

汇丰集合投资信托—
汇丰亚太股票（日本除外）专注波幅基金
2022年中期报告



HSBC Global Asset Management
汇丰 环球投资管理

汇丰集合投资信托—
汇丰亚太股票(日本除外)专注波幅基金

中期报告
截至 2022 年 9 月 30 日止期间

目录	页数
资产负债表(未经审计)	1
全面收益表(未经审计)	3
份额持有人应占资产净值变动表(未经审计)	5
现金流量表(未经审计)	9
投资组合报表 (未经审计)	10
投资组合变动表 (未经审计)	14
业绩表现记录(未经审计)	15
分派披露 (未经审计)	18
行政	20

资产负债表

2022年9月30日

	截至2022年 9月30日 (未经审计) 美元	截至2022年 3月31日 (经审计) 美元
资产		
以公允价值计入损益账的金融资产	51,721,495	76,260,571
应收股息	37,130	176,043
应收利息	82	51
应收申购款	141	68,805
应收经纪商款项	655,575	1,148,773
现金及现金等价物	1,191,290	2,129,181
	<u>53,605,713</u>	<u>79,783,424</u>
负债		
应付赎回款	110,582	6,313
应付经纪商款项	514,569	614,632
应付分派	94,435	99,696
其他应付款	140,262	184,421
	<u>859,848</u>	<u>905,062</u>
份额持有人应占资产净值	<u>52,745,865</u>	<u>78,878,362</u>
相当于：		
金融负债	<u>52,745,865</u>	<u>78,878,362</u>

资产负债表

2022年9月30日(续)

	截至2022年9 月30日 (未经审计) 美元	截至2022年 3月31日 (经审计) 美元
已发行份额总数		
- AM2类 – 美元	4,726,840	5,178,830
- AM2类 – 港元	16,544,580	20,231,804
- BC类 – 港元	668,009	692,905
- BC类 – 人民币	1,800,206	2,004,348
- BC类 – 美元	616,078	647,660
- BM2类 – 港元	798,575	847,224
- BM2类 – 人民币	1,215,536	1,253,718
- BM2类 – 美元	452,015	453,634
每份额资产净值		
- AM2类 – 美元	6.059	8.126
- AM2类 – 港元	0.779	1.045
- BC类 – 港元	0.880	1.168
- BC类 – 人民币	1.019	1.353
- BC类 – 美元	6.901	9.159
- BM2类 – 港元	0.789	1.058
- BM2类 – 人民币	0.916	1.229
- BM2类 – 美元	6.194	8.306

注：中期报告采用了与本基金年度报告相同的会计政策和计算方法。

全面收益表

截至2022年9月30日止期间

	2022年4月1 日至2022年9 月30日 美元	2021年4月1 日至2021年9 月30日 美元
现金和现金等价物的利息收入	2,161	17
股息收入	780,222	1,384,758
以公允价值计入损益账的金融资产和负债的亏损净值	(18,270,703)	(9,393,825)
汇兑亏损净值	(27,916)	(20,732)
其他收入	16,130	-
收入总额	(17,500,106)	(8,029,782)
管理费 ^{注2}	578,952	966,201
交易费用 ^{注1}	66,924	98,054
受托人费用 ^{注1}	23,158	38,648
审计师酬金	6,634	5,215
过户代办费用 ^{注1}	17,894	26,354
专业人员费用	14,844	16,861
保管费、银行手续费及杂费 ^{注1}	22,475	31,601
总经营开支	730,881	1,182,934
税前经营净亏损	(18,230,987)	(9,212,716)
税项	(108,727)	(130,101)
收益分配前经营净亏损	(18,339,714)	(9,342,817)
向份额持有人作出收益分配	(583,777)	(1,078,807)

全面收益表

截至2022年9月30日止期间(续)

份额持有人应占资产净值减少及
期间内全面收益总额

(18,923,491) (10,421,624)

注¹ 在截至2022年9月30日和2021年9月30日止期间内，除受托人费用和过户代办费用外，支付给受托人/受托人的关联人士的金额分别为：

	2022年4月1 日至2022年9 月30日 美元	2021年4月1 日至2021年9 月30日 美元
交易费用	6,626	12,031
保管费、银行手续费及杂费	17,462	25,676

