

汇丰集合投资信托—
汇丰亚太股票（日本除外）专注波幅基金
2023年中期报告



HSBC Global Asset Management
汇丰 环球投资管理

汇丰集合投资信托一
汇丰亚太股票(日本除外)专注波幅基金

中期报告
截至 2023 年 9 月 30 日止期间

目录	页码
资产负债表(未经审计)	1 - 3
全面收益表(未经审计)	4 - 5
份额持有人应占资产净值变动表(未经审计)	6 - 8
现金流量表(未经审计)	9
投资组合报表(未经审计)	10 - 12
投资组合变动表(未经审计)	13
业绩表现记录(未经审计)	14 - 16
分派披露(未经审计)	17 - 18
行政	19

资产负债表

2023 年 9 月 30 日

	2023 年 9 月 30 日 (未经审计) 美元	2023 年 3 月 31 日 (经审计) 美元
资产		
以公允价值计量且其变动计入损益账的金融资产	40,832,816	54,602,101
应收股息	51,160	182,555
应收利息	101	1,453
应收申购款	14,549	4,019
应收经纪商款项	876,553	1,180,004
现金及现金等价物	404,106	143,699
	<u>42,179,285</u>	<u>56,113,831</u>
负债		
应付赎回款	126,850	87,554
应付经纪商款项	291,544	632,259
应付分派	53,716	95,140
其他应付款	138,595	179,862
	<u>610,705</u>	<u>994,815</u>
份额持有人应占资产净值	<u>41,568,580</u>	<u>55,119,016</u>
相当于：		
金融负债	<u>41,568,580</u>	<u>55,119,016</u>

资产负债表(续) 2023 年 9 月 30 日

	2023 年 9 月 30 日 (未经审计) 美元	2023 年 3 月 31 日 (经审计) 美元
已发行份额总数		
- AM2 类 - 美元	3,488,278	4,667,669
- AM2 类 - 港元	12,746,217	13,484,915
- BC 类 - 港元	479,500	629,906
- BC 类 - 人民币	1,505,874	1,689,333
- BC 类 - 美元	502,748	573,254
- BM2 类 - 港元	718,846	736,882
- BM2 类 - 人民币	956,122	1,182,983
- BM2 类 - 美元	401,825	417,264

资产负债表(续)

2023 年 9 月 30 日

	2023 年 9 月 30 日 美元	2023 年 3 月 31 日 美元
每份额资产净值		
- AM2 类 - 美元	6.210	6.768
- AM2 类 - 港元	0.798	0.870
- BC 类 - 港元	0.923	0.994
- BC 类 - 人民币	1.069	1.152
- BC 类 - 美元	7.241	7.801
- BM2 类 - 港元	0.810	0.882
- BM2 类 - 人民币	0.941	1.024
- BM2 类 - 美元	6.359	6.919

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 2023 年 9 月 30 日止期间

	2023 年 4 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日 美元	2022 年 4 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日 美元
现金及现金等价物的利息收入	10,186	2,161
股息收入	814,678	780,222
以公允价值计量且其变动计入损益账的金融资 产的亏损净值	(3,638,155)	(18,270,703)
汇兑亏损净值	(18,678)	(27,916)
其他收入	30,525	16,130
收入总额	(2,801,444)	(17,500,106)
管理费 ^{注2}	425,046	578,952
交易费用 ^{注1}	60,584	66,924
受托人费用 ^{注1}	17,002	23,158
审计师酬金	6,610	6,634
过户代办费用 ^{注1}	16,738	17,894
专业人员费用	11,089	14,844
保管费、银行手续费及杂费 ^{注1}	2,292	22,475
总经营开支	539,361	730,881
税前经营净亏损	(3,340,805)	(18,230,987)
税项	(123,148)	(108,727)
收益分配前经营净亏损	(3,463,953)	(18,339,714)
向份额持有人作出收益分配	(476,463)	(583,777)
份额持有人应占资产净值减少及期间内全面收 益总额	(3,940,416)	(18,923,491)

全面收益表(续) 截至 2023 年 9 月 30 日止期间

注¹ 在截至 2023 年 9 月 30 日和 2022 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：

	2023 年 4 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日 美元	2022 年 4 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日 美元
交易费用	4,235	6,626
保管费、银行手续费及杂费	8,761	17,462

注² 在截至 2023 年 9 月 30 日和 2022 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 2023 年 9 月 30 日止期间

