

百达香港

未经审计半年度报告

瑞士百达策略收益

2021年10月1日至2022年3月31日止期间

瑞士百达亚洲债券收益

2021年10月1日至2022年3月31日止期间

百达香港之子基金

瑞士百达策略收益
瑞士百达亚洲债券收益
(百达香港之子基金)

目录

	页码
管理及行政	1
管理人报告	2-4
财务状况表(未经审计)	5-6
综合收益表(未经审计)	7-8
归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)	9-12
现金流量表(未经审计)	13-14
投资组合(未经审计)	15-30
投资组合持有变动表(未经审计)	31-32
衍生金融工具详情(未经审计)	33-35
分配披露(未经审计)	36-39
业绩记录(未经审计)	40-44

瑞士百达策略收益
瑞士百达亚洲债券收益
(百达香港之子基金)

管理及行政

管理人

瑞士百达资产管理(香港)有限公司
香港中环
干诺道中8号
遮打大厦8-9楼

管理人董事

Nicolas LERESCHE
John Alexander SAMPLE
Junjie WATKINS
Cédric Jean-Albert VERMESSE
Hau Keung YEUNG

受托人及注册登记机构

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

托管人

香港上海汇丰银行有限公司
香港中环
皇后大道中1号

中国内地托管人

汇丰银行(中国)有限公司
中国
上海市浦东新区
世纪大道8号
上海国金中心
汇丰银行大楼33楼

核数师

罗兵咸永道会计师事务所
香港中环
太子大厦22楼

管理人法律师

的近律师行
香港中环
遮打道18号
历山大厦5楼

瑞士百达策略收益 瑞士百达亚洲债券收益 (百达香港之子基金)

管理人报告

瑞士百达策略收益

踏入2022年，一系列宏观因素笼罩着整个市场：美联储收紧货币政策，全球央行紧随其后，通胀恶化，工资/物价飙升，收益率曲线出现倒挂，全球经济放缓，中国房地产行业发生违约，中国面临经济风险等。总体而言，市场面临三大冲击：通胀冲击、利率冲击和增长冲击。

俄乌冲突引发地缘政治剧烈动荡，爆发核战的几率有所提升。武装冲突造成巨大破坏和伤亡，更为不幸的是，随着冲突持续，破坏和伤亡将进一步扩大。加上供应链中断、经济制裁、能源价格飙升和市场波动带来的冲击，全球经济承受了广泛的损害。

市场参与者普遍忧虑危机会接踵而来。高度不确定性和市场波动加剧，有可能打击市场参与者的积极性，例如港交所旗下伦敦金属交易所取消了镍交易，不单把有关的账上收益/亏损作废，更对期货市场的交易和对冲操作造成严重的打击。部分市场参与者可能出现保证金问题和面临流动性危机。

瑞士百达策略收益认为，全球经济暗涌正在加剧，挑战着二次大战后形成的国际秩序。举例而言，全球化与孤立主义两者正在角力，亦有信奉“弱肉强食”的现实主义派与倡导“为共同利益而战”的自由主义派的争论。现代纷争牵涉多个领域，不仅涉及对海陆空的争夺，还涉及太空、网络和人力资源等领域的冲突。资本市场也无法幸免，因此其市场参与者必须作出相应调整。

在此背景下，2022年第一季度对于金融市场而言充满戏剧性。一方面，债券市场大范围受压。美国国债大跌5.5%，这是自1999年以来表现最差的季度；欧洲主权债同样遭受巨额损失。股市开始回调：截至第一季度末，纳斯达克指数跌幅达8.9%，新兴市场指数下跌7.0%。中概互联网指数（KWEB）抵消了过去9年以来的所有收益。另一方面，商品价格飞涨。能源、商品、农产品获得重大收益。

瑞士百达策略收益坚信，动态资产配置搭配精准的投资标的是规避风险、提高收益的至胜关键。

鉴于通胀恶化，地缘政治风险加剧，本基金更青睐实物资产，包括能源、矿产、农产品等商品。本基金同时看好参与上述业务的标的，重点关注现金流强劲和财务稳健的企业。总体而言，美国和澳大利亚在能源安全和粮食安全等领域占有领先地位，而印度、欧洲、日本和部分新兴市场的表现次之。

在新的环境下，我们可能需要对环境、社会和管治(ESG)等议题作出一些反思。固有的ESG概念很大程度上忽略了现实世界的动态发展。“能源自由”是国家安全的重要组成部分。国防和网络安全也日趋重要。如果没有国家安全，就没有国家主权，更谈不上可持续发展。

尽管受着所有负面情绪冲击，发达市场的经济正在逐步重启。能够受益于服务消费、千禧一代消费偏好的企业及优质品牌，均能表现优异。

经济增长放缓，通货膨胀恶化，造就了具有强大竞争优势、定价能力，并能管控自身供应链（“了解你的供应商”（KYS）原则）的优质公司。长线增长趋势证券在该方面继续保持优势。它们的现金流日渐充盈，有利扩展企业生态，提升技术领导力，并能找到新的投资机会。但考虑到近期市场发展，本基金不时对资产配置和投资标的作出相应的调整和优化。

中国政策制定者对民营企业和民营资本的取态已发生显著变化。但来自房地产放缓、融资困难、疫情封锁导致经济中断等挑战将仍会持续。政策监管和全球资本流动也会继续影响市场的论调。

黄金作为实物资产，可以对冲多种不确定性。通胀挂钩的债券能提供一定程度的保护。本基金公司信用债的配置也因此维持在极低的水平。

瑞士百达资产管理(香港)有限公司
2022年5月23日

瑞士百达策略收益

瑞士百达亚洲债券收益

(百达香港之子基金)

管理人报告(续)

瑞士百达亚洲债券收益

市场回顾

过去六个月，受中国发行人违约事件、利率波动，加上奥密克戎变异株触发新一轮新冠疫情，亚洲信用市场极为动荡。此外，俄罗斯入侵乌克兰，全球地缘政治局势紧张，多国对俄罗斯商品实施出口制裁，进一步加剧全球通胀。

2021年10月至2022年3月，摩根大通亚洲信用指数（“JACI”）企业指数下跌9%。在此期间，亚洲信用市场的主要影响来自于中国房地产板块高收益债的大幅回调，因为市场担忧实力较弱的房地产发行人会发生违约，随之牵连到更广泛的中国高收益信用市场。由于市场曾认为信用资质较强的优质房地产开发商，例如世茂和龙光等，却因铺天盖地的负面新闻导致价格持续走低，甚至导致出现投资级房地产开发商被抛售的情况。

2022年第一季度，中国房地产行业迎来更多的政策放松，包括下调房贷利率、部分城市放宽二套房购买限制等。尽管3月份新冠疫情反弹，房地产市场信心大减，短期内市场情绪仍然低迷不振，但这些积极措施有望持续推动国内房地产销售回暖。

除中国房地产行业以外，由于美联储的鹰派立场以及俄乌冲突引发的避险情绪，信用市场在2022年第一季度继续震荡下行。2022年1至3月，美国10年期国债收益率从1.5%上涨至2.3%，亚洲投资级信用债持续遇冷。到2022年第一季度末，俄罗斯入侵乌克兰导致风险资产遭大举抛售，从而引发亚洲高风险信用债也出现大幅抛售。针对非中国企业发行的债券，经济阴霾与接踵而至的通货膨胀导致企业债面临重新定价。例如，GMR海德拉巴机场（主要经营印度境内航班）发行的2024年到期债券，在3月份下跌幅度略微超过1%，但与美国2年期国债收益率的差距收窄了0.8%，表明这支债券的表现优于相似期限的美国国债，且跌幅更小。另一支在3月份表现出色的债券是力宝卡拉瓦奇发行的2025年到期债券。这支债券在月初时下跌，但随着市场风险偏好提升，到月末价格基本保持不变稳定。然而，由于美国国债收益率在第一季度波动较大，推动企业债重新定价，令表现优异的债券仍难逃损失。能源价格飙升，对不同国家宏观经济造成的影响不尽相同，部分国家的企业债相对而言表现更好。例如，马来西亚的企业债表现相对较好，这是因为油价上涨促进了该国经济。相比之下，印度、菲律宾和泰国三国则因为能源价格疯涨和其他商品通胀遭受更严重的损失。

投资组合回顾

2021年第四季度，我们认为地产政策的收紧会削弱房地产开发商的流动性，因此在该季度初抛售潮开始时，我们即降低了中国房地产投资的风险敞口。我们将高风险高收益的房地产持仓转向高质量的房地产企业。除中国高收益房地产投资外，我们还减持估值偏紧且上升空间有限的中国高收益工业企业敞口。为避免美国国债抛售引起的下行风险，我们减持了结构欠佳的永续债券（例如发行方如不赎回，调息幅度较小）。到2022年第一季度末，我们对中国房地产行业的投资继续重点关注违约概率低且财力雄厚、具备偿债能力的企业。我们也重新增持了一些相较基准指数低配的优质科技企业。

对于亚洲其他地区，我们在一月份和二月份降低了久期风险，亦减少了一些利差风险。我们继续增加在印度和印度尼西亚收益率较高的短期债券的比重。基于对久期的看法，我们还增持了一定程度的现金。此外，鉴于市场进行了回调，3月底我们增持了少量收益率较高的短期债券。

瑞士百达策略收益
瑞士百达亚洲债券收益
(百达香港之子基金)

管理人报告(续)

