

汇丰集合投资信托— 汇丰亚洲高入息债券基金

2021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 2021 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)	43
分派披露(未经审计)	50
行政	55

资产负债表
 2021年9月30日

	2021年9月30日 (未经审计) 美元	2021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	1,077,390,221	1,448,479,001
应收利息	13,020,700	15,770,400
应收申购款	1,106,074	6,891,799
应收经纪商款项	34,310,972	68,618,320
其他应收款	4,440,756	1,890,000
现金和现金等价物	7,277,017	4,070,218
	<u>1,137,545,740</u>	<u>1,545,719,738</u>
负债		
以公允价值计入损益账的金融负债	1,075,868	2,195,072
银行透支	54,469	319
应付赎回款	11,472,175	11,526,138
应付经纪商款项	7,720,454	71,845,959
应付分派	4,480,722	5,621,374
应付税项	20,936	20,640
其他应付款	1,265,561	3,050,665
	<u>26,090,185</u>	<u>94,260,167</u>
份额持有人应占资产净值	<u>1,111,455,555</u>	<u>1,451,459,571</u>
相当于：		
金融负债	<u>1,111,455,555</u>	<u>1,451,459,571</u>

资产负债表

2021年9月30日(续)

	2021年9月30日 (未经审计) 美元	2021年3月31日 (经审计) 美元
已发行份额总数		
- AC类 - 美元	715,596	931,401
- AM2类 - 美元	55,344,659	69,753,877
- AM2类 - 人民币	6,396,631	7,511,932
- AM3O类 - 人民币	49,971,594	67,949,810
- AM2类 - 港元	267,688,969	329,559,732
- AM2类 - 欧元	393,429	420,878
- AM3O类 - 欧元	504,427	728,238
- AM2类 - 澳元	1,384,675	1,841,608
- AM3O类 - 澳元	7,734,504	9,493,963
- AM2类 - 加元	425,187	757,703
- AM3O类 - 加元	4,706,577	5,631,633
- AM3O类 - 英镑	3,558,177	4,738,256
- AM3O类 - 新加坡元	1,074,248	1,078,191
- BC类 - 港元	527,966	549,658
- BC类 - 人民币	361,231	425,811
- BC类 - 美元	761,815	1,167,729
- BCO类 - 人民币	282,808	1,414,894
- BM2类 - 港元	507,836	401,454
- BM2类 - 人民币	762,666	928,106
- BM2类 - 美元	1,161,125	949,791
- BM3O类 - 澳元	181,920	95,156
- BM3O类 - 人民币	1,776,420	1,644,257
- IM2类 - 美元	367,547	174,986
- IC类 - 美元	498,256	-

资产负债表 2021年9月30日(续)

	2021年9月30日 (未经审计) 美元	2021年3月31日 (经审计) 美元
份额净值		
- AC类 - 美元	11.035	11.275
- AM2类 - 美元	9.255	9.674
- AM2类 - 人民币	1.350	1.411
- AM3O类 - 人民币	1.415	1.454
- AM2类 - 港元	1.193	1.247
- AM2类 - 欧元	9.797	10.239
- AM3O类 - 欧元	10.465	11.108
- AM2类 - 澳元	7.068	7.380
- AM3O类 - 澳元	6.557	7.233
- AM2类 - 加元	7.029	7.340
- AM3O类 - 加元	7.161	7.549
- AM3O类 - 英镑	12.182	13.032
- AM3O类 - 新加坡元	6.689	7.067
- BC类 - 港元	1.385	1.415
- BC类 - 人民币	1.521	1.556
- BC类 - 美元	10.740	10.971
- BCO类 - 人民币	1.717	1.710
- BM2类 - 港元	1.294	1.353
- BM2类 - 人民币	1.423	1.487
- BM2类 - 美元	10.034	10.488
- BM3O类 - 澳元	7.240	7.997
- BM3O类 - 人民币	1.558	1.603
- IM2类 - 美元	9.506	9.908
- IC类 - 美元	9.692	-

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2021年9月30日止期间

	2021年4月1日 至2021年9月 30日 美元	2020年4月1日 至2020年9月 30日 美元
现金和现金等价物的利息收入	896	650
以公允价值计入损益账的金融资产和负债的利息收入	31,197,271	28,603,161
股息收入	4,046	8,377
以公允价值计入损益账的金融资产和负债的(亏损)/收益净值	(44,090,473)	86,515,694
汇兑(亏损)/收益净值	(4,360,890)	17,469,903
其他收入	374	37,165
收入总额	(17,248,776)	132,634,950
管理费 ^{注2}	7,608,742	6,829,605
交易费用 ^{注1}	21,665	9,826
受托人费用 ^{注1}	464,223	415,725
审计师酬金	7,797	7,813
过户代办费用 ^{注1}	97,974	75,922
专业人员费用	6,851	9,084
保管费、银行手续费及杂费 ^{注1}	75,884	331,539
总经营开支	8,283,136	7,679,514
收益分配前经营净(亏损)/利润	(25,531,912)	124,955,436
向份额持有人作出收益分配	(29,715,115)	(31,081,471)
份额持有人应占资产净值(减少)/增加及 期间内全面收益总额	(55,247,027)	93,873,965

全面收益表

截至 2021 年 9 月 30 日止期间(续)

注1 在截至 2021 年 9 月 30 日和 2020 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：

	2021 年 4 月 1 日 至 2021 年 9 月 30 日 美元	2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日 美元
交易费用	12,457	9,826
保管费、银行手续费及杂费	41,869	34,320

注2 在截至 2021 年 9 月 30 日和 2020 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2021年9月30日止期间

	2021年4月1日 至2021年9月 30日 美元	2020年4月1日 至2020年9月 30日 美元
期初余额	1,451,459,571	1,020,461,121
份额持有人应占资产净值(减少)/增加及 期间内全面收益总额	(55,247,027)	93,873,965
份额认购		
- AC类 - 美元	809,650	5,828,813
- AM2类 - 美元	33,941,584	281,116,424
- AM2类 - 人民币	200,657	3,807,225
- AM3O类 - 人民币	11,433,925	56,536,740
- AM2类 - 港元	39,795,480	138,130,851
- AM2类 - 欧元	82,314	559,038
- AM3O类 - 欧元	987,740	2,166,310
- AM2类 - 澳元	989,527	4,641,011
- AM3O类 - 澳元	9,020,278	34,567,997
- AM2类 - 加元	97,404	3,148,091
- AM3O类 - 加元	7,576,822	21,340,713
- AM3O类 - 英镑	13,120,723	33,157,335
- AM3O类 - 新加坡元	152,783	3,650,992
- BC类 - 港元	126	1,191,348
- BC类 - 人民币	342,116	1,331,060
- BC类 - 美元	593,026	4,119,076
- BCO类 - 人民币	77,882	1,665,236
- BM2类 - 港元	182,563	408,933
- BM2类 - 人民币	218,657	1,460,019
- BM2类 - 美元	3,272,202	7,934,287
- BM3O类 - 澳元	836,529	856,767
- BM3O类 - 人民币	721,574	2,821,403
- IM2类 - 美元	1,900,000	1,264,362
- IC类 - 美元	5,000,000	-
	131,353,562	611,704,031

份额持有人应占资产净值变动表
 截至2021年9月30日止期间(续)

