

汇丰集合投资信托— 汇丰亚洲高入息债券基金

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
汇丰亚洲高入息债券基金

中期报告
截至 2023 年 9 月 30 日止期间

目录	页码
1. 汇丰亚洲高入息债券基金	
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 - 9
现金流量表(未经审计)	10
投资组合报表(未经审计)	11 - 30
投资组合变动表(未经审计)	31 - 33
金融衍生工具详情(未经审计)	34 - 37
业绩表现记录(未经审计)	38 - 44
分派披露(未经审计)	45 - 49
2. 行政	50

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	441,518,873	553,912,864
应收利息	6,151,476	6,609,240
应收申购款	115,809	6,738,992
应收经纪商款项	2,127,115	2,780,829
现金抵押资产	1,100,000	-
现金及现金等价物	2,644,083	6,311,121
	<u>453,657,356</u>	<u>576,353,046</u>
负债		
以公允价值计量且其变动计入损益账的金融负债	1,109,906	814,742
现金抵押负债	-	260,000
应付赎回款	1,693,588	3,988,090
应付经纪商款项	6,152,193	3,491,318
应付分派	2,632,168	3,592,968
应付税项	18,523	19,688
其他应付款	540,778	684,781
	<u>12,147,156</u>	<u>12,851,587</u>
份额持有人应占资产净值	<u>441,510,200</u>	<u>563,501,459</u>
相当于：		
金融负债	<u>441,510,200</u>	<u>563,501,459</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		
- AC类 - 美元	299,741	421,329
- AM2类 - 美元	29,389,090	35,626,850
- AM2类 - 人民币	3,645,179	3,706,725
- AM3O类 - 人民币	30,545,846	33,393,252
- AM2类 - 港元	180,242,994	206,498,177
- AM2类 - 欧元	262,958	275,447
- AM3O类 - 欧元	303,077	451,158
- AM2类 - 澳元	926,773	981,288
- AM3O类 - 澳元	5,276,897	6,131,829
- AM2类 - 加元	242,545	248,411
- AM3O类 - 加元	3,534,464	3,458,936
- AM3O类 - 英镑	2,562,135	3,332,988
- AM3O类 - 新加坡元	929,118	797,592
- BC类 - 港元	397,472	430,391
- BC类 - 人民币	204,009	249,875
- BC类 - 美元	221,886	250,422
- BCO类 - 人民币	196,412	221,929
- BM2类 - 港元	351,886	328,251
- BM2类 - 人民币	920,818	722,955
- BM2类 - 美元	732,955	830,410
- BM3O类 - 澳元	251,937	173,314
- BM3O类 - 人民币	1,253,277	1,132,935
- IM2类 - 美元	243,279	243,279
- IC类 - 美元	498,256	498,256

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
每份额资产净值		
- AC类 - 美元	8.469	8.879
- AM2类 - 美元	6.182	6.739
- AM2类 - 人民币	0.902	0.983
- AM3O类 - 人民币	0.834	0.965
- AM2类 - 港元	0.797	0.869
- AM2类 - 欧元	6.545	7.134
- AM3O类 - 欧元	6.327	7.110
- AM2类 - 澳元	4.727	5.151
- AM3O类 - 澳元	3.898	4.412
- AM2类 - 加元	4.699	5.122
- AM3O类 - 加元	4.479	4.879
- AM3O类 - 英镑	7.338	8.103
- AM3O类 - 新加坡元	4.437	4.967
- BC类 - 港元	1.063	1.115
- BC类 - 人民币	1.166	1.222
- BC类 - 美元	8.242	8.641
- BCO类 - 人民币	1.157	1.305
- BM2类 - 港元	0.870	0.942
- BM2类 - 人民币	0.957	1.037
- BM2类 - 美元	6.744	7.306
- BM3O类 - 澳元	4.323	4.867
- BM3O类 - 人民币	0.924	1.061
- IM2类 - 美元	6.422	6.981
- IC类 - 美元	7.523	7.865

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	34,210	4,459
以公允价值计量且其变动计入损益账的金融资产和负债的利息收入	12,626,350	13,315,059
股息收入	253,611	58,348
以公允价值计量且其变动计入损益账的金融资产和负债的亏损净值	(32,341,048)	(97,363,846)
汇兑亏损净值	(5,801,797)	(12,487,656)
其他收入	42,754	14,682
收入总额	(25,185,920)	(96,458,954)
管理费 ^{注2}	3,051,141	3,438,268
交易费用 ^{注1}	9,975	25,941
受托人费用 ^{注1}	186,681	210,242
审计师酬金	9,863	9,190
过户代办费用 ^{注1}	81,084	77,994
专业人员费用	8,121	4,391
保管费、银行手续费及杂费 ^{注1}	424,579	246,355
总经营开支	3,771,444	4,012,381
税前经营净亏损	(28,957,364)	(100,471,335)
税项	-	-
收益分配前经营净亏损	(28,957,364)	(100,471,335)
向份额持有人作出收益分配	(19,279,506)	(20,021,648)
份额持有人应占资产净值减少及期间内全面收益总额	(48,236,870)	(120,492,983)

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	9,372	10,443
保管费、银行手续费及杂费	13,548	23,611

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	563,501,459	705,150,383
份额持有人应占资产净值减少及期间内全面收益 总额	(48,236,870)	(120,492,983)
<i>份额认购</i>		
- AC类 - 美元	92,572	291,760
- AM2类 - 美元	26,092,991	4,968,107
- AM3O类 - 人民币	10,028,319	1,134,109
- AM2类 - 港元	25,856,278	1,971,472
- AM3O类 - 欧元	32,060	95,021
- AM3O类 - 澳元	6,990,565	544,385
- AM3O类 - 加元	8,090,284	461,670
- AM3O类 - 英镑	7,791,492	1,399,705
- AM3O类 - 新加坡元	1,047,703	381
- BC类 - 港元	2,523	-
- BC类 - 人民币	43	3,881
- BC类 - 美元	2,837	9,800
- BCO类 - 人民币	7,388	40,160
- BM2类 - 港元	30,347	13,170
- BM2类 - 人民币	352,187	95,614
- BM2类 - 美元	65,184	249,538
- BM3O类 - 澳元	360,079	169
- BM3O类 - 人民币	423,184	316,664
- IM2类 - 美元	-	400,000
	87,266,036	11,995,606

