2021年1月31日	1,400,000	1,412,082	0.10
FRANSHION BRILLIANT LTD 4% 2024年6月21日	2,634,000	2,722,608	0.20
FRANSHION BRILLIANT LTD 4.25% 2029年7月23日	2,978,000	3,060,312	0.22
GLOBE TELECOM INC 2.5% 2030年 7月23日	1,929,000	1,866,539	0.13
GLOBE TELECOM INC 3% 2035年7 月23日	640,000	610,637	0.04
金鹰商贸集团有限公司 4.625% 2023 年5月21日	5,058,000	5,016,120	0.36
GREENKO DUTCH BV 4.875% 2022 年7月24日	3,250,000	3,249,220	0.24
GREENKO INVESTMENT CO 4.875% 2023年8月16日	4,000,000	3,998,640	0.29
绿地全球投资有限公司 6.25% 2022年 12月16日	5,127,000	5,113,208	0.37
绿地香港控股有限公司 6% 2021年7 月17日	2,806,000	2,827,017	0.20
健合(H&H)国际控股有限公司 5.625% 2024年10月24日	2,250,000	2,329,380	0.17
HKT CAPITAL NO 4 LTD 3% 2026年 7月14日	2,000,000	2,129,220	0.15

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
HKT CAPITAL NO 5 LTD 3.25% 2029 年 9月30日	3,200,000	3,450,976	0.25
宏华集团有限公司 6.375% 2022 年 8 月 1 日	4,692,000	4,677,079	0.34
HONGKONG ELECTRIC FINANCE 2.25% 2030 年 6 月 9 日	1,877,000	1,907,783	0.14
HPHT FINANCE 19 LTD 2.875% 2024 年 11 月 5 日	6,647,000	6,923,050	0.50
HUARONG FINANCE 2017 CO 3.75% 2022 年 4 月 27 日	700,000	718,669	0.05
HUARONG FINANCE 2019 2.5% 2023 年 2 月 24 日	2,000,000	2,015,080	0.15
HUARONG FINANCE 2019 3.75% 2024 年 5 月 29 日	2,000,000	2,093,900	0.15
HUARONG FINANCE II 可变债券 永续债 券 2049 年 12 月 29 日	5,700,000	5,685,579	0.41
HUARONG FINANCE 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 29 日	5,000,000	5,072,600	0.37
HYSAN MTN LTD 2.875% 2027 年 6 月 2 日	5,468,000	5,659,599	0.41
工银国际租赁财务有限公司 1.75% 2025 年 8 月 25 日	15,669,000	15,675,894	1.14
IFC DEVELOPMENT CORP TRS 3.625% 2029 年 4 月 17 日	3,663,000	4,043,036	0.29
IIFL FINANCE LTD 5.875% 2023 年 4 月 20 日	1,000,000	881,790	0.06
INDIAN OIL CORP LTD 4.75% 2024 年 1 月 16 日	2,200,000	2,349,138	0.17
INDIKA ENERGY CAP II 6.875% 2022 年 4 月 10 日	2,067,000	2,073,222	0.15
INDO ENERGY FINANCE II 6.375% 2023 年 1 月 24 日	3,500,000	1,948,756	0.14

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
印度尼西亚共和国(政府) 2.85% 2030年 2月14日	10,000,000	10,528,800	0.76
印度尼西亚共和国(政府) 3.4% 2029年 9月18日	2,000,000	2,194,060	0.16
印度尼西亚共和国(政府) 4.2% 2050年 10月15日	5,000,000	5,792,900	0.42
印度尼西亚共和国(政府) 4.45% 2070年 4月15日	5,000,000	5,941,350	0.43
印度尼西亚共和国(政府) 5.125% 2045 年1月15日	9,000,000	11,341,260	0.82
印度尼西亚共和国(政府) 5.25% 2047年 1月8日	1,750,000	1,860,635	0.13
印度尼西亚共和国(政府) 8.5% 2035年 10月12日	1,500,000	2,405,970	0.17
INDONESIA ASAHAN ALUMINI 5.8% 2050年5月15日	2,100,000	2,470,020	0.18
INDONESIA ASAHAN ALUMINI 6.53% 2028年11月15日	4,000,000	4,886,680	0.35
INDONESIA ASAHAN ALUMINI 6.757% 2048年11月15日	900,000	1,164,240	0.08
中国工商银行股份有限公司 可变债券 永续债券 2049年12月31日	7,000,000	6,977,670	0.51
INTERNATIONAL CONTAINER 4.75% 2030年6月17日	2,785,000	2,920,685	0.21
巴基斯坦伊斯兰共和国(政府) 6.875% 2027年12月5日	9,000,000	8,968,500	0.65
JABABEKA INTERNATIONAL 6.5% 2023年10月5日	1,501,000	1,224,186	0.09
京东商城电子商务有限公司 3.375% 2030年1月14日	1,614,000	1,750,657	0.13
JGSH PHILIPPINES LTD 4.125% 2030 年7月9日	7,410,000	7,526,633	0.54