	2021年4月1日 至2021年9月 30日 美元	2020年4月1日 至2020年9月 30日 美元
<i>份额赎回</i>		
- AC类 - 美元	(3,256,096)	(5,523,309)
- AM2类 - 美元	(172,120,557)	(165,494,416)
- AM2类 - 人民币	(1,775,215)	(2,467,912)
- AM3O类 - 人民币	(37,797,552)	(10,396,278)
- AM2类 - 港元	(116,257,960)	(87,654,153)
- AM2类 - 欧元	(362,079)	(740,701)
- AM3O类 - 欧元	(3,487,140)	(1,981,805)
- AM2类 - 澳元	(4,335,265)	(2,741,706)
- AM3O类 - 澳元	(21,431,317)	(36,142,090)
- AM2类 - 加元	(2,532,131)	(699,202)
- AM3O类 - 加元	(14,569,191)	(12,415,491)
- AM3O类 - 英镑	(28,246,630)	(16,796,542)
- AM3O类 - 新加坡元	(178,308)	(148)
- BC类 - 港元	(30,976)	(564,474)
- BC类 - 人民币	(442,950)	(428,920)
- BC类 - 美元	(5,044,743)	(290,431)
- BCO类 - 人民币	(2,061,181)	(337,633)
- BM2类 - 港元	(38,240)	(5,678)
- BM2类 - 人民币	(457,807)	(223,285)
- BM2类 - 美元	(1,050,544)	(458,554)
- BM3O类 - 澳元	(125,268)	(53,821)
- BM3O类 - 人民币	(509,401)	(118,720)
	<u>(416,110,551)</u>	<u>(345,535,269)</u>
与份额持有人的交易价值总额	<u>(284,756,989)</u>	<u>266,168,762</u>
期末余额	<u>1,111,455,555</u>	<u>1,380,503,848</u>

份额持有人应占资产净值变动表 截至2021年9月30日止期间(续)

	2021年4月1日 至2021年9月30日	2020年4月1日 至2020年9月30日
AC类 - 美元份额		
4月1日的已发行份额数目	931,401	1,158,554
期间内已申购份额	71,511	534,778
期间内已赎回份额	(287,316)	(521,991)
9月30日的已发行份额数目	<u>715,596</u>	<u>1,171,341</u>
AM2类 - 美元份额		
4月1日的已发行份额数目	69,753,877	52,175,222
期间内已申购份额	3,517,111	28,876,673
期间内已赎回份额	(17,926,329)	(17,086,920)
9月30日的已发行份额数目	<u>55,344,659</u>	<u>63,964,975</u>
AM2类 - 人民币份额		
4月1日的已发行份额数目	7,511,932	7,796,336
期间内已申购份额	143,015	2,646,712
期间内已赎回份额	(1,258,316)	(1,775,622)
9月30日的已发行份额数目	<u>6,396,631</u>	<u>8,667,426</u>
AM30类 - 人民币份额		
4月1日的已发行份额数目	67,949,810	25,623,313
期间内已申购份额	7,785,824	41,630,752
期间内已赎回份额	(25,764,040)	(7,521,001)
9月30日的已发行份额数目	<u>49,971,594</u>	<u>59,733,064</u>

份额持有人应占资产净值变动表 截至 2021 年 9 月 30 日止期间(续)

	2021 年 4 月 1 日 至 2021 年 9 月 30 日	2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日
AM2 类 - 港元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	329,559,732	279,565,471
期间内已申购份额	31,943,603	109,371,206
期间内已赎回份额	(93,814,366)	(70,545,643)
	<hr/>	<hr/>
9 月 30 日的已发行份额数目	<u>267,688,969</u>	<u>318,391,034</u>
AM2 类 - 欧元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	420,878	841,900
期间内已申购份额	7,996	54,286
期间内已赎回份额	(35,445)	(70,822)
	<hr/>	<hr/>
9 月 30 日的已发行份额数目	<u>393,429</u>	<u>825,364</u>
AM30 类 - 欧元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	728,238	456,547
期间内已申购份额	88,588	203,514
期间内已赎回份额	(312,399)	(179,921)
	<hr/>	<hr/>
9 月 30 日的已发行份额数目	<u>504,427</u>	<u>480,140</u>
AM2 类 - 澳元份额		
4 月 1 日的已发行份额数目	1,841,608	1,922,663
期间内已申购份额	134,011	626,613
期间内已赎回份额	(590,944)	(376,492)
	<hr/>	<hr/>
9 月 30 日的已发行份额数目	<u>1,384,675</u>	<u>2,172,784</u>

份额持有人应占资产净值变动表 截至2021年9月30日止期间(续)

	2021年4月1日 至2021年9月30日	2020年4月1日 至2020年9月30日
AM30类 - 澳元份额		
4月1日的已发行份额数目	9,493,963	11,530,474
期间内已申购份额	1,261,014	5,133,669
期间内已赎回份额	(3,020,473)	(5,611,953)
	<hr/>	<hr/>
9月30日的已发行份额数目	<u>7,734,504</u>	<u>11,052,190</u>
AM2类 - 加元份额		
4月1日的已发行份额数目	757,703	538,456
期间内已申购份额	13,165	421,886
期间内已赎回份额	(345,681)	(97,130)
	<hr/>	<hr/>
9月30日的已发行份额数目	<u>425,187</u>	<u>863,212</u>
AM30类 - 加元份额		
4月1日的已发行份额数目	5,631,633	5,241,159
期间内已申购份额	995,181	3,009,501
期间内已赎回份额	(1,920,237)	(1,754,124)
	<hr/>	<hr/>
9月30日的已发行份额数目	<u>4,706,577</u>	<u>6,496,536</u>
AM30类 - 英镑份额		
4月1日的已发行份额数目	4,738,256	3,232,896
期间内已申购份额	998,777	2,742,379
期间内已赎回份额	(2,178,856)	(1,398,652)
	<hr/>	<hr/>
9月30日的已发行份额数目	<u>3,558,177</u>	<u>4,576,623</u>

份额持有人应占资产净值变动表 截至2021年9月30日止期间(续)

	2021年4月1日 至2021年9月30日	2020年4月1日 至2020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	1,078,191	447,875
期间内已申购份额	21,861	520,674
期间内已赎回份额	(25,804)	(20)
	<hr/>	<hr/>
9月30日的已发行份额数目	<u>1,074,248</u>	<u>968,529</u>
BC类 - 港元份额		
4月1日的已发行份额数目	549,658	-
期间内已申购份额	89	869,042
期间内已赎回份额	(21,781)	(398,996)
	<hr/>	<hr/>
9月30日的已发行份额数目	<u>527,966</u>	<u>470,046</u>
BC类 - 人民币份额		
4月1日的已发行份额数目	425,811	-
期间内已申购份额	219,967	1,096,473
期间内已赎回份额	(284,547)	(210,389)
	<hr/>	<hr/>
9月30日的已发行份额数目	<u>361,231</u>	<u>886,084</u>
BC类 - 美元份额		
4月1日的已发行份额数目	1,167,729	-
期间内已申购份额	53,900	386,730
期间内已赎回份额	(459,814)	(26,687)
	<hr/>	<hr/>
9月30日的已发行份额数目	<u>761,815</u>	<u>360,043</u>

份额持有人应占资产净值变动表 截至2021年9月30日止期间(续)