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>		
- AC类 - 美元	(1,153,963)	(625,289)
- AM2类 - 美元	(65,508,991)	(46,840,199)
- AM2类 - 人民币	(57,798)	(2,132,935)
- AM3O类 - 人民币	(12,059,356)	(8,167,630)
- AM2类 - 港元	(46,950,063)	(22,974,597)
- AM2类 - 欧元	(85,305)	(544,897)
- AM3O类 - 欧元	(1,010,587)	(477,108)
- AM2类 - 澳元	(265,634)	(841,268)
- AM3O类 - 澳元	(10,457,771)	(5,021,689)
- AM2类 - 加元	(29,238)	(420,902)
- AM3O类 - 加元	(7,664,466)	(3,819,554)
- AM3O类 - 英镑	(13,756,225)	(3,841,835)
- AM3O类 - 新加坡元	(415,936)	(334,871)
- BC类 - 港元	(39,251)	(65,641)
- BC类 - 人民币	(55,441)	(127,042)
- BC类 - 美元	(244,140)	(728,979)
- BCO类 - 人民币	(36,674)	(78,841)
- BM2类 - 港元	(8,332)	(175,468)
- BM2类 - 人民币	(157,869)	(115,424)
- BM2类 - 美元	(754,424)	(1,289,067)
- BM3O类 - 澳元	(7,953)	(46,742)
- BM3O类 - 人民币	(301,008)	(349,148)
	<u>(161,020,425)</u>	<u>(99,019,126)</u>
与份额持有人的交易价值总额	<u>(73,754,389)</u>	<u>(87,023,520)</u>
期末余额	<u>441,510,200</u>	<u>497,633,880</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

	AC类 - 美元份额		AM2类 - 美元份额		AM2类 - 人民币份额		AM3O类 - 人民币份额		AM2类 - 港元份额		AM2类 - 欧元份额		AM3O类 - 欧元份额		AM2类 - 澳元份额	
	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	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	421,329	530,133	35,626,850	37,927,193	3,706,725	5,780,277	33,393,252	32,165,216	206,498,177	214,830,393	275,447	367,276	451,158	404,334	981,288	1,184,276
期间内已申购份额	10,571	31,339	3,898,182	648,387	-	-	10,786,131	1,064,039	30,009,726	2,098,658	-	-	4,682	12,086	-	-
期间内已赎回份额	(132,159)	(70,663)	(10,135,942)	(6,390,945)	(61,546)	(1,963,648)	(13,633,537)	(7,429,823)	(56,264,909)	(24,240,035)	(12,489)	(66,746)	(152,763)	(60,808)	(54,515)	(147,640)
9月30日的已发行份额数目	299,741	490,809	29,389,090	32,184,635	3,645,179	3,816,629	30,545,846	25,799,432	180,242,994	192,689,016	262,958	300,530	303,077	355,612	926,773	1,036,636
	AM3O类 - 澳元份额		AM2类 - 加元份额		AM3O类 - 加元份额		AM3O类 - 英镑份额		AM3O类 - 新加坡元份额		BC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	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	6,131,829	5,895,980	248,411	338,120	3,458,936	3,617,423	3,332,988	3,188,458	797,592	821,628	430,391	482,360				
期间内已申购份额	1,590,462	113,232	-	-	1,694,830	85,901	948,088	152,291	221,521	74	2,251	-				
期间内已赎回份额	(2,445,394)	(956,667)	(5,866)	(72,425)	(1,619,302)	(704,701)	(1,718,941)	(438,388)	(89,995)	(67,828)	(35,170)	(54,209)				
9月30日的已发行份额数目	5,276,897	5,052,545	242,545	265,695	3,534,464	2,998,623	2,562,135	2,902,361	929,118	753,874	397,472	428,151				

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	13,118,324	15,377,467
已收股息	253,611	58,348
已付管理费	(3,172,229)	(3,647,486)
已付受托人费用	(194,070)	(223,014)
购买投资的付款	(441,700,781)	(528,800,839)
出售投资的所得款项	525,141,368	635,450,286
已付税项	(1,165)	(2,251)
其他已付经营开支	(6,086,082)	(13,166,314)
现金抵押资产增加	(1,100,000)	(530,000)
现金抵押负债(减少)/增加	(260,000)	540,000
经营活动产生的现金	<u>85,998,976</u>	<u>105,056,197</u>
融资活动		
份额发行所得款项	93,889,219	11,996,286
份额赎回付款	(163,314,927)	(98,877,879)
已付分配	(20,240,306)	(20,172,495)
融资活动使用的现金	<u>(89,666,014)</u>	<u>(107,054,088)</u>
现金及现金等价物净减少	(3,667,038)	(1,997,891)
期初现金及现金等价物	<u>6,311,121</u>	<u>3,802,759</u>
期末现金及现金等价物	<u>2,644,083</u>	<u>1,804,868</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
债券			
上市投资			
澳大利亚			
PERENTI FINANCE PTY LTD 6.5% 2025年10月 7日	588,000	588,306	0.13
百慕大			
合生创展集团有限公司 6.8% 2023年12月28日	2,589,566	2,584,904	0.59
英属维尔京群岛			
CELESTIAL MILES 可变债券 永续债券 2049年 12月29日	986,500	965,180	0.22
中铝香港投资有限公司 2.1% 2026年7月28日	1,241,774	1,117,942	0.25
中铝资本控股有限公司 可变债券 永续债券 2049 年12月31日	2,516,250	2,448,845	0.56
CLP POWER HK FINANCE LTD 可变债券 永续 债券 2049年12月31日	557,844	554,149	0.13
中国华能集团香港财资管理控股有限公司 可变债 券 永续债券 2049年12月31日	2,472,759	2,448,066	0.55
ENN CLEAN ENERGY 3.375% 2026年5月12日	4,044,437	4,196,809	0.95
FORTUNE STAR BVI LTD 5.95% 2025年10月 19日	909,530	857,984	0.19
FORTUNE STAR BVI LTD 6.85% 2024年7月2 日	1,093,500	1,098,816	0.25
HKT CAPITAL NO 6 LTD 3% 2032年1月18日	1,944,502	1,568,398	0.36
HUARONG FINANCE 4.875% 2026年11月22日	185,233	173,482	0.04
HUARONG FINANCE 2019 3.25% 2024年11月 13日	9,787,726	9,741,071	2.21
HUARONG FINANCE II 5% 2025年11月19日	294,750	270,795	0.06
HUARONG FINANCE II CO LTD 4.625 2026年6 月3日	278,733	263,766	0.06

