

汇丰集合投资信托一 汇丰亚洲高入息债券基金

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 -
汇丰亚洲高入息债券基金

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)	4
份额持有人应占资产净值变动表(未经审计)	6
现金流量表(未经审计)	15
投资组合报表(未经审计)	16
投资组合变动表(未经审计)	36
金融衍生工具详情(未经审计)	39
业绩表现记录(未经审计)	46
分派披露(未经审计)	53
行政	58

资产负债表

2022 年 9 月 30 日

	2022 年 9 月 30 日 (未经审计) 美元	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	504,592,603	722,519,064
现金抵押资产	530,000	-
应收利息	6,761,347	8,819,296
应收申购款	1,028	1,708
应收经纪商款项	26,020,314	5,710,999
其他应收款	-	64,099
现金和现金等价物	1,804,868	3,802,759
	539,710,160	740,917,925
负债		
以公允价值计入损益账的金融负债	778,277	910,824
现金抵押负债	1,230,000	690,000
应付赎回款	3,497,503	3,356,256
应付经纪商款项	32,697,919	26,623,720
应付分派	3,178,796	3,329,643
应付税项	19,079	21,330
其他应付款	674,706	835,769
	42,076,280	35,767,542
份额持有人应占资产净值	497,633,880	705,150,383
相当于： 金融负债	497,633,880	705,150,383

资产负债表 2022 年 9 月 30 日(续)

	2022 年 9 月 30 日 (未经审计) 美元	2022 年 3 月 31 日 (经审计) 美元
已发行份额总数		
– AC 类 – 美元	490,809	530,133
– AM2 类 – 美元	32,184,635	37,927,193
– AM2 类 – 人民币	3,816,629	5,780,277
– AM3O 类 – 人民币	25,799,432	32,165,216
– AM2 类 – 港元	192,689,016	214,830,393
– AM2 类 – 欧元	300,530	367,276
– AM3O 类 – 欧元	355,612	404,334
– AM2 类 – 澳元	1,036,636	1,184,276
– AM3O 类 – 澳元	5,052,545	5,895,980
– AM2 类 – 加元	265,695	338,120
– AM3O 类 – 加元	2,998,623	3,617,423
– AM3O 类 – 英镑	2,902,361	3,188,458
– AM3O 类 – 新加坡元	753,874	821,628
– BC 类 – 港元	428,151	482,360
– BC 类 – 人民币	249,219	348,794
– BC 类 – 美元	275,547	355,471
– BCO 类 – 人民币	227,941	257,654
– BM2 类 – 港元	309,941	459,185
– BM2 类 – 人民币	748,830	768,369
– BM2 类 – 美元	932,995	1,062,024
– BM3O 类 – 澳元	173,314	180,986
– BM3O 类 – 人民币	1,310,688	1,359,635
– IM2 类 – 美元	229,064	174,986
– IC 类 – 美元	498,256	498,256

资产负债表 2022 年 9 月 30 日(续)

	2022 年 9 月 30 日 (未经审计) 美元	2022 年 3 月 31 日 (经审计) 美元
份额净值		
– AC 类 – 美元	8.386	9.690
– AM2 类 – 美元	6.618	7.922
– AM2 类 – 人民币	0.965	1.155
– AM30 类 – 人民币	0.916	1.232
– AM2 类 – 港元	0.853	1.021
– AM2 类 – 欧元	7.008	8.386
– AM30 类 – 欧元	6.314	8.601
– AM2 类 – 澳元	5.059	6.054
– AM30 类 – 澳元	4.165	5.835
– AM2 类 – 加元	5.029	6.018
– AM30 类 – 加元	4.718	6.219
– AM30 类 – 英镑	7.200	10.179
– AM30 类 – 新加坡元	4.522	5.743
– BC 类 – 港元	1.053	1.216
– BC 类 – 人民币	1.155	1.336
– BC 类 – 美元	8.162	9.430
– BCO 类 – 人民币	1.202	1.553
– BM2 类 – 港元	0.925	1.108
– BM2 类 – 人民币	1.018	1.218
– BM2 类 – 美元	7.175	8.589
– BM30 类 – 澳元	4.597	6.440
– BM30 类 – 人民币	1.007	1.356
– IM2 类 – 美元	6.836	8.160
– IC 类 – 美元	7.407	8.534

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	4,459	896
以公允价值计入损益账的金融资产和负债的利息收入	13,315,059	31,197,271
股息收入	58,348	4,046
以公允价值计入损益账的金融资产和负债的亏损净值	(97,363,846)	(44,090,473)
汇兑亏损净值	(12,487,656)	(4,360,890)
其他收入	14,682	374
收入总额	(96,458,954)	(17,248,776)
管理费^{注2}	3,438,268	7,608,742
交易费用 ^{注1}	25,941	21,665
受托人费用 ^{注1}	210,242	464,223
审计师酬金	9,190	7,797
过户代办费用 ^{注1}	77,994	97,974
专业人员费用	4,391	6,851
保管费、银行手续费及杂费 ^{注1}	246,355	75,884
总经营开支	4,012,381	8,283,136
收益分配前经营净亏损	(100,471,335)	(25,531,912)
向份额持有人作出收益分配	(20,021,648)	(29,715,115)
份额持有人应占资产净值减少及 期间内全面收益总额	(120,492,983)	(55,247,027)

全面收益表

截至 2022 年 9 月 30 日止期间(续)

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	10,443	12,457
保管费、银行手续费及杂费	23,611	41,869

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	705,150,383	1,451,459,571
	-----	-----
份额持有人应占资产净值减少及 期间内全面收益总额	(120,492,983)	(55,247,027)
	-----	-----
<i>份额认购</i>		
– AC 类 – 美元	291,760	809,650
– AM2 类 – 美元	4,968,107	33,941,584
– AM2 类 – 人民币	-	200,657
– AM30 类 – 人民币	1,134,109	11,433,925
– AM2 类 – 港元	1,971,472	39,795,480
– AM2 类 – 欧元	-	82,314
– AM30 类 – 欧元	95,021	987,740
– AM2 类 – 澳元	-	989,527
– AM30 类 – 澳元	544,385	9,020,278
– AM2 类 – 加元	-	97,404
– AM30 类 – 加元	461,670	7,576,822
– AM30 类 – 英镑	1,399,705	13,120,723
– AM30 类 – 新加坡元	381	152,783
– BC 类 – 港元	-	126
– BC 类 – 人民币	3,881	342,116
– BC 类 – 美元	9,800	593,026
– BCO 类 – 人民币	40,160	77,882
– BM2 类 – 港元	13,170	182,563
– BM2 类 – 人民币	95,614	218,657
– BM2 类 – 美元	249,538	3,272,202
– BM30 类 – 澳元	169	836,529
– BM30 类 – 人民币	316,664	721,574
– IM2 类 – 美元	400,000	1,900,000
– IC 类 – 美元	-	5,000,000
	-----	-----
	11,995,606	131,353,562
	-----	-----

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 美元	2021 年 4 月 1 日 至 2021 年 9 月 30 日 美元
<i>份额赎回</i>		
– AC 类 – 美元	(625,289)	(3,256,096)
– AM2 类 – 美元	(46,840,199)	(172,120,557)
– AM2 类 – 人民币	(2,132,935)	(1,775,215)
– AM30 类 – 人民币	(8,167,630)	(37,797,552)
– AM2 类 – 港元	(22,974,597)	(116,257,960)
– AM2 类 – 欧元	(544,897)	(362,079)
– AM30 类 – 欧元	(477,108)	(3,487,140)
– AM2 类 – 澳元	(841,268)	(4,335,265)
– AM30 类 – 澳元	(5,021,689)	(21,431,317)
– AM2 类 – 加元	(420,902)	(2,532,131)
– AM30 类 – 加元	(3,819,554)	(14,569,191)
– AM30 类 – 英镑	(3,841,835)	(28,246,630)
– AM30 类 – 新加坡元	(334,871)	(178,308)
– BC 类 – 港元	(65,641)	(30,976)
– BC 类 – 人民币	(127,042)	(442,950)
– BC 类 – 美元	(728,979)	(5,044,743)
– BCO 类 – 人民币	(78,841)	(2,061,181)
– BM2 类 – 港元	(175,468)	(38,240)
– BM2 类 – 人民币	(115,424)	(457,807)
– BM2 类 – 美元	(1,289,067)	(1,050,544)
– BM30 类 – 澳元	(46,742)	(125,268)
– BM30 类 – 人民币	(349,148)	(509,401)
	(99,019,126)	(416,110,551)
与份额持有人的交易价值总额	(87,023,520)	(284,756,989)
期末余额	497,633,880	1,111,455,555

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	2021 年 4 月 1 日 至 2021 年 9 月 30 日
AC 类 – 美元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	530,133	931,401
期间内已申购份额	31,339	71,511
期间内已赎回份额	(70,663)	(287,316)
	490,809	715,596
AM2 类 – 美元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	37,927,193	69,753,877
期间内已申购份额	648,387	3,517,111
期间内已赎回份额	(6,390,945)	(17,926,329)
	32,184,635	55,344,659
AM2 类 – 人民币份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	5,780,277	7,511,932
期间内已申购份额	-	143,015
期间内已赎回份额	(1,963,648)	(1,258,316)
	3,816,629	6,396,631
AM3O 类 – 人民币份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	32,165,216	67,949,810
期间内已申购份额	1,064,039	7,785,824
期间内已赎回份额	(7,429,823)	(25,764,040)
	25,799,432	49,971,594