	2021年4月1日 至2021年9月30日	2020年4月1日 至2020年9月30日
BCO类 - 人民币份额		
4月1日的已发行份额数目	1,414,894	-
期间内已申购份额	44,798	894,820
期间内已赎回份额	(1,176,884)	(280,767)
	<hr/>	<hr/>
9月30日的已发行份额数目	282,808	614,053
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>
BM2类 - 港元份额		
4月1日的已发行份额数目	401,454	-
期间内已申购份额	135,201	299,237
期间内已赎回份额	(28,819)	(4,206)
	<hr/>	<hr/>
9月30日的已发行份额数目	507,836	295,031
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>
BM2类 - 人民币份额		
4月1日的已发行份额数目	928,106	-
期间内已申购份额	146,763	1,000,266
期间内已赎回份额	(312,203)	(146,799)
	<hr/>	<hr/>
9月30日的已发行份额数目	762,666	853,467
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>
BM2类 - 美元份额		
4月1日的已发行份额数目	949,791	-
期间内已申购份额	312,087	759,327
期间内已赎回份额	(100,753)	(42,947)
	<hr/>	<hr/>
9月30日的已发行份额数目	1,161,125	716,380
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>

份额持有人应占资产净值变动表 截至2021年9月30日止期间(续)

	2021年4月1日 至2021年9月30日	2020年4月1日 至2020年9月30日
BM30类 - 澳元份额		
4月1日的已发行份额数目	95,156	-
期间内已申购份额	102,867	124,719
期间内已赎回份额	(16,103)	(6,998)
	<hr/>	<hr/>
9月30日的已发行份额数目	181,920	117,721
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>
BM30类 - 人民币份额		
4月1日的已发行份额数目	1,644,257	-
期间内已申购份额	447,445	1,890,542
期间内已赎回份额	(315,282)	(80,001)
	<hr/>	<hr/>
9月30日的已发行份额数目	1,776,420	1,810,541
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>
IM2类 - 美元份额		
4月1日的已发行份额数目	174,986	-
期间内已申购份额	192,561	125,932
	<hr/>	<hr/>
9月30日的已发行份额数目	367,547	125,932
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>
IC类 - 美元份额		
4月1日的已发行份额数目	-	-
期间内已申购份额	498,256	-
	<hr/>	<hr/>
9月30日的已发行份额数目	498,256	-
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>

份额持有人应占资产净值变动表 截至 2021 年 9 月 30 日止期间(续)

	2021 年 4 月 1 日 至 2021 年 9 月 30 日	2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日
总额		
4 月 1 日的已发行份额数目	508,149,064	390,530,866
期间内已申购份额	49,135,591	203,219,731
期间内已赎回份额	(150,196,392)	(108,138,081)
9 月 30 日的已发行份额数目	<u>407,088,263</u>	<u>485,612,516</u>

现金流量表

截至 2021 年 9 月 30 日止期间

	2021 年 4 月 1 日 至 2021 年 9 月 30 日 美元	2020 年 4 月 1 日 至 2020 年 9 月 30 日 美元
经营活动		
已收利息	33,947,867	27,840,319
已收股息	4,046	8,377
已付管理费	(8,046,223)	(6,709,992)
已付受托人费用	(490,663)	(408,435)
购买投资的付款	(1,386,905,207)	(1,320,342,442)
出售投资的所得款项	1,683,454,853	1,050,183,982
退回税项	296	791
其他(已付)/已收经营开支	(8,931,326)	18,673,934
经营活动产生/(使用)的现金	313,033,643	(230,753,466)
融资活动		
份额发行所得款项	137,139,287	602,170,519
份额赎回付款	(416,164,514)	(339,594,082)
已付分配	(30,855,767)	(29,311,364)
融资活动(使用)/产生的现金	(309,880,994)	233,265,073
现金和现金等价物增加净额	3,152,649	2,511,607
期初现金和现金等价物	4,069,899	4,672,229
期末现金和现金等价物	7,222,548	7,183,836

投资组合报表(未经审计)
 2021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	3,300,000	3,487,704	0.31
		<hr/> 3,487,704	<hr/> 0.31
百慕大			
中油燃气集团有限公司 4.7% 2026年6月 30日	4,347,000	4,442,590	0.40
利丰有限公司 4.5% 2025年8月18日	5,000,000	5,177,300	0.47
		<hr/> 9,619,890	<hr/> 0.87
英属维尔京群岛			
CHALCO HK INVESTMENT 2.1% 2026 年7月28日	1,234,000	1,225,054	0.11
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE FIN 4% 永续债券 2049年12月31日	1,300,000	1,287,065	0.12
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE FIN 4.2% 永续债券 2049年12月31日	10,733,000	10,770,673	0.97
CHINA CINDA 2020 I MNGMN 1.875% 2026年1月20日	1,175,000	1,146,236	0.10
CHINA CINDA 2020 I MNGMN 2% 2023 年3月18日	1,478,000	1,483,587	0.13
CHINA CINDA FINANCE 2017 3.875% 2023年2月8日	3,000,000	3,085,800	0.28
中铝资本控股有限公司 可变债券 永续债 券 2049年12月31日	1,924,000	2,014,466	0.18
CICC HK FINANCE 2016 2% 2026年1 月26日	2,884,000	2,876,992	0.26

投资组合报表(未经审计)(续) 2021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)			
CN HUANENG GP HK TREASURY 可 变债券 永续债券 2049年12月31日	2,765,000	2,819,083	0.25
CNOOC FINANCE 2013 LTD 3.3% 2049年9月30日	7,149,000	6,821,147	0.61
CNRC CAPITALE LTD 可变债券 永续 债券 2049年12月31日	1,423,000	1,441,357	0.13
ELECT GLOBAL INV LTD 4.85% 永续 债券 2049年12月31日	2,153,000	2,192,228	0.20
FORTUNE STAR BVI LTD 5% 2026年 5月18日	5,835,000	5,785,227	0.52
FORTUNE STAR BVI LTD 5.95% 2025 年10月19日	5,908,000	6,038,094	0.54
HUARONG FINANCE 2017 CO 2022 年4月27日	900,000	874,845	0.08
HUARONG FINANCE 2017 CO 3.75% 2022年4月27日	1,938,000	1,894,473	0.17
HUARONG FINANCE 2017 CO 可变债 券 永续债券 2049年12月29日	3,000,000	2,778,660	0.25
HUARONG FINANCE 2019 3.375% 2022年5月29日	387,000	376,880	0.03
HUARONG FINANCE 可变债券 永续债 券 2049年12月29日	300,000	289,506	0.03
IFC DEVELOPMENT CORP TRS 3.625% 2029年4月17日	3,663,000	3,959,410	0.36
JOY TRSR ASSETS HOLDINGS 3.5% 2029年9月24日	1,324,000	1,344,575	0.12
LS FINANCE 2017 LTD 4.8% 2026年 6月18日	5,200,000	5,012,228	0.45
NAN FUNG TREASURY 5% 永续债券 2049年12月31日	5,151,000	5,192,105	0.47
NAN FUNG TREASURY LTD 3.625% 2030年8月27日	5,158,000	5,201,843	0.47