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
债券(续)			
上市投资(续)			
英属维尔京群岛(续)			
JOY TRSR ASSETS HOLDINGS 3.5% 2029年9月24日	1,319,829	1,076,942	0.24
KING POWER CAPITAL LTD 5.625% 2024年11月3日	1,717,000	1,693,931	0.38
NAN FUNG TREASURY LTD 3.625% 2030年8月27日	1,933,902	1,814,670	0.41
新城环球有限公司 4.625% 2025年10月15日	139,125	94,609	0.02
NWD FINANCE (BVI) LTD 可变债券 永续债券 2049年12月31日	3,539,917	2,529,152	0.58
中化离岸资本有限公司 1.5% 2026年9月23日	3,568,417	3,150,711	0.71
STAR ENERGY GEOTHERMAL 6.75% 2033年4月24日	2,809,422	2,736,122	0.62
国家电网海外投资有限公司 4.85% 2044年5月7日	775,882	676,924	0.15
STUDIO CITY CO LTD 7% 2027年2月15日	1,928,000	1,895,160	0.43
STUDIO CITY FINANCE LTD 6% 2025年7月15日	1,962,565	1,989,012	0.45
STUDIO CITY FINANCE LTD 6.5% 2028年1月15日	1,809,780	1,919,726	0.44
TSMC GLOBAL LTD 1.25% 2026年4月23日	4,683,073	4,501,400	1.02
YUNDA HOLDING INVESTMENT 2.25% 2025年8月19日	7,916,649	7,678,174	1.74
		57,461,836	13.02
开曼群岛			
阿里巴巴集团控股有限公司 3.15% 2051年2月9日	2,084,508	1,363,188	0.31
阿里巴巴集团控股有限公司 4.4% 2057年12月6日	1,742,400	1,521,256	0.35
CCBL CAYMAN 1 CORP 1.6% 2026年9月15日	1,087,786	971,724	0.22
CH OVS GRAND OCE FINANCE 2.45% 2026年2月9日	2,852,090	2,749,577	0.62

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
债券(续)			
上市投资(续)			
开曼群岛(续)			
中国宏桥集团有限公司 6.25% 2024年6月8日	1,169,122	1,176,594	0.27
中国现代牧业控股有限公司 2.125% 2026年7月14日	739,942	730,966	0.17
CHINA OVERSEA FIN III 6.375% 2043年10月29日	2,104,100	1,843,580	0.42
CHINA OVERSEAS FIN. VI 5.95% 2024年5月8日	2,183,000	1,993,060	0.45
秦淮数据集团控股有限公司 10.5% 2026年2月23日	2,344,943	2,387,557	0.54
EHI CAR SERVICES LTD 7.75% 2024年11月14日	503,360	539,154	0.12
吉利汽车 可变债券 永续债券 2049年12月31日	2,800,556	2,930,219	0.66
绿城中国控股有限公司 4.7% 2025年4月29日	2,243,081	1,913,402	0.43
健合(H&H)国际控股有限公司 5.625% 2024年10月24日	177,436	192,060	0.04
HPHT FINANCE 21 II LTD 1.5% 2026年9月17日	6,325,164	5,623,372	1.27
LINK FINANCE CAYMAN 2009 2.75% 2032年1月19日	1,485,735	1,194,555	0.27
龙湖集团控股有限公司 3.375% 2027年4月13日	467,079	348,937	0.08
龙湖地产有限公司 4.5% 2028年1月16日	2,545,977	2,177,293	0.49
美团 3.05% 2030年10月28日	630,216	621,408	0.14
MELCO RESORTS FINANCE 4.875% 2025年6月6日	7,657,410	7,723,175	1.75
MELCO RESORTS FINANCE 5.625% 2027年7月17日	3,217,989	3,360,600	0.76
美高梅中国控股有限公司 4.75% 2027年2月1日	2,746,600	2,706,840	0.61
美高梅中国控股有限公司 5.25% 2025年6月18日	3,293,700	3,648,646	0.83
美高梅中国控股有限公司 5.875% 2026年5月15日	175,000	190,750	0.04
当代置业(中国)有限公司 9% 2026年12月30日	1,386,384	54,388	0.01

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
债券(续)			
上市投资(续)			
开曼群岛(续)			
当代置业(中国)有限公司 可变债券 2023年12月30日	274,253	10,206	0.00
当代置业(中国)有限公司 可变债券 2024年12月30日	620,471	24,952	0.01
当代置业(中国)有限公司 可变债券 2025年12月30日	1,039,788	43,937	0.01
当代置业(中国)有限公司 可变债券 2027年12月30日	2,023,351	87,151	0.02
金辉控股(集团)有限公司 7.8% 2024年3月20日	775,533	448,104	0.10
弘阳地产集团有限公司 7.3% 2024年5月21日	889,905	38,158	0.01
金沙中国有限公司 2.55% 2027年3月8日	1,682,100	1,690,767	0.38
金沙中国有限公司 3.75% 2031年8月8日	2,016,478	1,899,069	0.43
金沙中国有限公司 3.8% 2026年1月8日	2,662,464	2,718,837	0.62
金沙中国有限公司 4.375% 2030年6月18日	457,900	432,310	0.10
金沙中国有限公司 5.125% 2025年8月8日	1,333,457	1,443,539	0.33
金沙中国有限公司 5.4% 2028年8月8日	759,163	742,962	0.17
SHUI ON DEVELOPMENT HOLDINGS 5.75% 2023年11月12日	686,400	751,960	0.17
SHUI ON DEVELOPMENT HOLDINGS 6.15% 2024年8月24日	980,791	705,979	0.16
腾讯控股有限公司 2.39% 2030年6月3日	1,874,065	1,531,686	0.35
龙湖集团控股有限公司 3.94% 2061年4月22日	3,432,752	2,988,483	0.68
腾讯控股有限公司 SER REGS 3.8% 2025年2月11日	5,273,171	4,871,150	1.10
腾讯音乐娱乐集团 2% 2030年9月3日	3,394,831	2,929,225	0.66
永利澳门有限公司 4.875% 2024年10月1日	822,313	925,889	0.21

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
债券(续)			
上市投资(续)			
开曼群岛(续)			
永利澳门有限公司 5.5% 2027年10月1日	2,638,150	2,814,273	0.64
永利澳门有限公司 5.5% 2026年1月15日	169,750	186,738	0.04
永利澳门有限公司 5.625% 2028年8月26日	4,658,013	4,582,972	1.04
中升集团控股有限公司 3% 2026年1月13日	4,729,245	4,620,035	1.05
		84,450,683	19.13
中国内地			
百度 3.425% 2030年4月7日	999,900	945,967	0.22
中国银行 SER 5% 2024年11月13日	3,482,885	3,457,475	0.78
中国建设银行股份有限公司 可变债券 2030年6月24日	2,758,693	2,603,605	0.59
中国农化(香港)峰桥有限公司 4.875% 2025 年3月14日	296,541	294,405	0.07
HUARONG FINANCE II SER 欧元中期票 据 5.5% 2025年1月16日	1,075,305	1,078,315	0.24
中国工商银行股份有限公司 可变债券 永 续债券 2049年12月31日	5,402,144	5,151,216	1.17

