

# 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，本基金会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)                      |
| <b>资产</b>                  |                           |                           |
| 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>         |
| <b>总资产</b>                 | <b><u>387,771,992</u></b> | <b><u>312,343,600</u></b> |
| <b>负债</b>                  |                           |                           |
| 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>          |
| <b>负债(不包括归属于份额持有人的净资产)</b> | <b><u>5,810,456</u></b>   | <b><u>7,071,709</u></b>   |
| <b>归属于份额持有人的净资产</b>        | <b><u>381,961,536</u></b> | <b><u>305,271,891</u></b> |
| <b>已发行的份额数目</b>            |                           |                           |
| - 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)                     |
| <b>资产</b>                  |                          |                          |
| 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>         |
| <b>总资产</b>                 | <b><u>31,031,616</u></b> | <b><u>42,210,414</u></b> |
| <b>负债</b>                  |                          |                          |
| 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>            |
| <b>负债(不包括归属于份额持有人的净资产)</b> | <b><u>1,148,974</u></b>  | <b><u>4,643,691</u></b>  |
| <b>归属于份额持有人的净资产</b>        | <b><u>29,882,642</u></b> | <b><u>37,566,723</u></b> |
| <b>已发行的份额数目</b>            |                          |                          |
| - 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<br>2022年3月31日期间 | 2020年10月1日至<br>2021年3月31日期间 |
|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                            | (美元)                        | (美元)                        |
| <b>收益</b>                  |                             |                             |
| 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                     |
| <b>总投资(亏损)/利润</b>          | <b>(11,166,295)</b>         | <b>24,490,373</b>           |
| <b>开支</b>                  |                             |                             |
| 管理费用 <sup>注2</sup>         | 2,482,861                   | 1,164,768                   |
| 受托人费用 <sup>注1</sup>        | 168,834                     | 79,941                      |
| 交易成本 <sup>注1</sup>         | 268,771                     | 139,499                     |
| 托管费和银行手续费 <sup>注1</sup>    | 56,399                      | 36,214                      |
| 核数师酬金                      | 15,998                      | 10,785                      |
| 法律及专业服务费用                  | 5,777                       | 51,004                      |
| 其他运营费用 <sup>注1</sup>       | 39,715                      | 39,027                      |
| <b>营业费用总额</b>              | <b>3,038,355</b>            | <b>1,521,238</b>            |
| <b>经营(亏损)/利润</b>           | <b>(14,204,650)</b>         | <b>22,969,135</b>           |
| <b>财务成本</b>                |                             |                             |
| 利息支出 <sup>注1</sup>         | (11,440)                    | (11,270)                    |
| 对份额持有人派发股息                 | (9,259,585)                 | (4,433,147)                 |
| <b>收益分配后及税前(亏损)/利润</b>     | <b>(23,475,675)</b>         | <b>18,524,718</b>           |
| 股息收入预扣税                    | (305,670)                   | (82,539)                    |
| <b>归属于份额持有人的净资产(减少)/增加</b> | <b>(23,781,345)</b>         | <b>18,442,179</b>           |

<sup>注1</sup>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<br>2022年3月31日期间 | 2020年10月1日至<br>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                       |

<sup>注2</sup>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)

| <b>收益</b>               |                           |
|-------------------------|---------------------------|
| 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>              |
| <b>总投资亏损</b>            | <b><u>(2,823,678)</u></b> |
| <b>开支</b>               |                           |
| 管理费用 <sup>注2</sup>      | 111,843                   |
| 受托人费用 <sup>注1</sup>     | 35,627                    |
| 托管费和银行手续费 <sup>注1</sup> | 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 <sup>注1</sup>    | <u>22,675</u>             |
| <b>营业费用总额</b>           | <b><u>200,643</u></b>     |
| <b>经营亏损</b>             | <b><u>(3,024,321)</u></b> |
| <b>财务成本</b>             |                           |
| 对份额持有人派发股息              | <u>(592,922)</u>          |
| <b>归属于份额持有人的净资产减少</b>   | <b><u>(3,617,243)</u></b> |