投资组合报表(未经审计)(续)
 2021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)			
NWD FINANCE (BVI) LTD 4.8% 永续债券 2049年12月31日	6,650,000	6,500,242	0.59
NWD FINANCE (BVI) LTD 可变债券 永续债券 2049年12月31日	4,903,000	4,860,295	0.44
PANTHER VENTURES LTD 3.5% 永续债券 2049年12月31日	3,000,000	2,887,140	0.26
RADIANCE CAPITAL INVESTMENTS 10.5% 2022年1月16日	3,717,000	3,707,633	0.33
RADIANCE CAPITAL INVESTMENTS 11.75% 2021年10月31日	3,400,000	3,408,466	0.31
RADIANCE CAPITAL INVESTMENTS 8.8% 2023年9月17日	2,484,000	2,391,744	0.22
RKPF OVERSEAS 2020 A LTD 5.125% 2026年7月26日	7,404,000	6,817,603	0.61
RKPF OVERSEAS 2020 A LTD 5.2% 2026年1月12日	6,517,000	6,044,061	0.54
SF HOLDING INVESTMENT 2.875% 2030年2月20日	3,734,000	3,776,978	0.34
SINOCHEM OFFSHORE CAPITAL 1.5% 2026年9月23日	5,583,000	5,488,647	0.49
SINOCHEM OFFSHORE CAPITAL 2.375% 2031年9月23日	5,593,000	5,439,752	0.49
SINOPEC GRP DEVELOPMENT 2018 2.7% 2030年5月13日	2,070,000	2,126,387	0.19
STUDIO CITY FINANCE LTD 6% 2025年7月15日	1,949,000	1,939,898	0.17
SUN HUNG KAI & CO BVI 5% 2026年9月7日	2,143,000	2,162,608	0.20

投资组合报表(未经审计)(续)
 2021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)			
TALENT YIELD INTERNATIONAL 3.125% 2031年5月6日	3,629,000	3,781,055	0.34
WHARF REIC FINANCE BVI 2.875% 2030年5月7日	1,706,000	1,739,421	0.16
怡锦投资有限公司 2.8% 2026年8月 18日	3,103,000	3,142,253	0.28
盈德气体投资有限公司 6.25% 2023年 1月19日	9,000,000	9,261,000	0.83
YUNDA HOLDING INVESTMENT 2.25% 2025年8月19日	8,467,000	8,280,049	0.75
		159,666,766	14.37
开曼群岛			
AAC TECHNOLOGIES HOLDING 3.75% 2031年6月2日	3,105,000	3,167,131	0.29
ACEN FINANCE LTD 4% 永续债券 2049年12月31日	3,394,000	3,357,650	0.30
雅居乐集团控股有限公司 可变债券 永 续债券 2049年12月31日	5,000,000	4,716,000	0.42
雅居乐集团控股有限公司 4.85% 2022 年8月31日	4,073,000	4,004,370	0.36
阿里巴巴集团控股有限公司 3.25% 2061年2月9日	5,000,000	4,681,050	0.42
AYC FINANCE LTD 3.9% 永续债券 2049年12月31日	5,295,000	5,154,100	0.46
AYC FINANCE LTD 4.85% 永续债券 2049年12月31日	542,000	560,368	0.05
神州租车有限公司 8.875% 2022年5月 10日	2,000,000	2,041,360	0.18
神州租车有限公司 9.75% 2024年3月 31日	250,000	261,113	0.02

投资组合报表(未经审计)(续)
 2021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)			
CCBL CAYMAN 1 CORP 1.6% 2026年 9月15日	1,094,000	1,078,914	0.10
CDBL FUNDING 1 3.5% 2027年10月 24日	5,000,000	5,286,550	0.48
建业地产控股有限公司 6.875% 2022年 8月8日	5,700,000	4,166,814	0.38
中国奥园集团股份有限公司 6.35% 2024年2月8日	450,000	383,445	0.03
中国奥园集团股份有限公司 7.95% 2024年6月21日	200,000	172,118	0.02
中国宏桥集团有限公司 7.125% 2022年 7月22日	4,500,000	4,581,180	0.41
中骏集团控股有限公司 6% 2026年2月 4日	6,328,000	5,675,393	0.51
CK PROPERTY FINANCE 1.375% 2026年6月30日	8,708,000	8,633,460	0.78
碧桂园控股有限公司 3.3% 2031年1月 12日	2,000,000	1,835,520	0.17
碧桂园控股有限公司 3.875% 2030年 10月22日	800,000	744,920	0.07
德信中国控股有限公司 9.95% 2022年 12月3日	4,779,000	4,328,818	0.39
一嗨汽车租赁有限公司 5.875% 2022年 8月14日	3,500,000	3,532,865	0.32
一嗨汽车租赁有限公司 7% 2026年9月 21日	2,921,000	2,760,520	0.25
一嗨汽车租赁有限公司 7.75% 2024年 11月14日	274,000	275,882	0.02
宏华集团有限公司 6.375% 2022年8月 1日	3,192,000	3,118,041	0.28
HPHT FINANCE 21 II LTD 1.5% 2026 年9月17日	6,362,000	6,266,952	0.56

投资组合报表(未经审计)(续)
 2021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)			
京东商城电子商务有限公司 3.375% 2030年1月14日	1,614,000	1,699,929	0.15
佳兆业集团控股有限公司 11.95% 2023 年11月12日	4,036,000	3,334,301	0.30
佳兆业集团控股有限公司 9.375% 2024 年6月30日	6,000,000	4,650,000	0.42
合景泰富集团控股有限公司 5.95% 2025年8月10日	2,368,000	2,146,355	0.19
合景泰富集团控股有限公司 6.3% 2026 年2月13日	4,918,000	4,453,593	0.40
合景泰富集团控股有限公司 7.4% 2027 年1月13日	250,000	234,223	0.02
美高梅中国控股有限公司 4.75% 2027 年2月1日	2,408,000	2,379,489	0.21
当代置业(中国)有限公司 9.8% 2023年 4月11日	5,176,000	4,377,861	0.39
宝龙地产控股有限公司 4.9% 2026年5 月13日	1,694,000	1,595,121	0.14
宝龙地产控股有限公司 5.95% 2025年 4月30日	2,240,000	2,159,181	0.19
宝龙地产控股有限公司 6.25% 2024年 8月10日	507,000	492,434	0.04
金辉控股(集团)有限公司 7.8% 2024年 3月20日	3,492,000	3,318,552	0.30
弘阳地产集团有限公司 7.3% 2025年1 月13日	3,000,000	2,505,090	0.23
弘阳地产集团有限公司 7.3% 2024年5 月21日	2,804,000	2,376,923	0.21
弘阳地产集团有限公司 9.7% 2023年4 月16日	2,500,000	2,299,650	0.21
力高地产集团有限公司 11% 2022年8 月6日	3,043,000	2,846,453	0.26

投资组合报表(未经审计)(续) 2021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 8% 2022年4月13日	1,181,000	1,104,011	0.10
金沙中国有限公司 2.3% 2027年3月8日	4,444,000	4,301,214	0.39
金沙中国有限公司 2.85% 2029年3月8日	2,667,000	2,568,134	0.23
金沙中国有限公司 3.25% 2031年8月8日	4,444,000	4,293,837	0.39
金沙中国有限公司 3.8% 2026年1月8日	756,000	780,842	0.07
金沙中国有限公司 4.375% 2030年6月18日	2,270,000	2,373,194	0.21
金沙中国有限公司 5.4% 2028年8月8日	4,553,000	5,039,534	0.45
SHUI ON DEVELOPMENT HOLDING 5.5% 2026年6月29日	3,416,000	3,289,335	0.30
新力控股(集团)有限公司 8.5% 2022年1月24日	3,593,000	898,250	0.08
融创中国控股有限公司 5.95% 2024年4月26日	4,706,000	3,808,895	0.34
融创中国控股有限公司 6.8% 2024年10月20日	9,756,000	7,899,726	0.71
腾讯控股有限公司 3.24% 2050年6月3日	6,000,000	5,736,600	0.52
腾讯控股有限公司 3.925% 2038年1月19日	2,100,000	2,241,708	0.20
腾讯音乐娱乐集团 2% 2030年9月3日	1,958,000	1,853,051	0.17
时代中国控股有限公司 6.2% 2026年3月22日	1,197,000	1,087,822	0.10
新浪公司 3.375% 2030年7月8日	5,000,000	5,014,300	0.45