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
债券(续)			
上市投资(续)			
中国内地(续)			
腾讯控股有限公司 SER 3.84% 2051年4月 22日	361,500	321,355	0.07
温氏食品集团股份有限公司 2.349% 2025 年10月29日	3,474,598	3,477,251	0.79
温氏食品集团股份有限公司 3.258% 2030 年10月29日	574,000	545,951	0.12
		17,875,540	4.05
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	4,997,000	4,483,824	1.02
香港机场管理局 可变债券 永续债券 2049 年12月31日	8,641,850	7,996,221	1.81
交通银行(香港)有限公司 可变债券 2031 年7月8日	2,076,000	1,878,510	0.43
东亚银行有限公司 可变债券 2028年7月 7日	380,388	369,472	0.08
东亚银行有限公司 可变债券 2030年5月 29日	275,709	275,865	0.06
东亚银行有限公司 可变债券 2032年4月 22日	1,884,545	1,746,220	0.40

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
债券(续)			
上市投资(续)			
香港(续)			
CK HUTCHISON INTL 19 II SER 2.75% 2029年9月6日	1,036,015	1,021,532	0.23
招银国际租赁管理有限公司 3% 2024年7 月3日	292,680	293,169	0.07
STUDIO CITY FINANCE LTD 5.1% 2024 年1月21日	1,249,451	1,192,733	0.27
联想集团有限公司 5.875% 2025年4月24 日	2,872,484	2,505,307	0.57
南洋商业银行 可变债券 2029年11月20 日	5,155,940	5,093,375	1.15
港华燃气(融资)有限公司 4% 2027年4月 26日	1,983,740	1,863,460	0.42
万科地产(香港)有限公司 3.15% 2025年5 月12日	1,231,048	1,162,570	0.26
万科地产(香港)有限公司 3.975% 2027年 11月9日	2,186,210	1,718,352	0.39
万科地产(香港)有限公司 4.2% 2024年6 月7日	2,857,282	2,669,737	0.60
阳光城嘉世国际有限公司 8.25% 2023年 11月25日	1,927,875	28,310	0.01
仁恒地产(香港)有限公司 5.125% 2026年5 月20日	361,460	298,992	0.07
		<u>34,597,649</u>	<u>7.84</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
债券(续)			
上市投资(续)			
印度			
AXIS BANK GIFT CITY 可变债券 永续债券 2049年12月31日	1,220,483	1,213,254	0.27
CONTINUUM ENERGY AURA SER 9.5% 2027年2月24日	1,255,125	1,250,285	0.28
DIAMOND II LTD SER 7.95% 2026年7月28日	2,035,289	2,031,799	0.46
印度进出口银行 SER 3.25% 2030年1月15日	1,730,460	1,704,760	0.39
GMR HYDERABAD INTERNATIONAL SER 4.25% 2027年10月27日	715,000	714,744	0.16
GMR HYDERABAD INTERNATIONAL 4.75% 2026年2月2日	2,867,300	2,843,880	0.64
HDFC BANK LTD 可变债券 永续债券 2049年12月31日	1,410,000	1,383,184	0.31
HPCL-MITTAL ENERGY LTD 5.25% 2027年4月28日	1,142,718	1,048,828	0.24
HPCL-MITTAL ENERGY LTD 5.45% 2026年10月22日	3,742,614	3,656,822	0.83
JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125% 2031年5月18日	2,963,530	2,867,750	0.65
JSW INFRASTRUCTURE 4.95% 2029年1月21日	1,807,527	1,744,544	0.39
JSW STEEL LTD 5.05% 2032年4月5日	414,645	403,930	0.09
JSW STEEL LTD 5.375% 2025年4月4日	1,010,625	975,400	0.22
NTPC LTD SER EMTN 4.375% 2024年10月26日	788,648	784,232	0.18
ONGC VIDESH LTD SER 4.625% 2024年7月15日	1,988,060	1,975,780	0.45

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
债券(续)			
上市投资(续)			
印度(续)			
POWER FINANCE CORP LTD 3.95% 2030 年4月23日	1,168,480	1,128,088	0.26
POWER FINANCE CORP LTD SER 全球中 期票据 3.35% 2031年5月16日	514,140	488,916	0.11
REC LIMITED 2.75% 2027年1月13日	1,497,375	1,481,733	0.34
RELIANCE INDUSTRIES LTD SER 3.75% 2062年1月12日	348,525	310,870	0.07
RENEW POWER PVT LTD 5.875% 2027年 3月5日	2,166,369	2,078,264	0.47
VEDANTA RESOURCES SER 8.95% 2025 年3月11日	397,850	429,252	0.10
		30,516,315	6.91
印尼			
BUKIT MAKMUR MANDIRI UTA 7.75% 2026年2月10日	652,190	651,833	0.15
FREEMPORT INDONESIA PT SER 6.2% 2052年4月14日	278,850	252,489	0.06
INDOFOOD CBP SUKSES MAKM 4.745% 2051年6月9日	872,563	791,442	0.18
印度尼西亚共和国(政府) 3.2% 2061年9月 23日	275,132	238,172	0.05
印度尼西亚共和国(政府) 3.35% 2071年3 月12日	804,000	721,296	0.16
印度尼西亚共和国(政府) 3.5% 2050年2月 14日	2,661,531	2,379,545	0.54
印度尼西亚共和国(政府) 3.55% 2051年6 月9日	2,237,616	1,829,182	0.42

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
债券(续)			
上市投资(续)			
印尼(续)			
印度尼西亚共和国(政府) 4.2% 2050年10月15日	4,158,582	3,382,555	0.77
印度尼西亚共和国(政府) 4.35% 2048年1月11日	2,644,500	2,388,390	0.54
JAPFA COMFEED TBK PT 5.375% 2026年3月23日	443,500	415,805	0.09
LISTRINDO CAPITAL BV 4.95% 2026年9月14日	601,742	604,586	0.14
MEDCO BELL PTE LTD SER 6.375% 2027年1月30日	953,500	944,880	0.21
MEDCO PLATINUM ROAD PTE SER 6.75% 2025年1月30日	787,520	800,152	0.18
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR SER 3.375% 2030年2月5日	1,748,000	1,694,840	0.38
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR SER 4% 2050年6月30日	585,600	516,864	0.12
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR SER 4.375% 2050年2月5日	986,050	887,510	0.20
PT ADARO INDONESIA 4.25% 2024年10月31日	4,176,047	4,127,804	0.94
PT INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM 与 PT MINERAL INDUSTRI INDONESIA (PERSERO) SER 5.8% 2050年5月15日	1,778,913	1,593,142	0.36
PT PAKUWON JATI 4.875% 2028年4月29日	5,838,987	5,444,572	1.23
PT PERTAMINA (PERSERO) 2.3% 2031年2月9日	3,983,000	3,106,182	0.70