<sup>注1</sup>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

<sup>注2</sup>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<br>2022年3月31日期间 | 2020年10月1日至<br>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                 | <b><u>381,961,536</u></b>   | <b><u>198,747,835</u></b>   |
| 已发行份额数目              | 份额                          | 份额                          |
| <b>P 每月派息 美元份额</b>   |                             |                             |
| 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>       |
| <b>P 每月派息 港元份额</b>   |                             |                             |
| 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>      |
| <b>HP 每月派息 人民币份额</b> |                             |                             |
| 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>      |
| <b>HP 每月派息 澳元份额</b>  |                             |                             |
| 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             |
|-----------------------|----------------|----------------|
| <b>HM 人民币份额</b>       |                |                |
| 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   |
| <b>I 每月派息 美元份额</b>    |                |                |
| 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   | -              |
| <b>I 累计 美元份额</b>      |                |                |
| 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   | -              |
| <b>HI 每月派息 新加坡元份额</b> |                |                |
| 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   | -              |
| <b>HI 累计 新加坡元份额</b>   |                |                |
| 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)                     |
|----------------------|--------------------------|
| <b>期初余额</b>          | 37,566,723               |
| 分配份额                 | 683,085                  |
| 赎回份额                 | <u>(4,749,923)</u>       |
| <b>份额交易净减少</b>       | <b>(4,066,838)</b>       |
| 归属于份额持有人的净资产减少       | (3,617,243)              |
| <b>期末余额</b>          | <b><u>29,882,642</u></b> |
| <b>已发行份额数目</b>       | <b>份额</b>                |
| <b>P 每月派息 美元份额</b>   |                          |
| 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>      |
| <b>P 每月派息 港元份额</b>   |                          |
| 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>      |
| <b>HP 每月派息 人民币份额</b> |                          |
| 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             |
|---------------------|----------------|
| <b>HP 每月派息 澳元份额</b> |                |
| 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   |
| <b>I 每月派息 美元份额</b>  |                |
| 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 |
| <b>I 累计 美元份额</b>    |                |
| 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   |
| <b>HI 累计 新加坡元份额</b> |                |
| 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<br>2022年3月31日期间 | 2020年10月1日至<br>2021年3月31日期间 |
|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
|                              | (美元)                        | (美元)                        |
| <b>经营活动产生的现金流量</b>           |                             |                             |
| 归属于份额持有人的净资产(减少)/增加          | (23,781,345)                | 18,442,179                  |
| <b>调整:</b>                   |                             |                             |
| 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)                    |
| <b>经营活动现金流出净额</b>            | <b>(93,364,894)</b>         | <b>(11,190,112)</b>         |
| <b>融资活动产生的现金流量</b>           |                             |                             |
| 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)                 |
| <b>融资活动现金流入净额</b>            | <b>93,766,109</b>           | <b>28,067,448</b>           |
| <b>现金及现金等价物之增加</b>           | <b>401,215</b>              | <b>16,877,336</b>           |
| 期初现金及现金等价物                   | 28,257,004                  | 10,499,395                  |
| <b>期末现金及现金等价物</b>            | <b><u>28,658,219</u></b>    | <b><u>27,376,731</u></b>    |
| <b>现金及现金等价物余额分析</b>          |                             |                             |
| 银行存款                         | <b><u>28,658,219</u></b>    | <b><u>27,376,731</u></b>    |

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)

|                              |                         |
|------------------------------|-------------------------|
| <b>经营活动产生的现金流量</b>           |                         |
| 归属于份额持有人的净资产减少               | (3,617,243)             |
| <b>调整:</b>                   |                         |
| 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                 |
| <b>经营活动现金流入净额</b>            | <b>10,177,092</b>       |
| <b>融资活动产生的现金流量</b>           |                         |
| 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)               |
| <b>融资活动现金流出净额</b>            | <b>(8,787,058)</b>      |
| <b>现金及现金等价物之增加</b>           | <b>1,390,034</b>        |
| 期初现金及现金等价物                   | 2,270,655               |
| <b>期末现金及现金等价物</b>            | <b><u>3,660,689</u></b> |
| <b>现金及现金等价物余额分析</b>          |                         |
| 银行存款                         | <b><u>3,660,689</u></b> |

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<br>百分比 |
|------------------|---|-----------|-------------------|-------------|
| <b>上市股票</b>      |   |           |                   |             |
| <b>澳大利亚2.90%</b> |   |           |                   |             |
|                  | 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        |
|                  |   |           | <b>11,068,863</b> | <b>2.90</b> |
| <b>开曼群岛3.95%</b> |   |           |                   |             |
|                  | Alibaba Group Holding Ltd Ord (每股面值<br>0.00003125美元)      | 63,400    | 907,518           | 0.24        |
|                  | Alibaba Group Holding-Sp Adr (1份美国存托凭证<br>("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<br>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        |
|                  |   |           | <b>15,104,951</b> | <b>3.95</b> |