注² 在截至2022年9月30日和2021年9月30日止期间内，除支付给管理人的管理费外，没有向管理人/管理人的关联人士支付任何款项。

份额持有人应占资产净值变动表 截至2022年9月30日止期间

	2022年4月1日 至2022年9月 30日 美元	2021年4月1 日至2021年9 月30日 美元
期初余额	78,878,362	111,898,665
份额持有人应占资产净值减少及 期间内全面收益总额	(18,923,491)	(10,421,624)
份额认购		
- AM2类 – 美元	1,286,128	20,722,770
- AM2类 – 港元	871,827	13,839,520
- BC类 – 港元	2,995	124,894
- BC类 – 人民币	4,565	395,329
- BC类 – 美元	9,603	364,281
- BM2类 – 港元	272	37,435
- BM2类 – 人民币	11,986	25,254
- BM2类 – 美元	132,839	391,364
	2,320,215	35,900,847
份额赎回		
- AM2类 – 美元	(4,489,545)	(18,505,196)
- AM2类 – 港元	(4,241,635)	(17,595,030)
- BC类 – 港元	(27,930)	(440,054)
- BC类 – 人民币	(256,944)	(752,723)
- BC类 – 美元	(265,778)	(1,751,973)
- BM2类 – 港元	(45,643)	(254,841)
- BM2类 – 人民币	(50,316)	(419,182)
- BM2类 – 美元	(151,430)	(1,327,115)
	(9,529,221)	(41,046,114)
与份额持有人的交易价值总额	(7,209,006)	(5,145,267)
期末余额	52,745,865	96,331,774

份额持有人应占资产净值变动表 截至2022年9月30日止期间(续)

	2022年4月1 日至2022年9 月30日 份额	2021年4月1日 至2021年9月 30日 份额
AM2类 – 美元		
4月1日的已发行份额数目	5,178,830	5,701,244
期间内已申购份额	174,464	2,096,938
期间内已赎回份额	(626,454)	(1,920,260)
9月30日的已发行份额数目	<u>4,726,840</u>	<u>5,877,922</u>
AM2类 – 港元		
4月1日的已发行份额数目	20,231,804	24,857,423
期间内已申购份额	920,965	11,007,858
期间内已赎回份额	(4,608,189)	(14,233,454)
9月30日的已发行份额数目	<u>16,544,580</u>	<u>21,631,827</u>
BC类 – 港元		
4月1日的已发行份额数目	692,905	931,783
期间内已申购份额	2,607	90,309
期间内已赎回份额	(27,503)	(313,570)
9月30日的已发行份额数目	<u>668,009</u>	<u>708,522</u>

份额持有人应占资产净值变动表 截至2022年9月30日止期间(续)

	2022年4月1 日至2022年9 月30日 份额	2021年4月1 日至2021年9 月30日 份额
BC类 – 人民币		
4月1日的已发行份额数目	2,004,348	2,456,615
期间内已申购份额	3,647	244,330
期间内已赎回份额	(207,789)	(467,846)
9月30日的已发行份额数目	<u>1,800,206</u>	<u>2,233,099</u>
BC类 – 美元		
4月1日的已发行份额数目	647,660	838,069
期间内已申购份额	1,139	33,936
期间内已赎回份额	(32,721)	(160,110)
9月30日的已发行份额数目	<u>616,078</u>	<u>711,895</u>
BM2类 – 港元		
4月1日的已发行份额数目	847,224	988,972
期间内已申购份额	281	29,931
期间内已赎回份额	(48,930)	(200,434)
9月30日的已发行份额数目	<u>798,575</u>	<u>818,469</u>
BM2类 – 美元		
4月1日的已发行份额数目	453,634	607,145
期间内已申购份额	18,256	38,708
期间内已赎回份额	(19,875)	(130,640)
9月30日的已发行份额数目	<u>452,015</u>	<u>515,213</u>

份额持有人应占资产净值变动表 截至2022年9月30日止期间(续)