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	2021 年 4 月 1 日 至 2021 年 9 月 30 日
AM2 类 – 港元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	214,830,393	329,559,732
期间内已申购份额	2,098,658	31,943,603
期间内已赎回份额	(24,240,035)	(93,814,366)
	192,689,016	267,688,969
AM2 类 – 欧元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	367,276	420,878
期间内已申购份额	-	7,996
期间内已赎回份额	(66,746)	(35,445)
	300,530	393,429
AM30 类 – 欧元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	404,334	728,238
期间内已申购份额	12,086	88,588
期间内已赎回份额	(60,808)	(312,399)
	355,612	504,427
AM2 类 – 澳元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	1,184,276	1,841,608
期间内已申购份额	-	134,011
期间内已赎回份额	(147,640)	(590,944)
	1,036,636	1,384,675

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	2021 年 4 月 1 日 至 2021 年 9 月 30 日
AM3O 类 – 澳元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	5,895,980	9,493,963
期间内已申购份额	113,232	1,261,014
期间内已赎回份额	(956,667)	(3,020,473)
	5,052,545	7,734,504
	5,052,545	7,734,504
AM2 类 – 加元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	338,120	757,703
期间内已申购份额	-	13,165
期间内已赎回份额	(72,425)	(345,681)
	265,695	425,187
	265,695	425,187
AM3O 类 – 加元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	3,617,423	5,631,633
期间内已申购份额	85,901	995,181
期间内已赎回份额	(704,701)	(1,920,237)
	2,998,623	4,706,577
	2,998,623	4,706,577
AM3O 类 – 英镑份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	3,188,458	4,738,256
期间内已申购份额	152,291	998,777
期间内已赎回份额	(438,388)	(2,178,856)
	2,902,361	3,558,177
	2,902,361	3,558,177

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	2021 年 4 月 1 日 至 2021 年 9 月 30 日
AM30 类 – 新加坡元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	821,628	1,078,191
期间内已申购份额	74	21,861
期间内已赎回份额	(67,828)	(25,804)
	753,874	1,074,248
	753,874	1,074,248
BC 类 – 港元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	482,360	549,658
期间内已申购份额	-	89
期间内已赎回份额	(54,209)	(21,781)
	428,151	527,966
	428,151	527,966
BC 类 – 人民币份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	348,794	425,811
期间内已申购份额	3,001	219,967
期间内已赎回份额	(102,576)	(284,547)
	249,219	361,231
	249,219	361,231
BC 类 – 美元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	355,471	1,167,729
期间内已申购份额	1,053	53,900
期间内已赎回份额	(80,977)	(459,814)
	275,547	761,815
	275,547	761,815

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	2021 年 4 月 1 日 至 2021 年 9 月 30 日
BCO 类 – 人民币份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	257,654	1,414,894
期间内已申购份额	30,443	44,798
期间内已赎回份额	(60,156)	(1,176,884)
	<hr/>	<hr/>
9 月 30 日的已发行份额数目	227,941	282,808
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>
BM2 类 – 港元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	459,185	401,454
期间内已申购份额	12,085	135,201
期间内已赎回份额	(161,329)	(28,819)
	<hr/>	<hr/>
9 月 30 日的已发行份额数目	309,941	507,836
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>
BM2 类 – 人民币份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	768,369	928,106
期间内已申购份额	88,524	146,763
期间内已赎回份额	(108,063)	(312,203)
	<hr/>	<hr/>
9 月 30 日的已发行份额数目	748,830	762,666
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>
BM2 类 – 美元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	1,062,024	949,791
期间内已申购份额	32,923	312,087
期间内已赎回份额	(161,952)	(100,753)
	<hr/>	<hr/>
9 月 30 日的已发行份额数目	932,995	1,161,125
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>

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	2021 年 4 月 1 日 至 2021 年 9 月 30 日
BM30 类 – 澳元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	180,986	95,156
期间内已申购份额	28	102,867
期间内已赎回份额	(7,700)	(16,103)
	173,314	181,920
	173,314	181,920
BM30 类 – 人民币份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	1,359,635	1,644,257
期间内已申购份额	264,919	447,445
期间内已赎回份额	(313,866)	(315,282)
	1,310,688	1,776,420
	1,310,688	1,776,420
IM2 类 – 美元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	174,986	174,986
期间内已申购份额	54,078	192,561
期间内已赎回份额	-	-
	229,064	367,547
	229,064	367,547
IC 类 – 美元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	498,256	-
期间内已申购份额	-	498,256
期间内已赎回份额	-	-
	498,256	498,256
	498,256	498,256

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	2021 年 4 月 1 日 至 2021 年 9 月 30 日
总额		
4 月 1 日的已发行份额数目	312,998,427	508,149,064
期间内已申购份额	4,693,061	49,135,591
期间内已赎回份额	(43,661,145)	(150,196,392)
9 月 30 日的已发行份额数目	<u>274,030,343</u>	<u>407,088,263</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	15,377,467	33,947,867
已收股息	58,348	4,046
已付管理费	(3,647,486)	(8,046,223)
已付受托人费用	(223,014)	(490,663)
购买投资的付款	(528,800,839)	(1,386,905,207)
出售投资的所得款项 (已付)/收回税项	635,450,286 (2,251)	1,683,454,853 296
其他已付经营开支	(13,166,314)	(8,931,326)
现金抵押资产增加	(530,000)	
现金抵押负债增加	540,000	
经营活动产生的现金	<u>105,056,197</u>	<u>313,033,643</u>
融资活动		
份额发行所得款项	11,996,286	137,139,287
份额赎回付款	(98,877,879)	(416,164,514)
已付分配	(20,172,495)	(30,855,767)
融资活动使用的现金	<u>(107,054,088)</u>	<u>(309,880,994)</u>
现金和现金等价物(减少)/增加净额	<u>(1,997,891)</u>	<u>3,152,649</u>
期初现金和现金等价物	3,802,759	4,069,899
期末现金和现金等价物	<u><u>1,804,868</u></u>	<u><u>7,222,548</u></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
债券			
上市投资			
百慕大			
中油燃气集团有限公司 4.7% 2026 年 6 月 30 日	457,000	347,142	0.07
合生创展集团有限公司 6.8% 2023 年 12 月 28 日	750,000	499,110	0.10
		846,252	0.17
英属维尔京群岛			
CHALCO HK INVESTMENT 2.1% 2026 年 7 月 28 日	1,234,000	1,098,630	0.22
CHINA CINDA 2020 I MNGMN 1.25% 2024 年 1 月 20 日	5,000,000	4,717,700	0.95
CHINA CINDA 2020 I MNGMN 1.875% 2026 年 1 月 20 日	1,175,000	1,023,707	0.21
CHINA CINDA 2020 I MNGMN 2% 2023 年 3 月 18 日	1,478,000	1,455,032	0.29
CHINA CINDA 2020 I MNGMN 3.125% 2030 年 3 月 18 日	700,000	540,078	0.11
CHINA CINDA 2020 I MNGMN 3.25% 2027 年 1 月 28 日	769,000	670,745	0.13
CHINA CINDA FINANCE 2017 3.875% 2023 年 2 月 8 日	3,000,000	2,984,550	0.60
中铝资本控股有限公司 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	2,499,000	2,435,850	0.49
CICC HK FINANCE 2016 2% 2026 年 1 月 26 日	1,384,000	1,256,561	0.25
CN HUANENG GP HK TREASURY 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	4,465,000	4,334,801	0.87
ENN CLEAN ENERGY 3.375% 2026 年 5 月 12 日	3,275,000	2,853,508	0.57
FORTUNE STAR BVI LTD 5.95% 2023 年 1 月 29 日	1,325,000	1,132,835	0.23

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
债券(续)			
上市投资(续)			
英属维尔京群岛(续)			
FORTUNE STAR BVI LTD 6.75% 2023 年 7 月 2 日	2,427,000	1,559,784	0.31
HKT CAPITAL NO 6 LTD 3% 2032 年 1 月 18 日	1,946,000	1,582,740	0.32
HUARONG FINANCE 4.875% 2026 年 11 月 22 日	2,050,000	1,684,875	0.34
HUARONG FINANCE 2019 2.125% 2023 年 9 月 30 日	3,064,000	2,882,244	0.58
HUARONG FINANCE 2019 2.5% 2023 年 2 月 24 日	1,192,000	1,169,066	0.23
HUARONG FINANCE 2019 3.25% 2024 年 11 月 13 日	3,912,000	3,472,017	0.70
HUARONG FINANCE 2019 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	2,214,000	1,674,935	0.34
HUARONG FINANCE II 5% 2025 年 11 月 19 日	700,000	599,837	0.12
JOY TRSR ASSETS HOLDINGS 3.5% 2029 年 9 月 24 日	1,324,000	1,022,539	0.21
LS FINANCE 2017 LTD 4.8% 2026 年 6 月 18 日	2,900,000	2,100,557	0.42
NAN FUNG TREASURY 5% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	5,151,000	3,896,010	0.78
新城环球有限公司 4.5% 2026 年 5 月 2 日	500,000	163,350	0.03
新城环球有限公司 4.8% 2024 年 12 月 15 日	200,000	89,128	0.02
新城环球有限公司 6.8% 2023 年 8 月 5 日	745,000	521,537	0.10
NWD FINANCE (BVI) LTD 可变债券 永 续债券 2049 年 12 月 31 日	3,529,000	3,368,148	0.68
POLY REAL ESTATE FINANCE 4.75% 2023 年 9 月 17 日	5,000,000	4,932,000	0.99
RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 5.9% 2025 年 3 月 5 日	300,000	130,590	0.03