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<br>百分比 |
|--------------------|--|-----------|------------------|-------------|
| <b>上市股票(续)</b>     |  |           |                  |             |
| <b>中国1.54%</b>     |  |           |                  |             |
|                    | 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        |
|                    |  |           | <b>5,853,817</b> | <b>1.54</b> |
| <b>英属格恩西岛0.67%</b> |  |           |                  |             |
|                    | Tufton Oceanic Assets Ltd Ord Npv                | 1,880,859 | 2,548,564        | 0.67        |
|                    |  |           | <b>2,548,564</b> | <b>0.67</b> |
| <b>香港1.39%</b>     |  |           |                  |             |
|                    | 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        |
|                    |  |           | <b>5,359,003</b> | <b>1.39</b> |
| <b>印尼0.05%</b>     |  |           |                  |             |
|                    | Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk Ord(每股面值50印尼盾) | 554,910   | 180,044          | 0.05        |
|                    |  |           | <b>180,044</b>   | <b>0.05</b> |
| <b>日本3.15%</b>     |  |           |                  |             |
|                    | 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<br>百分比 |
|-------------------|---|---------|-------------------|-------------|
| <b>上市股票(续)</b>    |   |         |                   |             |
| <b>日本3.15%(续)</b> |   |         |                   |             |
|                   | 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        |
|                   |   |         | <b>12,025,544</b> | <b>3.15</b> |
| <b>韩国0.65%</b>    |   |         |                   |             |
|                   | 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<br>Shares(每股面值100韩元) | 1,848   | 96,055            | 0.03        |
|                   | SK Telecom Company Limited  | 2,324   | 109,101           | 0.03        |
|                   |   |         | <b>2,468,644</b>  | <b>0.65</b> |
| <b>荷兰1.22%</b>    |   |         |                   |             |
|                   | ASML Holding Nv - Ny Reg Shs(每股面值0.09欧元)(1份ADR<br>代表1份普通股)          | 7,000   | 4,675,510         | 1.22        |
|                   |   |         | <b>4,675,510</b>  | <b>1.22</b> |
| <b>新西兰0.46%</b>   |   |         |                   |             |
|                   | Auckland International Airport                                      | 320,000 | 1,742,770         | 0.46        |
|                   |   |         | <b>1,742,770</b>  | <b>0.46</b> |
| <b>新加坡0.04%</b>   |   |         |                   |             |
|                   | United Overseas Bank Ltd  | 6,300   | 149,057           | 0.04        |
|                   |   |         | <b>149,057</b>    | <b>0.04</b> |
| <b>台湾3.22%</b>    |   |         |                   |             |
|                   | 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        |
|                   |   |         | <b>12,292,341</b> | <b>3.22</b> |

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<br>百分比 |
|-----------------|--|--------|------------|-------------|
| <b>上市股票(续)</b>  |  |        |            |             |
| <b>美国29.24%</b> |  |        |            |             |
|                 | 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<br>百分比  |
|--------------------|---|--------|--------------------|--------------|
| <b>上市股票(续)</b>     |   |        |                    |              |
| <b>美国29.24%(续)</b> |   |        |                    |              |
|                    | 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         |
|                    |   |        | <b>111,712,873</b> | <b>29.24</b> |

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<br>百分比  |
|------------------|---|---------------|-------------------|--------------|
| <b>固定收益</b>      |   |               |                   |              |
| <b>澳大利亚3.02%</b> |   |               |                   |              |
|                  | Australia (Govt of) 5.5% 21/04/2023                       | 1,850,000     | 1,454,007         | 0.38         |
|                  | Australian Government Ser 136 (Reg S) 4.75%<br>21/04/2027 | 12,200,000    | 10,093,026        | 2.64         |
|                  |   |               | <b>11,547,033</b> | <b>3.02</b>  |
| <b>开曼群岛0.50%</b> |   |               |                   |              |
|                  | Powerlong Real Estate (Reg) (Reg S) 3.9% 13/04/2022       | 2,000,000     | 1,900,000         | 0.50         |
|                  |   |               | <b>1,900,000</b>  | <b>0.50</b>  |
| <b>日本9.20%</b>   |   |               |                   |              |
|                  | 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         |
|                  |   |               | <b>35,116,119</b> | <b>9.20</b>  |
| <b>美国15.16%</b>  |   |               |                   |              |
|                  | 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         |
|                  |   |               | <b>57,918,584</b> | <b>15.16</b> |