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
JOY TRSR ASSETS HOLDINGS 3.5% 2029年9月24日	4,000,000	4,234,840	0.31
JOY TRSR ASSETS HOLDINGS 4.5% 2029年3月20日	462,000	524,074	0.04
JSW STEEL LTD 5.25% 2022年4 月13日	5,582,000	5,617,167	0.41
JUBILANT PHARMA LTD 4.875% 2021年10月6日	2,000,000	1,340,587	0.10
JUBILANT PHARMA LTD 6% 2024 年3月5日	6,000,000	6,254,940	0.45
佳兆业集团控股有限公司 11.25% 2022年4月9日	1,000,000	1,025,540	0.07
佳兆业集团控股有限公司 11.25% 2025年4月16日	1,520,000	1,494,221	0.11
佳兆业集团控股有限公司 11.5% 2023年1月30日	3,000,000	3,065,430	0.22
佳兆业集团控股有限公司 8.5% 2022年6月30日	4,314,000	4,238,764	0.31
佳兆业集团控股有限公司 9.75% 2023年9月28日	8,857,000	8,645,052	0.63
KOOKMIN BANK 可变债券 永续债 券 2049年12月31日	2,538,000	2,658,428	0.19
KT CORP 1% 2025年9月1日	7,925,000	7,896,470	0.57
合景泰富集团控股有限公司 6% 2022年9月15日	3,000,000	3,033,180	0.22
合景泰富地产控股有限公司 5.875% 2024年11月10日	2,000,000	1,965,560	0.14
利丰有限公司 4.5% 2025年8月18 日	5,000,000	5,010,000	0.36
LLPL CAPITAL PTE LTD 6.875% 2039年2月4日	4,000,000	4,328,790	0.31

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.25% 2024 年6月19日	500,000	461,260	0.03
龙光集团有限公司 5.75% 2025年1月 14日	2,000,000	2,012,980	0.15
龙光地产控股有限公司 6.5% 2023年7 月16日	3,000,000	3,069,810	0.22
龙湖地产有限公司 3.9% 2023年4月 16日	3,000,000	3,154,860	0.23
龙湖地产有限公司 4.5% 2028年1月 16日	214,000	234,809	0.02
MANILA WATER CO INC 4.375% 2030年7月30日	5,000,000	4,866,350	0.35
MARBLE II PTE LTD 5.3% 2022年6 月20日	5,000,000	5,043,350	0.36
MEDCO OAK TREE PTE LTD 7.375% 2026年5月14日	5,000,000	4,811,600	0.35
MEDCO PLATINUM ROAD PTE LTD 6.75% 2025年1月30日	5,000,000	4,808,650	0.35
MELCO RESORTS FINANCE 5.625% 2027年7月17日	6,875,000	7,115,625	0.52
MELCO RESORTS FINANCE 5.75% 2028年7月21日	3,513,000	3,580,414	0.26
METROPOLITAN BANK & TRUST 2.125% 2026年1月15日	6,536,000	6,499,594	0.47
METROPOLITAN LIGHT CO 5.5% 2022年11月21日	6,872,000	7,054,452	0.51
美高梅中国控股有限公司 5.25% 2025 年6月18日	2,000,000	2,035,840	0.15
美高梅中国控股有限公司 5.375% 2024 年5月15日	4,800,000	4,951,392	0.36
美高梅中国控股有限公司 5.875% 2026 年5月15日	684,000	705,478	0.05

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
MINEJESA CAPITAL BV 4.625% 2030年8月10日	7,500,000	7,722,225	0.56
MINOR INTERNATIONAL PCL 可变 债券 永续债券 2049年12月29日	3,885,000	3,961,301	0.29
MINOR INTERNATIONAL PCL 可变 债券 永续债券 2049年12月31日	10,193,000	10,262,618	0.74
当代置业(中国)有限公司 11.5% 2022 年11月13日	2,913,000	2,893,832	0.21
当代置业(中国)有限公司 11.8% 2022 年2月26日	3,200,000	3,188,992	0.23
蒙古(政府) 5.125% 2022年12月5 日	616,000	630,790	0.05
蒙古(政府)国际债券 5.125% 2026年 4月7日	2,148,000	2,166,967	0.16
蒙古(政府)国际债券 5.625% 2023年 5月1日	6,739,000	6,952,626	0.50
蒙古(政府)国际债券 8.75% 2024年3 月9日	2,500,000	2,809,550	0.20
MUTHOOT FINANCE LTD 4.4% 2023年9月2日	3,200,000	3,129,376	0.23
MUTHOOT FINANCE LTD 6.125% 2022年10月31日	1,672,000	1,705,841	0.12
NAN FUNG TREASURY III 5% 永续 债券 2049年12月31日	5,351,000	5,330,880	0.39
NAN FUNG TREASURY LTD 3.625% 2030年8月27日	10,616,000	10,661,436	0.77
NEERG ENERGY LTD 6% 2022年 2月13日	594,000	595,402	0.04
NETWORK I2I LTD 可变债券 永续债 券 2049年12月31日	4,528,000	4,524,876	0.33

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
NEXEN ENERGY ULC 7.875% 2032 年3月15日	2,000,000	3,107,960	0.22
NTPC LTD 4.25% 2026年2月26日	650,000	695,305	0.05
NTPC LTD 4.375% 2024年11月26日	2,000,000	2,140,360	0.15
NTPC LTD 4.75% 2022年10月3日	1,114,000	1,172,351	0.08
NWD FINANCE (BVI) 5.75% 永续债券 2049年12月29日	2,000,000	2,007,680	0.15
NWD FINANCE (BVI) LTD 6.25% 永续 债券 2049年12月31日	1,500,000	1,532,535	0.11
NWD MTN LTD 4.125% 2029年7月 18日	3,000,000	3,047,490	0.22
NWD MTN LTD 4.5% 2030年5月19 日	3,023,000	3,143,587	0.23
OIL INDIA LTD 5.125% 2029年2月4 日	5,000,000	5,374,550	0.39
ONGC VIDESH VANKORNEFT 2.875% 2022年1月27日	5,000,000	5,050,250	0.37
华侨银行 可变债券 2030年9月10日	5,850,000	5,848,479	0.42
PAKUWON PRIMA 5% 2024年2月14 日	5,000,000	5,054,150	0.37
PERENTI FINANCE PTY LTD 6.5% 2025年10月7日	8,300,000	8,350,464	0.60
PERTAMINA PERSERO 6% 2042年5 月3日	500,000	613,170	0.04
PERUSAHAAN LISTRIK 4.125% 2027 年5月15日	1,300,000	1,412,294	0.10
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 3% 2030年6月30日	4,501,000	4,534,442	0.33