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
债券(续)			
上市投资(续)			
印尼(续)			
SARANA MULTI INFRASTRUKTUR 2.05% 2026年5月11日	1,927,329	1,718,491	0.39
		<hr/>	<hr/>
		34,489,732	7.81
		<hr/>	<hr/>
爱尔兰			
SMBC AVIATION CAPITAL FI SER 5.7% 2033年7月25日	3,826,982	3,582,336	0.81
		<hr/>	<hr/>
马恩岛			
GOHL CAPITAL LTD 4.25% 2027年1月 24日	1,143,450	1,155,313	0.26
		<hr/>	<hr/>
泽西岛(海峡群岛)			
中国西部水泥有限公司 4.95% 2026年7月 8日	1,879,820	1,696,756	0.38
		<hr/>	<hr/>
马来西亚			
PETRONAS CAPITAL LTD 3.404% 2061年 4月28日	2,940,998	2,168,495	0.49
PETRONAS CAPITAL LTD 4.5% 2045年3 月18日	2,490,800	2,142,036	0.49
		<hr/>	<hr/>
		4,310,531	0.98
		<hr/>	<hr/>

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
债券(续)			
上市投资(续)			
毛里求斯			
CA MAGNUM HOLDINGS 5.375% 2026年 10月31日	2,354,950	2,313,844	0.52
CLEAN RENEWABLE POWER 4.25% 2027 年3月25日	1,857,800	1,784,566	0.40
CLIFFTON LTD 6.25% 2025年10月25日	2,461,348	2,494,002	0.57
GREENKO SOLAR MAURITIUS 5.55% 2025 年1月29日	500,709	498,798	0.11
GREENKO SOLAR MAURITIUS 5.95% 2026 年7月29日	743,985	747,864	0.17
GREENKO WIND PROJECTS MU 5.5% 2025年4月6日	9,338,000	9,205,344	2.08
INDIA CLEAN ENERGY HOLDINGS 4.5% 2027年4月18日	653,883	694,197	0.16
INDIA GREEN POWER HOLDINGS 4% 2027年2月22日	1,384,068	1,368,802	0.31
NETWORK I2I LTD SER 可变债券 永续债券 2049年12月31日	889,925	911,540	0.21
		20,018,957	4.53
蒙古			
MN MINING/ENERGY RESOURC 12.5% 2026年9月13日	474,274	684,040	0.16
蒙古(政府)国际债券 3.5% 2027年7月7日	1,946,286	1,982,321	0.45
蒙古(政府)国际债券 4.45% 2031年7月7日	592,372	586,857	0.13

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
债券(续)			
上市投资(续)			
蒙古(续)			
蒙古(政府)国际债券 8.75% 2024年3月9日	807,200	806,216	0.18
		<hr/>	<hr/>
		4,059,434	0.92
		<hr/>	<hr/>
荷兰			
ICTSI TREASURY BV 3.5% 2031年11月16日	3,169,000	2,695,741	0.61
JABABEKA INTERNATIONAL STP 2027年12月15日	2,966,585	2,193,092	0.50
MINEJESA CAPITAL BV 4.625% 2030年8月10日	746,000	717,368	0.16
		<hr/>	<hr/>
		5,606,201	1.27
		<hr/>	<hr/>
巴基斯坦			
巴基斯坦伊斯兰共和国(政府) SER 6.875% 2027年12月5日	1,617,725	1,625,893	0.37
巴基斯坦伊斯兰共和国(政府) SER 6% 2026年4月8日	1,283,092	1,278,573	0.29
巴基斯坦伊斯兰共和国(政府) SER 7.375% 2031年4月8日	282,325	278,921	0.06
巴基斯坦伊斯兰共和国(政府) SER 8.25% 2024年4月15日	725,625	740,349	0.17

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
债券(续)			
上市投资(续)			
巴基斯坦(续)			
巴基斯坦伊斯兰共和国(政府) SER 8.25% 2025年9月30日	1,247,636	1,318,280	0.30
		<hr/>	<hr/>
		5,242,016	1.19
		<hr/>	<hr/>
菲律宾			
菲律宾开发与银行 2.375% 2031年3月11日	2,818,510	2,227,833	0.51
GLOBE TELECOM INC 可变债券 永续债券 2049年12月31日	2,176,000	2,028,989	0.46
菲律宾共和国(政府) 4.2% 2047年3月29日	4,092,400	3,658,715	0.83
菲律宾共和国(政府) 2.65% 2045年12月10日	4,118,599	3,630,478	0.82
		<hr/>	<hr/>
		11,546,015	2.62
		<hr/>	<hr/>
新加坡			
AEV INTERNATIONAL PTE 4.2% 2030年1月16日	660,800	594,003	0.13
中银航空租赁有限公司 SER 3.5% 2024年10月10日	3,029,630	3,017,757	0.68
CONTINUUM ENERGY LEVANTE 4.5% 2027年2月9日	492,848	525,194	0.12
星展集团控股有限公司 SER 5.479% 2025年9月12日	213,000	213,613	0.05
星展集团控股有限公司 可变债券 2031年3月10日	550,000	497,986	0.11
星展集团控股有限公司 可变债券 永续债券 2049年12月31日	4,057,029	4,055,892	0.92

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
债券(续)			
上市投资(续)			
新加坡(续)			
GLP PTE LTD 可变债券 永续债券 2049年 12月31日	1,621,825	882,817	0.20
INDIKA ENERGY 5.875% 2024年11月9日	6,618,903	6,453,730	1.46
JOLLIBEE WORLDWIDE PTE LTD 4.125% 2026年1月24日	3,260,800	3,091,904	0.70
MEDCO OAK TREE PTE LTD 7.375% 2026 年5月14日	4,499,860	4,397,414	1.00
华侨银行 可变债券 2032年6月15日	3,641,000	3,471,293	0.79
华侨银行 可变债券 2030年9月10日	3,850,000	3,538,342	0.80
TML HOLDINGS PTE LTD 4.35% 2026年6 月9日	2,806,924	2,563,968	0.58
大华银行有限公司 可变债券 2031年3月16 日	6,590,753	5,955,526	1.35
		39,259,439	8.89
韩国			
韩亚银行 3.25% 2027年3月30日	4,290,385	3,991,395	0.90
韩华生命保险 可变债券 2032年2月4日	802,876	712,960	0.16
KODIT GLOBAL 2023-1 LTD 4.954% 2026 年5月25日	2,278,000	2,234,946	0.51
KOOKMIN BANK 2.5% 2030年11月4日	1,031,368	813,973	0.18
KOOKMIN BANK SER (REG_S) 可变债券 永续债券 2049年12月31日	2,931,750	2,931,450	0.66