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<br>百分比  |
|--------------------|---|---------|-------------------|--------------|
| <b>上市/报价投资基金</b>   |   |         |                   |              |
| <b>英属格恩西岛0.08%</b> |   |         |                   |              |
|                    | Sequoia Economic Infrastructure Inc Fd Ltd Ord Npv                          | 238,276 | 322,511           | 0.08         |
|                    |   |         | <b>322,511</b>    | <b>0.08</b>  |
| <b>爱尔兰11.85%</b>   |   |         |                   |              |
|                    | 贝莱德资产管理爱尔兰有限公司 - Ishares Gold<br>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)<br>Fund Solutions Plc ETF | 113,610 | 12,147,181        | 3.18         |
|                    |   |         | <b>45,276,022</b> | <b>11.85</b> |
| <b>卢森堡4.23%</b>    |   |         |                   |              |
|                    | 百达-人民币债券  | 55,600  | 6,552,124         | 1.72         |
|                    | 百达-新兴市场多元资产- Z 美元   | 18,400  | 1,664,832         | 0.44         |
|                    | 百达-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<br>Convertible                               | 46,600  | 5,785,755         | 1.51         |
|                    |   |         | <b>16,132,775</b> | <b>4.23</b>  |

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<br>百分比   |
|--------------------|-----------------------------|------|--------------------|---------------|
| <b>期货合约</b>        |                             |      |                    |               |
| <b>日本0.04%</b>     |                             |      |                    |               |
|                    | 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)        |
|                    |                             |      | <b>(161,104)</b>   | <b>(0.04)</b> |
| <b>英国0.02%</b>     |                             |      |                    |               |
|                    | 富时100指数期货 17/06/2022        | 15   | 74,851             | 0.02          |
|                    |                             |      | <b>74,851</b>      | <b>0.02</b>   |
| <b>美国0.03%</b>     |                             |      |                    |               |
|                    | CBOE波动率指数期货 20/04/2022      | 44   | (105,864)          | (0.03)        |
|                    |                             |      | <b>(105,864)</b>   | <b>(0.03)</b> |
| <b>远期外汇合约0.13%</b> |                             |      |                    |               |
|                    | 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          |
|                    |                             |      | <b>511,550</b>     | <b>0.13</b>   |
|                    |                             |      | <b>185,181,981</b> |               |
|                    |                             |      | <b>106,481,736</b> |               |
|                    |                             |      | <b>61,731,308</b>  |               |
|                    |                             |      | <b>(192,117)</b>   |               |
|                    |                             |      | <b>511,550</b>     |               |
|                    |                             |      | <b>353,714,458</b> |               |
|                    |                             |      | <b>345,189,578</b> |               |

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<br>百分比  |
|---------------|---|---------|------------------|--------------|
| <b>固定收益</b>   |   |         |                  |              |
| 百慕大0.96%      | Li & Fung Ltd Ser Emtn (Reg) (Reg S) 4.5% 18/08/2025                | 300,000 | 287,667          | 0.96         |
|               |   |         | <b>287,667</b>   | <b>0.96</b>  |
| 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)<br>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%<br>24/02/2027          | 200,000 | 192,681          | 0.64         |
|               | Greenland Glb Invst Ser Emtn (Reg) (Reg S) 6.75%<br>26/09/2023      | 200,000 | 136,650          | 0.46         |
|               | GZ Mtr Fin Bvi Ser Emtn (Reg) (Reg S) 2.31%<br>17/09/2030           | 200,000 | 174,531          | 0.58         |
|               | Huarong Finance 2019 Ser Emtn (Reg S) 3.375%<br>24/02/2030          | 400,000 | 349,500          | 1.17         |
|               | Huarong Finance Ii Co Ltd (Reg) (Reg S) 4.625%<br>03/06/2026        | 200,000 | 195,750          | 0.66         |
|               | Huarong Finance Ii Ser Emtn (Reg) (Regs) 5.5%<br>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%<br>05/03/2025           | 200,000 | 159,050          | 0.53         |
|               | Shanghai ELC Group Glb Inv (Reg) (Reg S) 2.3%<br>21/02/2025         | 500,000 | 478,125          | 1.60         |
|               |   |         | <b>3,700,581</b> | <b>12.38</b> |