瑞士百达亚洲债券收益

市场前景

展望未来，我们对亚洲信用市场持谨慎乐观态度。我们认为，亚洲市场的信用利差已显著扩大，价格已充分反映亚洲市场的多项不利因素，但相较于世界其他国家，亚洲国家的基本面大体上维持稳健。尽管如此，我们也意识到俄乌局势目前尚不明朗，与此同时美联储采取紧缩政策以遏制通胀恶化的成效仍需一段时间显现。因此，我们将继续着眼于优质信用债券的投资策略。针对高收益债券，我们将继续锁定流动性相对较好的企业。针对投资级债券，我们继续低配利差收窄且更易受到美国国债收益率影响的行业，比如石油天然气行业、金融业的优先级债券等。此外，考虑到久期较短、收益率较高等优势，我们将继续超配BBB级的企业。基金也保持相对市场而言较短的久期。

瑞士百达资产管理(香港)有限公司
2022年5月23日

瑞士百达策略收益
瑞士百达亚洲债券收益
(百达香港之子基金)

财务状况表(未经审计)

于2022年3月31日

瑞士百达策略收益

	2022年3月31日	2021年9月30日
	(美元)	(美元)
资产		
投资	353,395,025	268,810,626
衍生金融资产	746,398	1,061,002
应收认购款	562,480	3,525,147
应收经纪款	889,346	6,406,252
应收股息	234,014	172,450
应收银行利息	1,340	1,012
应收投资利息	429,851	309,105
其他应收款	142,799	143,902
保证金	2,712,520	3,657,100
现金及现金等价物	<u>28,658,219</u>	<u>28,257,004</u>
总资产	<u>387,771,992</u>	<u>312,343,600</u>
负债		
衍生金融负债	426,965	288,759
应付赎回款	737,738	1,145,701
应付经纪款	1,601,758	4,308,342
其他应付款	<u>3,043,995</u>	<u>1,328,907</u>
负债(不包括归属于份额持有人的净资产)	<u>5,810,456</u>	<u>7,071,709</u>
归属于份额持有人的净资产	<u>381,961,536</u>	<u>305,271,891</u>
已发行的份额数目		
- P 每月派息 美元	13,789,503.8802	9,233,691.9242
- P 每月派息 港元	103,012,716.9030	81,336,356.0050
- HP 每月派息 人民币	27,709,305.3576	22,154,763.3018
- HP 每月派息 澳元	6,578,402.6307	6,028,093.2580
- HM 人民币	508,052.4400	505,212.1900
- I 每月派息 美元	404,855.4457	300,799.3387
- I 累计 美元	157,480.9997	-
- HI 每月派息 新加坡元	308,768.9210	232,000.0000
- HI 累计 新加坡元	338,592.3640	130,000.0000

注：子基金半年度报告采用的会计政策和计算方法与年度报告采用的会计政策和计算方法相同。

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

财务状况表(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达亚洲债券收益

	2022年3月31日	2021年9月30日
	(美元)	(美元)
资产		
投资	26,771,037	35,739,637
衍生金融资产	19,593	563
应收经纪款	206,203	3,694,435
应收银行利息	6	-
应收投资利息	258,275	412,786
其他应收款	38,025	43,095
保证金	77,788	49,243
现金及现金等价物	<u>3,660,689</u>	<u>2,270,655</u>
总资产	<u>31,031,616</u>	<u>42,210,414</u>
负债		
衍生金融负债	563	41,249
应付赎回款	-	4,127,298
应付经纪款	1,065,089	368,311
应付成立费用	38,870	43,940
其他应付款	<u>44,452</u>	<u>62,893</u>
负债(不包括归属于份额持有人的净资产)	<u>1,148,974</u>	<u>4,643,691</u>
归属于份额持有人的净资产	<u>29,882,642</u>	<u>37,566,723</u>
已发行的份额数目		
- P 每月派息 美元	867,703.0871	1,202,493.1330
- P 每月派息 港元	971,937.4334	1,725,018.1380
- HP 每月派息 人民币	122,061.7790	122,061.7790
- HP 每月派息 澳元	114,304.8300	150,934.8300
- I 每月派息 美元	1,076,253.0200	1,057,277.7470
- I 累计 美元	884,000.0000	887,968.6080
- HI 累计 新加坡元	550,796.7288	552,302.0080

注：子基金半年度报告采用的会计政策和计算方法与年度报告采用的会计政策和计算方法相同。

瑞士百达策略收益
瑞士百达亚洲债券收益
(百达香港之子基金)

综合收益表(未经审计)

截至2022年3月31日止6个月期间

瑞士百达策略收益

	2021年10月1日至 2022年3月31日期间	2020年10月1日至 2021年3月31日期间
	(美元)	(美元)
收益		
股息收入	1,421,147	796,555
银行存款利息收益	820	327
投资利息收益	503,099	268,531
投资与衍生金融工具公允价值的净变动	(12,721,863)	23,562,992
汇兑净损失	(372,519)	(296,658)
已收佣金回扣	3,021	2,985
对基金的补偿	—	155,641
总投资(亏损)/利润	(11,166,295)	24,490,373
开支		
管理费用 ^{注2}	2,482,861	1,164,768
受托人费用 ^{注1}	168,834	79,941
交易成本 ^{注1}	268,771	139,499
托管费和银行手续费 ^{注1}	56,399	36,214
核数师酬金	15,998	10,785
法律及专业服务费	5,777	51,004
其他运营费用 ^{注1}	39,715	39,027
营业费用总额	3,038,355	1,521,238
经营(亏损)/利润	(14,204,650)	22,969,135
财务成本		
利息支出 ^{注1}	(11,440)	(11,270)
对份额持有人派发股息	(9,259,585)	(4,433,147)
收益分配后及税前(亏损)/利润	(23,475,675)	18,524,718
股息收入预扣税	(305,670)	(82,539)
归属于份额持有人的净资产(减少)/增加	(23,781,345)	18,442,179

^{注1}截至2022年3月31日和2021年3月31日止期间，向受托人或其关联人士支付了受托人费用、托管费和银行手续费，向受托人或其关联人士支付的其他款项如下：

	2021年10月1日至 2022年3月31日期间	2020年10月1日至 2021年3月31日期间
交易成本	53,475	40,300
其他运营费用	15,964	9,303
利息支出	4,013	1,800

^{注2}截至2022年3月31日和2021年3月31日止期间，除向管理人支付了管理费用外，未向管理人或其关联人士支付其他款项。

瑞士百达策略收益
瑞士百达亚洲债券收益
(百达香港之子基金)

综合收益表(未经审计)(续)

截至2022年3月31日止6个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

2021年10月1日至
2022年3月31日期间

(美元)

收益	
银行存款利息收益	21
投资利息收益	667,819
投资与衍生金融工具公允价值的净变动	(3,491,181)
汇兑净损失	<u>(337)</u>
总投资亏损	<u>(2,823,678)</u>
开支	
管理费用 ^{注2}	111,843
受托人费用 ^{注1}	35,627
托管费和银行手续费 ^{注1}	7,864
核数师酬金	15,499
法律及专业服务费	2,065
成立费	5,070
其他运营费用 ^{注1}	<u>22,675</u>
营业费用总额	<u>200,643</u>
经营亏损	<u>(3,024,321)</u>
财务成本	
对份额持有人派发股息	<u>(592,922)</u>
归属于份额持有人的净资产减少	<u>(3,617,243)</u>

^{注1}截至2022年3月31日止期间，向受托人或其关联人士支付了受托人费用、托管费和银行手续费，向受托人或其关联人士支付的其他款项如下：

2021年10月1日至
2022年3月31日期间

其他运营费用 19,808

^{注2}截至2022年3月31日止期间，除向管理人支付了管理费用外，未向管理人或其关联人士支付其他款项。

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)

截至2022年3月31日止6个月期间

瑞士百达策略收益

	2021年10月1日至 2022年3月31日期间	2020年10月1日至 2021年3月31日期间
	(美元)	(美元)
期初余额	305,271,891	146,565,013
分配份额	151,834,747	83,711,175
赎回份额	<u>(51,363,757)</u>	<u>(49,970,532)</u>
份额交易净增加	100,470,990	33,740,643
归属于份额持有人的净资产(减少)/增加	<u>(23,781,345)</u>	<u>18,442,179</u>
期末余额	<u>381,961,536</u>	<u>198,747,835</u>
已发行份额数目	份额	份额
P 每月派息 美元份额		
期初已发行份额	9,233,691.9242	5,096,311.9105
已分配份额	5,826,999.1255	3,047,002.3087
已赎回份额	<u>(1,271,187.1695)</u>	<u>(1,304,619.7692)</u>
期末已发行份额	<u>13,789,503.8802</u>	<u>6,838,694.4500</u>
P 每月派息 港元份额		
期初已发行份额	81,336,356.0050	40,994,729.7329
已分配份额	33,510,989.1518	20,309,180.7194
已赎回份额	<u>(11,834,628.2538)</u>	<u>(11,617,772.6174)</u>
期末已发行份额	<u>103,012,716.9030</u>	<u>49,686,137.8349</u>
HP 每月派息 人民币份额		
期初已发行份额	22,154,763.3018	14,586,113.0906
已分配份额	9,183,596.0179	6,884,346.4134
已赎回份额	<u>(3,629,053.9621)</u>	<u>(5,258,698.6537)</u>
期末已发行份额	<u>27,709,305.3576</u>	<u>16,211,760.8503</u>
HP 每月派息 澳元份额		
期初已发行份额	6,028,093.2580	3,547,270.8738
已分配份额	2,322,898.0247	1,152,362.1746
已赎回份额	<u>(1,772,588.6520)</u>	<u>(1,338,946.0297)</u>
期末已发行份额	<u>6,578,402.6307</u>	<u>3,360,687.0187</u>

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)(续)