	2022年4月1 日至2022年9 月30日 份额	2021年4月1 日至2021年 9月30日 份额
BM2类 – 人民币		
4月1日的已发行份额数目	1,253,718	1,504,514
期间内已申购份额	10,736	17,383
期间内已赎回份额	(48,918)	(278,272)
9月30日的已发行份额数目	<u>1,215,536</u>	<u>1,243,625</u>
总额		
4月1日的已发行份额数目	31,310,123	37,885,765
期间内已申购份额	1,132,095	13,559,393
期间内已赎回份额	(5,620,379)	(17,704,586)
9月30日的已发行份额数目	<u>26,821,839</u>	<u>33,740,572</u>

现金流量表

截至2022年9月30日止期间

	2022年4月1 日至2022年9 月30日 美元	2021年4月1 日至2021年 9月30日 美元
经营活动		
已收利息	2,130	20
已收股息	919,135	1,514,450
已付管理费	(611,590)	(994,286)
已付受托人费用	(24,463)	(39,771)
购买投资的付款	(27,107,748)	(53,872,834)
出售投资的所得款项	33,769,255	55,700,655
已付税项	(108,727)	(130,101)
其他已付经营开支	(150,772)	(232,961)
经营活动产生的现金	<u>6,687,220</u>	<u>1,945,172</u>
融资活动		
份额发行所得款项	2,388,879	40,315,725
份额赎回付款	(9,424,952)	(40,918,212)
已付分配	(589,038)	(1,150,825)
融资活动使用的现金	<u>(7,625,111)</u>	<u>(1,753,312)</u>
现金及现金等价物的净(减少)/增加	<u>(937,891)</u>	<u>191,860</u>
期初现金和现金等价物	<u>2,129,181</u>	<u>2,881,683</u>
期末现金和现金等价物	<u>1,191,290</u>	<u>3,073,543</u>

投资组合报表(未经审计) 2022年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
股票			
上市投资			
澳大利亚			
BHP GROUP LTD	37,787	935,849	1.78
CSL LIMITED	15,225	2,790,036	5.29
GOODMAN GROUP STAPLED SEC	62,598	635,104	1.20
RESMED INC	24,908	541,774	1.03
		<u>4,902,763</u>	<u>9.30</u>
中国			
隆基绿能科技股份有限公司	223,016	1,498,734	2.84
宜宾五粮液股份有限公司	78,700	1,868,161	3.54
		<u>3,366,895</u>	<u>6.38</u>
香港			
友邦保险控股有限公司	334,400	2,788,122	5.28
祖龙娱乐有限公司	1,352,000	485,693	0.92
百度集团股份有限公司	126,900	1,844,519	3.50
香港交易及 结算所有限公司	54,800	1,882,072	3.57
L'OCCITANE INTERNATIONAL	736,000	2,236,156	4.24
美团	71,000	1,497,803	2.84
农夫山泉股份有限公司	223,600	1,297,466	2.46
申洲国际集团控股有限公司	148,300	1,159,022	2.20
创科实业有限公司	70,000	676,378	1.28
腾讯控股有限公司	91,700	3,111,999	5.90
药明生物技术有限公司	304,000	1,835,641	3.48
		<u>18,814,871</u>	<u>35.67</u>

投资组合报表 (未经审计) (续)

2022年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
股票(续)			
上市投资(续)			
印度			
FSN E-COMMERCE VENTURES LTD	45,943	718,417	1.36
HCL TECHNOLOGIES LTD	164,546	1,885,828	3.58
HDFC BANK LIMITED	22,052	385,287	0.73
HINDUSTAN UNILEVER LTD	56,415	1,869,919	3.55
INFOSYS LTD	85,364	1,483,170	2.81
		<hr/>	<hr/>
		6,342,621	12.03
		<hr/>	<hr/>
印尼			
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,983,600	1,752,543	3.32
		<hr/>	<hr/>
		1,752,543	3.32
		<hr/>	<hr/>
韩国			
KB FINANCIAL GROUP INC	54,728	1,671,639	3.17
LG H&H CO LTD	2,789	1,233,967	2.34
NCISOFT CORP	1,082	261,671	0.49
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	14,215	527,585	1.00
SK SQUARE CO LTD	48,375	1,222,308	2.32
		<hr/>	<hr/>
		4,917,170	9.32
		<hr/>	<hr/>