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      |
|-------------------|--|---------|------------------|--------------|
| <b>固定收益 (续)</b>   |  |         |                  |              |
| <b>开曼群岛13.04%</b> |  |         |                  |              |
|                   | 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%<br>28/09/2030      | 800,000 | 709,888          | 2.37         |
|                   | CH OVS Grand Oce Finance (Reg) (Reg S) 2.45%<br>09/02/2026         | 400,000 | 365,188          | 1.22         |
|                   | China SCE Grp Hldgs Ltd (Reg) (Reg S) 5.95%<br>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%<br>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%<br>19/01/2028    | 400,000 | 390,685          | 1.31         |
|                   | Weibo Corp (Reg) 3.5% 05/07/2024                                   | 200,000 | 195,396          | 0.65         |
|                   |  |         | <b>3,897,816</b> | <b>13.04</b> |
| <b>香港6.49%</b>    |  |         |                  |              |
|                   | 远东宏信有限公司SER欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.625%<br>03/03/2024               | 300,000 | 280,158          | 0.94         |
|                   | 金地永隆SER欧洲中期债券 (Reg) (Reg S)<br>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)<br>3.975%<br>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)<br>5.35%<br>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%<br>20/01/2026                 | 500,000 | 459,500          | 1.53         |
|                   | Xiaomi Best Time Intl Ser (Reg) (Reg S) 2.875%<br>14/07/2031       | 500,000 | 432,070          | 1.45         |
|                   |  |         | <b>1,938,685</b> | <b>6.49</b>  |

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<br>百分比        |
|-----------------|--|---------|-------------------------|--------------------|
| <b>固定收益 (续)</b> |  |         |                         |                    |
| <b>印度6.47%</b>  |  |         |                         |                    |
|                 | Adani Green Energy Ltd Ser (Reg) (Reg S) 4.375%<br>08/09/2024          | 200,000 | 196,250                 | 0.66               |
|                 | Adani Ports and Special Ser Reg (Reg S) 4%<br>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%<br>01/09/2026                 | 200,000 | 184,935                 | 0.62               |
|                 | REC Limited Ser Gmtn (Reg) (Reg S) 3.375%<br>25/07/2024                | 200,000 | 197,799                 | 0.66               |
|                 | Reliance Industries Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S)<br>3.625%<br>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               |
|                 |  |         | <b><u>1,933,007</u></b> | <b><u>6.47</u></b> |
| <b>印尼3.92%</b>  |  |         |                         |                    |
|                 | Bank Mandiri PT Ser Emtn (Reg) (Reg S) 3.75%<br>11/04/2024             | 200,000 | 200,999                 | 0.67               |
|                 | Indonesia Asahan Alumini Ser (Reg S) 5.45%<br>15/05/2030               | 200,000 | 209,109                 | 0.71               |
|                 | Indonesia Asahan Alumini Ser Regs (Reg S) 4.75%<br>15/05/2025          | 200,000 | 204,050                 | 0.68               |
|                 | PT Bank Tabungan Negara (Reg) (Reg S) 4.2%<br>23/01/2025               | 200,000 | 194,650                 | 0.65               |
|                 | PT Pertamina (Persero) Ser Regs (Reg S) 4.175%<br>21/01/2050           | 200,000 | 184,797                 | 0.62               |
|                 | PT Pertamina (Persero) Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.3%<br>09/02/2031       | 200,000 | 177,329                 | 0.59               |
|                 |  |         | <b><u>1,170,934</u></b> | <b><u>3.92</u></b> |
| <b>马恩岛1.60%</b> |  |         |                         |                    |
|                 | GOHL Capital Ltd 4.25% 24/01/2027                                      | 500,000 | 477,330                 | 1.60               |
|                 |  |         | <b><u>477,330</u></b>   | <b><u>1.60</u></b> |