截至2022年3月31日止6个月期间

瑞士百达策略收益

已发行份额数目(续)	份额	份额
HM 人民币份额		
期初已发行份额	505,212.1900	134,276.7500
已分配份额	181,538.8200	522,927.9300
已赎回份额	(178,698.5700)	(345,210.9100)
期末已发行份额	508,052.4400	311,993.7700
I 每月派息 美元份额		
期初已发行份额	300,799.3387	-
已分配份额	104,056.1070	-
已赎回份额	-	-
期末已发行份额	404,855.4457	-
I 累计 美元份额		
期初已发行份额	-	-
已分配份额	177,137.6900	-
已赎回份额	(19,656.6903)	-
期末已发行份额	157,480.9997	-
HI 每月派息 新加坡元份额		
期初已发行份额	232,000.0000	-
已分配份额	76,768.9210	-
已赎回份额	-	-
期末已发行份额	308,768.9210	-
HI 累计 新加坡元份额		
期初已发行份额	130,000.0000	-
已分配份额	208,592.3640	-
已赎回份额	-	-
期末已发行份额	338,592.3640	-

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)(续)

截至2022年3月31日止6个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

2021年10月1日至
 2022年3月31日期间

	(美元)
期初余额	37,566,723
分配份额	683,085
赎回份额	<u>(4,749,923)</u>
份额交易净减少	(4,066,838)
归属于份额持有人的净资产减少	(3,617,243)
期末余额	<u>29,882,642</u>
已发行份额数目	份额
P 每月派息 美元份额	
期初已发行份额	1,202,493.1330
已分配份额	34,659.6547
已赎回份额	<u>(369,449.7006)</u>
期末已发行份额	<u>867,703.0871</u>
P 每月派息 港元份额	
期初已发行份额	1,725,018.1380
已分配份额	-
已赎回份额	<u>(753,080.7046)</u>
期末已发行份额	<u>971,937.4334</u>
HP 每月派息 人民币份额	
期初已发行份额	122,061.7790
已分配份额	-
已赎回份额	-
期末已发行份额	<u>122,061.7790</u>

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)(续)

截至2022年3月31日止6个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

已发行份额数目(续)	份额
HP 每月派息 澳元份额	
期初已发行份额	150,934.8300
已分配份额	28,938.1354
已赎回份额	(65,568.1354)
期末已发行份额	114,304.8300
I 每月派息 美元份额	
期初已发行份额	1,057,277.7470
已分配份额	18,975.2730
已赎回份额	-
期末已发行份额	1,076,253.0200
I 累计 美元份额	
期初已发行份额	887,968.6080
已分配份额	-
已赎回份额	(3,968.6080)
期末已发行份额	884,000.0000
HI 累计 新加坡元份额	
期初已发行份额	552,302.0080
已分配份额	-
已赎回份额	(1,505.2792)
期末已发行份额	550,796.7288

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

现金流量表(未经审计)

截至2022年3月31日止6个月期间

瑞士百达策略收益

	2021年10月1日至 2022年3月31日期间	2020年10月1日至 2021年3月31日期间
	(美元)	(美元)
经营活动产生的现金流量		
归属于份额持有人的净资产(减少)/增加	(23,781,345)	18,442,179
调整:		
股息收入	(1,421,147)	(796,555)
银行存款利息收益	(820)	(327)
投资利息收益	(503,099)	(268,531)
利息支出	11,440	11,270
股息收入预扣税	305,670	82,539
对份额持有人派发股息	9,259,585	4,433,147
以公允价值计量且其变动计入损益的投资及衍生金融工具净增加	(84,131,589)	(34,865,140)
应收经纪款减少	5,516,906	5,206,027
其他应收款减少/(增加)	1,103	(128,170)
保证金减少	944,580	1,320,238
应付经纪款减少	(2,706,584)	(5,751,415)
其他应付账款增加	1,715,088	228,161
已收股息(扣除已付预扣税)	1,053,913	558,971
已收银行存款利息	492	216
已收投资利息	382,353	348,548
已付利息	(11,440)	(11,270)
经营活动现金流出净额	(93,364,894)	(11,190,112)
融资活动产生的现金流量		
分配份额所得款项	154,797,415	82,152,688
赎回份额付款	(51,771,721)	(49,652,093)
已付收益分配	(9,259,585)	(4,433,147)
融资活动现金流入净额	93,766,109	28,067,448
现金及现金等价物之增加	401,215	16,877,336
期初现金及现金等价物	28,257,004	10,499,395
期末现金及现金等价物	<u>28,658,219</u>	<u>27,376,731</u>
现金及现金等价物余额分析		
银行存款	<u>28,658,219</u>	<u>27,376,731</u>

瑞士百达策略收益
瑞士百达亚洲债券收益
(百达香港之子基金)

现金流量表(未经审计)(续)

截至2022年3月31日止6个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

2021年10月1日至
2022年3月31日期间

(美元)

经营活动产生的现金流量

归属于份额持有人的净资产减少	(3,617,243)
调整:	
银行存款利息收益	(21)
投资利息收益	(667,819)
对份额持有人派发股息	592,922
以公允价值计量且其变动计入损益的投资及衍生金融工具净减少	8,908,884
应收经纪款减少	3,488,232
其他应收款减少	5,070
保证金增加	(28,545)
应付经纪款增加	696,778
应付成立费用减少	(5,070)
其他应付账款减少	(18,441)
已收银行存款利息	15
已收投资利息	822,330
经营活动现金流入净额	10,177,092

融资活动产生的现金流量

分配份额所得款项	683,085
赎回份额付款	(8,877,221)
已付收益分配	(592,922)
融资活动现金流出净额	(8,787,058)

现金及现金等价物之增加

期初现金及现金等价物	2,270,655
期末现金及现金等价物	<u>3,660,689</u>

现金及现金等价物余额分析

银行存款	<u>3,660,689</u>
------	-------------------------

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)

于2022年3月31日

瑞士百达策略收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
上市股票				
澳大利亚2.90%				
	BHP Group Ltd	45,000	1,748,775	0.46
	Commonwealth Bank of Aust	11,000	873,708	0.23
	CSL Limited	10,900	2,194,903	0.57
	Goodman Group Stapled Sec Ord Npv	69,003	1,186,109	0.31
	Rio Tinto Limited Ord Npv	14,000	1,252,239	0.33
	Santos Ltd	373,000	2,168,008	0.57
	Westpac Banking Corporation	48,000	873,745	0.23
	Woodside Petroleum Ltd Com Npv	32,000	771,376	0.20
			11,068,863	2.90
开曼群岛3.95%				
	Alibaba Group Holding Ltd Ord (每股面值 0.00003125美元)	63,400	907,518	0.24
	Alibaba Group Holding-Sp Adr (1份美国存托凭证 ("ADR")代表1份普通股)	7,080	770,304	0.20
	Bilibili Inc - Adr(1份ADR代表1份普通股)	5,480	140,178	0.04
	Chailease Holdings Co Ltd Ord(每股面值10台币)	24,306	215,052	0.06
	China Lesso Group Holdings Ltd Ord(每股面值0.05港元)	72,000	87,525	0.02
	China Resources Cement Hldg Ltd	1,378,000	1,149,008	0.30
	China Resources Land Limited(每股面值0.1港元)	72,000	335,572	0.09
	CK Asset Holdings Ltd Ord(每股面值1港元)	133,000	911,983	0.24
	JD.Com Inc Adr - Cl A Ord(每股面值0.00002美元)	4,676	139,718	0.04
	Meituan Dianping Ord(每股面值0.00001港元)	98,700	1,961,044	0.50
	Netease.Com Inc Adr(1份ADR代表25份普通股)	7,190	644,871	0.17
	Sea Ltd - Adr(1份ADR代表1份普通股)	840	100,624	0.03
	Shenzhou International Group Ord(每股面值0.1港元)	88,800	1,188,324	0.31
	Silergy Corp Ord Npv	26,000	3,112,577	0.81
	Sunny Optical Technology Group Co Ltd Ord(每股面值 0.1港元)	30,200	486,276	0.13
	Tencent Hldgs Ltd(每股面值0.0002港元)	52,300	2,498,999	0.65
	Xpeng Inc - Class A Shares Ord(每股面值0.00001美元)	31,700	455,378	0.12
			15,104,951	3.95

瑞士百达策略收益
瑞士百达亚洲债券收益
(百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达策略收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
上市股票(续)				
中国1.54%				
	安徽海螺水泥股份有限公司-H股(每股面值1港元)	168,000	864,520	0.23
	中国建设银行H股普通股(每股面值1人民币)	765,000	575,357	0.15
	中国招商银行H股普通股(每股面值1人民币)	126,000	990,283	0.26
	中国石油化工股份有限公司-H股普通股(每股面值1人民币)	694,000	348,267	0.09
	中国旅游集团中免股份有限公司Cc普通股(每股面值1人民币)	2,600	67,321	0.02
	宁德时代新能源科技股份有限公司深港通普通股(每股面值1人民币)	13,500	1,089,468	0.29
	恒生电子股份有限公司CC普通股(每股面值1人民币)	12,800	89,647	0.02
	江苏恒瑞医药股份有限公司CC普通股(每股面值1人民币)	82,900	480,833	0.13
	江苏洋河酒厂股份有限公司-A股普通股(每股面值1人民币)(深港通)	5,900	126,056	0.03
	贵州茅台酒股份有限公司CC普通股(每股面值1人民币)	600	162,474	0.04
	美的集团股份有限公司深港通普通股(每股面值1人民币)	16,900	151,746	0.04
	明阳智慧能源集团股份有限公司-A股CC	36,900	128,869	0.03
	康龙化成(北京)新药技术有限公司-H股普通股(每股面值1人民币)	8,800	107,255	0.03
	平安银行股份有限公司深港通普通股(每股面值1人民币)	88,500	214,415	0.06
	深圳迈瑞生物医疗电子股份有限公司深港通普通股(每股面值1人民币)	6,900	333,962	0.09
	阳光电源股份有限公司-A股普通股(每股面值1人民币)(深港通)	7,300	123,344	0.03
			5,853,817	1.54
英属格恩西岛0.67%				
	Tufton Oceanic Assets Ltd Ord Npv	1,880,859	2,548,564	0.67
			2,548,564	0.67
香港1.39%				
	友邦保险控股有限公司	175,800	1,850,845	0.48
	国泰航空有限公司	1,320,000	1,299,538	0.34
	中国海外发展有限公司	338,000	1,012,092	0.26
	香港交易及结算所有限公司普通股(每股面值1港元)	6,600	313,001	0.08
	新世界发展有限公司Ord Npv	85,000	345,692	0.09
	新鸿基地产发展有限公司	45,000	537,835	0.14
			5,359,003	1.39
印尼0.05%				
	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk Ord(每股面值50印尼盾)	554,910	180,044	0.05
			180,044	0.05
日本3.15%				
	Hoya Corporation	6,400	739,790	0.19
	Lasertec Corp Ord Npv	6,100	1,044,601	0.28