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
债券(续)			
上市投资(续)			
韩国(续)			
韩国产业银行 1.375% 2027年4月25日	3,088,050	3,059,000	0.69
KOREA NATIONAL OIL CORP 2.125% 2027年4月18日	2,039,845	1,833,749	0.42
KT CORP 2.5% 2026年7月18日	813,312	735,136	0.17
KT CORP 4% 2025年8月8日	2,206,354	2,144,341	0.49
LGENERGYSOLUTION SER 5.75% 2028年 9月25日	1,274,903	1,268,995	0.29
新韩银行 4.375% 2032年4月13日	2,691,800	2,363,413	0.53
SHINHAN CARD CO LTD 2.5% 2027年1月 27日	4,416,128	4,059,791	0.92
新韩金融集团 可变债券 2030年2月5日	1,418,000	1,358,586	0.31
		27,507,735	6.23
泰国			
盘谷银行 可变债券 2036年9月23日	4,101,191	3,927,839	0.89
盘谷银行香港分行 可变债券 2034年9月25 日	1,049,087	1,085,851	0.25
盘谷银行香港分行 可变债券 永续债券 2049 年12月31日	1,963,247	1,872,628	0.42
泰国进出口银行 3.902% 2027年6月2日	1,781,000	1,682,208	0.38
GC TREASURY CENTRE CO SER 4.4% 2032年3月30日	702,512	683,432	0.16

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
债券(续)			
上市投资(续)			
泰国(续)			
开泰银行香港分行 可变债券 永续债券 2049 年12月31日	189,625	193,389	0.04
KRUNG THAI BANK/CAYMAN 可变债券 永续债券 2049年12月31日	872,155	877,687	0.20
THAIOIL TRSRY CENTER SER 2.5% 2030 年6月18日	3,298,149	3,147,420	0.71
		<u>13,470,454</u>	<u>3.05</u>
土耳其			
HYUNDAI ASSAN OTOMOTIV 1.625% 2026年7月12日	4,296,701	3,801,324	0.86
阿拉伯联合酋长国			
FIRST ABU DHABI BANK PJS 可变债券 2034年4月4日	5,203,000	5,194,987	1.18
英国			
PRUDENTIAL FUNDING (ASIA) PLC 可变 债券 2033年11月3日	1,535,430	1,339,233	0.31
渣打银行 可变债券 2032年6月29日	3,364,730	3,141,830	0.71
渣打银行 SER 6.296% 2034年7月6日	1,680,310	1,644,189	0.37
渣打银行 可变债券 2036年2月18日	2,273,153	2,130,054	0.48
渣打银行 可变债券 永续债券 2049年12月 31日	2,590,625	2,432,050	0.55

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
债券(续)			
上市投资(续)			
英国(续)			
VEDANTA RESOURCES 13.875% 2024年1月21日	759,450	744,966	0.17
		<hr/>	<hr/>
		11,432,322	2.59
		<hr/>	<hr/>
美国			
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 2.1% 2028年9月15日	3,362,297	2,791,861	0.63
PERIAMA HOLDINGS LLC/DE 5.95% 2026年4月19日	3,839,204	3,691,142	0.84
RESORTS WORLD/RWLV CAP SER 8.45% 2030年7月27日	1,782,644	1,743,966	0.40
TSMC ARIZONA CORP 1.75% 2026年10月25日	1,530,633	1,372,787	0.31
美国财政部 3.625% 2053年2月15日	1,154,929	992,906	0.22
		<hr/>	<hr/>
		10,592,662	2.40
		<hr/>	<hr/>
未上市但有报价的投资			
印尼			
PT PERTAMINA (PERSERO) 4.15% 2060年2月25日	2,579,363	2,108,985	0.48
		<hr/>	<hr/>
债券(合计)		433,150,432	98.12
		<hr/>	<hr/>

投资组合报表(未经审计)(续) 2023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*	4,309,289	4,309,289	0.98
卢森堡			
HSBC INVESTMENT FUNDS LUXEMBOURG SA/LUXEMBOURG- HSBC-ASIAN CURRENCIES BD-ZD*	2,154,571	1,917,448	0.43
非上市投资			
香港			
HSBC ALL CHINA BOND ZC-USD	1,506,000	1,613,250	0.36
单位信托(合计)		7,839,987	1.77

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
债券期货			
US 5YR NOTE (CBT) 29/12/2023	35	(1,398)	-
US LONG BOND(CBT) 19/12/2023	30	(162,188)	(0.04)
US ULTRA BOND CBT 19/12/2023	(45)	225,531	0.05
		61,945	0.01
外汇远期合同		228,662	0.05
掉期		(872,059)	(0.20)
投资总额(投资成本合计: 475,705,529 美元)		440,408,967	99.75
其他资产净值		1,101,233	0.25
2023年9月30日的资产净值总额		441,510,200	100.00

* 投资基金在香港未获认可，不面向香港公众发行。

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		
债务证券		
上市债券		
澳大利亚	0.13	-
百慕大	0.59	0.23
英属维尔京群岛	13.02	16.76
加拿大	-	0.79
开曼群岛	19.13	17.71
中国内地	4.05	1.75
香港	7.84	11.60
印度	6.91	4.84
印尼	7.81	6.48
爱尔兰	0.81	-
马恩岛	0.26	0.29
日本	-	0.08
泽西岛(海峡群岛)	0.38	0.63
马来西亚	0.98	0.88
毛里求斯	4.53	2.56
蒙古	0.92	0.52
荷兰	1.27	1.85
巴基斯坦	1.19	-
菲律宾	2.62	2.34
新加坡	8.89	8.07
韩国	6.23	4.68
泰国	3.05	2.67
土耳其	0.86	0.67
阿拉伯联合酋长国	1.18	-
英国	2.59	2.52
美国	2.40	4.80
	<hr/> 97.64	<hr/> 92.72

投资组合变动表(未经审计)(续)

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		
债务证券(续)		
未上市但有报价的债券		
印尼	0.48	0.20
	<hr/>	<hr/>
单位信托		
上市投资		
爱尔兰	0.98	4.54
卢森堡	0.43	0.38
	<hr/>	<hr/>
	1.41	4.92
	<hr/>	<hr/>
未上市但有报价的投资		
香港	0.36	0.30
	<hr/>	<hr/>
	0.36	0.30
	<hr/>	<hr/>

投资组合变动表(未经审计)(续)

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
债券期货	0.01	-
外汇远期合同	0.05	0.08
掉期	(0.20)	(0.07)
投资总额	99.75	98.15
其他资产净值	0.25	1.85
资产净值总额	100.00	100.00

金融衍生工具详情(未经审计) 2023年4月1日起至2023年9月30日止期间

外汇远期合同

截至2023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: 1,085,948 美元	1,691,800 澳元	2023年10月31日	HSBC Markets Treasury Services	7,125
20,809,952 美元	32,419,861 澳元	2023年10月31日	HSBC Markets Treasury Services	136,541
25,877,100 美元	189,102,107 离岸人 民币	2023年10月31日	HSBC Markets Treasury Services	103,367
1,157,590 美元	8,459,322 离岸人 民币	2023年10月31日	HSBC Markets Treasury Services	4,624
227,167 美元	1,660,066 离岸人 民币	2023年10月31日	HSBC Markets Treasury Services	907
18,962,066 美元	15,557,112 英镑	2023年10月31日	HSBC Markets Treasury Services	29,532
4,500,000 美元	375840000 印度卢比	2023年10月31日	Westpac Banking Corp	8,785
4,151,161 美元	5,669,282 新加坡元	2023年10月31日	HSBC Markets Treasury Services	7,900
8,700,000 离岸人 民币	1,196,306 美元	2023年10月31日	Westpac Banking Corp	999
				299,780