投资组合报表(未经审计)(续)
 2021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% 2026年1月15日	5,224,000	5,074,333	0.46
永利澳门有限公司 5.625% 2028年8月26日	1,811,000	1,733,960	0.16
禹洲地产股份有限公司 7.375% 2026年1月13日	1,960,000	1,305,850	0.12
禹洲地产股份有限公司 7.7% 2025年2月20日	4,907,000	3,633,535	0.33
禹洲地产股份有限公司 8.625% 2022年1月23日	2,800,000	2,698,304	0.24
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	217,777	0.02
正荣地产集团有限公司 6.5% 2022年9月1日	1,157,000	1,120,254	0.10
正荣地产集团有限公司 7.1% 2024年9月10日	3,863,000	3,407,475	0.31
正荣地产集团有限公司 7.125% 2022年6月30日	33,630,000	5,128,653	0.46
中升集团控股有限公司 3% 2026年1月13日	1,125,000	1,138,163	0.10
		<u>199,402,446</u>	<u>17.94</u>
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	2,805,018	0.25
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	3,486,431	0.32
		<u>6,291,449</u>	<u>0.57</u>

投资组合报表(未经审计)(续)
 2021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			
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	8,438,162	0.76
香港机场管理局 可变债券 永续债券 2049年12月31日	4,033,000	4,040,017	0.36
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	5,366,700	0.48
交通银行(香港)有限公司 可变债券 永续 债券 2031年7月8日	19,575,000	19,268,651	1.73
东亚银行有限公司 可变债券 2030年5 月29日	6,800,000	7,125,312	0.64
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	1,378,242	0.12
华南城控股有限公司 10.75% 2023年4 月11日	5,720,000	3,429,884	0.31
招银国际租赁管理有限公司 1.875% 2025年8月12日	7,013,000	6,987,543	0.63
招银国际租赁管理有限公司 2% 2026年 2月4日	4,623,000	4,601,642	0.41
中国农化(香港)峰桥有限公司 3% 2030 年9月22日	282,000	282,510	0.03
中国农化(香港)峰桥有限公司 3.125% 2022年6月19日	300,000	304,203	0.03
中国农化(香港)峰桥有限公司 4.625% 2023年3月14日	5,000,000	5,237,600	0.47
中国农化(香港)峰桥有限公司 4.75% 2049年6月19日	200,000	228,542	0.02
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	8,000,000	8,150,400	0.73
远东宏信有限公司 2.625% 2024年3月 3日	4,273,000	4,283,170	0.39

投资组合报表(未经审计)(续)
2021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)			
FEC FINANCE LTD 5.1% 2024年1月 21日	2,300,000	2,352,900	0.21
工银国际租赁财务有限公司 1.75% 2025年8月25日	1,669,000	1,660,171	0.15
联想集团有限公司 5.875% 2025年4月 24日	2,516,000	2,836,563	0.26
阳光城嘉世国际有限公司 7.5% 2021年 2月17日	758,000	492,791	0.05
阳光城嘉世国际有限公司 8.25% 2023 年11月25日	1,900,000	1,295,325	0.12
阳光城嘉世国际有限公司 9.25% 2023 年4月15日	1,200,000	988,848	0.09
		88,749,176	7.99
印度			
10 RENEW POWER SUBSIDIARY 4.5% 2028年7月14日	7,937,000	8,098,915	0.73
ADANIREN KODSOPAR WARSOM 4.625% 2039年10月15日	3,468,000	3,301,774	0.30
AXIS BANK GIFT CITY 可变债券 永续 债券 2049年12月31日	3,925,000	3,893,718	0.35
EXPORT-IMPORT BK INDIA 2.25% 2031年1月13日	11,627,000	10,832,178	0.97
HDFC BANK LTD 可变债券 永续债券 2049年12月31日	8,670,000	8,652,400	0.78
JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125% 2031年5月18日	7,245,000	7,217,904	0.65
JSW STEEL LTD 3.95% 2027年4月5 日	3,890,000	3,869,422	0.35
JSW STEEL LTD 5.05% 2032年4月5 日	1,366,000	1,362,175	0.12

投资组合报表(未经审计)(续)
 2021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)			
NTPC LTD 4.5% 2028年3月19日	650,000	707,083	0.06
POWER FINANCE CORP LTD 3.35% 2031年5月16日	18,977,000	18,572,600	1.67
REC LTD 2.25% 2026年9月1日	7,388,000	7,215,490	0.65
REC LTD 2.75% 2027年1月13日	9,788,000	9,704,019	0.87
RELIANCE INDUSTRIES LTD 4.875% 2045年2月10日	7,200,000	8,916,048	0.80
SHRIRAM TRANSPORT FIN 4.4% 2024年3月13日	1,200,000	1,201,452	0.11
SHRIRAM TRANSPORT FIN 5.95% 2022年10月24日	7,583,000	7,736,480	0.70
YES BANK IFSC BANKING 3.75% 2023年2月6日	8,500,000	8,417,550	0.76
		109,699,208	9.87
印尼			
BANK MANDIRI PT 2% 2026年4月 19日	1,513,000	1,518,553	0.14
BANK NEGARA INDONESIA 可变债券 永续债券 2049年12月31日	3,291,000	3,294,455	0.30
BUKIT MAKMUR MANDIRI UTA 7.75% 2026年2月10日	1,283,000	1,262,382	0.11
INDOFOOD CBP SUKSES MAKM 4.745% 2051年6月9日	1,500,000	1,551,360	0.14
印度尼西亚共和国(政府) 3.2% 2061年 9月23日	9,494,000	8,882,586	0.80
印度尼西亚共和国(政府) 3.35% 2071年 3月12日	6,400,000	5,928,896	0.53
印度尼西亚共和国(政府) 3.55% 2051年 6月9日	4,423,000	4,379,168	0.39

投资组合报表(未经审计)(续)
 2021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) 4.45% 2070年 4月15日	8,000,000	9,153,280	0.82
印度尼西亚共和国(政府) 5.125% 2045 年1月15日	6,500,000	7,881,900	0.71
印度尼西亚共和国(政府) 8.5% 2035年 10月12日	4,106,000	6,423,796	0.58
INDONESIA ASAHAN ALUMINI 6.53% 2028年11月15日	4,000,000	4,871,800	0.44
INDONESIA ASAHANALUMINI 6.757% 2048年11月15日	2,090,000	2,693,216	0.24
JAPFA COMFEED TBK PT 5.375% 2026年3月23日	1,288,000	1,367,431	0.12
PERTAMINA PERSERO 6.45% 2044 年5月30日	1,000,000	1,305,960	0.12
PERTAMINA PERSERO PT 6.5% 2048年11月7日	3,000,000	3,987,060	0.36
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 6.15% 2048年5月21日	10,219,000	12,665,735	1.14
PT PAKUWON JATI 4.875% 2028年4 月29日	12,106,000	12,531,284	1.13
PT PERTAMINA (PERSERO) 2.3% 2031年2月9日	23,783,000	22,770,320	2.05
SAKA ENERGI INDONESIA PT 4.45% 2024年5月5日	800,000	770,760	0.07
SARANA MULTI INFRASTRUKT 2.05% 2026年5月11日	1,940,000	1,913,888	0.17
		<u>115,153,830</u>	<u>10.36</u>