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 4% 2050年6月30日	7,963,000	7,965,548	0.58
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 6.15% 2048年5月21日	5,000,000	6,439,500	0.47
PETRONAS CAPITAL LTD 4.55% 2050 年4月21日	1,732,000	2,218,467	0.16
菲律宾共和国(政府) 2.95% 2045年5月 5日	5,545,000	5,872,377	0.43
菲律宾共和国(政府) 5% 2037年1月13 日	8,653,000	11,287,752	0.82
菲律宾共和国(政府) 6.375% 2034年10 月23日	5,000,000	7,244,800	0.52
PLDT INC 2.5% 2031年1月23日	1,344,000	1,381,847	0.10
POLY REAL ESTATE FINANCE 3.875% 2024年3月25日	2,580,000	2,720,765	0.20
POLY REAL ESTATE FINANCE 3.95% 2023年2月5日	1,210,000	1,263,760	0.09
POWER FINANCE CORP LTD 3.9% 2029年9月16日	2,000,000	1,950,900	0.14
POWER FINANCE CORP LTD 3.95% 2030年4月23日	2,000,000	1,950,260	0.14
POWER FINANCE CORP LTD 4.5% 2029年6月18日	4,500,000	4,569,210	0.33
POWER FINANCE CORP LTD 6.15% 2028年12月6日	4,806,000	5,422,418	0.39
宝龙地产控股有限公司 6.25% 2024年8 月10日	6,407,000	6,394,250	0.46
宝龙地产控股有限公司 6.95% 2023年7 月23日	4,808,000	4,924,450	0.36
PT ADARO INDONESIA 4.25% 2024年 10月31日	6,300,000	6,145,776	0.44

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
PT BANK TABUNGAN NEGARA 4.2% 2025年1月23日	2,285,000	2,284,452	0.17
PT PELABUHAN INDONESIA II 4.25% 2025年5月5日	2,176,000	2,366,835	0.17
PT PERTAMINA (PERSERO) 4.15% 2060年2月25日	10,000,000	9,949,600	0.72
PT PERTAMINA (PERSERO) 4.7% 2049年7月30日	7,000,000	7,562,310	0.55
PTTEP TREASURY CENTER CO 2.587% 2027年6月10日	1,622,000	1,683,522	0.12
RADIANCE CAPITAL INVESTMENTS 10.5% 2022年1月16日	2,217,000	2,289,585	0.17
RADIANCE CAPITAL INVESTMENTS 8.8% 2023年9月17日	8,341,000	8,450,434	0.61
RADIANT ACCESS 4.6% 永续债券 2049 年12月29日	3,000,000	3,004,560	0.22
REC LTD 3.375% 2024年7月25日	3,000,000	3,045,810	0.22
REC LTD 4.75% 2023年5月19日	8,200,000	8,653,542	0.63
弘阳地产集团有限公司 9.95% 2022年4 月11日	3,250,000	3,338,238	0.24
力高地产集团有限公司 11% 2022年8月 6日	2,453,000	2,498,430	0.18
力高地产集团有限公司 8.5% 2021年8 月19日	3,478,000	3,465,757	0.25
RELIANCE INDUSTRIES LTD 4.125% 2025年1月28日	1,200,000	1,318,008	0.10
RENEW POWER PVT LTD 5.875% 2027年3月5日	2,200,000	2,205,104	0.16
RENEW POWER SYNTHETIC 6.67% 2024年3月12日	7,000,000	7,246,400	0.52

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
印度尼西亚共和国(政府) 4.1% 2028年4月24日	7,000,000	7,989,310	0.58
印度尼西亚共和国(政府) 4.75% 2029年2月11日	7,500,000	8,913,300	0.65
印度尼西亚共和国(政府) 5.35% 2049年2月11日	3,000,000	3,981,210	0.29
菲律宾共和国(政府) 3.7% 2042年2月2日	6,600,000	7,654,680	0.55
斯里兰卡民主社会主义共和国(政府) 5.875% 2022年7月25日	12,662,000	10,163,028	0.74
斯里兰卡民主社会主义共和国(政府) 6.75% 2028年4月18日	3,514,000	2,408,250	0.17
斯里兰卡民主社会主义共和国(政府) 6.85% 2025年11月3日	2,824,000	2,020,544	0.15
斯里兰卡民主社会主义共和国(政府) 7.55% 2030年3月28日	1,579,000	1,078,536	0.08
斯里兰卡民主社会主义共和国(政府) 7.85% 2029年3月14日	5,000,000	3,482,800	0.25
RHB BANK 3.766% 2024年2月19日	2,209,000	2,371,847	0.17
RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 6% 2025年9月4日	2,541,000	2,519,198	0.18
RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 7.875% 2023年2月1日	3,539,000	3,705,970	0.27
RONGSHI INTERNATIONAL FINANCE 3.75% 2029年5月21日	5,000,000	5,623,400	0.41
RONGXINGDA DEVELOPMENT 8.75% 2021年1月28日	2,952,000	2,944,620	0.21
RONGXINGDA DEVELOPMENT 9% 2021年7月15日	3,000,000	3,007,860	0.22
融信中国控股有限公司 6.75% 2024年8月5日	4,902,000	4,661,557	0.34