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
债券(续)			
上市投资(续)			
英属维尔京群岛(续)			
RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 7.875% 2023 年 2 月 1 日	354,000	325,680	0.07
RKPF OVERSEAS 2020 A LTD 5.125% 2026 年 7 月 26 日	5,656,000	2,048,660	0.41
RKPF OVERSEAS 2020 A LTD 5.2% 2026 年 1 月 12 日	2,117,000	749,206	0.15
RONGSHI INTERNATIONAL FI 3.25% 2024 年 5 月 21 日	500,000	487,510	0.10
SF HLDNG INVESTMENT 2021 3.125% 2031 年 11 月 17 日	1,700,000	1,364,420	0.27
SF HOLDING INVESTMENT 2021 2.375% 2026 年 11 月 17 日	5,300,000	4,730,038	0.95
上港集团 BVI 发展有限公司 2.375% 2030 年 7 月 13 日	1,500,000	1,245,495	0.25
中化离岸资本有限公司 1.5% 2026 年 9 月 23 日	3,583,000	3,081,237	0.62
TSMC GLOBAL LTD 1.25% 2026 年 4 月 23 日	4,500,000	3,946,095	0.79
万达地产海外有限公司 6.875% 2023 年 7 月 23 日	1,041,000	838,286	0.17
万达地产海外有限公司 6.95% 2022 年 12 月 5 日	300,000	287,007	0.06
怡锦投资有限公司 2.8% 2026 年 8 月 18 日	3,103,000	2,844,024	0.57
YUNDA HOLDING INVESTMENT 2.25% 2025 年 8 月 19 日	2,967,000	2,623,273	0.53
		<u>79,924,285</u>	<u>16.06</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
债券(续)			
上市投资(续)			
开曼群岛			
AC ENERGY FIN INTERNATIONAL LTD 5.1% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	800,000	663,832	0.13
雅居乐集团控股有限公司 5.5% 2026 年 5 月 17 日	1,000,000	285,180	0.06
雅居乐集团控股有限公司 5.75% 2025 年 1 月 2 日	200,000	63,098	0.01
阿里巴巴集团控股有限公司 3.15% 2051 年 2 月 9 日	4,279,000	2,531,414	0.51
阿里巴巴集团控股有限公司 3.6% 2024 年 11 月 28 日	4,700,000	4,557,731	0.92
阿里巴巴集团控股有限公司 4.4% 2057 年 12 月 6 日	1,800,000	1,296,414	0.26
AYC FINANCE LTD 3.9% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	395,000	284,542	0.06
AYC FINANCE LTD 4.85% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	542,000	462,781	0.09
百度公司 3.875% 2023 年 9 月 29 日	3,200,000	3,165,952	0.64
CCBL CAYMAN 1 CORP 1.6% 2026 年 9 月 15 日	1,094,000	955,609	0.19
建业地产控股有限公司 7.65% 2023 年 8 月 27 日	1,320,000	421,397	0.09
CH OVS GRAND OCE FINANCE 2.45% 2026 年 2 月 9 日	1,374,000	1,159,216	0.23
中国宏桥集团有限公司 6.25% 2024 年 6 月 8 日	1,503,000	1,373,096	0.28
CHINA OVERSEAS FIN 4.75% 2028 年 4 月 26 日	302,000	274,615	0.06
CHINA OVERSEAS FIN. VI 5.95% 2024 年 5 月 8 日	3,571,000	3,573,571	0.72
中骏集团控股有限公司 5.95% 2024 年 9 月 29 日	1,737,000	343,196	0.07

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
债券(续)			
上市投资(续)			
开曼群岛(续)			
中骏集团控股有限公司 6% 2026 年 2 月 4 日	1,373,000	209,479	0.04
中骏集团控股有限公司 7% 2025 年 5 月 2 日	424,000	67,628	0.01
中骏集团控股有限公司 7.25% 2023 年 4 月 19 日	272,000	87,385	0.02
旭辉控股(集团)有限公司 4.45% 2026 年 8 月 17 日	500,000	98,760	0.02
旭辉控股(集团)有限公司 5.25% 2026 年 5 月 13 日	500,000	102,415	0.02
旭辉控股(集团)有限公司 5.5% 2023 年 1 月 23 日	2,667,000	2,013,718	0.40
旭辉控股(集团)有限公司 5.95% 2025 年 10 月 20 日	200,000	41,036	0.01
旭辉控股(集团)有限公司 6% 2025 年 7 月 16 日	319,000	72,493	0.01
旭辉控股(集团)有限公司 6.45% 2024 年 11 月 7 日	405,000	92,170	0.02
碧桂园控股有限公司 4.75% 2023 年 1 月 17 日	1,779,000	1,458,460	0.29
碧桂园控股有限公司 5.4% 2025 年 5 月 27 日	500,000	174,990	0.04
碧桂园控股有限公司 6.15% 2025 年 9 月 17 日	2,000,000	670,940	0.14
碧桂园控股有限公司 6.5% 2024 年 4 月 8 日	232,000	94,006	0.02
碧桂园控股有限公司 8% 2024 年 1 月 27 日	3,147,000	1,385,215	0.28
金鹰商贸集团有限公司 4.625% 2023 年 5 月 21 日	3,544,000	3,341,248	0.67
绿城中国控股有限公司 5.65% 2025 年 7 月 13 日	550,000	432,933	0.09

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
债券(续)			
上市投资(续)			
开曼群岛(续)			
绿城中国控股有限公司 4.7% 2025 年 4 月 29 日	641,000	505,775	0.10
健合(H&H)国际控股有限公司 5.625% 2024 年 10 月 24 日	1,650,000	1,324,719	0.27
HPHT FINANCE 21 II LTD 1.5% 2026 年 9 月 17 日	6,362,000	5,522,471	1.11
京东商城电子商务有限公司 3.875% 2026 年 4 月 29 日	200,000	190,024	0.04
合景泰富集团控股有限公司 5.95% 2025 年 8 月 10 日	457,000	84,303	0.02
合景泰富集团控股有限公司 6% 2024 年 1 月 14 日	475,000	169,608	0.03
合景泰富集团控股有限公司 6.3% 2026 年 2 月 13 日	3,317,000	540,704	0.11
LINK FINANCE CAYMAN 2009 2.75% 2032 年 1 月 19 日	1,500,000	1,232,355	0.25
龙湖集团控股有限公司 3.95% 2029 年 9 月 16 日	404,000	268,450	0.05
龙湖地产有限公司 4.5% 2028 年 1 月 16 日	2,691,000	2,011,146	0.40
MELCO RESORTS FINANCE 4.875% 2025 年 6 月 6 日	4,880,000	3,650,240	0.73
美高梅中国控股有限公司 4.75% 2027 年 2 月 1 日	1,694,000	1,317,153	0.26
美高梅中国控股有限公司 5.25% 2025 年 6 月 18 日	3,800,000	3,207,922	0.64
美高梅中国控股有限公司 5.875% 2026 年 5 月 15 日	200,000	163,550	0.03
当代置业(中国)有限公司 9.8% 2023 年 4 月 11 日	5,176,000	873,398	0.18
金辉控股(集团)有限公司 7.8% 2024 年 3 月 20 日	3,052,000	1,237,159	0.25
弘阳地产集团有限公司 7.3% 2024 年 5 月 21 日	897,000	62,171	0.01

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
债券(续)			
上市投资(续)			
开曼群岛(续)			
力高地产集团有限公司 11% 2023 年 8 月 6 日	349,497	68,428	0.01
金沙中国有限公司 2.55% 2027 年 3 月 8 日	1,000,000	794,010	0.16
金沙中国有限公司 4.375% 2030 年 6 月 18 日	2,000,000	1,583,160	0.32
金沙中国有限公司 5.125% 2025 年 8 月 8 日	3,478,000	3,158,789	0.63
金沙中国有限公司 5.4% 2028 年 8 月 8 日	3,403,000	2,873,663	0.58
金沙中国有限公司 WI 3.1% 2029 年 3 月 8 日	2,076,000	1,559,242	0.31
新城发展控股有限公司 6.15% 2023 年 4 月 15 日	600,000	477,774	0.10
瑞安房地产有限公司 5.5% 2025 年 3 月 3 日	650,000	438,438	0.09
瑞安房地产控股有限公司 6.15% 2024 年 8 月 24 日	200,000	153,118	0.03
瑞安房地产控股有限公司 5.5% 2026 年 6 月 29 日	2,566,000	1,521,484	0.31
新力控股(集团)有限公司 8.5% 2099 年 12 月 31 日	2,107,000	42,140	0.01
腾讯控股有限公司 2.39% 2030 年 6 月 3 日	3,000,000	2,364,810	0.48
腾讯控股有限公司 3.84% 2051 年 4 月 22 日	3,000,000	2,032,740	0.41
腾讯控股有限公司 SER REGS 3.8% 2025 年 2 月 11 日	5,000,000	4,855,150	0.98
腾讯音乐娱乐集团 2% 2030 年 9 月 3 日	2,658,000	1,943,423	0.39
腾讯音乐娱乐集团 1.375% 2025 年 9 月 3 日	2,500,000	2,212,150	0.44