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达策略收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
上市股票(续)				
日本3.15%(续)				
	Shin-Etsu Chemical Company Limited Com Npv	18,300	2,833,013	0.74
	Sumco Corporation	169,000	2,822,352	0.74
	Tokyo Electron Ltd Ord Npv	8,800	4,585,788	1.20
			12,025,544	3.15
韩国0.65%				
	Hyundai Mobis	619	109,802	0.03
	KB Financial Group Inc Ord(每股面值5,000韩元)	2,773	140,246	0.04
	Posco Holdings Inc Ord(每股面值5,000韩元)	439	106,123	0.03
	Samsung Electronics Co Ltd Ord(每股面值100韩元)	33,215	1,907,317	0.49
	Samsung Electronics Company Limited Preference Shares(每股面值100韩元)	1,848	96,055	0.03
	SK Telecom Company Limited	2,324	109,101	0.03
			2,468,644	0.65
荷兰1.22%				
	ASML Holding Nv - Ny Reg Shs(每股面值0.09欧元)(1份ADR 代表1份普通股)	7,000	4,675,510	1.22
			4,675,510	1.22
新西兰0.46%				
	Auckland International Airport	320,000	1,742,770	0.46
			1,742,770	0.46
新加坡0.04%				
	United Overseas Bank Ltd	6,300	149,057	0.04
			149,057	0.04
台湾3.22%				
	联发科技股份有限公司	38,000	1,200,286	0.31
	台积电	518,000	10,793,362	2.83
	联华电子股份有限公司普通股(每股面值10台币)	65,000	122,507	0.03
	纬颖科技服务股份有限公司普通股(每股面值10台币)	4,949	176,186	0.05
			12,292,341	3.22

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达策略收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
上市股票(续)				
美国29.24%				
	Adobe Inc Com(每股面值0.0001美元)	8,100	3,690,522	0.97
	Advanced Micro Devices Inc	42,800	4,679,752	1.23
	Alphabet Inc-C1 A Com(每股面值0.001美元)	3,630	10,096,300	2.64
	Amazon Com Inc Com(每股面值0.01美元)	2,200	7,171,890	1.88
	Apple Inc Com Npv	36,980	6,457,078	1.69
	Applied Materials Inc Com(每股面值0.01美元)	22,200	2,925,960	0.77
	Avalonbay Communities Inc	12,300	3,054,951	0.80
	Boeing Co(1987年8月7日至1997年8月7日期间享有优先股购 买权)	4,200	804,300	0.21
	Boston Properties Incorporation	12,300	1,584,240	0.42
	Chevron Corp Com(每股面值0.75美元)	28,000	4,559,240	1.19
	Coca-Cola Co/The Com(每股面值0.25美元)	22,884	1,418,808	0.37
	Costco Wholesale Corporation	1,280	737,088	0.19
	D. R. Horton Inc	25,200	1,877,652	0.50
	Danaher Corporation	3,560	1,044,255	0.27
	Deere And Co	3,780	1,570,439	0.41
	Disney (Walt) Productions Del Com	16,100	2,208,276	0.58
	Edwards Lifesciences Corp Ord(每股面值1美元)	16,600	1,954,152	0.51
	Equinix Inc Reit Com(每股面值0.001美元)	600	444,972	0.11
	Extra Space Storage Inc Reit(每股面值0.01美元)	17,600	3,618,560	0.95
	Exxon Mobil Corporation	45,000	3,716,550	0.97
	Generac Holdings Inc Com(每股面值0.01美元)	3,800	1,129,588	0.30
	Home Depot Inc Com(每股面值0.05美元)	2,800	838,124	0.22
	Illumina Inc Com(每股面值0.01美元)	1,350	471,690	0.12
	JPMorgan Chase And Co Com(每股面值1美元)	16,300	2,222,016	0.58
	KLA Corp Com(每股面值0.001美元)	5,400	1,976,724	0.52
	Lam Research Corporation	2,660	1,430,043	0.37
	Lennar Corporation Class A	12,412	1,007,482	0.26
	Lockheed Martin Corporation	950	419,330	0.11
	Mastercard Incorporated A Shrs Com(每股面值0.0001美 元)	10,200	3,645,276	0.95
	Micron Technology	10,300	802,267	0.21
	Microsoft Corp	22,583	6,962,565	1.82

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达策略收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
上市股票(续)				
美国29.24%(续)				
	Mid-America Apartment Communities Inc(每股面值0.01美元)	7,800	1,633,710	0.43
	Morgan Stanley Com(每股面值0.01美元)	33,600	2,936,640	0.77
	Nextera Energy Inc Com(每股面值0.01美元)	14,480	1,226,601	0.32
	Nvidia Corporation	17,890	4,881,465	1.28
	Palo Alto Networks Inc Com(每股面值0.0001美元)	4,300	2,676,793	0.70
	Prologis Inc Reit(每股面值0.01美元)	15,200	2,454,496	0.64
	Public Storage Inc	5,000	1,951,400	0.51
	Raytheon Technologies Corporation	4,200	416,094	0.11
	Regency Centers Corporation	9,000	642,060	0.17
	Salesforce.Com Inc	11,160	2,369,491	0.62
	Simon Property Group Inc	4,100	539,396	0.14
	Uber Technologies Inc Com(每股面值0.00001美元)	23,000	820,640	0.21
	Visa Inc Com Cl A	8,900	1,973,753	0.52
	Wells Fargo & Co Com(每股面值1.666美元)	30,700	1,487,722	0.39
	Welltower Inc Reit(每股面值1美元)	12,300	1,182,522	0.31
			111,712,873	29.24

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达策略收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
固定收益				
澳大利亚3.02%				
	Australia (Govt of) 5.5% 21/04/2023	1,850,000	1,454,007	0.38
	Australian Government Ser 136 (Reg S) 4.75% 21/04/2027	12,200,000	10,093,026	2.64
			11,547,033	3.02
开曼群岛0.50%				
	Powerlong Real Estate (Reg) (Reg S) 3.9% 13/04/2022	2,000,000	1,900,000	0.50
			1,900,000	0.50
日本9.20%				
	Japan (Govt of) Ser 25 0.2% 10/03/2030	2,692,000,000	24,052,364	6.30
	Japan Govt Cpi Linked Ser 21 0.1% 10/03/2026	1,255,000,000	11,063,755	2.90
			35,116,119	9.20
美国15.16%				
	TSY Infl Ix N/B 0.25% 15/02/2050	1,500,000	1,733,671	0.45
	美国国库 0.125% 15/02/2051	6,000,000	6,684,507	1.75
	美国国库 0.125% 15/01/2032	5,500,000	5,945,656	1.56
	美国国库 0.125% 15/10/2026	5,500,000	5,785,260	1.51
	美国国库 1.25% 31/12/2026	21,200,000	20,034,000	5.25
	美国国库 1.625% 15/05/2031	9,000,000	8,475,467	2.22
	美国国库 2.25% 15/02/2052	4,100,000	3,934,399	1.03
	美国国库证券 4.75% 15/02/2041	4,000,000	5,325,624	1.39
			57,918,584	15.16

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达策略收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
上市/报价投资基金				
英属格恩西岛0.08%				
	Sequoia Economic Infrastructure Inc Fd Ltd Ord Npv	238,276	322,511	0.08
			322,511	0.08
爱尔兰11.85%				
	贝莱德资产管理爱尔兰有限公司 - Ishares Gold Producers UCITS ETFokL@	161,000	2,660,525	0.69
	景顺实物黄金 Etc ETF	162,100	30,468,316	7.98
	Lantern Structured Asset Management Ltd-Ubs (Irl) Fund Solutions Plc ETF	113,610	12,147,181	3.18
			45,276,022	11.85
卢森堡4.23%				
	百达一人民币债券	55,600	6,552,124	1.72
	百达一新兴市场多元资产- Z 美元	18,400	1,664,832	0.44
	百达一全球环境机会-Z 美元	5,139	2,130,064	0.56
	信实环球资产管理有限公司-信实环球基金 - RWC Asia Convertible	46,600	5,785,755	1.51
			16,132,775	4.23