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
融信中国控股有限公司 8.1% 2023年6月9日	2,000,000	1,995,920	0.14
ROYAL CAPITAL BV 可变债券 永续债券 2049年12月31日	6,230,000	6,234,797	0.45
SAN MIGUEL CORP 可变债券 永续债券 2049年12月31日	3,000,000	2,993,940	0.22
金沙中国有限公司 5.125% 2025年8月8日	2,250,000	2,464,313	0.18
金沙中国有限公司 5.4% 2028年8月8日	12,300,000	13,757,550	1.00
新城发展控股有限公司 6% 2024年8月12日	2,664,000	2,650,467	0.19
新城发展控股有限公司 6.45% 2022年6月11日	1,787,000	1,808,104	0.13
SF HOLDING INVESTMENT 2.875% 2030年2月20日	6,734,000	7,045,717	0.51
上港集团 BVI 发展有限公司 2.375% 2030年7月13日	1,651,000	1,657,026	0.12
上港集团 BVI 发展有限公司 3.375% 2029年6月18日	4,969,000	5,415,017	0.39
深圳国际控股有限公司 可变债券 永续债券 2049年12月29日	1,000,000	1,020,420	0.07
世茂集团控股有限公司 4.6% 2030年7月13日	2,045,000	2,164,960	0.16
SHINHAN BANK 3.75% 2027年9月20日	2,381,000	2,603,171	0.19
SHINHAN FINANCIAL GROUP 1.35% 2026年1月10日	2,962,000	2,967,983	0.21
SHINHAN FINANCIAL GROUP 可变债券 2030年2月5日	1,418,000	1,489,155	0.11
首钢集团有限公司 4% 2024年5月23日	10,000,000	10,694,100	0.77

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE 5.1% 2023年7月16日	6,700,000	6,185,172	0.45
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE 5.95% 2022年10月24日	2,583,000	2,444,835	0.18
SHUI ON DEVELOPMENT HOLDING 6.15% 2024年8月24日	5,158,000	5,145,621	0.37
四川省铁路产业投资集团有限责任公司 3.8% 2022年6月27日	2,904,000	2,954,878	0.21
SIHC INTERNATIONAL CAPITAL 4.35% 2023年9月26日	3,087,000	3,315,160	0.24
新力控股(集团)有限公司 10.5% 2022年 6月18日	7,289,000	7,324,789	0.53
SINOPEC GROUP 2018 2.7% 2030年5 月13日	7,070,000	7,430,711	0.54
SK HYNIX INC 3% 2024年9月17日	1,723,000	1,815,077	0.13
SP GROUP TREASURY PTE 3.375% 2029年2月27日	2,000,000	2,283,040	0.17
SPIC LUX LATAM RE ENER 4.65% 2023年10月30日	483,000	522,350	0.04
SPIC MTN CO LTD 1.625% 2025年7 月27日	6,049,000	6,070,897	0.44
STATE BANK INDIA/LONDON 4.375% 2024年1月24日	8,000,000	8,552,800	0.62
国家电网海外投资有限公司 1.625% 2030年8月5日	22,004,000	21,264,226	1.54
STUDIO CITY FINANCE LTD 6% 2025 年7月15日	2,634,000	2,702,747	0.20
SUN HUNG KAI PROP (CAP) 3.75% 2029年2月25日	3,248,000	3,662,315	0.27
融创中国控股有限公司 7.35% 2021年7 月19日	6,000,000	6,063,060	0.44

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
SUNNY EXPRESS 2.625% 2025年4月 23日	1,250,000	1,302,888	0.09
SUNNY EXPRESS 可变债券 永续债券 2049年12月31日	2,538,000	2,580,156	0.19
TBLA INTERNATIONAL PTE 7% 2023 年1月24日	1,000,000	932,490	0.07
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.25% 2051年4月6日	3,685,000	3,589,374	0.26
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.5% 2070 年10月6日	7,248,000	7,196,684	0.52
腾讯控股有限公司 1.81% 2026年1月 26日	5,276,000	5,380,201	0.39
腾讯控股有限公司 3.925% 2038年1月 19日	2,500,000	2,851,275	0.21
腾讯音乐娱乐集团 2% 2030年9月3日	1,958,000	1,918,292	0.14
THREE GORGES FINANCE I CAYMAN 3.15% 2026年6月2日	5,000,000	5,441,850	0.39
时代中国控股有限公司 6.25% 2021年1 月17日	3,000,000	3,007,410	0.22
TINGYI (C.I.) HOLDING CORP 1.625% 2025年9月24日	7,253,000	7,199,255	0.52
TMB BANK/CAYMAN ISLANDS 可变债 券 永续债券 2049年12月31日	3,944,000	3,766,875	0.27
TSMC GLOBAL LTD 0.75% 2025年9 月28日	9,657,000	9,576,267	0.69
TSMC GLOBAL LTD 1.375% 2030年9 月28日	5,314,000	5,211,334	0.38
UHI CAPITAL 3% 2024年6月12日	5,395,000	5,650,345	0.41
UNITED OVERSEAS BANK LTD 可变债 券 2027年3月8日	3,000,000	3,052,320	0.22