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
债券(续)			
上市投资(续)			
开曼群岛(续)			
时代中国控股有限公司 5.75% 2027 年 1 月 14 日	200,000	20,482	0.00
时代中国控股有限公司 6.2% 2026 年 3 月 22 日	200,000	23,998	0.01
时代中国控股有限公司 6.75% 2025 年 7 月 8 日	400,000	51,996	0.01
永利澳门有限公司 4.875% 2024 年 10 月 1 日	700,000	570,010	0.11
永利澳门有限公司 5.5% 2026 年 1 月 15 日	200,000	152,552	0.03
永利澳门有限公司 5.625% 2028 年 8 月 26 日	1,243,000	850,299	0.17
禹洲地产股份有限公司 7.375% 2026 年 1 月 13 日	1,635,000	109,545	0.02
禹洲地产股份有限公司 7.7% 2025 年 2 月 20 日	1,907,000	127,082	0.03
禹洲地产股份有限公司 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	330,000	21,051	0.00
正荣地产集团有限公司 8% 2023 年 3 月 6 日	15,190,000	318,687	0.06
正荣地产集团有限公司 3% 2026 年 1 月 13 日	4,525,000	3,999,376	0.80
		86,439,265	17.37
中国			
中国建设银行股份有限公司 可变债券 2030 年 6 月 24 日	2,764,000	2,585,473	0.52
中国建设银行股份有限公司 可变债券 2029 年 2 月 27 日	2,000,000	1,978,660	0.40
中国工商银行 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	6,300,000	5,789,259	1.16

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
债券(续)			
上市投资(续)			
中国(续)			
温氏食品集团股份有限公司 2.349% 2025 年 10 月 29 日	2,259,000	1,979,110	0.40
浙江沪杭甬高速公路股份有限公司 1.638% 2026 年 7 月 14 日	3,523,000	3,126,909	0.63
		15,459,411	3.11
香港			
友邦保险控股有限公司 可变债券 永续 债券 2049 年 12 月 31 日	8,316,000	6,957,498	1.40
香港机场管理局 2.5% 2032 年 1 月 12 日	1,686,000	1,400,324	0.28
香港机场管理局 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	7,533,000	6,509,946	1.31
中国银行(香港)有限公司 可变债券 永续 债券 2049 年 12 月 29 日	5,000,000	5,016,950	1.01
交通銀行(香港) 有限公司 可变债券 2031 年 7 月 8 日	6,575,000	5,887,781	1.18
东亚银行有限公司 可变债券 2030 年 5 月 29 日	6,800,000	6,330,324	1.27
香港国泰航空有限公司 4.875% 2026 年 8 月 17 日	1,891,000	1,720,961	0.35
中铝国际香港有限公司 可变债券 永续 债券 2049 年 12 月 31 日	1,350,000	1,339,996	0.27
招银国际租赁管理有限公司 1.875% 2025 年 8 月 12 日	4,786,000	4,329,081	0.87
招银国际租赁管理有限公司 2% 2026 年 2 月 4 日	4,623,000	4,137,539	0.83
中国农化(香港)峰桥有限公司 4.625% 2023 年 3 月 14 日	2,000,000	1,998,640	0.40

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
债券(续)			
上市投资(续)			
香港			
中国农化(香港)峰桥有限公司 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	2,000,000	1,956,120	0.39
大新银行有限公司 可变债券 2031 年 11 月 2 日	1,188,000	1,062,048	0.21
FEC FINANCE LTD 5.1% 2024 年 1 月 21 日	1,225,000	1,181,929	0.24
GEMDALE EVER PROSPERITY 4.95% 2024 年 8 月 12 日	200,000	125,658	0.02
工银国际租赁财务有限公司 1.75% 2025 年 8 月 25 日	1,669,000	1,520,526	0.31
联想集团有限公司 5.831% 2028 年 1 月 27 日	2,110,000	2,017,730	0.41
联想集团有限公司 5.875% 2025 年 4 月 24 日	2,516,000	2,486,236	0.50
南洋商业银行 可变债券 2029 年 11 月 20 日	1,373,000	1,305,503	0.26
港华燃气(融资)有限公司 4% 2027 年 4 月 26 日	2,000,000	1,883,180	0.38
万科地产(香港)有限公司 3.15% 2025 年 5 月 12 日	1,387,000	1,194,665	0.24
万科地产(香港)有限公司 3.5% 2029 年 11 月 12 日	200,000	146,996	0.03
万科地产(香港)有限公司 3.975% 2027 年 11 月 9 日	231,000	188,209	0.04
万科地产(香港)有限公司 4.2% 2024 年 6 月 7 日	1,300,000	1,213,745	0.24
WESTWOOD GROUP HOLDING LTD 5.375% 2023 年 10 月 19 日	2,000,000	1,981,080	0.40
阳光城嘉世国际有限公司 8.25% 2023 年 11 月 25 日	1,900,000	110,884	0.02
阳光城嘉世国际有限公司 9.25% 2023 年 4 月 15 日	1,200,000	70,452	0.01

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
债券(续)			
上市投资(续)			
香港(续)			
仁恒地产(香港)有限公司 5.125% 2026 年 5 月 20 日	2,513,000	1,771,012	0.36
仁恒地产(香港)有限公司 6.8% 2024 年 2 月 27 日	1,100,000	943,030	0.19
		66,788,043	13.42
印度			
10 RENEW POWER SUBSIDIARY 4.5% 2028 年 7 月 14 日	661,000	503,133	0.10
AXIS BANK GIFT CITY 可变债券 永续 债券 2049 年 12 月 31 日	681,000	564,679	0.11
CANARA BANK LONDON 3.875% 2024 年 3 月 28 日	2,700,000	2,645,001	0.53
DELHI INTERNATIONAL AIRPORT 6.45% 2029 年 6 月 4 日	477,000	401,515	0.08
DELHI INTERNATIONAL AIRPORT LIMITED 6.125% 2026 年 10 月 31 日	714,000	660,214	0.13
GMR HYDERABAD INTERNATIONAL 4.75% 2026 年 2 月 2 日	1,100,000	989,868	0.20
GMR HYDERABAD INTERNATIONAL 5.375% 2024 年 4 月 10 日	2,007,000	1,941,572	0.39
HDFC BANK LTD 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	1,186,000	966,151	0.19
HPCL-MITTAL ENERGY LTD 5.25% 2027 年 4 月 28 日	1,100,000	978,901	0.20
HPCL-MITTAL ENERGY LTD 5.45% 2026 年 10 月 22 日	3,808,000	3,522,895	0.71
JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125% 2031 年 5 月 18 日	4,100,000	2,996,967	0.60

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
债券(续)			
上市投资(续)			
印度(续)			
JSW INFRASTRUCTURE 4.95% 2029 年 1 月 21 日	1,294,000	1,018,947	0.21
JSW STEEL LTD 3.95% 2027 年 4 月 5 日	915,000	736,017	0.15
JSW STEEL LTD 5.375% 2025 年 4 月 4 日	1,000,000	938,360	0.19
MANAPPURAM FINANCE LTD 5.9% 2023 年 1 月 13 日	2,700,000	2,677,698	0.54
MUTHOOT FINANCE LTD 4.4% 2023 年 9 月 2 日	2,700,000	2,636,334	0.53
ONGC VIDESH LTD 4.625% 2024 年 7 月 15 日	800,000	788,400	0.16
POWER FINANCE CORP LTD 6.15% 2028 年 12 月 6 日	4,712,000	4,665,021	0.94
REC LTD 2.25% 2026 年 9 月 1 日	2,000,000	1,737,660	0.35
RENEW POWER PVT LTD 5.875% 2027 年 3 月 5 日	4,026,000	3,635,156	0.73
SHRIRAM TRANSPORT FIN 4.15% 2025 年 7 月 18 日	1,629,000	1,455,740	0.29
SHRIRAM TRANSPORT FIN 4.4% 2024 年 3 月 13 日	1,700,000	1,593,155	0.32
SHRIRAM TRANSPORT FIN 5.1% 2023 年 7 月 16 日	1,956,000	1,899,550	0.38
SHRIRAM TRANSPORT FIN 5.95% 2022 年 10 月 24 日	1,500,000	1,496,100	0.30
YES BANK IFSC BANKING 3.75% 2023 年 2 月 6 日	5,829,000	5,736,669	1.15
		47,185,703	9.48