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<br>百分比        |
|------------------|--|---------|-------------------------|--------------------|
| <b>固定收益 (续)</b>  |  |         |                         |                    |
| <b>韩国0.60%</b>   |  |         |                         |                    |
|                  | Kookmin Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.5%<br>04/11/2030             | 200,000 | 179,071                 | 0.60               |
|                  |  |         | <b><u>179,071</u></b>   | <b><u>0.60</u></b> |
| <b>马来西亚1.93%</b> |  |         |                         |                    |
|                  | Axiata Spv5 Labuan Ltd Ser Emtn (Reg S) 3.064%<br>19/08/2050       | 200,000 | 172,626                 | 0.58               |
|                  | Misc Capital Two Labuan Ser Regs (Reg S) 3.625%<br>06/04/2025      | 200,000 | 199,480                 | 0.67               |
|                  | Petronas Capital Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.5%<br>21/04/2030     | 200,000 | 203,900                 | 0.68               |
|                  |  |         | <b><u>576,006</u></b>   | <b><u>1.93</u></b> |
| <b>毛里求斯2.87%</b> |  |         |                         |                    |
|                  | Greenko Solar Mauritius Ser (Reg) (Reg S) 5.95%<br>29/07/2026      | 200,000 | 203,000                 | 0.68               |
|                  | Greenko Solar Mauritius Ser Regs (Reg) (Reg S)<br>5.55% 29/01/2024 | 200,000 | 202,000                 | 0.68               |
|                  | Greenko Wind Projects Mu Ser Regs (Reg S) 5.5%<br>06/04/2025       | 200,000 | 199,900                 | 0.67               |
|                  | India Green Energy Hldng Ser Regs (Reg S) 5.375%<br>29/04/2024     | 250,000 | 251,863                 | 0.84               |
|                  |  |         | <b><u>856,763</u></b>   | <b><u>2.87</u></b> |
| <b>新加坡4.05%</b>  |  |         |                         |                    |
|                  | 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%<br>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               |
|                  |  |         | <b><u>1,211,302</u></b> | <b><u>4.05</u></b> |

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

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<br>百分比 |
|----------------------|--|---------|------------------|-------------|
| <b>浮动收益</b>          |  |         |                  |             |
| <b>英属维尔京群岛 3.93%</b> |  |         |                  |             |
|                      | Bluestar Fin Holdings (Reg) (Reg S) Var Perpetual<br>31/12/2049        | 600,000 | 589,238          | 1.97        |
|                      | China Huaneng Gp HK Treasury (Reg) (Reg S) Var<br>Perpetual 31/12/2049 | 400,000 | 391,560          | 1.31        |
|                      | Elect Global Investments Ltd (Reg) (Reg S) Var<br>Perpetual 31/12/2049 | 200,000 | 193,000          | 0.65        |
|                      |  |         | <b>1,173,798</b> | <b>3.93</b> |
| <b>中国5.15%</b>       |  |         |                  |             |
|                      | 国银金融租赁股份有限公司 (Reg) (Reg S) VAR<br>28/09/2030                           | 700,000 | 677,918          | 2.26        |
|                      | 中国信达资产管理 Ser (Reg) (Reg S) Var Perp<br>31/12/2049                      | 200,000 | 187,135          | 0.63        |
|                      | 中国建设银行 (Reg) (Reg S) VAR<br>24/06/2030                                 | 700,000 | 674,790          | 2.26        |
|                      |  |         | <b>1,539,843</b> | <b>5.15</b> |
| <b>香港7.06%</b>       |  |         |                  |             |
|                      | 友邦保险控股有限公司SER欧洲中期债券(Reg) (Reg S)<br>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<br>31/12/2049                             | 300,000 | 275,504          | 0.92        |
|                      | 中国银行(香港)有限公司 Ser Regs (Reg) VAR<br>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<br>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<br>S) VAR<br>28/02/2029               | 600,000 | 606,333          | 2.03        |
|                      |  |         | <b>2,111,122</b> | <b>7.06</b> |
| <b>印尼0.61%</b>       |  |         |                  |             |
|                      | Bank Negara Indonesia (Reg S) Var Perpetual<br>31/12/2049              | 200,000 | 182,841          | 0.61        |
|                      |  |         | <b>182,841</b>   | <b>0.61</b> |

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

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<br>百分比 |
|--------------------|-------------------------------|------|-------------------|-------------|
| <b>期货合约</b>        |                               |      |                   |             |
| <b>美国0.02%</b>     |                               |      |                   |             |
|                    | US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022 | (3)  | (563)             | -           |
|                    | US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022  | (2)  | 5,078             | 0.02        |
|                    |                               |      | <b>4,515</b>      | <b>0.02</b> |
| <b>远期外汇合约0.05%</b> |                               |      |                   |             |
|                    | 买澳元沽美元 29/04/2022             |      | 2,730             | 0.01        |
|                    | 买离岸人民币沽美元 29/04/2022          |      | 868               | -           |
|                    | 买新加坡元沽美元 29/04/2022           |      | 10,917            | 0.04        |
|                    |                               |      | <b>14,515</b>     | <b>0.05</b> |
|                    |                               |      | <b>17,373,678</b> |             |
|                    |                               |      | <b>9,397,359</b>  |             |
|                    |                               |      | <b>4,515</b>      |             |
|                    |                               |      | <b>14,515</b>     |             |
|                    |                               |      | <b>26,790,067</b> |             |
|                    |                               |      | <b>28,537,994</b> |             |