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
UNITED OVERSEAS BANK LTD 可变债券 2029年4月15日	1,517,000	1,618,594	0.12
UNITED OVERSEAS BANK LTD 可变债券 2031年3月16日	6,608,000	6,570,268	0.48
UPL CORP LTD 可变债券 永续债券 2049年12月31日	1,573,000	1,488,813	0.11
美国国债 0.625% 2030年8月15日	10,000,000	9,942,969	0.72
万科地产(香港)有限公司 3.15% 2025年5月12日	6,029,000	6,300,004	0.46
万科地产(香港)有限公司 4.2% 2024年6月7日	2,000,000	2,153,120	0.16
VEDANTA HD MAURITIUS II 13% 2023年8月21日	7,334,000	7,591,057	0.55
VEDANTA RESOURCES PLC 6.125% 2024年8月9日	1,500,000	1,049,880	0.08
VEDANTA RESOURCES PLC 6.375% 2022年7月30日	3,000,000	2,428,110	0.18
VEDANTA RESOURCES PLC 7.125% 2023年5月31日	1,713,000	1,321,562	0.10
VEDANTA RESOURCES PLC 8% 2023年4月23日	400,000	316,520	0.02
VEDANTA RESOURCES PLC 8.25% 2021年6月7日	4,968,000	4,670,665	0.34
VIGOROUS CHAMPION INTERNATIONAL LTD 3.625% 2024年5月28日	2,800,000	2,946,272	0.21
WEALTH DRIVEN LTD 5.5% 2023年8月17日	2,267,000	2,298,307	0.17
WHARF REIC FINANCE BVI 2.375% 2025年5月7日	2,836,000	2,912,203	0.21

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
WHARF REIC FINANCE BVI 2.875% 2030年5月7日	1,706,000	1,785,790	0.13
永利澳门有限公司 5.5% 2026年1月15 日	5,013,000	4,943,520	0.36
西安城市基础设施建设投资集团有限公司 4% 2022年6月24日	2,435,000	2,489,885	0.18
阳光城嘉世国际有限公司 6.8% 2021年3 月11日	2,549,000	2,553,308	0.18
阳光城嘉世国际有限公司 7.5% 2024年4 月15日	1,500,000	1,498,935	0.11
阳光城嘉世国际有限公司 8.25% 2023年 11月25日	1,040,000	1,046,136	0.08
阳光城嘉世国际有限公司 9.25% 2023年 4月15日	818,000	842,908	0.06
阳光城嘉世国际有限公司 9.5% 2021年4 月3日	2,100,000	2,126,817	0.15
YES BANK IFSC BANKING 3.75% 2023 年2月6日	1,500,000	1,421,565	0.10
盈德气体集团有限公司 6.25% 2023年1 月19日	9,000,000	9,328,050	0.68
YONGDA INVESTMENT LTD 2.25% 2025年6月16日	4,086,000	4,189,498	0.30
YUNDA HOLDING INVESTMENT 2.25% 2025年8月19日	13,467,000	13,358,052	0.97
禹洲地产股份有限公司 7.375% 2026年 1月13日	5,000,000	4,823,750	0.35
禹洲地产股份有限公司 7.7% 2025年2 月20日	5,000,000	4,986,850	0.36
正荣地产集团有限公司 5.6% 2021年2 月28日	1,811,000	1,799,573	0.13

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券(续)			
上市投资(续)			
正荣地产集团有限公司 7.35% 2025年2月5日	3,122,000	3,036,801	0.22
正荣地产集团有限公司 8.3% 2023年9月15日	1,000,000	1,013,740	0.07
正荣地产集团有限公司 9.15% 2023年5月6日	800,000	832,416	0.06
正荣地产集团有限公司 9.8% 2021年8月20日	2,105,000	2,159,941	0.16
中梁控股集团有限公司 11.5% 2021年9月26日	5,199,000	5,276,101	0.38
ZOOMLION HK SPV CO LTD 6.125% 2022年12月20日	1,750,000	1,824,480	0.13
未上市但有报价的债券			
SUN HUNG KAI PROP (CAP) 3.2% 2027年8月14日	45,000,000	6,584,258	0.47
债券(合计)		<u>1,355,996,279</u>	<u>98.22</u>

投资组合报表(未经审计)(续)

2020年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
单位信托			
上市投资			
HSBC GLOBAL LIQUIDITY FUNDS - HSBC GLOBAL LIQUIDITY FUNDS PL*	15,559,866	15,559,866	1.13
非上市投资			
HSBC ALL CHINA BOND ZC-USD	150,000	1,696,050	0.12
单位信托(合计)		<u>17,255,916</u>	<u>1.25</u>
外币远期合同		<u>2,872,878</u>	<u>0.21</u>
投资总额(投资成本合计: 1,338,274,128 美元)		1,376,125,073	99.68
其他资产净值		<u>4,378,775</u>	<u>0.32</u>
2020年9月30日的资产净值总额		<u><u>1,380,503,848</u></u>	<u><u>100.00</u></u>

*该投资基金在香港未获授权，也不对香港公众开放。

投资组合变动表(未经审计)

2020年4月1日起至2020年9月30日止期间

	占资产净值 百分比 2020年 9月30日	占资产净值 百分比 2020年 3月31日
金融资产		
债务证券		
上市债券	97.75	98.14
未上市但有报价的债券	0.47	-
	<u>98.22</u>	<u>98.14</u>
单位信托		
上市单位信托	1.13	0.16
未上市单位信托	0.12	-
	<u>1.25</u>	<u>0.16</u>
外币远期合同	<u>0.21</u>	<u>0.58</u>
投资总额	99.68	98.88
其他资产净值	<u>0.32</u>	<u>1.12</u>
资产净值总额	<u>100.00</u>	<u>100.00</u>

衍生金融工具详情(未经审计)