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
债券(续)			
上市投资(续)			
印尼			
FREEPORT INDONESIA PT 6.2% 2052 年 4 月 14 日	480,000	370,838	0.07
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR 4.745% 2051 年 6 月 9 日	2,703,000	1,728,623	0.35
印度尼西亚共和国(政府) 3.55% 2051 年 6 月 9 日	2,823,000	1,996,284	0.40
印度尼西亚共和国(政府) 4.2% 2050 年 10 月 15 日	7,355,000	5,631,576	1.13
印度尼西亚共和国(政府) 5.45% 2052 年 9 月 20 日	4,986,000	4,615,441	0.93
PT ADARO INDONESIA 4.25% 2024 年 10 月 31 日	5,773,000	5,498,494	1.11
PT PAKUWON JATI 4.875% 2028 年 4 月 29 日	3,341,000	2,743,162	0.55
PT PERTAMINA (PERSERO) 2.3% 2031 年 2 月 9 日	4,783,000	3,630,297	0.73
SARANA MULTI INFRASTRUKTUR 2.05% 2026 年 5 月 11 日	1,940,000	1,699,246	0.34
		27,913,961	5.61
泽西岛			
中国西部水泥有限公司 4.95% 2026 年 7 月 8 日	4,454,000	3,167,106	0.64
		3,167,106	0.64

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
债券(续)			
上市投资(续)			
马来西亚			
PETRONAS CAPITAL LTD 3.404% 2061 年 4 月 28 日	4,050,000	2,789,275	0.56
		<u>2,789,275</u>	<u>0.56</u>
毛里求斯			
CA MAGNUM HOLDINGS 5.375% 2026 年 10 月 31 日	1,500,000	1,270,920	0.26
CLEAN RENEWABLE POWER 4.25% 2027 年 3 月 25 日	962,000	721,794	0.14
CLIFFTON LTD 6.25% 2025 年 10 月 25 日	1,350,000	1,186,205	0.24
GREENKO INVESTMENT CO 4.875% 2023 年 8 月 16 日	3,600,000	3,442,248	0.69
GREENKO MAURITIUS LTD 6.25% 2023 年 2 月 21 日	2,609,000	2,566,760	0.52
GREENKO SOLAR MAURITIUS 5.95% 2026 年 7 月 29 日	250,000	210,440	0.04
GREENKO WIND PROJECTS MU 5.5% 2025 年 4 月 6 日	3,563,000	3,148,409	0.63
NETWORK I2I LTD 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	2,600,000	2,394,002	0.48
UPL CORP LTD 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	1,382,000	1,006,552	0.20
		<u>15,947,330</u>	<u>3.20</u>
蒙古			
蒙古(政府)国际债券 8.75% 2024 年 3 月 9 日	500,000	455,525	0.09
		<u>455,525</u>	<u>0.09</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
债券(续)			
上市投资(续)			
荷兰			
ICTSI TREASURY BV 3.5% 2031 年 11 月 16 日	4,569,000	3,673,567	0.74
JABABEKA INTERNATIONAL 6.5% 2023 年 10 月 5 日	7,751,000	4,386,834	0.88
MINEJESA CAPITAL BV 4.625% 2030 年 8 月 10 日	800,000	656,616	0.13
		<hr/>	
		8,717,017	1.75
		<hr/>	
巴基斯坦			
巴基斯坦伊斯兰共和国(政府) 6.875% 2027 年 12 月 5 日	3,600,000	1,376,172	0.28
巴基斯坦伊斯兰共和国(政府) 6% 2026 年 4 月 8 日	1,148,000	451,267	0.09
		<hr/>	
		1,827,439	0.37
		<hr/>	
菲律宾			
DEV BANK PHILIPPINES 2.375% 2031 年 3 月 11 日	3,780,000	2,870,948	0.58
GLOBE TELECOM INC 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	2,176,000	1,929,633	0.39
PETRON CORP 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	219,000	205,507	0.04
		<hr/>	
		5,006,088	1.01
		<hr/>	
新加坡			
ABJA INVESTMENT CO 5.45% 2028 年 1 月 24 日	2,838,000	2,636,758	0.53
AEV INTERNATIONAL PTE 4.2% 2030 年 1 月 16 日	640,000	591,648	0.12
CONTINUUM ENERGY LEVANTE 4.5% 2027 年 2 月 9 日	1,400,000	1,107,968	0.22

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
债券(续)			
上市投资(续)			
新加坡(续)			
星展集团控股有限公司 可变债券 2031 年 3 月 10 日	8,000,000	7,049,360	1.42
星展集团控股有限公司 可变债券 永续债 券 2049 年 12 月 31 日	2,769,000	2,534,133	0.51
INDIKA ENERGY 5.875% 2024 年 11 月 9 日	4,330,000	4,190,444	0.84
JOLLIBEE WORLDWIDE PTE LTD 4.125% 2026 年 1 月 24 日	3,200,000	3,106,048	0.62
LLPL CAPITAL PTE LTD 6.875% 2039 年 2 月 4 日	3,200,000	2,214,634	0.45
LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.25% 2024 年 6 月 19 日	319,000	235,068	0.05
MEDCO OAK TREE PTE LTD 7.375% 2026 年 5 月 14 日	4,422,000	3,868,189	0.78
华侨银行 4.25% 2024 年 6 月 19 日	2,550,000	2,517,666	0.51
华侨银行 可变债券 2030 年 9 月 10 日	3,850,000	3,449,446	0.69
华侨银行 可变债券 2032 年 6 月 15 日	3,641,000	3,468,235	0.70
新加坡航空有限公司 3% 2026 年 7 月 20 日	278,000	259,724	0.05
新加坡航空有限公司 3.375% 2029 年 1 月 19 日	293,000	257,069	0.05
THETA CAPITAL PTE LTD 6.75% 2026 年 10 月 31 日	1,810,000	1,156,427	0.23
THETA CAPITAL PTE LTD 8.125% 2025 年 1 月 22 日	1,069,000	835,146	0.17
TML HOLDINGS PTE LTD 4.35% 2026 年 6 月 9 日	3,986,000	3,358,165	0.67
UNITED OVERSEAS BANK LTD 可变债 券 2031 年 3 月 16 日	6,608,000	5,805,458	1.17

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
债券(续)			
上市投资(续)			
新加坡(续)			
UNITED OVERSEAS BANK LTD 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	5,000,000	4,832,050	0.97
		<u>53,473,636</u>	<u>10.75</u>
韩国			
HANA BANK 1.25% 2026 年 12 月 16 日	4,112,000	3,544,914	0.71
HANA BANK 3.25% 2027 年 3 月 30 日	4,302,000	3,996,988	0.80
HANWHA LIFE INSURANCE 可变债券 2032 年 2 月 4 日	8,062,000	6,905,748	1.39
KOOKMIN BANK 2.375% 2027 年 2 月 15 日	4,957,000	4,463,680	0.90
KOOKMIN BANK 2.5% 2030 年 11 月 4 日	1,033,000	820,873	0.17
KOREA ELECTRIC POWER CO 3.625% 2025 年 6 月 14 日	1,087,000	1,049,194	0.21
KOREA NATIONAL OIL CORP 2.125% 2027 年 4 月 18 日	2,054,000	1,806,719	0.36
KT CORP 2.5% 2026 年 7 月 18 日	800,000	731,912	0.15
KT CORP 4% 2025 年 8 月 8 日	2,210,000	2,148,805	0.43
SHINHAN BANK 4.375% 2032 年 4 月 13 日	2,705,000	2,445,996	0.49
SHINHAN CARD CO LTD 2.5% 2027 年 1 月 27 日	4,544,000	3,996,039	0.80
SHINHAN FINANCIAL GROUP 可变债券 2030 年 2 月 5 日	1,418,000	1,330,722	0.27
SHINHAN FINANCIAL GROUP 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	1,237,000	1,228,242	0.25
SK HYNIX INC 2.375% 2031 年 1 月 19 日	5,199,000	3,889,632	0.78
		<u>38,359,464</u>	<u>7.71</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
债券(续)			
上市投资(续)			
泰国			
BANGKOK BANK PCL/HK 可变债券 永 续债券 2049 年 12 月 31 日	4,371,000	3,887,699	0.78
EXPORT-IMPORT BANK THAILND 3.902% 2027 年 6 月 2 日	1,781,000	1,690,454	0.34
GC TREASURY CENTRE CO 5.2% 2052 年 3 月 30 日	900,000	728,307	0.15
MINOR INTERNATIONAL PCL 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	5,193,000	5,070,289	1.02
THAIOIL TRSRY CENTER 5.375% 2048 年 11 月 20 日	2,618,000	2,107,595	0.42
		13,484,344	2.71
土耳其			
HYUNDAI ASSAN OTOMOTIV 1.625% 2026 年 7 月 12 日	4,314,000	3,681,266	0.74
		3,681,266	0.74
英国			
PRUDENTIAL PLC 可变债券 2033 年 11 月 3 日	1,612,000	1,238,338	0.25
VEDANTA RESOURCES 13.875% 2024 年 1 月 21 日	4,392,000	3,692,838	0.74
VEDANTA RESOURCES LTD 7.125% 2023 年 5 月 31 日	1,573,000	1,459,728	0.29
		6,390,904	1.28