投资组合报表(未经审计)(续)
 2021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)			
泽西岛			
中国西部水泥有限公司 4.95% 2026年 7月8日	4,158,000	4,063,572	0.37
		<hr/> 4,063,572	<hr/> 0.37
马来西亚			
MALAYSIA WAKALA SUKUK 3.075% 2051年4月28日	3,066,000	3,124,009	0.28
PETRONAS CAPITAL LTD 3.404% 2061年4月28日	17,000,000	17,137,020	1.54
		<hr/> 20,261,029	<hr/> 1.82
毛里求斯			
AZURE POWER ENERGY LTD 3.575% 2026年8月19日	4,178,000	4,239,333	0.38
CLEAN RENEWABLE POWER 4.25% 2027年3月25日	4,491,000	4,557,512	0.41
INDIA GREEN ENERGY HOLDING 5.375% 2024年4月29日	1,759,000	1,833,335	0.16
NETWORK I2I LTD 可变债券 永续债券 2049年12月31日	7,857,000	8,152,671	0.74
UPL CORP LTD 可变债券 永续债券 2049年12月31日	2,732,000	2,794,563	0.25
		<hr/> 21,577,414	<hr/> 1.94

投资组合报表(未经审计)(续)
 2021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			
蒙古(政府)国际债券 3.5% 2027年7月7日	1,784,000	1,734,673	0.15
蒙古(政府)国际债券 4.45% 2031年7月7日	1,685,000	1,637,129	0.15
		3,371,802	0.30
荷兰			
JABABEKA INTERNATIONAL 6.5% 2023年10月5日	7,751,000	7,508,936	0.67
MINEJESA CAPITAL BV 4.625% 2030 年8月10日	7,500,000	7,766,475	0.70
		15,275,411	1.37
巴基斯坦			
巴基斯坦伊斯兰共和国(政府) 6.875% 2027年12月5日	5,000,000	5,042,850	0.45
巴基斯坦伊斯兰共和国(政府) 6% 2026年 4月8日	12,043,000	11,996,755	1.08
巴基斯坦伊斯兰共和国(政府) 7.375% 2031年4月8日	3,277,000	3,278,180	0.30
		20,317,785	1.83
菲律宾			
DEV BANK PHILIPPINES 2.375% 2031 年3月11日	6,100,000	5,952,929	0.53
PETRON CORP 可变债券 永续债券 2049年12月31日	3,837,000	3,990,096	0.36
菲律宾共和国(政府) 5% 2037年1月13 日	8,653,000	10,694,675	0.96

投资组合报表(未经审计)(续)
 2021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)			
菲律宾(续)			
菲律宾共和国(政府) 3.2% 2046年7月6日	16,885,000	16,656,377	1.50
菲律宾共和国(政府) 2.65% 2045年12月10日	4,455,000	4,083,498	0.37
菲律宾共和国(政府) 3.7% 2042年2月2日	9,600,000	10,192,608	0.92
		51,570,183	4.64
新加坡			
ABJA INVESTMENT CO 5.45% 2028年1月24日	11,135,000	12,159,420	1.09
中银航空租赁有限公司 2.625% 2030年9月17日	14,915,000	14,768,386	1.33
星展集团控股有限公司 可变债券 2031年3月10日	11,692,000	11,634,358	1.05
怡略有限公司 5.75% 2022年1月13日	2,000,000	1,807,500	0.16
INDIKA ENERGY 5.875% 2024年11月9日	4,401,000	4,430,751	0.40
INDIKA ENERGY CAPITAL 8.25% 2025年10月22日	11,361,000	11,820,666	1.06
LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.5% 2026年2月9日	2,008,000	2,085,669	0.19
MEDCO BELL PTE LTD 6.375% 2027年1月30日	3,000,000	3,031,080	0.27
MEDCO OAK TREE PTE LTD 7.375% 2026年5月14日	11,400,000	12,166,422	1.10
ONGC VIDESH VANKORNEFT 3.75% 2026年7月27日	9,397,000	9,942,308	0.89
华侨银行 可变债券 2030年9月10日	3,850,000	3,837,680	0.35

投资组合报表(未经审计)(续)
 2021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)			
THETA CAPITAL PTE LTD 6.75% 2026 年10月31日	8,088,000	8,001,458	0.72
THETA CAPITAL PTE LTD 8.125% 2025年1月22日	869,000	907,219	0.08
TML HOLDINGS PTE LTD 4.35% 2026 年6月9日	12,022,000	12,137,291	1.09
TML HOLDINGS PTE LTD 5.5% 2024 年6月3日	738,000	770,856	0.07
UNITED OVERSEAS BANK LTD 可变债 券 2031年3月16日	6,608,000	6,555,797	0.59
UNITED OVERSEAS BANK LTD 可变债 券 永续债券 2049年12月31日	5,000,000	5,185,100	0.47
		121,241,961	10.91
韩国			
HANA BANK 1.25% 2026年12月16日	4,112,000	4,063,561	0.37
KOOKMIN BANK 2.5% 2030年11月4 日	3,915,000	3,875,341	0.35
LG CHEM LTD 2.375% 2031年7月7 日	1,628,000	1,603,938	0.14
SHINHAN FINANCIAL GROUP 可变债 券 2030年2月5日	1,418,000	1,472,635	0.13
SHINHAN FINANCIAL GROUP 可变债 券 永续债券 2049年12月29日	6,000,000	5,965,260	0.54
SK HYNIX INC 2.375% 2031年1月19 日	5,199,000	5,050,621	0.45
		22,031,356	1.98

投资组合报表(未经审计)(续)
 2021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)			
斯里兰卡			
斯里兰卡民主社会主义共和国(政府) 5.75% 2023年4月18日	9,089,000	6,053,819	0.55
斯里兰卡民主社会主义共和国(政府) 6.2% 2027年5月11日	2,950,000	1,813,689	0.16
斯里兰卡民主社会主义共和国(政府) 6.35% 2024年6月28日	600,000	386,028	0.04
斯里兰卡民主社会主义共和国(政府) 6.75% 2028年4月18日	1,250,000	768,313	0.07
斯里兰卡民主社会主义共和国(政府) 6.85% 2025年11月3日	5,000,000	3,164,350	0.28
斯里兰卡民主社会主义共和国(政府) 6.85% 2024年3月14日	5,400,000	3,472,146	0.31
斯里兰卡民主社会主义共和国(政府) 7.85% 2029年3月14日	2,500,000	1,537,850	0.14
斯里兰卡(政府)国际债券 6.825% 2026年 7月18日	5,000,000	3,124,300	0.28
		20,320,495	1.83
泰国			
BANGKOK BANK PCL/HK 可变债券 永 续债券 2049年12月31日	3,371,000	3,517,841	0.32
BANGKOK BANK PLC 9.025% 2029年 3月15日	4,718,000	6,484,985	0.57
GC TREASURY CENTRE CO 2.98% 2031年3月18日	2,585,000	2,618,450	0.24
MINOR INTERNATIONAL PCL 可变债券 永续债券 2049年12月31日	5,193,000	5,295,614	0.48
THAIOIL TRSRY CENTER 5.375% 2048 年11月20日	2,618,000	2,970,356	0.27