投资组合报表 (未经审计) (续)

2022年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
股票(续)			
上市投资(续)			
台湾			
联发科技股份有限公司	100,000	1,735,488	3.29
台湾积体电路制造股份有限公司	359,000	4,771,741	9.05
		<hr/>	<hr/>
		6,507,229	12.34
美国			
HDFC BANK LIMITED	3,183	185,951	0.35
INFOSYS LTD	36,232	614,857	1.17
SEA LTD	11,619	651,245	1.23
腾讯音乐娱乐集团	269,724	1,095,079	2.08
		<hr/>	<hr/>
		2,547,132	4.83
股票(总计)			
		<hr/>	<hr/>
		49,151,224	93.19

投资组合报表 (未经审计) (续)

2022年9月30日

	<i>持有量</i>	<i>市场价值 美元</i>	<i>占资产净 值百分比</i>
单位信托			
上市投资			
爱尔兰			
HSBC GLOBAL LIQUIDITY FUNDS - HSBC GLOBAL LIQUIDITY FUNDS PL*	2,570,271	<u>2,570,271</u>	<u>4.87</u>
单位信托(总计)		<u>2,570,271</u>	<u>4.87</u>
投资总额			
(投资成本合计: 73,074,692 美元)		51,721,495	98.06
其他资产净值		<u>1,024,370</u>	<u>1.94</u>
2022年9月30日的资产净值总额		<u><u>52,745,865</u></u>	<u><u>100.00</u></u>

*该投资基金在香港未获授权，也不对香港公众开放。

投资组合变动表(未经审计)

2022年4月1日起至2022年9月30日止期间

	占资产净值 百分比 2022年 9月30日	占资产净值 百分比 2022年 3月31日
金融资产		
股票		
上市投资		
澳大利亚	9.30	6.70
中国内地	6.38	2.49
香港	35.67	30.77
印度	12.03	11.65
印尼	3.32	-
韩国	9.32	17.37
台湾	12.34	18.14
美国	4.83	4.88
	<hr/>	<hr/>
	93.19	92.00
	<hr/>	<hr/>
单位信托		
上市投资		
爱尔兰	4.87	4.68
	<hr/>	<hr/>
投资总额	98.06	96.68
其他资产净值	1.94	3.32
	<hr/>	<hr/>
资产净值总额	100.00	100.00
	<hr/>	<hr/>

业绩表现记录(未经审计)

(a) 总资产净值(按《香港财务报告准则》计算)

	2022年 9月30日 美元	2022年 3月31日 美元	2021年 3月31日 美元	2020年 3月31日 美元
总资产净值	52,745,865	78,878,362	111,898,665	77,027,342

(b) 每份额资产净值(按《香港财务报告准则》计算)

	计价货币	2022年 9月30日	2022年 3月31日	2021年 3月31日	2020年 3月31日
每份额资产净值					
- AM2类 - 美元	美元	6.059	8.126	9.876	7.279
- AM2类 - 港元	港元	6.115	8.184	9.874	7.255
- BC类 - 美元	美元	6.901	9.159	10.901	7.762
- BC类 - 港元	港元	6.908	9.147	10.799	7.666
- BC类 - 人民币	人民币	7.265	8.589	10.564	8.130
- BM2类 - 美元	美元	6.194	8.306	10.095	7.441
- BM2类 - 港元	港元	6.194	8.286	9.998	7.348
- BM2类 - 人民币	人民币	6.530	7.802	9.796	7.804

(c) 价格记录(每份额交易资产净值)

截至下列日期止的财务期间/年度	AM2类 - 美元			
	买入价		卖出价	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2022年9月30日	6.057	9.208	6.057	9.208
2022年3月31日	7.329	10.224	7.329	10.224
2021年3月31日	7.118	10.877	7.118	10.877

截至下列日期止的财务期间/年度	AM2类 - 港元			
	买入价		卖出价	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2022年9月30日	6.115	9.227	6.115	9.227
2022年3月31日	7.373	10.195	7.373	10.195
2021年3月31日	7.094	10.838	7.094	10.838