金融衍生工具详情(未经审计)(续)

2023年4月1日起至2023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：				
16,006,311 美元	21,583,870 加元	2023年10月31日	HSBC Markets Treasury Services	(35,145)
1,936,713 美元	1,824,908 欧元	2023年10月31日	HSBC Markets Treasury Services	(2,202)
4,509,324 美元	660,000,000 日元	2023年10月31日	Australia and New Zealand Bank Melbourne	(24,432)
17,000,000 离岸人 民币	2,332,966 美元	2023年10月31日	HSBC Markets Treasury Services	(2,671)
8,200,000 离岸人 民币	1,122,845 美元	2023年10月31日	State Street Bank and Trust Company HK	(3,746)
252,094 离岸人民币	34,575 美元	2023年10月31日	HSBC Markets Treasury Services	(59)
299,621 澳元	192,130 美元	2023年10月31日	HSBC Markets Treasury Services	(1,453)
824,980 离岸人民币	112,832 美元	2023年10月31日	HSBC Markets Treasury Services	(498)
4,477 英镑	5,462 美元	2023年10月31日	HSBC Markets Treasury Services	(3)
1,432,730 离岸人 民币	196,041 美元	2023年10月31日	HSBC Markets Treasury Services	(779)
18,269 英镑	22,172 美元	2023年10月31日	HSBC Markets Treasury Services	(130)
				(71,118)

金融衍生工具详情(未经审计)(续)

2023年4月1日起至2023年9月30日止期间

期货合同

截至2023年9月30日，本基金持有的期货合同如下：

说明	标的资产	交易对手	公允价值 美元
金融资产：			
US 5YR NOTE (CBT) 29/12/2023	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	1,461
US 5YR NOTE (CBT) 29/12/2023	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	234
US ULTRA BOND CBT 19/12/2023	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	74,687
US ULTRA BOND CBT 19/12/2023	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	32,813
US ULTRA BOND CBT 19/12/2023	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	23,875
US ULTRA BOND CBT 19/12/2023	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	49,688
US ULTRA BOND CBT 19/12/2023	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	2,750
US ULTRA BOND CBT 19/12/2023	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	41,719
			227,227
金融负债：			
US 5YR NOTE (CBT) 29/12/2023	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	(3,094)
US LONG BOND(CBT) 19/12/2023	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	(162,188)
			(165,282)

金融衍生工具详情(未经审计)(续) 2023年4月1日起至2023年9月30日止期间

信用违约掉期

截至2023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~ 88 71,900,000.00 USD 25/09/2023 20/12/2028	CDX.NA.IG.40	BNP Paribas SA Paris	(872,059) <hr/> (872,059) <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)

	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	441,510,200	563,501,459	705,150,383	1,451,459,571

(b) 每份额资产净值(按《香港财务报告准则》计算)

每份额资产净值	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
- AC类 - 美元	美元	8.469	8.879	9.690	11.275
- AM2类 - 美元	美元	6.182	6.739	7.922	9.674
- AM2类 - 人民币	人民币	6.572	6.751	7.332	9.258
- AM3O类 - 人民币	人民币	6.076	6.627	7.821	9.540
- AM2类 - 港元	港元	6.242	6.822	7.996	9.695
- AM2类 - 欧元	欧元	6.182	6.566	7.536	8.712
- AM3O类 - 欧元	欧元	5.976	6.544	7.729	9.451
- AM2类 - 澳元	澳元	7.324	7.691	8.062	9.689
- AM3O类 - 澳元	澳元	6.040	6.588	7.770	9.225
- AM2类 - 加元	加元	6.353	6.932	7.517	9.496
- AM3O类 - 加元	加元	6.056	6.603	7.767	9.488
- AM3O类 - 英镑	英镑	6.012	6.553	7.730	9.446
- AM3O类 - 新加坡元	新加坡元	6.056	6.604	7.771	9.495
- BC类 - 美元	美元	8.242	8.641	9.430	11.001
- BC类 - 人民币	人民币	8.494	8.394	8.480	10.209
- BCO类 - 人民币	人民币	8.430	8.961	9.861	10.971
- BC类 - 港元	港元	8.327	8.750	9.527	11.220
- BM2类 - 美元	美元	6.744	7.306	8.588	10.519
- BM2类 - 人民币	人民币	6.972	7.120	7.733	9.757
- BM3O类 - 人民币	人民币	6.732	7.289	8.609	10.488
- BM2类 - 港元	港元	6.813	7.397	8.675	10.500
- BM3O类 - 澳元	澳元	6.699	7.267	8.575	10.518
- IM2类 - 美元	美元	6.422	6.981	8.159	9.908
- IC类 - 美元	美元	7.523	7.865	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
2023年9月30日	8.435	8.957	8.435	8.957
2023年3月31日	7.916	9.747	7.916	9.747
2022年3月31日	9.316	11.444	9.316	11.444
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
2023年9月30日	6.181	6.798	6.181	6.798
2023年3月31日	6.206	7.969	6.206	7.969
2022年3月31日	7.651	9.746	7.651	9.746
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
2023年9月30日	6.572	6.994	6.572	6.994
2023年3月31日	6.467	7.618	6.467	7.618
2022年3月31日	7.108	9.287	7.108	9.287
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
2023年9月30日	6.076	6.674	6.076	6.674
2023年3月31日	6.119	7.864	6.119	7.864
2022年3月31日	7.560	9.622	7.560	9.622

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
2023年9月30日	6.242	6.875	6.242	6.875
2023年3月31日	6.280	8.048	6.280	8.048
2022年3月31日	7.717	9.754	7.717	9.754
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
2023年9月30日	6.063	6.592	6.063	6.592
2023年3月31日	6.420	7.866	6.420	7.866
2022年3月31日	7.371	8.714	7.371	8.714
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
2023年9月30日	5.976	6.596	5.976	6.596
2023年3月31日	6.042	7.775	6.042	7.775
2022年3月31日	7.465	9.508	7.465	9.508
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
2023年9月30日	7.222	7.810	7.222	7.810
2023年3月31日	7.142	8.533	7.142	8.533
2022年3月31日	7.978	10.230	7.978	10.230