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达策略收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
期货合约				
日本0.04%				
	日经225指数(大阪证券交易所) 09/06/2022	12	27,683	0.01
	东京证交所TOPIX银行指数 09/06/2022	285	(188,787)	(0.05)
			(161,104)	(0.04)
英国0.02%				
	富时100指数期货 17/06/2022	15	74,851	0.02
			74,851	0.02
美国0.03%				
	CBOE波动率指数期货 20/04/2022	44	(105,864)	(0.03)
			(105,864)	(0.03)
远期外汇合约0.13%				
	买澳元沽美元 29/04/2022		179,659	0.05
	买离岸人民币沽美元 29/04/2022		259,001	0.07
	买新加坡元沽美元 29/04/2022		13,767	-
	买美元沽澳元 29/04/2022		(67,358)	(0.03)
	买美元沽离岸人民币 29/04/2022		(55,062)	(0.01)
	买美元沽欧元 29/04/2022		(9,894)	-
	买美元沽港元 29/04/2022		14,813	-
	买美元沽日元 28/04/2022		176,624	0.05
			511,550	0.13
			185,181,981	
			106,481,736	
			61,731,308	
			(192,117)	
			511,550	
			353,714,458	
			345,189,578	

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达亚洲债券收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
固定收益				
百慕大0.96%	Li & Fung Ltd Ser Emtn (Reg) (Reg S) 4.5% 18/08/2025	300,000	287,667	0.96
			287,667	0.96
英属维尔京群岛12.38%	CCTHK 2021 Ltd Ser Emtn (Reg) (Reg S) 2% 19/01/2025	200,000	191,140	0.64
	China Cinda 2020 I Mngmn Ser Emtn (Reg) (Reg S) 3.25% 28/01/2027	200,000	194,632	0.65
	China Railway Xunjie (Reg) (Reg S) 3.25% 28/07/2026	300,000	295,799	0.99
	Chinalco Capital Holding (Reg S) 2.125% 03/06/2026	400,000	374,366	1.25
	Chinalco Capital Holding (Reg) (Reg S) 2.95% 24/02/2027	200,000	192,681	0.64
	Greenland Glb Invst Ser Emtn (Reg) (Reg S) 6.75% 26/09/2023	200,000	136,650	0.46
	GZ Mtr Fin Bvi Ser Emtn (Reg) (Reg S) 2.31% 17/09/2030	200,000	174,531	0.58
	Huarong Finance 2019 Ser Emtn (Reg S) 3.375% 24/02/2030	400,000	349,500	1.17
	Huarong Finance Ii Co Ltd (Reg) (Reg S) 4.625% 03/06/2026	200,000	195,750	0.66
	Huarong Finance Ii Ser Emtn (Reg) (Regs) 5.5% 16/01/2025	200,000	202,750	0.68
	Joy Trsr Assets Hld (Reg) (Reg S) 2.75% 17/11/2030	500,000	437,068	1.46
	LS Finance 2017 Ltd (Reg) (Reg S) 4.8% 18/06/2026	200,000	176,340	0.59
	New Metro Global Ltd (Reg) (Reg S) 4.8% 15/12/2024	200,000	142,199	0.48
	RKPF Overseas 2019 A Ltd (Reg) (Reg S) 5.9% 05/03/2025	200,000	159,050	0.53
	Shanghai ELC Group Glb Inv (Reg) (Reg S) 2.3% 21/02/2025	500,000	478,125	1.60
			3,700,581	12.38

瑞士百达策略收益
瑞士百达亚洲债券收益
(百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达亚洲债券收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产百分比
固定收益 (续)				
开曼群岛13.04%				
	Alibaba Group Holding (Reg) 2.8% 06/06/2023	300,000	299,007	1.00
	Baidu Inc (Reg) 2.375% 23/08/2031	300,000	262,488	0.88
	CCBL Cayman 1 Corp Ser Emtn (Reg) (Reg S) 2.55% 28/09/2030	800,000	709,888	2.37
	CH OVS Grand Oce Finance (Reg) (Reg S) 2.45% 09/02/2026	400,000	365,188	1.22
	China SCE Grp Hldgs Ltd (Reg) (Reg S) 5.95% 29/09/2024	300,000	166,125	0.56
	Cifi Holdings Group (Reg) (Reg S) 5.5% 23/01/2023	200,000	187,500	0.63
	Cifi Holdings Group (Reg) (Reg S) 6.55% 28/03/2024	200,000	178,500	0.60
	Country Garden Hldgs 5.625% 15/12/2026	500,000	370,000	1.24
	JD.com Inc 4.125% 14/01/2020	200,000	173,025	0.58
	Melco Resorts Finance 4.875% 06/06/2025	200,000	183,502	0.61
	Mgm China Holdings Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.375% 15/05/2024	200,000	187,823	0.63
	Powerlong Real Estate (Reg) (Reg S) 5.95% 30/04/2025	200,000	73,000	0.24
	Tencent Holdings Ltd Ser (Reg S) 3.24% 03/06/2050	200,000	155,689	0.52
	Tencent Holdings Ltd Ser Regs (Reg) (Regs) 3.595% 19/01/2028	400,000	390,685	1.31
	Weibo Corp (Reg) 3.5% 05/07/2024	200,000	195,396	0.65
			3,897,816	13.04
香港6.49%				
	远东宏信有限公司SER欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.625% 03/03/2024	300,000	280,158	0.94
	金地永隆SER欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 4.95% 12/08/2024	200,000	184,480	0.62
	Lai Sun Mtn Ltd (Reg) (Reg S) 5% 28/07/2026	200,000	191,650	0.64
	万科地产(香港)有限公司SER欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 3.975% 09/11/2027	200,000	188,702	0.63
	万科地产(香港)有限公司SER欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 5.35% 11/03/2024	200,000	202,125	0.68
	卓裕控股有限公司SER欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.8% 20/01/2026	500,000	459,500	1.53
	Xiaomi Best Time Intl Ser (Reg) (Reg S) 2.875% 14/07/2031	500,000	432,070	1.45
			1,938,685	6.49

瑞士百达策略收益
瑞士百达亚洲债券收益
(百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达亚洲债券收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产百分比
固定收益 (续)				
印度6.47%				
	Adani Green Energy Ltd Ser (Reg) (Reg S) 4.375% 08/09/2024	200,000	196,250	0.66
	Adani Ports and Special Ser Reg (Reg S) 4% 30/07/2027	200,000	194,232	0.65
	GMR Hyderabad Intl Ser (Reg S) 5.375% 10/04/2024	400,000	403,970	1.35
	REC Limited Ser Gmtn (Reg) (Reg S) 2.25% 01/09/2026	200,000	184,935	0.62
	REC Limited Ser Gmtn (Reg) (Reg S) 3.375% 25/07/2024	200,000	197,799	0.66
	Reliance Industries Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.625% 12/01/2052	400,000	354,743	1.19
	Shriram Transport Fin Ser (Reg S) 5.1% 16/07/2023	400,000	401,078	1.34
			<u>1,933,007</u>	<u>6.47</u>
印尼3.92%				
	Bank Mandiri PT Ser Emtn (Reg) (Reg S) 3.75% 11/04/2024	200,000	200,999	0.67
	Indonesia Asahan Alumini Ser (Reg S) 5.45% 15/05/2030	200,000	209,109	0.71
	Indonesia Asahan Alumini Ser Regs (Reg S) 4.75% 15/05/2025	200,000	204,050	0.68
	PT Bank Tabungan Negara (Reg) (Reg S) 4.2% 23/01/2025	200,000	194,650	0.65
	PT Pertamina (Persero) Ser Regs (Reg S) 4.175% 21/01/2050	200,000	184,797	0.62
	PT Pertamina (Persero) Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.3% 09/02/2031	200,000	177,329	0.59
			<u>1,170,934</u>	<u>3.92</u>
马恩岛1.60%				
	GOHL Capital Ltd 4.25% 24/01/2027	500,000	477,330	1.60
			<u>477,330</u>	<u>1.60</u>

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达亚洲债券收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
固定收益 (续)				
韩国0.60%				
	Kookmin Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.5% 04/11/2030	200,000	179,071	0.60
			<u>179,071</u>	<u>0.60</u>
马来西亚1.93%				
	Axiata Spv5 Labuan Ltd Ser Emtn (Reg S) 3.064% 19/08/2050	200,000	172,626	0.58
	Misc Capital Two Labuan Ser Regs (Reg S) 3.625% 06/04/2025	200,000	199,480	0.67
	Petronas Capital Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.5% 21/04/2030	200,000	203,900	0.68
			<u>576,006</u>	<u>1.93</u>
毛里求斯2.87%				
	Greenko Solar Mauritius Ser (Reg) (Reg S) 5.95% 29/07/2026	200,000	203,000	0.68
	Greenko Solar Mauritius Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.55% 29/01/2024	200,000	202,000	0.68
	Greenko Wind Projects Mu Ser Regs (Reg S) 5.5% 06/04/2025	200,000	199,900	0.67
	India Green Energy Hldng Ser Regs (Reg S) 5.375% 29/04/2024	250,000	251,863	0.84
			<u>856,763</u>	<u>2.87</u>
新加坡4.05%				
	Abja Invest Co (Regs) (Reg) 5.95% 31/07/2024	400,000	419,308	1.39
	Global Prime Capital (Reg S) 5.95% 23/01/2025	400,000	387,500	1.30
	Medco Oak Tree Pte Ltd Ser (Reg) (Reg S) 7.375% 14/05/2026	200,000	202,184	0.68
	Theta Capital Pte. Ltd (Reg S) 8.125% 22/01/2025	200,000	202,310	0.68
			<u>1,211,302</u>	<u>4.05</u>