2020 年 4 月 1 日起至 2020 年 9 月 30 日止期间

外汇即期合同

截至 2020 年 9 月 30 日，本基金持有未平仓的外汇即期合同如下：

待交割合同	交换	结算日	交易对手	公允价值 美元
金融资产：				
美元	加元	2020 年 10 月 5 日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	325
美元	英镑	2020 年 10 月 5 日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	28
美元	港元	2020 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	2
美元	澳元	2020 年 10 月 6 日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	1,286
美元	澳元	2020 年 10 月 6 日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	3,693
美元	加元	2020 年 10 月 6 日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	851
美元	英镑	2020 年 10 月 6 日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	58
美元	加元	2020 年 10 月 7 日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	1,460
美元	离岸人民币	2020 年 10 月 7 日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	167
美元	英镑	2020 年 10 月 7 日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	1,266
美元	离岸人民币	2020 年 10 月 9 日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	8
美元	离岸人民币	2020 年 10 月 9 日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	35
				9,179

衍生金融工具详情(未经审计)(续)

2020年4月1日起至2020年9月30日止期间

外汇即期合同(续)

待交割合同	交换	结算日	交易对手	公允价值 美元
金融负债：				
离岸人民币	美元	2020年10月5日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(3,729)
澳元	美元	2020年10月6日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(2,205)
澳元	美元	2020年10月6日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(26,219)
离岸人民币	美元	2020年10月6日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(1,885)
欧元	美元	2020年10月6日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(826)
澳元	美元	2020年10月7日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(2,264)
离岸人民币	美元	2020年10月9日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(2)
离岸人民币	美元	2020年10月13日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(119)
离岸人民币	美元	2020年10月13日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(5)
离岸人民币	美元	2020年10月13日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(153)
离岸人民币	美元	2020年10月13日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(70)
				<u>(37,477)</u>

衍生金融工具详情(未经审计)(续)

2020年4月1日起至2020年9月30日止期间

外汇远期合同

截至2020年9月30日，本基金持有未平仓的外汇远期合同如下：

待交割合同	交换	结算日	交易对手	公允价值 美元
金融资产：				
美元	澳元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	1,224,866
美元	加元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	47,589
美元	加元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	257
美元	离岸人民币	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	633,208
美元	欧元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	37,034
美元	英镑	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	908,831
美元	新加坡元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	55,113
美元	离岸人民币	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	10,600
美元	澳元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	14,679
美元	离岸人民币	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	21,093
美元	澳元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	26,163
美元	离岸人民币	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	3,496
美元	离岸人民币	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	1,663
美元	欧元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	835
美元	离岸人民币	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	57

衍生金融工具详情(未经审计)(续)

2020年4月1日起至2020年9月30日止期间

外汇远期合同(续)

待交割合同	交换	结算日	交易对手	公允价值 美元
金融资产(续):				
美元	澳元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	2,250
美元	离岸人民币	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	99
美元	离岸人民币	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	127
				2,987,960
金融负债:				
澳元	美元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(4,002)
澳元	美元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(3,706)
加元	美元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(329)
加元	美元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(863)
加元	美元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(1,479)
离岸人民币	美元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(13)
离岸人民币	美元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(17)
离岸人民币	美元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(33)
离岸人民币	美元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(8)
离岸人民币	美元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(153)
英镑	美元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(4,365)

衍生金融工具详情(未经审计)(续)

2020年4月1日起至2020年9月30日止期间

外汇远期合同(续)

待交割合同	交换	结算日	交易对手	公允价值 美元
金融负债(续):				
英镑	美元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(28)
英镑	美元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(58)
英镑	美元	2020年10月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(1,278)
离岸人民币	美元	2020年11月30日	HSBC Mkts Treasury Services HK - Cur	(98,750)
				<u>(115,082)</u>

业绩表现记录(未经审计)

(a) 总资产净值(按《香港财务报告准则》计算)

	2020 年 9 月 30 日 美元	2020 年 3 月 31 日 美元	2019 年 3 月 31 日 美元	2018 年 3 月 31 日 美元
总资产净值	1,380,503,848	1,020,461,121	830,526,536	1,300,171,309

(b) 份额净值(按《香港财务报告准则》计算)

	计价货币	2020 年 9 月 30 日	2020 年 3 月 31 日	2019 年 3 月 31 日	2018 年 3 月 31 日
份额净值					
- AC 类 - 美元	美元	11.131	10.090	10.245	9.828
- AM2 类 - 美元	美元	9.776	9.094	9.708	9.789
- AM2 类 - 人民币	人民币	9.677	9.399	9.516	8.965
- AM3O 类 - 人民币	人民币	9.643	8.959	9.570	9.662
- AM2 类 - 港元	港元	9.765	9.084	9.820	9.904
- AM2 类 - 欧元	欧元	8.808	8.755	9.145	8.413
- AM3O 类 - 欧元	欧元	9.565	8.909	9.536	9.624
- AM2 类 - 澳元	澳元	10.401	11.350	10.485	9.822
- AM3O 类 - 澳元	澳元	9.600	8.927	9.549	9.652
- AM2 类 - 加元	加元	9.913	9.828	9.862	9.621
- AM3O 类 - 加元	加元	9.585	8.914	9.531	9.629
- AM3O 类 - 英镑	英镑	9.547	8.887	9.527	9.637
- AM3O 类 - 新加坡元	新加坡元	9.599	8.933	9.553	9.647
- BC 类 - 港元	港元	10.827	-	-	-
- BC 类 - 人民币	人民币	10.424	-	-	-
- BC 类 - 美元	美元	10.829	-	-	-
- BCO 类 - 人民币	人民币	10.980	-	-	-
- BM2 类 - 港元	港元	10.594	-	-	-
- BM2 类 - 人民币	人民币	10.207	-	-	-
- BM2 类 - 美元	美元	10.599	-	-	-
- BM3O 类 - 澳元	澳元	10.623	-	-	-
- BM3O 类 - 人民币	人民币	10.634	-	-	-
- IM2 类 - 美元	美元	9.943	-	-	-