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 - 澳元			
	买入价		卖出价	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2023年9月30日	6.040	6.640	6.040	6.640
2023年3月31日	6.075	7.816	6.075	7.816
2022年3月31日	7.507	9.563	7.507	9.563
截至下列日期止的财务期间/年度	AM2 类 - 加元			
	买入价		卖出价	
	最低 加元	最高 加元	最低 加元	最高 加元
2023年9月30日	6.353	6.992	6.353	6.992
2023年3月31日	6.313	7.637	6.313	7.637
2022年3月31日	7.408	9.390	7.408	9.390
截至下列日期止的财务期间/年度	AM30 类 - 加元			
	买入价		卖出价	
	最低 加元	最高 加元	最低 加元	最高 加元
2023年9月30日	6.056	6.658	6.056	6.658
2023年3月31日	6.081	7.813	6.081	7.813
2022年3月31日	7.504	9.555	7.504	9.555
截至下列日期止的财务期间/年度	AM30 类 - 英镑			
	买入价		卖出价	
	最低 英镑	最高 英镑	最低 英镑	最高 英镑
2023年9月30日	6.011	6.608	6.011	6.608
2023年3月31日	6.049	7.777	6.049	7.777
2022年3月31日	7.468	9.515	7.468	9.515

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 - 新加坡元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入价		卖出价	
	最低	最高	最低	最高
	新加坡元	新加坡元	新加坡元	新加坡元
2023年9月30日	6.056	6.659	6.056	6.659
2023年3月31日	6.088	7.818	6.088	7.818
2022年3月31日	7.508	9.565	7.508	9.565
BC 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	最高	最低	最高
	港元	港元	港元	港元
2023年9月30日	8.301	8.825	8.301	8.825
2023年3月31日	7.801	9.590	7.801	9.590
2022年3月31日	9.149	11.157	9.149	11.157
BC 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	最高	最低	最高
	人民币	人民币	人民币	人民币
2023年9月30日	8.416	8.802	8.416	8.802
2023年3月31日	7.788	8.851	7.788	8.851
2022年3月31日	8.183	10.244	8.183	10.244
BC 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	最高	最低	最高
	美元	美元	美元	美元
2023年9月30日	8.209	8.717	8.209	8.717
2023年3月31日	7.704	9.487	7.704	9.487
2022年3月31日	9.066	11.135	9.066	11.135

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
2023年9月30日	8.400	9.028	8.400	9.028
2023年3月31日	8.084	9.920	8.084	9.920
2022年3月31日	9.470	11.444	9.470	11.444
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
2023年9月30日	6.795	7.461	6.795	7.461
2023年3月31日	6.812	8.733	6.812	8.733
2022年3月31日	8.369	10.584	8.369	10.584
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
2023年9月30日	6.969	7.367	6.969	7.367
2023年3月31日	6.823	8.036	6.823	8.036
2022年3月31日	7.497	9.791	7.497	9.791
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
2023年9月30日	6.730	7.370	6.730	7.370
2023年3月31日	6.729	8.640	6.729	8.640
2022年3月31日	8.295	10.567	8.295	10.567

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)

BM30 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
2023年9月30日	6.684	7.327	6.684	7.327
2023年3月31日	6.705	8.625	6.705	8.625
2022年3月31日	8.285	10.561	8.285	10.561
BM30 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
2023年9月30日	6.717	7.343	6.717	7.343
2023年3月31日	6.738	8.660	6.738	8.660
2022年3月31日	8.327	10.602	8.327	10.602
IM2 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
2023年9月30日	6.422	7.044	6.422	7.044
2023年3月31日	6.414	8.209	6.414	8.209
2022年3月31日	7.879	9.994	7.879	9.994
IC 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
2023年9月30日	7.489	7.936	7.489	7.936
2023年3月31日	6.996	8.586	6.996	8.586
2022年3月31日	8.203	10.035	8.203	10.035

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	0.0393	1,156,170.82
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0396	1,208,977.73
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0408	1,369,200.87
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0437	1,527,846.06
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0441	1,608,706.97
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0449	1,672,485.42

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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月17日	0.0417	152,003.95
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0421	154,993.31
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0426	156,834.09
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0456	167,878.74
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0448	164,933.50
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0451	167,173.28

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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月11日	0.0334	1,018,061.02
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0202	685,492.82
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0242	909,905.63
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0278	1,004,906.19
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0266	970,327.68
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0278	1,004,906.19

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	0.0396	7,136,353.76
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0399	7,431,832.13
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0412	8,439,761.52
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0441	9,364,295.08
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0446	9,731,055.34
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0455	9,638,285.86

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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月11日	0.0387	10,176.46
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0385	10,123.87
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0386	10,228.96
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0428	11,788.38
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0430	11,843.46
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0431	11,871.75

AM30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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月11日	0.0298	9,031.69
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0288	12,600.42
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0301	13,348.44
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0332	14,978.45
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0312	14,222.22
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0332	14,978.45

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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月11日	0.0468	43,372.98
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0467	44,117.90
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0453	43,295.54
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0492	48,141.38
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0505	49,535.71
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0508	49,849.45

AM30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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月11日	0.0318	167,805.32
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0318	175,067.44
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0343	199,889.97
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0351	212,492.83
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0345	232,170.62
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0368	223,686.77

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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月11日	0.0404	9,798.82
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0406	9,847.33
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0407	9,871.58
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0441	10,696.24
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0453	11,253.03
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0457	11,352.40

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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月11日	0.0358	126,533.83
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0360	115,349.04
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0370	134,942.35
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0410	166,347.14
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0392	154,413.92
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0410	166,347.14

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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月11日	0.0370	94,798.99
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0374	98,302.48
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0381	115,945.23
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0398	148,073.40
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0384	148,756.11
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0398	148,073.40

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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月11日	0.0310	28,802.68
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0294	27,315.76
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0337	27,521.27
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0386	33,115.41
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0355	30,456.36
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0386	33,115.41

分派披露(续)

BM2类 - 港元

	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17日	0.0426	31,223.88
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0430	31,483.41
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0443	33,708.39
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0487	40,009.91
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0478	38,663.59
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0487	40,009.91

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	0.0439	40,423.93
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0444	40,527.42
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0449	40,313.92
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0475	34,340.35
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0473	34,195.76
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0475	34,340.35

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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月17日	0.0368	46,120.60
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0222	27,600.26
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0267	33,976.82
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0306	33,363.91
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0292	31,837.46
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0306	33,363.91

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17日	0.0430	15,131.12
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0433	15,203.52
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0447	15,656.23
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0493	16,701.33
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0484	16,407.43
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0493	16,701.33

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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月17日	0.0351	8,842.99
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0351	8,303.29
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0378	6,519.87
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0406	7,002.83
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0381	6,587.19
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0406	7,002.83

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
2023年9月派息	2023年9月29日	2023年10月11日	0.0408	9,925.77
2023年8月派息	2023年8月31日	2023年9月12日	0.0411	9,998.75
2023年7月派息	2023年7月31日	2023年8月9日	0.0424	10,315.01
2023年6月派息	2023年6月30日	2023年7月11日	0.0466	11,336.78
2023年5月派息	2023年5月31日	2023年6月9日	0.0458	11,142.16
2023年4月派息	2023年4月28日	2023年5月10日	0.0466	11,336.78

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