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达亚洲债券收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
固定收益 (续)				
泰国1.86%				
	GC Treasury Centre Co Ser Regs (Reg S) 4.4% 30/03/2032	400,000	406,564	1.36
	Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg S) 3.5% 17/10/2049	200,000	149,757	0.50
			<u>556,321</u>	<u>1.86</u>
英国0.67%				
	State Grid Europe Develo (Reg) (Reg S) 3.25% 07/04/2027	200,000	199,202	0.67
			<u>199,202</u>	<u>0.67</u>
美国1.30%				
	Periama Holdings LLC/De (Reg) (Reg S) 5.95% 19/04/2026	200,000	204,154	0.68
	SK Battery America Inc (Reg) (Reg S) 2.125% 26/01/2026	200,000	184,839	0.62
			<u>388,993</u>	<u>1.30</u>

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达亚洲债券收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
浮动收益				
英属维尔京群岛 3.93%				
	Bluestar Fin Holdings (Reg) (Reg S) Var Perpetual 31/12/2049	600,000	589,238	1.97
	China Huaneng Gp HK Treasury (Reg) (Reg S) Var Perpetual 31/12/2049	400,000	391,560	1.31
	Elect Global Investments Ltd (Reg) (Reg S) Var Perpetual 31/12/2049	200,000	193,000	0.65
			1,173,798	3.93
中国5.15%				
	国银金融租赁股份有限公司 (Reg) (Reg S) VAR 28/09/2030	700,000	677,918	2.26
	中国信达资产管理 Ser (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	200,000	187,135	0.63
	中国建设银行 (Reg) (Reg S) VAR 24/06/2030	700,000	674,790	2.26
			1,539,843	5.15
香港7.06%				
	友邦保险控股有限公司SER欧洲中期债券(Reg) (Reg S) VAR永续债31/12/2049	400,000	373,893	1.25
	香港机场管理局 (Reg) (Reg S) VAR永续债 31/12/2049	300,000	275,504	0.92
	中国银行(香港)有限公司 Ser Regs (Reg) VAR 永续债29/12/2049	600,000	620,947	2.08
	交通银行(香港)有限公司 (Reg) (Reg S) VAR 08/07/2031	250,000	234,445	0.78
	中信银行(国际)有限公司SER欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) VAR 28/02/2029	600,000	606,333	2.03
			2,111,122	7.06
印尼0.61%				
	Bank Negara Indonesia (Reg S) Var Perpetual 31/12/2049	200,000	182,841	0.61
			182,841	0.61

瑞士百达策略收益
瑞士百达亚洲债券收益
(百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达亚洲债券收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
浮动收益(续)				
韩国4.59%				
	Hanwha Life Insurance Ser (Reg) (Reg S) 23/04/2048	200,000	202,634	0.68
	Hanwha Life Insurance Ser (Reg) (Reg S) 23/04/2048	400,000	399,194	1.34
	Kookmin Bank Ser Regs (Reg) (Reg_S) Var Perpetual 31/12/2049	200,000	200,498	0.67
	Shinhan Financial Group (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	200,000	204,300	0.68
	Shinhan Financial Group Ser (Reg) (Reg S) Var 31/12/2049	200,000	365,780	1.22
			1,372,406	4.59
毛里求斯1.33%				
	Network i2i Ltd Ser (Reg) (Reg S) Var Perpetual 31/12/2049	400,000	396,982	1.33
			396,982	1.33
菲律宾3.25%				
	Petron Corp (Reg) (Reg S) Var Perp 29/12/2049	200,000	193,625	0.65
	Rizal Commercial Banking (Reg) (Reg S) Var Perpetual 31/12/2049	200,000	190,098	0.64
	San Miguel Corp Ser Emtn (Reg) (Reg S) Var Perpetual 31/12/2049	200,000	196,310	0.66
	SMC Global Power Hldgs (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	200,000	195,450	0.65
	SMC Global Power Holdings (Reg S) Var Perpetual 31/12/2049	200,000	195,000	0.65
			970,483	3.25
新加坡3.62%				
	DBS Group Holdings Ltd Ser Gmtn (Reg) (Reg S) Var Perpetual 31/12/2049	400,000	389,482	1.30
	Jollibee Worldwide Pte Ltd (Reg S) Var Perpetual 31/12/2049	200,000	193,780	0.65
	United Overseas Bank Ltd Ser Emtn (Reg) (Reg S) Var Perpetual 31/12/2049	500,000	497,050	1.67
			1,080,312	3.62
泰国1.91%				
	Kasikornbank PCL HK Ser Emtn (Reg) (Reg S) Var 02/10/2031	200,000	188,184	0.63
	Muang Thai Life Assuranc (Reg) (Reg S) Var 27/01/2037	200,000	189,156	0.63
	TMB Thanachart Bank Var Perpetual 31/12/2049	200,000	192,232	0.65
			569,572	1.91

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

投资组合持有变动表(未经审计)

截至 2022 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

	于2022年3月31日 占净资产百分比	于2021年9月30日 占净资产百分比
上市股票		
澳大利亚	2.90	0.42
百慕大	-	0.08
开曼群岛	3.95	7.22
中国	1.54	1.86
英属格恩西岛	0.67	0.86
香港	1.39	0.55
印度尼西亚	0.05	0.05
日本	3.15	4.42
韩国	0.65	0.52
马来西亚	-	0.04
荷兰	1.22	0.94
新西兰	0.46	-
新加坡	0.04	0.04
台湾	3.22	2.48
美国	29.24	37.60
	<u>48.48</u>	<u>57.08</u>
固定收益		
澳大利亚	3.02	0.93
英属维尔京群岛	-	0.33
开曼群岛	0.50	4.05
意大利	-	1.85
日本	9.20	3.86
美国	15.16	3.98
	<u>27.88</u>	<u>15.00</u>
上市/报价投资基金		
英属格恩西岛	0.08	0.11
爱尔兰	11.85	7.48
卢森堡	4.23	8.39
	<u>16.16</u>	<u>15.98</u>
期货合约		
日本	(0.04)	(0.02)
英国	0.02	-
美国	(0.03)	0.11
	<u>(0.05)</u>	<u>0.09</u>
远期外汇合约		
	0.13	0.16
	<u>0.13</u>	<u>0.16</u>
组合投资合计	<u>92.60</u>	<u>88.31</u>

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

投资组合持有变动表(未经审计)

截至 2022 年 3 月 31 日止 6 个月

瑞士百达亚洲债券收益

	于2022年3月31日 占净资产百分比	于2021年9月30日 占净资产百分比
固定收益		
百慕大	0.96	1.97
英属维尔京群岛	12.38	11.49
开曼群岛	13.04	24.14
香港	6.49	7.12
印度	6.47	5.40
印度尼西亚	3.92	1.27
马恩岛	1.60	0.84
泽西岛	-	1.30
韩国	0.60	-
马来西亚	1.93	-
毛里求斯	2.87	1.78
菲律宾	-	0.49
新加坡	4.05	3.64
泰国	1.86	0.48
英国	0.67	1.05
美国	1.30	1.64
	<u>58.14</u>	<u>62.61</u>
浮动收益		
英属维尔京群岛	3.93	4.59
开曼群岛	-	0.81
中国	5.15	5.42
香港	7.06	9.37
印度尼西亚	0.61	0.53
韩国	4.59	3.82
毛里求斯	1.33	1.14
菲律宾	3.25	1.67
新加坡	3.62	3.55
泰国	1.91	1.63
	<u>31.45</u>	<u>32.53</u>
期货合约		
美国	0.02	(0.04)
	<u>0.02</u>	<u>(0.04)</u>
远期外汇合约		
	0.05	(0.07)
	<u>0.05</u>	<u>(0.07)</u>
组合投资合计	<u>89.66</u>	<u>95.03</u>

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

衍生金融工具详情(未经审计)

于 2022 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

远期外汇合约

于2022年3月31日，子基金持有的远期外汇合约详情如下：

于2022年3月31日

交割合约	折算额	结算日期	交易对手	公允价值 (美元)
金融资产：				
港元138,200,000	美元17,665,956	2022年4月29日	香港上海汇丰银行有限公司	14,813
日元5,530,000,000	美元45,760,671	2022年4月28日	香港上海汇丰银行有限公司	176,624
美元46,231,335	澳元61,783,296	2022年4月29日	香港上海汇丰银行有限公司	179,659
美元48,455,980	离岸人民币309,794,297	2022年4月29日	香港上海汇丰银行有限公司	259,001
美元4,530,556	新加坡元6,150,805	2022年4月29日	香港上海汇丰银行有限公司	13,767
				<hr/>
				643,864
金融负债：				
澳元22,814,956	美元17,071,009	2022年4月29日	香港上海汇丰银行有限公司	(67,358)
离岸人民币57,854,717	美元9,042,561	2022年4月29日	香港上海汇丰银行有限公司	(55,062)
欧元860,000	美元947,748	2022年4月29日	香港上海汇丰银行有限公司	(9,894)
				<hr/>
				(132,314)

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

衍生金融工具详情(未经审计)(续)

于 2022 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

期货合约

于2022年3月31日，子基金持有的期货合约详情如下：

于2022年3月31日

说明	相关资产	合约规模	名义市值 (美元)	持仓量	交易对手	公允价值 (美元)
金融资产：						
富时100指数期货 17/06/2022	富时100指数	10	1,403,615	15	瑞银期货 有限责任公司	74,851
日经225指数(大阪证券交易 所) 09/06/2022	日经225指数	1000	2,723,790	12	瑞银期货 有限责任公司	27,683
						102,534
金融负债：						
CBOE波动率指数期货 20/04/2022	CBOX波动率指数	1000	1,138,500	44	瑞银期货 有限责任公司	(105,864)
东京证交所TOPIX银行指数 09/06/2022	东京证交所TOPIX 银行指数	10000	3,915,213	285	瑞银期货 有限责任公司	(188,787)
						(294,651)