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(交易份额净值)

AC 类—美元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2020年9月30日	9.896	11.311	9.896	11.311
2020年3月31日	9.790	11.210	9.790	11.210
2019年3月31日	9.545	10.261	9.545	10.403
AM2 类—美元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2020年9月30日	8.919	10.003	8.919	10.003
2020年3月31日	8.862	10.147	8.862	10.147
2019年3月31日	9.246	9.817	9.246	10.361
AM2 类—人民币				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020年9月30日	9.229	10.130	9.229	10.130
2020年3月31日	9.144	10.441	9.144	10.441
2019年3月31日	8.854	9.646	9.275	10.182
AM30 类—人民币				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020年9月30日	8.782	9.873	8.782	9.873
2020年3月31日	8.740	10.014	8.740	10.014
2019年3月31日	9.119	9.692	9.119	10.233

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(交易份额净值)(续)

截至下列日期止的财务期间/年度	AM2 类 – 港元			
	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2020年9月30日	8.906	9.990	8.906	9.990
2020年3月31日	8.857	10.173	8.857	10.173
2019年3月31日	9.328	9.930	9.328	10.487
截至下列日期止的财务期间/年度	AM2 类 – 欧元			
	买入		卖出	
	最低 欧元	最高 欧元	最低 欧元	最高 欧元
2020年9月30日	8.672	9.194	8.672	9.194
2020年3月31日	8.604	9.871	8.604	9.871
2019年3月31日	8.352	9.186	8.558	9.384
截至下列日期止的财务期间/年度	AM30 类 – 欧元			
	买入		卖出	
	最低 欧元	最高 欧元	最低 欧元	最高 欧元
2020年9月30日	8.735	9.785	8.735	9.785
2020年3月31日	8.669	9.951	8.669	9.951
2019年3月31日	8.947	9.643	8.955	10.178
截至下列日期止的财务期间/年度	AM2 类 – 澳元			
	买入		卖出	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2020年9月30日	10.260	11.514	10.260	11.514
2020年3月31日	10.385	12.101	10.385	12.101
2019年3月31日	9.596	10.601	9.704	10.794

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(交易份额净值)(续)

截至下列日期止的财务期间/年度	AM3O 类 – 澳元			
	买入		卖出	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2020年9月30日	8.754	9.826	8.754	9.826
2020年3月31日	8.703	9.982	8.703	9.982
2019年3月31日	9.108	9.679	9.111	10.216
截至下列日期止的财务期间/年度	AM2 类 – 加元			
	买入		卖出	
	最低 加元	最高 加元	最低 加元	最高 加元
2020年9月30日	9.535	10.117	9.535	10.117
2020年3月31日	9.574	10.434	9.574	10.434
2019年3月31日	9.204	9.979	9.271	10.228
截至下列日期止的财务期间/年度	AM3O 类 – 加元			
	买入		卖出	
	最低 加元	最高 加元	最低 加元	最高 加元
2020年9月30日	8.744	9.808	8.744	9.808
2020年3月31日	8.689	9.964	8.689	9.964
2019年3月31日	9.061	9.656	9.061	10.192
截至下列日期止的财务期间/年度	AM3O 类 – 英镑			
	买入		卖出	
	最低 英镑	最高 英镑	最低 英镑	最高 英镑
2020年9月30日	8.712	9.767	8.712	9.767
2020年3月31日	8.658	9.974	8.658	9.974
2019年3月31日	9.090	9.659	9.090	10.194

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(交易份额净值)(续)

AM3O 类 – 新加坡元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 新加坡元	最高 新加坡元	最低 新加坡元	最高 新加坡元
2020年9月30日	8.759	9.821	8.759	9.821
2020年3月31日	8.707	10.003	8.707	10.003
2019年3月31日	9.095	9.668	9.095	10.205
BC 类 – 港元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2020年9月30日	9.949	11.004	9.949	11.004
2020年3月31日	-	-	-	-
2019年3月31日	-	-	-	-
BC 类 – 人民币				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020年9月30日	10.000	10.821	10.000	10.821
2020年3月31日	-	-	-	-
2019年3月31日	-	-	-	-
BC 类 – 美元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2020年9月30日	9.949	11.004	9.949	11.004
2020年3月31日	-	-	-	-
2019年3月31日	-	-	-	-

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(交易份额净值)(续)

BCO 类—人民币				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020年9月30日	10.000	11.142	10.000	11.142
2020年3月31日	-	-	-	-
2019年3月31日	-	-	-	-
BM2 类—港元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2020年9月30日	9.947	10.842	9.947	10.842
2020年3月31日	-	-	-	-
2019年3月31日	-	-	-	-
BM2 类—人民币				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020年9月30日	10.000	10.686	10.000	10.686
2020年3月31日	-	-	-	-
2019年3月31日	-	-	-	-
BM2 类—美元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2020年9月30日	9.949	10.846	9.949	10.846
2020年3月31日	-	-	-	-
2019年3月31日	-	-	-	-

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(交易份额净值)(续)

BM30 类 – 澳元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2020年9月30日	10.000	10.874	10.000	10.874
2020年3月31日	-	-	-	-
2019年3月31日	-	-	-	-
BM30 类 – 人民币				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020年9月30日	9.986	10.894	9.986	10.894
2020年3月31日	-	-	-	-
2019年3月31日	-	-	-	-
IM2 类 – 美元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2020年9月30日	9.931	10.040	9.931	10.040
2020年3月31日	-	-	-	-
2019年3月31日	-	-	-	-