	2023 年 4 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日 美元	2022 年 4 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日 美元
期初余额	55,119,016	78,878,362
份额持有人应占资产净值减少及期间内全面收益 总额	(3,940,416)	(18,923,491)
份额认购		
- AM2 类 - 美元	927,834	1,286,128
- AM2 类 - 港元	672,341	871,827
- BC 类 - 港元	27,666	2,995
- BC 类 - 人民币	31,306	4,565
- BC 类 - 美元	2,910	9,603
- BM2 类 - 港元	2,229	272
- BM2 类 - 人民币	2,337	11,986
- BM2 类 - 美元	60,674	132,839
份额认购	1,727,297	2,320,215

份额持有人应占资产净值变动表(续)
 截至 2023 年 9 月 30 日止期间

	2023 年 4 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日 美元	2022 年 4 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日 美元
<i>份额赎回</i>		
- AM2 类 - 美元	(8,678,584)	(4,489,545)
- AM2 类 - 港元	(1,291,389)	(4,241,635)
- BC 类 - 港元	(175,859)	(27,930)
- BC 类 - 人民币	(238,678)	(256,944)
- BC 类 - 美元	(546,078)	(265,778)
- BM2 类 - 港元	(17,508)	(45,643)
- BM2 类 - 人民币	(224,982)	(151,430)
- BM2 类 - 美元	(164,239)	(50,316)
份额赎回	<u>(11,337,317)</u>	<u>(9,529,221)</u>
与份额持有人的交易价值总额	<u>(9,610,020)</u>	<u>(7,209,006)</u>
期末余额	<u>41,568,580</u>	<u>52,745,865</u>

份额持有人应占资产净值变动表(续) 截至 2023 年 9 月 30 日止期间

	AM2 类 - 美元份额		AM2 类 - 港元份额		BC 类 - 港元份额		BC 类 - 人民币份额		BC 类 - 美元份额		BM2 类 - 港元份额	
	2023 年 4 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日	2023 年 4 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日	2023 年 4 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日	2023 年 4 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日	2023 年 4 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日	2023 年 4 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日
4 月 1 日的已发行份额数目	4,667,669	5,178,830	13,484,915	20,231,804	629,906	692,905	1,689,333	2,004,348	573,254	647,660	736,882	847,224
期间内已申购份额	139,255	174,464	776,631	920,965	27,729	2,607	28,426	3,647	371	1,139	2,544	281
期间内已赎回份额	(1,318,646)	(626,454)	(1,515,329)	(4,608,189)	(178,135)	(27,503)	(211,885)	(207,789)	(70,877)	(32,721)	(20,580)	(48,930)
9 月 30 日的已发行份额数目	<u>3,488,278</u>	<u>4,726,840</u>	<u>12,746,217</u>	<u>16,544,580</u>	<u>479,500</u>	<u>668,009</u>	<u>1,505,874</u>	<u>1,800,206</u>	<u>502,748</u>	<u>616,078</u>	<u>718,846</u>	<u>798,575</u>
							BM2 类 - 人民币份额		BM2 类 - 美元份额		总额	
							2023 年 4 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日	2023 年 4 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日	2023 年 4 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日
4 月 1 日的已发行份额数目							417,264	453,634	1,182,983	1,253,718	23,382,206	31,310,123
期间内已申购份额							8,790	18,256	2,322	10,736	986,068	1,132,095
期间内已赎回份额							(24,229)	(19,875)	(229,183)	(48,918)	(3,568,864)	(5,620,379)
9 月 30 日的已发行份额数目							<u>401,825</u>	<u>452,015</u>	<u>956,122</u>	<u>1,215,536</u>	<u>20,799,410</u>	<u>26,821,839</u>

现金流量表

截至 2023 年 9 月 30 日止期间

	2023 年 4 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日 美元	2022 年 4 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日 美元
经营活动		
已收利息	11,538	2,130
已收股息	946,073	919,135
已付管理费	(445,083)	(611,590)
已付受托人费用	(17,803)	(24,463)
购买投资的付款	(20,233,856)	(27,107,748)
出售投资的所得款项	30,327,721	33,769,255
已付税项	(123,148)	(108,727)
其他已付经营开支	(105,894)	(150,772)
经营活动产生的现金	<u>10,359,548</u>	<u>6,687,220</u>
融资活动		
份额发行所得款项	1,716,767	2,388,879
份额赎回付款	(11,298,021)	(9,424,952)
已付分配	(517,887)	(589,038)
融资活动使用的现金	<u>(10,099,141)</u>	<u>(7,625,111)</u>
现金及现金等价物的净增加/(减少)	260,407	(937,891)
期初现金及现金等价物	<u>143,699</u>	<u>2,129,181</u>
期末现金及现金等价物	<u>404,106</u>	<u>1,191,290</u>