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
债券(续)			
上市投资(续)			
美国			
BOC AVIATION USA CORP 1.625% 2024 年 4 月 29 日	3,300,000	3,113,748	0.63
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 2.1% 2028 年 9 月 15 日	3,366,000	2,663,213	0.53
PERIAMA HOLDINGS LLC/DE 5.95% 2026 年 4 月 19 日	2,041,000	1,775,139	0.35
TSMC ARIZONA CORP 1.75% 2026 年 10 月 25 日	1,531,000	1,346,407	0.27
美国国债 2.25% 2052 年 2 月 15 日	2,250,000	1,635,821	0.33
美国国债 2.875% 2052 年 5 月 15 日	12,825,000	10,727,912	2.16
		21,262,240	4.27
未上市但有报价的投资			
印尼			
PT PERTAMINA (PERSERO) 4.15% 2060 年 2 月 25 日	1,548,000	1,004,187	0.20
		1,004,187	0.20
债券(合计)		500,122,741	100.50
单位信托			
非上市投资			
香港			
HSBC ALL CHINA BOND ZC-USD	150,000	1,608,150	0.32
		1,608,150	0.32

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
单位信托			
未上市投资(续)			
单位信托(合计)		1,608,150	0.32
债券期货			
US 2YR NOTE (CBT) 30/12/2022	(1)	216	-
US 2YR NOTE (CBT) 30/12/2022	(48)	11,322	-
US 5YR NOTE (CBT) 30/12/2022	(47)	16,156	-
US 5YR NOTE (CBT) 30/12/2022	(2)	516	-
US 10YR NOTE (CBT) 20/12/2022	(21)	7,875	-
US 10YR NOTE (CBT) 20/12/2022	(21)	2,625	-
US 10YR NOTE (CBT) 20/12/2022	(41)	21,781	-
US 10YR NOTE (CBT) 20/12/2022	(41)	28,188	0.01
US 10YR ULTRA FUT 20/12/2022	(40)	(23,750)	-
US LONG BOND(CBT) 20/12/2022	(19)	(7,719)	-
		57,210	0.01
外币远期合同		943,014	0.19
掉期		1,083,210	0.22
投资总额(投资成本合计: 595,019,704 美元)		503,814,325	101.24
其他净负债		(6,152,195)	(1.24)
2022 年 9 月 30 日的资产净值总额		497,662,130	100.00

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		
债务证券		
上市债券		
澳大利亚	-	0.47
百慕大	0.17	0.30
英属维尔京群岛	16.06	17.62
开曼群岛	17.37	20.22
中国	3.11	1.72
香港	13.42	11.85
印度	9.48	8.10
印尼	5.61	5.93
泽西岛	0.64	0.31
马来西亚	0.56	0.11
毛里求斯	3.20	3.61
蒙古	0.09	0.08
荷兰	1.75	1.58
巴基斯坦	0.37	0.95
菲律宾	1.01	1.61
新加坡	10.75	11.78
韩国	7.71	5.87
泰国	2.71	1.53
土耳其	0.74	0.56
英国	1.28	1.32
美国	4.27	3.48
	<hr/>	<hr/>
	100.30	99.00
	<hr/>	<hr/>

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		
债务证券(续)		
未上市但有报价的债券		
开曼群岛	-	0.47
印尼	0.20	0.14
	<u>0.20</u>	<u>0.61</u>
单位信托		
上市投资		
爱尔兰	-	2.48
	<u>-</u>	<u>2.48</u>
未上市但有报价的投资		
香港	0.32	0.25
	<u>0.32</u>	<u>0.25</u>

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		
债券期货	0.01	(0.08)
外币远期合同	0.19	0.07
掉期	0.22	-
投资总额	101.24	102.33
其他净负债	(1.24)	(2.33)
资产净值总额	100.00	100.00

金融衍生工具详情(未经审计) 2022 年 4 月 1 日起至 2022 年 9 月 30 日止期间

外汇远期合同

截至 2022 年 9 月 30 日，本基金持有未平仓的外汇远期合同如下：

货币/卖出金额	货币/ 买入金额	结算日	交易对手	公允价值 美元
金融资产：				
15,669 澳元	10,174 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	96
331,110 澳元	214,285 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	1,320
281,634 加元	205,543 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	594
368,114 加元	268,952 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	1,070
66,397 加元	48,513 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	195
114,898 离岸人民币	16,158 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	35
18,000,000	2,600,761 美元	2022 年 10 月 31 日	Westpac Banking Corporation	74,701
18,300,000 离岸人民币	2,664,016 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	95,807
2,102,462	295,664 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	631
23,704 离岸人民币	3,333 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	7
4,100,000 离岸人民币	596,855 美元	2022 年 10 月 31 日	State Street Bank and Trust	21,464
2,600,000 欧元	2,587,965 美元	2022 年 10 月 31 日	Westpac Banking Corporation	35,616
2,600,000 欧元	2,635,027 美元	2022 年 10 月 31 日	Westpac Banking Corporation	82,650
2,700,000 欧元	2,706,623 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	56,095
28,903 欧元	28,376 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	3

金融衍生工具详情(未经审计)(续) 2022 年 4 月 1 日起至 2022 年 9 月 30 日止期间

外汇远期合同(续)

货币/卖出金额	货币/ 买入金额	结算日	交易对手	公允价值 美元
金融资产：				
5,300,000 欧元	5,339,530 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	136,625
38,914,200,000 印尼盾	2,600,000 美元	2022 年 10 月 31 日	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	46,631
380,000,000 日元	2,647,172 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	14,576
310,341,350 菲律宾比索	5,500,000 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	209,825
61,908 新加坡元	43,197 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	40
1,396,766 美元	10,011,998 离岸人民币	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	8,160
14 美元	100 离岸人民币	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	-
14 美元	98 离岸人民币	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	-
20,590,322 美元	19,063,189 英镑	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	701,792
2,246,194 美元	2,331,666 欧元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	42,604
24,279,785 美元	174,037,183 离岸人民币	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	141,851
248 美元	256 欧元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	4
2,500,000 美元	204,712,500 印尼盾	2022 年 10 月 31 日	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	8,703
2,548,432 美元	2,600,000 欧元	2022 年 10 月 31 日	Australia and New Zealand Bank Melbourne	3,884
275,826 美元	1,977,115 离岸人民币	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	1,612

金融衍生工具详情(未经审计)(续) 2022 年 4 月 1 日起至 2022 年 9 月 30 日止期间

外汇远期合同(续)

货币/卖出金额	货币/ 买入金额	结算日	交易对手	公允价值 美元
金融资产：				
3,472,253 美元	4,985,579 新加坡元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	3,201
845 美元	784 英镑	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	31
				1,689,823
金融负债：				
1,434,058 离岸人民币	200,457 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	(777)
17,500,000 离岸人民币	2,451,537 美元	2022 年 11 月 30 日	HSBC Markets Treasury Services	(5,811)
423,928 离岸人民币	59,258 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	(230)
1,050,000 英镑	1,171,969 美元	2022 年 11 月 30 日	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	(1,045)
1,200,000 英镑	1,296,515 美元	2022 年 11 月 30 日	State Street Bank and Trust Company	(43,868)
231,306 英镑	258,235 美元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	(139)
14,909,457 美元	20,344,446 加元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	(104,376)
21,624,350 美元	33,359,328 澳元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	(167,946)
2,498,615 美元	2,500,000 欧元	2022 年 10 月 31 日	State Street Bank and Trust Company	(44,336)
2,520,468 美元	360,000,000 日元	2022 年 11 月 30 日	HSBC Markets Treasury Services	(17,760)

金融衍生工具详情(未经审计)(续) 2022 年 4 月 1 日起至 2022 年 9 月 30 日止期间

外汇远期合同(续)

货币/卖出金额	货币/ 买入金额	结算日	交易对手	公允价值 美元
金融负债(续):				
2,597,917 美元	2,600,000 欧元	2022 年 10 月 31 日	Westpac Banking Corporation	(45,469)
2,600,000 美元	39,429,000,000 印尼盾	2022 年 10 月 31 日	Australia and New Zealand Bank Melbourne	(13,015)
2,650,151 美元	380,000,000 日元	2022 年 10 月 31 日	BNP Paribas SA	(17,508)
2,657,672 美元	2,700,000 欧元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	(7,160)
2,790,483 美元	2,800,000 欧元	2022 年 10 月 31 日	State Street Bank and Trust Company	(41,712)
5,024,738 美元	35,000,000 离岸人民币	2022 年 10 月 31 日	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	(113,008)
5,500,000 美元	315,810,000 菲律宾比索	2022 年 10 月 31 日	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	(116,292)
818,539 美元	1,262,739 澳元	2022 年 10 月 31 日	HSBC Markets Treasury Services	(6,357)
				(746,809)