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<br>占净资产百分比 | 于2021年9月30日<br>占净资产百分比 |
|------------------|------------------------|------------------------|
| <b>上市股票</b>      |                        |                        |
| 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                  |
|                  | <b>48.48</b>           | <b>57.08</b>           |
| <b>固定收益</b>      |                        |                        |
| 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                   |
|                  | <b>27.88</b>           | <b>15.00</b>           |
| <b>上市/报价投资基金</b> |                        |                        |
| 英属格恩西岛           | 0.08                   | 0.11                   |
| 爱尔兰              | 11.85                  | 7.48                   |
| 卢森堡              | 4.23                   | 8.39                   |
|                  | <b>16.16</b>           | <b>15.98</b>           |
| <b>期货合约</b>      |                        |                        |
| 日本               | (0.04)                 | (0.02)                 |
| 英国               | 0.02                   | -                      |
| 美国               | (0.03)                 | 0.11                   |
|                  | <b>(0.05)</b>          | <b>0.09</b>            |
| <b>远期外汇合约</b>    |                        |                        |
|                  | 0.13                   | 0.16                   |
|                  | <b>0.13</b>            | <b>0.16</b>            |
| 组合投资合计           | <b>92.60</b>           | <b>88.31</b>           |

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<br>占净资产百分比 | 于2021年9月30日<br>占净资产百分比 |
|---------------|------------------------|------------------------|
| <b>固定收益</b>   |                        |                        |
| 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                   |
|               | <b>58.14</b>           | <b>62.61</b>           |
| <b>浮动收益</b>   |                        |                        |
| 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                   |
|               | <b>31.45</b>           | <b>32.53</b>           |
| <b>期货合约</b>   |                        |                        |
| 美国            | 0.02                   | (0.04)                 |
|               | <b>0.02</b>            | <b>(0.04)</b>          |
| <b>远期外汇合约</b> |                        |                        |
|               | 0.05                   | (0.07)                 |
|               | <b>0.05</b>            | <b>(0.07)</b>          |
| 组合投资合计        | <b>89.66</b>           | <b>95.03</b>           |