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(每份额交易资产净值)(续)

截至下列日期止的财务期间/年度	BM2 类 - 美元			
	买入价		卖出价	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2022年9月30日	6.191	9.412	6.191	9.412
2022年3月31日	7.491	10.451	7.491	10.451
2021年3月31日	7.276	11.009	7.276	11.009

截至下列日期止的财务期间/年度	BM2 类 - 港元			
	买入价		卖出价	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2022年9月30日	6.193	9.346	6.193	9.346
2022年3月31日	7.471	10.332	7.471	10.332
2021年3月31日	7.187	10.875	7.187	10.875

截至下列日期止的财务期间/年度	BM2 类 - 人民币			
	买入价		卖出价	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2022年9月30日	6.530	8.858	6.530	8.858
2022年3月31日	7.081	9.999	7.081	9.999
2021年3月31日	7.658	10.513	7.658	10.513

截至下列日期止的财务期间/年度	BC 类 - 港元			
	买入价		卖出价	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2022年9月30日	6.902	10.264	6.902	10.264
2022年3月31日	8.229	11.207	8.229	11.207
2021年3月31日	7.500	11.693	7.500	11.693

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(每份额交易资产净值)(续)

截至下列日期止的财务期间/年度	BC类-人民币			
	买入价		卖出价	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2022年9月30日	7.264	9.709	7.264	9.709
2022年3月31日	7.786	10.786	7.786	10.786
2021年3月31日	7.974	11.289	7.974	11.289

截至下列日期止的财务期间/年度	BC类-美元			
	买入价		卖出价	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2022年9月30日	6.899	10.333	6.899	10.333
2022年3月31日	8.249	11.331	8.249	11.331
2021年3月31日	7.591	11.834	7.591	11.834

分派披露(未经审计)

AM2类 – 美元	除息日期	支付日期	每单位分派金额 美元	总分派金额 美元
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0124	58,612.82
2022年8月派息	2022年8月31日	2022年9月9日	0.0137	66,527.64
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0115	56,695.02
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0117	58,716.3000
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0115	58,126.36
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0121	61,550.61

AM2类 – 港元	除息日期	支付日期	每单位分派金额 港元	总分派金额 港元
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0126	208,461.71
2022年8月派息	2022年8月31日	2022年9月9日	0.0138	231,574.34
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0116	206,975.52
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0118	218,407.04
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0116	217,478.75
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0122	241,820.63

BM2类 – 港元	除息日期	支付日期	每单位分派金额 港元	总分派金额 港元
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0127	10,141.90
2022年8月派息	2022年8月31日	2022年9月9日	0.0140	11,297.51
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0118	9,672.81
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0119	9,889.05
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0117	9,721.94
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0124	10,302.28

BM2类 – 人民币	除息日期	支付日期	每单位分派金额 人民币	总分派金额 人民币
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0131	15,923.52
2022年8月派息	2022年8月31日	2022年9月9日	0.0141	17,472.68
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0117	14,497.22
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0118	14,906.13
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0115	14,451.61
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月13日	0.0116	14,544.64

分派披露(未经审计) (续)

BM2类—美元	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 美元	总分派 金额 美元
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0127	5,740.60
2022年8月派息	2022年8月31日	2022年9月9日	0.0140	6,326.21
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0117	5,349.02
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0119	5,400.11
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0117	5,181.74
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0124	5,510.72

行政

管理人

汇丰投资基金(香港)有限公司
香港中环
皇后大道中1号
汇丰总行大厦

管理人董事

陈宝枝
刘嘉燕
叶士奇(已于2022年10月10日辞职)
何慧芬
谭振邦

受托人和基金注册登记机构

汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司
香港中环
皇后大道中1号
汇丰总行大厦

投资顾问

汇丰环球投资管理(香港)有限公司
香港中环
皇后大道中1号
汇丰总行大厦

审计师

毕马威
香港
中环
遮打道10号
太子大厦8楼

法律顾问

的近律师行
香港
中环
遮打道18号
历山大厦5楼