投资组合报表(未经审计)(续)
 2021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)			
TMB THANACHART BANK 可变债券 永 续债券 2049年12月31日	1,284,000	1,300,525	0.12
		<hr/>	<hr/>
		22,187,771	2.00
		<hr/>	<hr/>
土耳其			
HYUNDAI ASSAN OTOMOTIV 1.625% 2026年7月12日	6,314,000	6,251,870	0.56
		<hr/>	<hr/>
		6,251,870	0.56
		<hr/>	<hr/>
英国			
VEDANTA RESOURCES 13.875% 2024 年1月21日	6,400,000	6,902,464	0.62
VEDANTA RESOURCES 8.95% 2025 年3月11日	4,380,000	4,380,219	0.39
VEDANTA RESOURCES LTD 6.375% 2022年7月30日	4,870,000	4,864,205	0.44
VEDANTA RESOURCES LTD 8% 2023 年4月23日	644,000	626,998	0.06
		<hr/>	<hr/>
		16,773,886	1.51
		<hr/>	<hr/>
美国			
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 2.1% 2028年9月15日	3,366,000	3,321,535	0.30
PERIAMA HOLDINGS LLC/DE 5.95% 2026年4月19日	2,865,000	3,079,732	0.27
RESORTS WORLD/RWLV CAP 4.625% 2029年4月16日	1,300,000	1,322,308	0.12
		<hr/>	<hr/>
		7,723,575	0.69
		<hr/>	<hr/>

投资组合报表(未经审计)(续)
 2021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)			
未上市但有报价的投资			
开曼群岛			
MELCO RESORTS FINANCE 5.75% 2028年7月21日	3,156,000	3,238,056	0.29
		<u>3,238,056</u>	<u>0.29</u>
债券(合计)		<u>1,048,276,635</u>	<u>94.32</u>
单位信托			
上市投资			
爱尔兰			
HSBC GLOBAL LIQUIDITY FUNDS - HSBC GLOBAL LIQUIDITY FUNDS PL*	25,484,515	25,484,515	2.29
		<u>25,484,515</u>	<u>2.29</u>
非上市投资			
香港			
HSBC ALL CHINA BOND ZC-USD	150,000	1,854,150	0.17
		<u>1,854,150</u>	<u>0.17</u>
单位信托(合计)		<u>27,338,665</u>	<u>2.46</u>
债券期货			
上市投资			
US 10YR ULTRA FUT 21/12/2021	(63)	133,383	0.01
US 10YR ULTRA FUT 21/12/2021	(40)	110,000	0.01

投资组合报表(未经审计)(续)
 2021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			
US 10YR ULTRA FUT 21/12/2021	(72)	171,421	0.01
US 10YR ULTRA FUT 21/12/2021	(50)	33,594	-
US 10YR ULTRA FUT 21/12/2021	(50)	(6,250)	-
US ULTRA BOND CBT 21/12/2021	(30)	130,434	0.01
US ULTRA BOND CBT 21/12/2021	(10)	62,448	0.01
US ULTRA BOND CBT 21/12/2021	(40)	256,249	0.02
US ULTRA BOND CBT 21/12/2021	(50)	293,749	0.03
US ULTRA BOND CBT 21/12/2021	(50)	243,887	0.02
US ULTRA BOND CBT 21/12/2021	(25)	78,199	0.01
US ULTRA BOND CBT 21/12/2021	(50)	67,188	0.01
		1,574,302	0.14
外币远期合同		(875,249)	(0.08)
投资总额(投资成本合计: 1,100,090,201 美元)		1,076,314,353	96.84
其他资产净值		35,141,202	3.16
2021年9月30日的资产净值总额		1,111,455,555	100.00

*该投资基金在香港未获授权，也不对香港公众开放。

投资组合变动表(未经审计)
 2021年4月1日起至2021年9月30日止期间

	占资产净值 百分比 2021年 9月30日	占资产净值百分 比 2021年 3月31日
金融资产		
债务证券		
上市债券		
澳大利亚	0.31	0.61
百慕大	0.87	0.99
英属维尔京群岛	14.37	20.28
加拿大	-	0.56
开曼群岛	17.94	26.19
中国内地	0.57	0.36
香港	7.99	8.14
印度	9.87	8.50
印尼	10.36	8.10
泽西岛	0.37	-
马来西亚	1.82	0.33
毛里求斯	1.94	1.97
蒙古	0.30	0.03
荷兰	1.37	1.31
巴基斯坦	1.83	1.32
菲律宾	4.64	3.45
新加坡	10.91	8.96
韩国	1.98	1.30
斯里兰卡	1.83	0.21
泰国	2.00	3.59
土耳其	0.56	-
英国	1.51	0.91
美国	0.69	0.60
	<hr/>	<hr/>
	94.03	97.71
	<hr/>	<hr/>

投资组合变动表(未经审计)
 2021年4月1日起至2021年9月30日止期间(续)

	占资产净值 百分比 2021年 9月30日	占资产净值百分 比 2021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	0.29	0.37
印尼	-	0.96
新加坡	-	0.51
	0.29	1.84
单位信托		
上市投资		
爱尔兰	2.29	-
	2.29	-
未上市但有报价的投资		
香港	0.17	0.12
	0.17	0.12

投资组合变动表(未经审计)
 2021 年 4 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日止期间(续)

	占资产净值 百分比 2021 年 9 月 30 日	占资产净值百分 比 2021 年 3 月 31 日
金融资产		
债券期货	0.14	0.06
外币远期合同	(0.08)	(0.09)
投资总额	96.84	99.64
其他资产净值	3.16	0.36
资产净值总额	100.00	100.00

金融衍生工具详情(未经审计) 2021 年 4 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日止期间

外汇即期合同

截至 2021 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:				
81,111 澳元	59,072 美元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	475
9,339 澳元	6,758 美元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	12
76,662 加元	60,655 美元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	144
9,963 加元	7,878 美元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	15
740,467 欧元	864,755 美元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	6,139
53,387 英镑	73,012 美元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	1,024
55,410 英镑	75,940 美元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	1,225
151 美元	980 离岸人民币	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	-
155,626 美元	197,600 加元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	345
226,347 美元	1,467,186 离岸人 民币	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	481
2,824,487 美元	18,302,577 离岸 人民币	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	5,100
34,568,159 美元	43,857,003 加元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	49,387
508,665 美元	3,296,132 离岸人 民币	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	919
71,496,310 美元	463,293,657 离岸 人民币	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	129,103
				194,369

金融衍生工具详情(未经审计)(续)
 2021 年 4 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日止期间

外汇即期合同(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:				
364,853 澳元	262,287 美元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	(1,296)
448,026 加元	351,994 美元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	(1,646)
523,167 加元	411,865 美元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	(1,085)
113,389 离岸人民币	17,521 美元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	(9)
141,128 离岸人民币	21,812 美元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	(7)
1,854,940 离岸人民币	286,481 美元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	(293)
889,973 离岸人民币	137,261 美元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	(329)
91,496 离岸人民币	14,117 美元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	(28)
265,466 英镑	356,390 美元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	(1,564)
1,337,482 美元	1,842,176 澳元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	(6,628)
14 美元	20 澳元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	-
45,019,101 美元	32,860,466 英镑	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	(710,016)

金融衍生工具详情(未经审计)(续)
 2021 年 4 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日止期间

外汇即期合同(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):				
51,758,231 美元	71,288,990 澳元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	(256,498)
6,255,304 美元	5,345,167 欧元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	(57,263)
7,278,561 美元	9,857,363 新加坡元	2021 年 10 月 29 日	HSBC Markets Treasury Services	(18,088)
17,749,212 美元	115,000,000 离岸人 民币	2021 年 11 月 30 日	HSBC Markets Treasury Services	(14,868)
				<u>(1,069,618)</u>

金融衍生工具详情(未经审计)(续)