金融衍生工具详情(未经审计)(续) 2022 年 4 月 1 日起至 2022 年 9 月 30 日止期间

期货合同

截至 2022 年 9 月 30 日，本基金持有未平仓的期货合同如下：

说明	标的资产	交易对手	公允价值 美元
金融资产：			
US 10YR NOTE (CBT) 20/12/2022	US Treasury Note 3.25% 30Jun2029	HSBC BANK PLC	7,875
US 10YR NOTE (CBT) 20/12/2022	US Treasury Note 3.25% 30Jun2029	HSBC BANK PLC	2,625
US 10YR NOTE (CBT) 20/12/2022	US Treasury Note 3.25% 30Jun2029	HSBC BANK PLC	21,781
US 10YR NOTE (CBT) 20/12/2022	US Treasury Note 3.25% 30Jun2029	HSBC BANK PLC	28,188
US 2YR NOTE (CBT) 30/12/2022	US Treasury Note 4.25% 30Sep2024	HSBC BANK PLC	216
US 2YR NOTE (CBT) 30/12/2022	US Treasury Note 4.25% 30Sep2024	HSBC BANK PLC	11,322
US 5YR NOTE (CBT) 30/12/2022	US Treasury Note 1.875% 28Feb2027	HSBC BANK PLC	16,156
US 5YR NOTE (CBT) 30/12/2022	US Treasury Note 1.875% 28Feb2027	HSBC BANK PLC	516
			<hr/> 88,679 <hr/>
金融负债：			
US LONG BOND(CBT) 20/12/2022	US Treasury Note 4.375% 15Feb2038	HSBC BANK PLC	(7,719)
US 10YR ULTRA FUT 20/12/2022	US Treasury Note 10 - year 6%	HSBC BANK PLC	(23,750)
			<hr/> (31,469) <hr/>

金融衍生工具详情(未经审计)(续) 2022 年 4 月 1 日起至 2022 年 9 月 30 日止期间

信用违约掉期

截至 2022 年 9 月 30 日，本基金持有的信用违约掉期如下：

说明	标的资产	交易对手	公允价值 美元
金融资产：			
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 44 6,965,000.00 USD 06/07/2022 20/06/2027	INDONESIA (REPUBLIC OF) 4.125% 15 JANUARY 2025	J.P. Morgan Securities PLC, London	128,811
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 45 2,857,000.00 USD 07/07/2022 20/06/2027	INDONESIA (REPUBLIC OF) 4.125% 15 JANUARY 2025	BNP Paribas, Hong Kong	52,837
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 47 13,000,000.00 USD 15/07/2022 20/06/2027	PHILIPPINES (REPUBLIC OF) 10.625% 16 MARCH 2025	J.P. Morgan Securities PLC	93,677
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 50 3,750,000.00 USD 27/09/2022 20/12/2027	INDONESIA (REPUBLIC OF) 4.125% 15 JANUARY 2025	HSBC Ltd, Hong Kong	96,603
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 51 4,150,000.00 USD 27/09/2022 20/12/2027	iTraxx Asia ex-Japan index Series 38	HSBC Ltd, Hong Kong	153,439
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 52 3,750,000.00 USD 27/09/2022 20/12/2027	INDONESIA (REPUBLIC OF) 4.125% 15 JANUARY 2025	BNP Paribas, Hong Kong	96,603

金融衍生工具详情(未经审计)(续) 2022 年 4 月 1 日起至 2022 年 9 月 30 日止期间

信用违约掉期(续)

说明	标的资产	交易对手	公允价值 美元
金融资产：			
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 53 4,150,000.00 USD 27/09/2022 20/12/2027	iTraxx Asia ex-Japan index Series 38 INDONESIA	BNP Paribas, Hong Kong	153,439
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 54 1,750,000.00 USD 29/09/2022 20/12/2027	(REPUBLIC OF) 4.125% 15 JANUARY 2025	BNP Paribas, Hong Kong	45,275
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 55 2,075,000.00 USD 29/09/2022 20/12/2027			72,180
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 56 2,075,000.00 USD 30/09/2022 20/12/2027			68,774
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 57 1,750,000.00 USD 30/09/2022 20/12/2027	INDONESIA (REPUBLIC OF) 4.125% 15 JANUARY 2025	HSBC Ltd, Hong Kong	45,323
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 58 2,075,000.00 USD 03/10/2022 20/12/2027			76,249
			1,083,210

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	截至 2022 年 3 月 31 日 美元	截至 2021 年 3 月 31 日 美元	截至 2020 年 3 月 31 日 美元
总资产净值	497,633,880	705,150,383	1,451,459,571	1,020,461,121

(b) 份额净值(按《香港财务报告准则》计算)

	计价货币	截至 2022 年 9 月 30 日	截至 2022 年 3 月 31 日	截至 2021 年 3 月 31 日	截至 2020 年 3 月 31 日
每份额资产净值					
- AC 类 - 美元	美元	8.386	9.690	11.275	10.090
- AM2 类 - 美元	美元	6.618	7.922	9.674	9.094
- AM2 类 - 人民币	人民币	6.880	7.332	9.258	9.399
- AM30 类 - 人民币	人民币	6.530	7.821	9.540	8.959
- AM2 类 - 港元	港元	6.696	7.996	9.695	9.084
- AM2 类 - 欧元	欧元	7.154	7.536	8.712	8.755
- AM30 类 - 欧元	欧元	6.445	7.729	9.451	8.909
- AM2 类 - 澳元	澳元	7.868	8.062	9.689	11.350
- AM30 类 - 澳元	澳元	6.478	7.770	9.225	8.927
- AM2 类 - 加元	加元	6.910	7.517	9.496	9.828
- AM30 类 - 加元	加元	6.483	7.767	9.488	8.914
- AM30 类 - 英镑	英镑	6.450	7.730	9.446	8.887
- AM30 类 - 新加坡元	新加坡元	6.489	7.771	9.495	8.933
- BC 类 - 港元	港元	8.265	9.527	11.001	-
- BC 类 - 人民币	人民币	8.230	8.480	10.209	-
- BC 类 - 美元	美元	8.162	9.430	10.971	-
- BCO 类 - 人民币	人民币	8.567	9.861	11.220	-
- BM2 类 - 港元	港元	7.264	8.675	10.519	-
- BM2 类 - 人民币	人民币	7.257	7.733	9.757	-
- BM2 类 - 美元	美元	7.175	8.588	10.488	-
- BM30 类 - 澳元	澳元	7.150	8.575	10.500	-
- BM30 类 - 人民币	人民币	7.180	8.609	10.518	-
- IM2 类 - 美元	美元	6.836	8.160	9.908	-
- IC 类 - 美元	美元	7.407	8.534	-	-

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)

AC 类 – 美元				
截至下列日期止的财务期间/年度	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	8.386	10.664	8.386	10.664
2022 年 3 月 31 日	9.316	11.444	9.316	11.444
2021 年 3 月 31 日	9.896	11.518	9.896	11.518
AM2 类 – 美元				
截至下列日期止的财务期间/年度	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	6.618	8.840	6.618	8.840
2022 年 3 月 31 日	7.651	9.746	7.651	9.746
2021 年 3 月 31 日	8.919	10.003	8.919	10.003
AM2 类 – 人民币				
截至下列日期止的财务期间/年度	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	6.808	8.216	6.808	8.216
2022 年 3 月 31 日	7.108	9.287	7.108	9.287
2021 年 3 月 31 日	9.169	10.130	9.169	10.130
AM30 类 – 人民币				
截至下列日期止的财务期间/年度	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	8.732	6.530	8.732
2022 年 3 月 31 日	7.560	9.622	7.560	9.622
2021 年 3 月 31 日	8.782	9.873	8.782	9.873

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	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	6.696	8.886	6.696	8.886
2022 年 3 月 31 日	7.717	9.754	7.717	9.754
2021 年 3 月 31 日	8.906	9.990	8.906	9.990
截至下列日期止的财务期间/年度	AM2 类 – 欧元			
	买入价		卖出价	
	最低 欧元	最高 欧元	最低 欧元	最高 欧元
2022 年 9 月 30 日	7.121	8.274	7.121	8.274
2022 年 3 月 31 日	7.371	8.714	7.371	8.714
2021 年 3 月 31 日	8.493	9.194	8.493	9.194
截至下列日期止的财务期间/年度	AM30 类 – 欧元			
	买入价		卖出价	
	最低 欧元	最高 欧元	最低 欧元	最高 欧元
2022 年 9 月 30 日	6.445	8.618	6.445	8.618
2022 年 3 月 31 日	7.465	9.508	7.465	9.508
2021 年 3 月 31 日	8.735	9.785	8.735	9.785
截至下列日期止的财务期间/年度	AM2 类 – 澳元			
	买入价		卖出价	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2022 年 9 月 30 日	7.489	9.423	7.489	9.423
2022 年 3 月 31 日	7.978	10.230	7.978	10.230
2021 年 3 月 31 日	9.445	11.514	9.445	11.514

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)