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<br>(美元) |
|-----------------|------------------|------------|--------------|--------------|
| <b>金融资产：</b>    |                  |            |              |              |
| 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       |
|                 |                  |            |              | 643,864      |
| <b>金融负债：</b>    |                  |            |              |              |
| 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)      |
|                 |                  |            |              | (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<br>(美元) | 持仓量 | 交易对手           | 公允价值<br>(美元) |
|------------------------------------|--------------------|-------|--------------|-----|----------------|--------------|
| <b>金融资产：</b>                       |                    |       |              |     |                |              |
| 富时100指数期货<br>17/06/2022            | 富时100指数            | 10    | 1,403,615    | 15  | 瑞银期货<br>有限责任公司 | 74,851       |
| 日经225指数(大阪证券交易<br>所)<br>09/06/2022 | 日经225指数            | 1000  | 2,723,790    | 12  | 瑞银期货<br>有限责任公司 | 27,683       |
|                                    |                    |       |              |     |                | 102,534      |
| <b>金融负债：</b>                       |                    |       |              |     |                |              |
| CBOE波动率指数期货<br>20/04/2022          | CBOX波动率指数          | 1000  | 1,138,500    | 44  | 瑞银期货<br>有限责任公司 | (105,864)    |
| 东京证交所TOPIX银行指数<br>09/06/2022       | 东京证交所TOPIX<br>银行指数 | 10000 | 3,915,213    | 285 | 瑞银期货<br>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<br>(美元) |
|--------------|-----------------|-----------------|--------------|--------------|
| <b>金融资产：</b> |                 |                 |              |              |
| 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<br>(美元) | 持仓量 | 交易对手                           | 公允价值<br>(美元) |
|---------------------------------|--------|-------|--------------|-----|--------------------------------|--------------|
| <b>金融资产：</b>                    |        |       |              |     |                                |              |
| US 5YR NOTE<br>(CBT) 30/06/2022 | 美国国库票据 | 1,000 | (234,453)    | (2) | J. P. Morgan<br>Securities Ltd | 5,078        |
|                                 |        |       |              |     |                                | 5,078        |
| <b>金融负债：</b>                    |        |       |              |     |                                |              |
| NOTE (CBT)<br>21/06/2022        | 美国国库票据 | 1,000 | (368,063)    | (3) | J. P. Morgan<br>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<br>(美元) | 有权收取派息之份<br>额   | 总派息额<br>(美元) | 总派息额<br>(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<br>(港元) | 有权收取派息之份<br>额    | 总派息额<br>(港元) | 总派息额<br>(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<br>(人民币) | 有权收取派息之份<br>额   | 总派息额<br>(人民币) | 总派息额<br>(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<br>(澳元) | 有权收取派息<br>之份额  | 总派息额<br>(澳元) | 总派息额<br>(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<br>(美元) | 有权收取派息<br>之份额 | 总派息额<br>(美元) | 总派息额<br>(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<br>(新加坡元) | 有权收取派息<br>之份额 | 总派息额<br>(新加坡元) | 总派息额<br>(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<br>(美元) | 有权收取派息<br>之份额  | 总派息额<br>(美元) | 总派息额<br>(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<br>(港元) | 有权收取派息<br>之份额  | 总派息额<br>(港元) | 总派息额<br>(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<br>(人民币) | 有权收取派息<br>之份额 | 总派息额<br>(人民币) | 总派息额<br>(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<br>(澳元) | 有权收取派息<br>之份额 | 总派息额<br>(澳元) | 总派息额<br>(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<br>(美元) | 有权收取派息<br>之份额  | 总派息额<br>(美元) | 总派息额<br>(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      |
|---------------------|---------------|-------------|
| <b>P 每月派息 美元</b>    |               |             |
| 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    |
| <b>P 每月派息 港元</b>    |               |             |
| 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    |
| <b>HP 每月派息 人民币</b>  |               |             |
| 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  |
| <b>HP 每月派息 澳元</b>   |               |             |
| 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    |
| <b>HM 人民币</b>       |               |             |
| 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  |
| <b>I 每月派息 美元</b>    |               |             |
| 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    |
| <b>I 累计美元</b>       |               |             |
| 2022年3月31日          | 美元1,467,907   | 美元9.3211    |
| <b>HI 每月派息 新加坡元</b> |               |             |
| 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 |
| <b>HI 累计 新加坡元</b>   |               |             |
| 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    |
|--------------------|--------------|------------|
| <b>P 每月派息 美元</b>   |              |            |
| 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   |
| <b>P 每月派息 港元</b>   |              |            |
| 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   |
| <b>HP 每月派息 人民币</b> |              |            |
| 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  |
| <b>HP 每月派息 澳元</b>  |              |            |
| 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   |
| <b>I 每月派息 美元</b>   |              |            |
| 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   |
| <b>I 累计 美元</b>     |              |            |
| 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   |
| <b>HI 累计 新加坡元</b>  |              |            |
| 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<br>资产净值 | 每份额最低<br>资产净值 |
|-----------------------|---------------|---------------|
| <b>P 每月派息 美元</b>      |               |               |
| 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      |
| <b>P 每月派息 港元</b>      |               |               |
| 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      |
| <b>HP 每月派息 人民币</b>    |               |               |
| 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     |
| <b>HP 每月派息 澳元</b>     |               |               |
| 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      |
| <b>HM 人民币</b>         |               |               |
| 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<br>资产净值 | 每份额最低<br>资产净值 |
|------------------------|---------------|---------------|
| <b>I 每月派息 美元</b>       |               |               |
| 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      |
| <b>I 累计 美元</b>         |               |               |
| 2021年11月29日至2022年3月31日 | 美元10.1201     | 美元8.9542      |
| <b>HI 每月派息 新加坡元</b>    |               |               |
| 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   |
| <b>HI 累计 新加坡元</b>      |               |               |
| 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<br>资产净值 | 每份额最低<br>资产净值 |
|------------------------|---------------|---------------|
| <b>P 每月派息 美元</b>       |               |               |
| 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      |
| <b>P 每月派息 港元</b>       |               |               |
| 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      |
| <b>HP 每月派息 人民币</b>     |               |               |
| 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     |
| <b>HP 每月派息 澳元</b>      |               |               |
| 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      |
| <b>I 每月派息 美元</b>       |               |               |
| 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      |
| <b>I 累计 美元</b>         |               |               |
| 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      |
| <b>HI 累计 新加坡元</b>      |               |               |
| 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](http://www.assetmanagement.pictet)  
[www.pictet.com](http://www.pictet.com)