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

衍生金融工具详情(未经审计)(续)

于 2022 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

远期外汇合约

于2022年3月31日，子基金持有的远期外汇合约详情如下：

于2022年3月31日

交割合约	折算额	结算日期	交易对手	公允价值 (美元)
金融资产：				
美元 702,196	澳元 938,412	2022 年 4 月 29 日	香港上海汇丰银行有限公司	2,730
美元 162,320	离岸人民币 1,037,764	2022 年 4 月 29 日	香港上海汇丰银行有限公司	868
美元 3,592,615	新加坡元 4,877,431	2022 年 4 月 29 日	香港上海汇丰银行有限公司	10,917
				14,515

期货合约

于2022年3月31日，子基金持有的期货合约详情如下：

于2022年3月31日

说明	相关资产	合约规模	名义市值 (美元)	持仓量	交易对手	公允价值 (美元)
金融资产：						
US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	美国国库票据	1,000	(234,453)	(2)	J. P. Morgan Securities Ltd	5,078
						5,078
金融负债：						
NOTE (CBT) 21/06/2022	美国国库票据	1,000	(368,063)	(3)	J. P. Morgan Securities Ltd	(563)
						(563)

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

分配披露(未经审计)

截至 2022 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

P 每月派息 美元

记录日	除息日	派息日	每份额派息额 (美元)	有权收取派息之份 额	总派息额 (美元)	总派息额 (美元)
2021年10月19日	2021年10月20日	2021年10月26日	0.045	9,409,486.1505	423,426.87	423,426.87
2021年11月19日	2021年11月22日	2021年11月26日	0.045	11,019,646.5204	495,884.09	495,884.09
2021年12月17日	2021年12月20日	2021年12月24日	0.045	12,221,695.9341	549,976.32	549,976.32
2022年1月19日	2022年1月20日	2022年1月26日	0.045	13,488,963.5809	607,003.38	607,003.38
2022年2月18日	2022年2月21日	2022年2月25日	0.045	13,897,689.1087	625,396.02	625,396.02
2022年3月18日	2022年3月21日	2022年3月25日	0.045	13,804,379.1209	621,197.07	621,197.07

P 每月派息 港元

记录日	除息日	派息日	每份额派息额 (港元)	有权收取派息之份 额	总派息额 (港元)	总派息额 (美元)
2021年10月19日	2021年10月20日	2021年10月26日	0.045	82,972,668.4476	3,733,770.08	480,227.66
2021年11月19日	2021年11月22日	2021年11月26日	0.045	88,846,478.7403	3,998,091.54	513,316.20
2021年12月17日	2021年12月20日	2021年12月24日	0.045	91,792,175.7690	4,130,647.92	529,329.33
2022年1月19日	2022年1月20日	2022年1月26日	0.045	100,071,566.5351	4,503,220.50	578,444.65
2022年2月18日	2022年2月21日	2022年2月25日	0.045	103,330,892.4835	4,649,890.18	596,166.52
2022年3月18日	2022年3月21日	2022年3月25日	0.045	103,051,222.5333	4,637,305.01	592,660.92

HP 每月派息 人民币

记录日	除息日	派息日	每份额派息额 (人民币)	有权收取派息之份 额	总派息额 (人民币)	总派息额 (美元)
2021年10月19日	2021年10月20日	2021年10月26日	0.05	22,961,597.3931	1,148,079.86	179,637.29
2021年11月19日	2021年11月22日	2021年11月26日	0.05	22,620,590.3910	1,131,029.51	177,142.69
2021年12月17日	2021年12月20日	2021年12月24日	0.05	23,061,787.4540	1,153,089.38	180,580.75
2022年1月19日	2022年1月20日	2022年1月26日	0.05	27,314,701.1290	1,365,735.06	215,308.65
2022年2月18日	2022年2月21日	2022年2月25日	0.05	27,802,417.3734	1,390,120.87	219,837.57
2022年3月18日	2022年3月21日	2022年3月25日	0.05	27,781,731.8863	1,389,086.60	218,181.71

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

分配披露(未经审计)

截至 2022 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

HP 每月派息 澳元

记录日	除息日	派息日	每份额派息额 (澳元)	有权收取派息 之份额	总派息额 (澳元)	总派息额 (美元)
2021年10月19日	2021年10月20日	2021年10月26日	0.05	6,151,072.4783	307,553.61	230,988.14
2021年11月19日	2021年11月22日	2021年11月26日	0.05	5,018,335.9733	250,916.79	181,864.49
2021年12月17日	2021年12月20日	2021年12月24日	0.05	5,253,586.8072	262,679.34	186,699.34
2022年1月19日	2022年1月20日	2022年1月27日	0.05	6,061,613.4102	303,080.68	220,415.42
2022年2月18日	2022年2月21日	2022年2月25日	0.05	6,464,016.1730	323,200.80	231,961.21
2022年3月18日	2022年3月21日	2022年3月25日	0.05	6,460,621.0101	323,031.05	239,640.58

I 每月派息 美元

记录日	除息日	派息日	每份额派息额 (美元)	有权收取派息 之份额	总派息额 (美元)	总派息额 (美元)
2021年10月19日	2021年10月20日	2021年10月26日	0.045	404,855.4457	18,218.50	18,218.50
2021年11月19日	2021年11月22日	2021年11月26日	0.045	404,855.4457	18,218.50	18,218.50
2021年12月17日	2021年12月20日	2021年12月24日	0.045	404,855.4457	18,218.50	18,218.50
2022年1月19日	2022年1月20日	2022年1月26日	0.045	404,855.4457	18,218.50	18,218.50
2022年2月18日	2022年2月21日	2022年2月25日	0.045	404,855.4457	18,218.50	18,218.50
2022年3月18日	2022年3月21日	2022年3月25日	0.045	404,855.4457	18,218.50	18,218.50

HI 每月派息 新加坡元

记录日	除息日	派息日	每份额派息额 (新加坡元)	有权收取派息 之份额	总派息额 (新加坡元)	总派息额 (美元)
2021年10月19日	2021年10月20日	2021年10月26日	0.045	241,983.4270	10,889.25	8,106.64
2021年11月19日	2021年11月22日	2021年11月26日	0.045	241,983.4270	10,889.25	7,991.82
2021年12月17日	2021年12月20日	2021年12月24日	0.045	241,983.4270	10,889.25	7,964.34
2022年1月19日	2022年1月20日	2022年1月26日	0.045	308,768.9210	13,894.6	10,341.32
2022年2月18日	2022年2月21日	2022年2月25日	0.045	308,768.9210	13,894.6	10,329.02
2022年3月18日	2022年3月21日	2022年3月25日	0.045	308,768.9210	13,894.6	10,253.94

瑞士百达策略收益
瑞士百达亚洲债券收益
(百达香港之子基金)

分配披露(未经审计)(续)

截至 2022 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

P 每月派息 美元

记录日	除息日	派息日	每份额派息额 (美元)	有权收取派息 之份额	总派息额 (美元)	总派息额 (美元)
2021年10月19日	2021年10月20日	2021年10月26日	0.042	1,192,632.2810	50,090.55	50,090.55
2021年11月19日	2021年11月22日	2021年11月26日	0.042	1,152,598.6530	48,409.14	48,409.14
2021年12月17日	2021年12月20日	2021年12月24日	0.042	1,147,648.6530	48,201.24	48,201.24
2022年1月19日	2022年1月20日	2022年1月26日	0.042	887,453.0871	37,273.03	37,273.03
2022年2月18日	2022年2月21日	2022年2月25日	0.042	867,703.0871	36,443.53	36,443.53
2022年3月18日	2022年3月21日	2022年3月25日	0.042	867,703.0871	36,443.53	36,443.53

P 每月派息 港元

记录日	除息日	派息日	每份额派息额 (港元)	有权收取派息 之份额	总派息额 (港元)	总派息额 (美元)
2021年10月19日	2021年10月20日	2021年10月26日	0.042	1,577,190.6380	66,242.04	8,519.87
2021年11月19日	2021年11月22日	2021年11月26日	0.042	1,001,813.7394	42,076.18	5,402.17
2021年12月17日	2021年12月20日	2021年12月24日	0.042	1,001,813.7394	42,076.18	5,391.93
2022年1月19日	2022年1月20日	2022年1月26日	0.042	991,737.4334	41,652.97	5,350.38
2022年2月18日	2022年2月21日	2022年2月25日	0.042	991,737.4334	41,652.97	5,339.85
2022年3月18日	2022年3月21日	2022年3月25日	0.042	971,937.4334	40,821.37	5,217.09

HP 每月派息 人民币

记录日	除息日	派息日	每份额派息额 (人民币)	有权收取派息 之份额	总派息额 (人民币)	总派息额 (美元)
2021年10月19日	2021年10月20日	2021年10月26日	0.047	122,061.7790	5,736.90	897.64
2021年11月19日	2021年11月22日	2021年11月26日	0.047	122,061.7790	5,736.90	898.52
2021年12月17日	2021年12月20日	2021年12月24日	0.047	122,061.7790	5,736.90	898.43
2022年1月19日	2022年1月20日	2022年1月26日	0.047	122,061.7790	5,736.90	904.42
2022年2月18日	2022年2月21日	2022年2月25日	0.047	122,061.7790	5,736.90	907.13
2022年3月18日	2022年3月21日	2022年3月25日	0.047	122,061.7790	5,736.90	901.09

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

分配披露(未经审计)(续)