AM30 类 – 澳元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入价		卖出价	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2022 年 9 月 30 日	6.478	8.670	6.478	8.670
2022 年 3 月 31 日	7.507	9.563	7.507	9.563
2021 年 3 月 31 日	8.754	9.826	8.754	9.826
AM2 类 – 加元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入价		卖出价	
	最低 加元	最高 加元	最低 加元	最高 加元
2022 年 9 月 30 日	6.749	8.511	6.749	8.511
2022 年 3 月 31 日	7.408	9.390	7.408	9.390
2021 年 3 月 31 日	9.181	10.117	9.181	10.117
AM30 类 – 加元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入价		卖出价	
	最低 加元	最高 加元	最低 加元	最高 加元
2022 年 9 月 30 日	6.483	8.665	6.483	8.665
2022 年 3 月 31 日	7.504	9.555	7.504	9.555
2021 年 3 月 31 日	8.744	9.808	8.744	9.808
AM30 类 – 英镑				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入价		卖出价	
	最低 英镑	最高 英镑	最低 英镑	最高 英镑
2022 年 9 月 30 日	6.450	8.625	6.450	8.625
2022 年 3 月 31 日	7.468	9.515	7.468	9.515
2021 年 3 月 31 日	8.712	9.767	8.712	9.767

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	AM30 类 – 新加坡元			
	买入价		卖出价	
	最低 新加坡元	最高 新加坡元	最低 新加坡元	最高 新加坡元
2022 年 9 月 30 日	6.489	8.673	6.489	8.673
2022 年 3 月 31 日	7.508	9.565	7.508	9.565
2021 年 3 月 31 日	8.759	9.821	8.759	9.821
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	8.264	10.435	8.264	10.435
2022 年 3 月 31 日	9.149	11.157	9.149	11.157
2021 年 3 月 31 日	9.949	11.210	9.949	11.210
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	7.993	9.370	7.993	9.370
2022 年 3 月 31 日	8.183	10.244	8.183	10.244
2021 年 3 月 31 日	10.000	10.821	-	10.821
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	8.162	10.379	8.162	10.379
2022 年 3 月 31 日	9.066	11.135	9.066	11.135
2021 年 3 月 31 日	9.949	11.206	9.949	11.206

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)

BCO 类 – 人民币				
截至下列日期止的财务期间/年度	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	8.566	10.792	8.566	10.792
2022 年 3 月 31 日	9.470	11.444	9.470	11.444
2021 年 3 月 31 日	10.000	11.442	10.000	11.442
BM2 类 – 港元				
截至下列日期止的财务期间/年度	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	7.264	9.635	7.264	9.635
2022 年 3 月 31 日	8.369	10.584	8.369	10.584
2021 年 3 月 31 日	9.947	10.842	9.947	10.842
BM2 类 – 人民币				
截至下列日期止的财务期间/年度	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	7.185	8.665	7.185	8.665
2022 年 3 月 31 日	7.497	9.791	7.497	9.791
2021 年 3 月 31 日	9.666	10.686	9.666	10.686
BM2 类 – 美元				
截至下列日期止的财务期间/年度	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	7.175	9.584	7.175	9.584
2022 年 3 月 31 日	8.295	10.567	8.295	10.567
2021 年 3 月 31 日	9.949	10.846	9.949	10.846

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	BM30 类 – 澳元			
	买入价		卖出价	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2022 年 9 月 30 日	7.150	9.571	7.150	9.571
2022 年 3 月 31 日	8.285	10.561	8.285	10.561
2021 年 3 月 31 日	10.000	10.874	10.000	10.874
截至下列日期止的财务期间/年度	BM30 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	7.181	9.614	7.181	9.614
2022 年 3 月 31 日	8.327	10.602	8.327	10.602
2021 年 3 月 31 日	9.986	10.894	9.986	10.894
截至下列日期止的财务期间/年度	IM2 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	6.836	9.093	6.836	9.093
2022 年 3 月 31 日	7.879	9.994	7.879	9.994
2021 年 3 月 31 日	9.867	10.222	9.867	10.222
截至下列日期止的财务期间/年度	IC 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	7.407	9.380	7.407	9.380
2022 年 3 月 31 日	8.203	10.035	8.203	10.035
2021 年 3 月 31 日	-	-	-	-

分派披露

AM2类 – 美元	除息日期	支付日期	每单位分派金额 美元	总分派金额 美元
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0436	1,411,012.75
2022年8月派息	2022年8月31日	2022年9月9日	0.0443	1,468,318.21
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0443	1,496,701.92
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0427	1,496,403.08
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0435	1,561,463.65
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0354	1,332,498.87

AM2类 – 人民币	除息日期	支付日期	每单位分派金额 人民币	总分派金额 人民币
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0444	170,562.70
2022年8月派息	2022年8月31日	2022年9月9日	0.0439	178,373.68
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0434	176,342.09
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0416	184,348.04
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0422	226,603.32
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月13日	0.0327	175,590.72

AM30类 – 人民币	除息日期	支付日期	每单位分派金额 人民币	总分派金额 人民币
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0399	1,035,971.45
2022年8月派息	2022年8月31日	2022年9月9日	0.0406	1,088,824.93
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0473	1,265,945.68
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0472	1,332,711.68
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0602	1,730,132.26
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月13日	0.0500	1,527,729.42

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	0.0441	8,500,312.03
2022年8月派息	2022年8月31日	2022年9月9日	0.0448	8,757,602.51
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0448	8,931,367.88
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0432	8,771,093.24
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0440	9,106,656.19
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0357	7,484,715.99

分派披露(续)

AM3H类 – 欧元	除息日期	支付日期	每单位分派金额 欧元	总分派金额 欧元
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0461	13,854.43
2022年8月派息	2022年8月31日	2022年9月9日	0.0460	13,824.38
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0464	13,944.59
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0422	12,729.50
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0437	13,793.77
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0336	11,793.47

AM3O类 – 欧元	除息日期	支付日期	每单位分派金额 欧元	总分派金额 欧元
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0297	10,561.67
2022年8月派息	2022年8月31日	2022年9月9日	0.0276	9,813.80
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0307	11,283.03
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0313	11,503.55
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0328	12,053.75
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0271	10,877.00

AM2类 – 澳元	除息日期	支付日期	每单位分派金额 澳元	总分派金额 澳元
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0492	51,079.74
2022年8月派息	2022年8月31日	2022年9月9日	0.0481	50,061.44
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0498	52,612.46
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0455	48,848.63
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0468	53,235.24
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0360	42,013.16

AM3O类 – 澳元	除息日期	支付日期	每单位分派金额 澳元	总分派金额 澳元
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0401	202,607.05
2022年8月派息	2022年8月31日	2022年9月9日	0.0399	204,773.15
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0418	213,435.18
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0382	202,546.58
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0386	207,403.010
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0316	172,657.26

分派披露(续)

AM2类 – 加元	除息日期	支付日期	每单位分派金额 加元	总分派金额 加元
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0434	11,531.17
2022年8月派息	2022年8月31日	2022年9月9日	0.0435	11,557.74
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0436	11,688.75
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0410	11,374.98
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0423	11,831.34
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0336	11,360.83

AM30类 – 加元	除息日期	支付日期	每单位分派金额 加元	总分派金额 加元
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0445	133,438.74
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0435	139,130.74
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0430	143,721.02
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0432	148,300.06
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0351	126,129.41

AM30类 – 英镑	除息日期	支付日期	每单位分派金额 英镑	总分派金额 英镑
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0392	113,772.56
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0401	121,829.21
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0408	125,912.18
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0428	133,935.22
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0353	111,154.51

AM30类 – 新加坡元	除息日期	支付日期	每单位分派金额 新加坡元	总分派金额 新加坡元
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0417	31,436.56
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月10日	0.0437	33,842.84
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0433	35,577.91
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0436	35,823.85
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0355	29,168.14

分派披露(续)

BM2类 – 美元	除息日期	支付日期	每单位分派金额 美元	总分派金额 美元
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0473	44,130.67
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0480	46,026.71
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0463	44,768.35
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0472	48,088.56
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0383	39,612.00

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	0.0468	35,045.23
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0458	31,787.09
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0438	33,654.57
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0445	34,192.43
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月13日	0.0345	26,508.74

BM30类 – 人民币	除息日期	支付日期	每单位分派金额 人民币	总分派金额 人民币
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0439	57,539.18
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0521	79,229.14
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0519	81,052.52
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0663	90,154.62
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月13日	0.0550	74,782.46

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	0.0479	14,846.17
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0486	15,185.55
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0468	14,621.05
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0478	14,933.47
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0387	13,432.79

分派披露(续)

BM30类 – 澳元	除息 日期	支付 日期	每单位 分派金额 澳元	总分派 金额 澳元
2022年9月派息	2022年9月30日	2022年10月12日	0.0442	7,660.49
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0461	7,989.79
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0422	7,313.86
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0426	7,382.88
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0349	6,209.16

IM2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	0.0450	10,307.88
2022年7月派息	2022年7月29日	2022年8月9日	0.0457	9,195.57
2022年6月派息	2022年6月30日	2022年7月12日	0.0440	8,260.75
2022年5月派息	2022年5月31日	2022年6月10日	0.0448	7,839.37
2022年4月派息	2022年4月29日	2022年5月12日	0.0364	6,369.49

行政

经理

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

管理人董事

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