分派披露

AM2类—美元	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 美元	总分派 金额 美元
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0432	2,771,947.57
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0428	2,681,443.19
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0416	2,480,922.97
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月10日	0.0412	2,316,109.96
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0402	2,101,464.63
2020年4月派息	2020年4月29日	2020年5月12日	0.0396	2,066,631.36

AM2类—人民币	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 人民币	总分派 金额 人民币
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月19日	0.0431	373,566.08
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0435	378,565.10
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0429	323,551.77
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月10日	0.0431	292,078.57
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0415	281,622.23
2020年4月派息	2020年4月29日	2020年5月12日	0.0410	292,827.82

AM30类—人民币	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 人民币	总分派 金额 人民币
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月19日	0.0611	3,642,535.36
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0592	3,041,716.36
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0555	2,681,978.33
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月10日	0.0562	2,517,345.55
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0448	1,953,056.55
2020年4月派息	2020年4月29日	2020年5月12日	0.0324	1,383,074.98

AM2类—港元	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 港元	总分派 金额 港元
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0431	13,709,620.12
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0427	12,994,629.58
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0416	11,690,541.85
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月10日	0.0412	11,254,253.60
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0402	10,942,325.62
2020年4月派息	2020年4月29日	2020年5月12日	0.0396	10,888,519.10

分派披露(续)

AM2类 – 欧元	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 欧元	总分派 金额 欧元
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0381	31,485.16
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0382	30,871.43
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0392	33,728.98
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月10日	0.0391	33,583.04
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0391	33,583.04
2020年4月派息	2020年4月29日	2020年5月12日	0.0381	32,651.29
AM30类 – 欧元	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 欧元	总分派 金额 欧元
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0358	17,189.00
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0352	18,056.93
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0336	17,502.89
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月10日	0.0346	17,309.79
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0333	17,558.33
2020年4月派息	2020年4月29日	2020年5月12日	0.0269	12,840.88
AM2类 – 澳元	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 澳元	总分派 金额 澳元
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0445	96,688.87
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0455	95,757.53
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0461	92,331.42
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月10日	0.0474	85,709.26
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0470	86,374.98
2020年4月派息	2020年4月29日	2020年5月12日	0.0494	89,713.99
AM30类 – 澳元	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 澳元	总分派 金额 澳元
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0409	451,324.75
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0406	455,112.55
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0396	393,023.91
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月10日	0.0395	385,087.19
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0379	370,771.93
2020年4月派息	2020年4月29日	2020年5月12日	0.0309	360,077.86

分派披露(续)

AM2类 – 加元	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 加元	总分派 金额 加元
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0427	36,859.15
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0435	30,342.68
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0431	25,001.96
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月10日	0.0432	22,289.42
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0425	21,543.28
2020年4月派息	2020年4月29日	2020年5月12日	0.0428	23,092.51
AM30类 – 加元	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 加元	总分派 金额 加元
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0415	269,689.30
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0410	243,402.38
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0395	229,516.34
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月10日	0.0404	242,599.05
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0378	208,299.04
2020年4月派息	2020年4月29日	2020年5月12日	0.0352	186,969.55
AM30类 – 英镑	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 英镑	总分派 金额 英镑
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0403	183,836.30
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0399	162,192.41
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0387	141,517.32
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月10日	0.0392	135,964.57
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0376	142,072.97
2020年4月派息	2020年4月29日	2020年5月12日	0.0320	102,571.49
AM30类 – 新加坡元	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 新加坡元	总分派 金额 新加坡元
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0430	41,646.73
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0415	26,588.25
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0403	25,819.94
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月13日	0.0393	22,225.69
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0389	17,422.35
2020年4月派息	2020年4月29日	2020年5月12日	0.0336	15,048.61

分派披露(续)

BM2类 – 美元	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 美元	总分派 金额 美元
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0468	33,526.50
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0464	29,207.83
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0452	23,327.42
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月10日	0.0447	18,970.25
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0436	9,574.48
BM2类 – 人民币	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 人民币	总分派 金额 人民币
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0455	38,832.75
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0459	36,441.07
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0453	40,199.61
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月10日	0.0454	33,061.59
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0438	24,508.55
BM30类 – 人民币	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 人民币	总分派 金额 人民币
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0674	122,024.23
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0653	104,675.86
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0612	80,346.89
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月10日	0.0620	67,608.32
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0495	28,663.76
BM2类 – 港元	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 港元	总分派 金额 港元
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0468	13,807.47
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0464	11,984.61
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0451	6,660.16
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月10日	0.0447	4,741.55
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0436	2,236.81

分派披露(续)

BM30类— 澳元	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 澳元	总分派 金额 澳元
2020年9月派息	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0453	5,332.78
2020年8月派息	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0449	5,058.01
2020年7月派息	2020年7月31日	2020年8月11日	0.0438	5,184.32
2020年6月派息	2020年6月30日	2020年7月10日	0.0438	4,472.93
2020年5月派息	2020年5月29日	2020年6月9日	0.0421	3,013.69

行政

经理

汇丰投资基金 (香港) 有限公司
香港中环
皇后大道中 1 号
汇丰总行大厦

管理人董事

鲍国贤 (已于 2020 年 8 月 28 日辞职)
巴培卓
刘嘉燕
马浩德
谭振邦

受托人和基金注册登记机构

汇丰机构信托服务 (亚洲) 有限公司
香港中环
皇后大道中 1 号
汇丰总行大厦

投资顾问

汇丰环球投资管理 (香港) 有限公司
香港中环
皇后大道中 1 号
汇丰总行大厦

审计师

毕马威
香港
中环
遮打道 10 号
太子大厦 8 楼

法律顾问

的近律师行
香港
中环
遮打道 18 号
历山大厦 5 楼