截至 2022 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

HP 每月派息 澳元

记录日	除息日	派息日	每份额派息额 (澳元)	有权收取派息 之份额	总派息额 (澳元)	总派息额 (美元)
2021年10月19日	2021年10月20日	2021年10月26日	0.047	114,304.8300	5,372.33	4,034.89
2021年11月19日	2021年11月22日	2021年11月26日	0.047	143,242.9654	6,732.42	4,879.66
2021年12月17日	2021年12月20日	2021年12月24日	0.047	143,242.9654	6,732.42	4,785.07
2022年1月19日	2022年1月20日	2022年1月27日	0.047	114,304.8300	5,372.33	3,907.03
2022年2月18日	2022年2月21日	2022年2月25日	0.047	114,304.8300	5,372.33	3,875.87
2022年3月18日	2022年3月21日	2022年3月25日	0.047	114,304.8300	5,372.33	3,985.46

I 每月派息 美元

记录日	除息日	派息日	每份额派息额 (美元)	有权收取派息 之份额	总派息额 (美元)	总派息额 (美元)
2021年10月19日	2021年10月20日	2021年10月26日	0.042	1,057,277.7470	44,405.67	44,405.67
2021年11月19日	2021年11月22日	2021年11月26日	0.042	1,070,846.5626	44,975.56	44,975.56
2021年12月17日	2021年12月20日	2021年12月24日	0.042	1,070,846.5626	44,975.56	44,975.56
2022年1月19日	2022年1月20日	2022年1月26日	0.042	1,076,253.0300	45,202.63	45,202.63
2022年2月18日	2022年2月21日	2022年2月25日	0.042	1,076,253.0300	45,202.63	45,202.63
2022年3月18日	2022年3月21日	2022年3月25日	0.042	1,076,253.0300	45,202.63	45,202.63

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

业绩记录(未经审计)

于2022年3月31日

瑞士百达策略收益

资产净值

	资产净值	每份资产净值
P 每月派息 美元		
2022年3月31日	美元140,634,939	美元10.1986
2021年9月30日	美元100,346,073	美元10.8673
2020年9月30日	美元49,519,248	美元9.7166
P 每月派息 港元		
2022年3月31日	美元135,993,208	港元10.3386
2021年9月30日	美元114,388,076	港元10.9480
2020年9月30日	美元51,539,195	港元9.7434
HP 每月派息 人民币		
2022年3月31日	美元47,992,568	人民币10.9949
2021年9月30日	美元39,746,503	人民币11.5787
2020年9月30日	美元21,796,369	人民币10.1409
HP 每月派息 澳元		
2022年3月31日	美元46,710,728	澳元9.4555
2021年9月30日	美元44,278,544	澳元10.1687
2020年9月30日	美元23,509,004	澳元9.2463
HM 人民币		
2022年3月31日	美元954,250	人民币11.9233
2021年9月30日	美元957,407	人民币12.2307
2020年9月30日	美元201,197	人民币10.1684
I 每月派息 美元		
2022年3月31日	美元3,649,511	美元9.0143
2021年9月30日	美元2,888,818	美元9.6038
I 累计美元		
2022年3月31日	美元1,467,907	美元9.3211
HI 每月派息 新加坡元		
2022年3月31日	美元2,143,349	新加坡元9.3944
2021年9月30日	美元1,708,898	新加坡元10.0000
HI 累计 新加坡元		
2022年3月31日	美元2,415,076	新加坡元9.6530
2021年9月30日	美元957,572	新加坡元10.0000

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

业绩记录(未经审计)

于2022年3月31日

瑞士百达亚洲债券收益

资产净值

	资产净值	每份额资产净值
P 每月派息 美元		
2022年3月31日	美元7,287,293	美元8.3983
2021年9月30日	美元11,427,716	美元9.5033
P 每月派息 港元		
2022年3月31日	美元1,052,983	港元8.4844
2021年9月30日	美元2,114,408	港元9.5418
HP 每月派息 人民币		
2022年3月31日	美元165,671	人民币8.6160
2021年9月30日	美元182,385	人民币9.6435
HP 每月派息 澳元		
2022年3月31日	美元713,793	澳元8.3156
2021年9月30日	美元1,031,131	澳元9.4575
I 每月派息 美元		
2022年3月31日	美元9,095,376	美元8.4509
2021年9月30日	美元10,084,047	美元9.5377
I 累计 美元		
2022年3月31日	美元7,915,834	美元8.9545
2021年9月30日	美元8,726,007	美元9.8269
HI 累计 新加坡元		
2022年3月31日	美元3,651,692	新加坡元8.9724
2021年9月30日	美元4,001,029	新加坡元9.8348

瑞士百达策略收益
 瑞士百达亚洲债券收益
 (百达香港之子基金)

业绩记录(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达策略收益

每份额最高/最低资产净值

	每份额最高 资产净值	每份额最低 资产净值
P 每月派息 美元		
2021年10月1日至2022年3月31日	美元11.4930	美元9.8437
2020年10月1日至2021年9月30日	美元11.5467	美元9.6576
2019年10月1日至2020年9月30日	美元10.0910	美元8.2699
2018年10月1日至2019年9月30日	美元9.9269	美元9.0702
2017年10月1日至2018年9月30日	美元10.7456	美元9.8417
2016年9月30日至2017年9月30日	美元10.0694	美元9.5151
P 每月派息 港元		
2021年10月1日至2022年3月31日	港元11.5836	港元9.9726
2020年10月1日至2021年9月30日	港元11.5827	港元9.6904
2019年10月1日至2020年9月30日	港元10.1189	港元8.3032
2018年10月1日至2019年9月30日	港元10.0475	港元9.1808
2017年10月1日至2018年9月30日	港元10.8433	港元9.9794
2016年9月30日至2017年9月30日	港元10.1609	港元9.5253
HP 每月派息 人民币		
2021年10月1日至2022年3月31日	人民币12.2778	人民币10.6036
2020年10月1日至2021年9月30日	人民币12.1353	人民币10.0983
2019年10月1日至2020年9月30日	人民币10.5191	人民币8.6004
2018年10月1日至2019年9月30日	人民币10.3085	人民币9.7658
2017年10月1日至2018年9月30日	人民币11.0396	人民币10.2153
2016年9月30日至2017年9月30日	人民币10.2390	人民币9.5287
HP 每月派息 澳元		
2021年10月1日至2022年3月31日	澳元10.4592	澳元9.1424
2020年10月1日至2021年9月30日	澳元10.8503	澳元9.1813
2019年10月1日至2020年9月30日	澳元9.5697	澳元7.9808
2018年10月1日至2019年9月30日	澳元9.8450	澳元9.1565
2017年10月1日至2018年9月30日	澳元10.7144	澳元9.7659
2016年9月30日至2017年9月30日	澳元10.0260	澳元9.5342
HM 人民币		
2021年10月1日至2022年3月31日	人民币13.0247	人民币11.4463
2020年10月1日至2021年9月30日	人民币12.6958	人民币10.1741
2019年10月1日至2020年9月30日	人民币10.4957	人民币10.0149

瑞士百达策略收益
瑞士百达亚洲债券收益
(百达香港之子基金)

业绩记录(未经审计)(续)

于2022年3月31日

瑞士百达策略收益

每份额最高/最低资产净值

	每份额最高 资产净值	每份额最低 资产净值
I 每月派息 美元		
2021年10月1日至2022年3月31日	美元10.1610	美元8.7030
2021年9月9日至2021年9月30日	美元10.0200	美元9.6038
I 累计 美元		
2021年11月29日至2022年3月31日	美元10.1201	美元8.9542
HI 每月派息 新加坡元		
2021年10月1日至2022年3月31日	新加坡元10.5821	新加坡元9.0692
于2021年9月30日	新加坡元10.0000	新加坡元10.0000
HI 累计 新加坡元		
2021年10月1日至2022年3月31日	新加坡元10.6285	新加坡元9.2740
于2021年9月30日	新加坡元10.0000	新加坡元10.0000

瑞士百达策略收益
瑞士百达亚洲债券收益
(百达香港之子基金)

业绩记录(未经审计) (续)

于2022年3月31日

瑞士百达亚洲债券收益

每份额最高/最低资产净值

	每份额最高 资产净值	每份额最低 资产净值
P 每月派息 美元		
2021年10月1日至2022年3月31日	美元9.5084	美元 8.1667
2020年11月23日至2021年9月30日	美元10.0746	美元9.4916
P 每月派息 港元		
2021年10月1日至2022年3月31日	港元9.5491	港元8.2453
2020年11月23日至2021年9月30日	港元10.0745	港元9.5297
HP 每月派息 人民币		
2021年10月1日至2022年3月31日	人民币9.6514	人民币8.373
2020年11月23日至2021年9月30日	人民币10.1072	人民币9.6329
HP 每月派息 澳元		
2021年10月1日至2022年3月31日	澳元9.2713	澳元8.0957
2020年11月23日至2021年9月30日	澳元10.0378	澳元9.4456
I 每月派息 美元		
2021年10月1日至2022年3月31日	美元 9.5434	美元 8.2158
2020年11月23日至2021年9月30日	美元10.0801	美元9.5258
I 累计 美元		
2021年10月1日至2022年3月31日	美元 9.8327	美元 8.6615
2020年11月23日至2021年9月30日	美元10.0801	美元9.8146
HI 累计 新加坡元		
2021年10月1日至2022年3月31日	新加坡元9.8408	新加坡元8.6782
2020年11月23日至2021年9月30日	新加坡元10.0802	新加坡元9.8222

瑞士百达策略收益
瑞士百达亚洲债券收益
(百达香港之子基金)

欲知更多信息，
请访问我们的网站：

www.assetmanagement.pictet
www.pictet.com