投资组合报表(未经审计) 2023 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	2,319	66,228	0.16
COCHLEAR LIMITED	4,037	665,231	1.60
CSL LIMITED	6,091	985,928	2.37
GOODMAN GROUP STAPLED SEC	62,598	866,596	2.09
MACQUARIE GROUP LTD	9,281	1,004,696	2.42
RESMED INC	24,570	374,237	0.90
SANTOS LTD	228,239	1,163,713	2.80
TELSTRA GROUP LTD	414,998	1,031,183	2.48
WOOLWORTHS GROUP LTD	27,157	654,112	1.57
		<u>6,811,924</u>	<u>16.39</u>
开曼群岛			
康师傅控股有限公司	820,000	1,145,425	2.75
药明生物技术有限公司	192,500	1,122,037	2.70
		<u>2,267,462</u>	<u>5.45</u>
中国内地			
国电南瑞科技股份有限公司	412,526	1,256,418	3.02
中国平安保险(集团)股份有限公司	186,500	1,068,014	2.57
深圳迈瑞生物医疗电子股份有限公司	17,900	662,883	1.60
宜宾五粮液股份有限公司	18,500	396,370	0.95
		<u>3,383,685</u>	<u>8.14</u>

投资组合报表(未经审计)(续)

2023 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)			
香港			
友邦保险控股有限公司	214,200	1,746,289	4.20
阿里巴巴集团控股有限公司	160,600	1,755,314	4.22
百威亚太控股有限公司	570,600	1,126,359	2.71
香港交易及结算所有限公司	22,100	825,662	1.99
美团	63,690	931,948	2.24
腾讯控股有限公司	62,700	2,451,367	5.90
		<u>8,836,939</u>	<u>21.26</u>
印度			
BHARTI AIRTEL LTD	115,046	1,283,442	3.09
EICHER MOTORS LTD	26,585	1,103,514	2.66
HDFC BANK LIMITED	51,150	940,138	2.26
HINDUSTAN UNILEVER LTD	13,972	414,846	1.00
ICICI BANK LTD	124,126	1,422,853	3.42
INFOSYS LTD	26,271	454,120	1.09
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	277,013	666,336	1.60
RELIANCE INDUSTRIES LTD	34,681	979,356	2.36
STATE BANK OF INDIA	159,772	1,151,615	2.77
		<u>8,416,220</u>	<u>20.25</u>
印尼			
BANK CENTRAL ASIA TBK	1,528,400	872,736	2.10
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,462,200	570,026	1.37
BANK RAKYAT INDONESIA PERSERO TBK	585,400	197,911	0.47
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,494,400	1,333,161	3.21
		<u>2,973,834</u>	<u>7.15</u>

投资组合报表(未经审计)(续)
 2023 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)			
韩国			
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	70,254	3,561,119	8.57
SK HYNIX INC	4,336	368,563	0.89
		<u>3,929,682</u>	<u>9.46</u>
台湾			
台湾积体电路制造股份有限公司	250,000	4,050,433	9.74
国巨股份有限公司	10,000	162,637	0.39
		<u>4,213,070</u>	<u>10.13</u>
股票(总计)		<u>40,832,816</u>	<u>98.23</u>
投资总额 (投资成本合计: 45,035,859 美元)		40,832,816	98.23
其他资产净值		<u>724,764</u>	<u>1.77</u>
2023 年 9 月 30 日的资产净值总额		<u><u>41,568,580</u></u>	<u><u>100.00</u></u>

投资组合变动表(未经审计)
 2023 年 4 月 1 日起至 2023 年 9 月 30 日止期间

	占资产净 值百分比 2023 年 9 月 30 日	占资产净 值百分比 2023 年 3 月 31 日
金融资产		
股票		
上市投资		
澳大利亚	16.39	18.11
开曼群岛	5.45	3.25
中国内地	8.14	14.00
香港	21.26	20.01
印度	20.25	14.11
印尼	7.15	6.62
新西兰	-	1.05
韩国	9.46	9.48
台湾	10.13	12.43
	<hr/>	<hr/>
	98.23	99.06
投资总额	98.23	99.06
其他资产净值	1.77	0.94
	<hr/>	<hr/>
资产净值总额	100.00	100.00

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)

	2023 年 9 月 30 日 美元	2023 年 3 月 31 日 美元	2022 年 3 月 31 日 美元	2021 年 3 月 31 日 美元
总资产净值	41,568,580	55,119,016	78,878,362	111,898,665

(b) 每份额资产净值(按《香港财务报告准则》计算)

	计价货币	2023 年 9 月 30 日	2023 年 3 月 31 日	2022 年 3 月 31 日	2021 年 3 月 31 日
每份额资产净值					
- AM2 类 - 美元	美元	6.210	6.768	8.126	9.876
- AM2 类 - 港元	港元	6.250	6.829	8.184	9.874
- BC 类 - 美元	美元	7.241	7.801	9.160	10.901
- BC 类 - 港元	港元	7.229	7.803	9.147	10.799
- BC 类 - 人民币	人民币	7.788	7.911	8.589	10.564
- BM2 类 - 美元	美元	6.359	6.919	8.306	10.095
- BM2 类 - 港元	港元	6.344	6.924	8.286	9.998
- BM2 类 - 人民币	人民币	6.856	7.032	7.802	9.796

(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
2023 年 9 月 30 日	6.156	6.907	6.156	6.907
2023 年 3 月 31 日	5.513	8.241	5.513	8.241
2022 年 3 月 31 日	7.329	10.224	7.329	10.224
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
2023 年 9 月 30 日	7.150	7.968	7.150	7.968
2023 年 3 月 31 日	5.565	8.304	5.565	8.304
2022 年 3 月 31 日	7.373	10.195	7.373	10.195

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
2023 年 9 月 30 日	6.192	6.944	6.192	6.944
2023 年 3 月 31 日	5.636	8.317	5.636	8.317
2022 年 3 月 31 日	7.491	10.451	7.491	10.451
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
2023 年 9 月 30 日	6.796	7.451	6.796	7.451
2023 年 3 月 31 日	5.637	8.302	5.637	8.302
2022 年 3 月 31 日	7.471	10.332	7.471	10.332
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
2023 年 9 月 30 日	6.293	7.061	6.293	7.061
2023 年 3 月 31 日	6.070	7.835	6.070	7.835
2022 年 3 月 31 日	7.081	9.999	7.081	9.999
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
2023 年 9 月 30 日	7.723	8.420	7.723	8.420
2023 年 3 月 31 日	6.283	9.159	6.283	9.159
2022 年 3 月 31 日	8.229	11.207	8.229	11.207

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
2023 年 9 月 30 日	7.167	7.994	7.167	7.994
2023 年 3 月 31 日	6.751	8.626	6.751	8.626
2022 年 3 月 31 日	7.786	10.786	7.786	10.786
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
2023 年 9 月 30 日	6.277	7.035	6.277	7.035
2023 年 3 月 31 日	6.280	9.172	6.280	9.172
2022 年 3 月 31 日	8.249	11.331	8.249	11.331

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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月11日	0.0105	36,626.92
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0123	43,907.54
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0135	53,032.96
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0135	54,137.16
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0126	52,423.22
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0143	61,111.04

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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月11日	0.0105	133,835.28
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0123	158,102.93
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0136	182,797.28
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0136	180,833.28
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0127	170,903.00
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0144	197,445.48

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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月11日	0.0107	7,691.65
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0125	9,242.83
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0138	10,198.07
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0138	10,188.34
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0129	9,523.89
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0146	10,778.97

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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月17日	0.0115	10,995.41
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0135	12,971.71
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0146	15,706.28
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0147	15,811.93
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0133	14,786.89
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0149	17,299.20

分派披露(续)

<i>BM2类 - 港元</i>	<i>除息 日期</i>	<i>支付 日期</i>	<i>每单位 分派金额 美元</i>	<i>总分派 金额 美元</i>
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月17日	0.0107	4,299.52
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0125	5,058.90
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0138	5,583.77
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0138	5,567.86
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0129	5,193.16
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0146	5,991.27

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
何慧芬
谭振邦
GEHRINGER, Edgar (2023 年 11 月 1 日委任)

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