2021 年 4 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日止期间

期货合同

截至 2021 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 ULTRA FUT 21/12/2021		HSBC PLC FUT WHOLE TRDG OPS (11) MAR	133,383
US 10YR ULTRA FUT 21/12/2021		HSBC PLC FUT WHOLE TRDG OPS (11) MAR	110,000
US 10YR ULTRA FUT 21/12/2021		HSBC PLC FUT WHOLE TRDG OPS (11) MAR	171,421
US 10YR ULTRA FUT 21/12/2021		HSBC PLC FUT WHOLE TRDG OPS (11) MAR	33,594
US ULTRA BOND CBT 21/12/2021		HSBC PLC FUT WHOLE TRDG OPS (11) MAR	130,434
US ULTRA BOND CBT 21/12/2021		HSBC PLC FUT WHOLE TRDG OPS (11) MAR	62,447
US ULTRA BOND CBT 21/12/2021		HSBC PLC FUT WHOLE TRDG OPS (11) MAR	256,250
US ULTRA BOND CBT 21/12/2021		HSBC PLC FUT WHOLE TRDG OPS (11) MAR	293,750
US ULTRA BOND CBT 21/12/2021		HSBC PLC FUT WHOLE TRDG OPS (11) MAR	243,887
US ULTRA BOND CBT 21/12/2021		HSBC PLC FUT WHOLE TRDG OPS (11) MAR	78,199
US ULTRA BOND CBT 21/12/2021		HSBC PLC FUT WHOLE TRDG OPS (11) MAR	67,187
			1,580,552
金融负债:			
US 10YR ULTRA FUT 21/12/2021		HSBC PLC FUT WHOLE TRDG OPS (11) MAR	(6,250)
			(6,250)

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)

	2021年 9月30日 美元	2021年 3月31日 美元	2020年 3月31日 美元	2019年 3月31日 美元
总资产净值	1,111,455,555	1,451,459,571	1,020,461,121	830,526,536

(b) 份额净值(按《香港财务报告准则》计算)

份额净值	计价货币	2021年 9月30日	2021年 3月31日	2020年 3月31日	2019年 3月31日
- AC类 - 美元	美元	11.035	11.275	10.090	10.245
- AM2类 - 美元	美元	9.255	9.674	9.094	9.708
- AM2类 - 人民币	人民币	8.713	9.258	9.399	9.516
- AM3O类 - 人民币	人民币	9.132	9.540	8.959	9.570
- AM2类 - 港元	港元	9.287	9.695	9.084	9.820
- AM2类 - 欧元	欧元	8.453	8.712	8.755	9.145
- AM3O类 - 欧元	欧元	9.030	9.451	8.909	9.536
- AM2类 - 澳元	澳元	9.785	9.689	11.350	10.485
- AM3O类 - 澳元	澳元	9.077	9.225	8.927	9.549
- AM2类 - 加元	加元	8.905	9.496	9.828	9.862
- AM3O类 - 加元	加元	9.072	9.488	8.914	9.531
- AM3O类 - 英镑	英镑	9.035	9.446	8.887	9.527
- AM3O类 - 新加坡元	新加坡元	9.081	9.495	8.933	9.553
- BC类 - 港元	港元	10.785	10.971	-	-
- BC类 - 人民币	人民币	9.819	10.209	-	-
- BC类 - 美元	美元	10.740	11.220	-	-
- BCO类 - 人民币	人民币	11.083	11.001	-	-
- BM2类 - 港元	港元	10.075	10.488	-	-
- BM2类 - 人民币	人民币	9.187	9.757	-	-
- BM2类 - 美元	美元	10.034	10.518	-	-
- BM3O类 - 澳元	澳元	10.023	10.519	-	-
- BM3O类 - 人民币	人民币	10.056	10.500	-	-
- IM2类 - 美元	美元	9.506	9.908	-	-
- IC类 - 美元	美元	9.692	-	-	-

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(交易份额净值)

截至下列日期止的财务期间/年度	AC类 - 美元			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2021年9月30日	11.033	11.444	11.033	11.444
2021年3月31日	9.896	11.518	9.896	11.518
2020年3月31日	9.790	11.210	9.790	11.210
截至下列日期止的财务期间/年度	AM2类 - 美元			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2021年9月30日	9.256	9.746	9.256	9.746
2021年3月31日	8.919	10.003	8.919	10.003
2020年3月31日	8.862	10.147	8.862	10.147
截至下列日期止的财务期间/年度	AM2类 - 人民币			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2021年9月30日	8.713	9.287	8.713	9.287
2021年3月31日	9.169	10.130	9.169	10.130
2020年3月31日	9.144	10.441	9.144	10.441
截至下列日期止的财务期间/年度	AM30类 - 人民币			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2021年9月30日	9.132	9.622	9.132	9.622
2021年3月31日	8.782	9.873	8.782	9.873
2020年3月31日	8.740	10.014	8.740	10.014

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(交易份额净值)(续)

截至下列日期止的财务期间/年度	AM2类 - 港元			
	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2021年9月30日	9.287	9.754	9.287	9.754
2021年3月31日	8.906	9.990	8.906	9.990
2020年3月31日	8.857	10.173	8.857	10.173

截至下列日期止的财务期间/年度	AM2类 - 欧元			
	买入		卖出	
	最低 欧元	最高 欧元	最低 欧元	最高 欧元
2021年9月30日	8.347	8.714	8.347	8.714
2021年3月31日	8.493	9.194	8.493	9.194
2020年3月31日	8.604	9.871	8.604	9.871

截至下列日期止的财务期间/年度	AM30类 - 欧元			
	买入		卖出	
	最低 欧元	最高 欧元	最低 欧元	最高 欧元
2021年9月30日	9.030	9.508	9.030	9.508
2021年3月31日	8.735	9.785	8.735	9.785
2020年3月31日	8.669	9.951	8.669	9.951

截至下列日期止的财务期间/年度	AM2类 - 澳元			
	买入		卖出	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2021年9月30日	9.397	10.230	9.397	10.230
2021年3月31日	9.445	11.514	9.445	11.514
2020年3月31日	10.385	12.101	10.385	12.101

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(交易份额净值)(续)

截至下列日期止的财务期间/年度	AM30类 - 澳元			
	买入		卖出	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2021年9月30日	9.079	9.563	9.079	9.563
2021年3月31日	8.754	9.826	8.754	9.826
2020年3月31日	8.703	9.982	8.703	9.982
截至下列日期止的财务期间/年度	AM2类 - 加元			
	买入		卖出	
	最低 加元	最高 加元	最低 加元	最高 加元
2021年9月30日	8.811	9.390	8.811	9.390
2021年3月31日	9.181	10.117	9.181	10.117
2020年3月31日	9.574	10.434	9.574	10.434
截至下列日期止的财务期间/年度	AM30类 - 加元			
	买入		卖出	
	最低 加元	最高 加元	最低 加元	最高 加元
2021年9月30日	9.072	9.555	9.072	9.555
2021年3月31日	8.744	9.808	8.744	9.808
2020年3月31日	8.689	9.964	8.689	9.964
截至下列日期止的财务期间/年度	AM30类 - 英镑			
	买入		卖出	
	最低 英镑	最高 英镑	最低 英镑	最高 英镑
2021年9月30日	9.035	9.515	9.035	9.515
2021年3月31日	8.712	9.767	8.712	9.767
2020年3月31日	8.658	9.974	8.658	9.974

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(交易份额净值)(续)

截至下列日期止的财务期间/年度	AM30类 - 新加坡元			
	买入		卖出	
	最低 新加坡元	最高 新加坡元	最低 新加坡元	最高 新加坡元
2021年9月30日	9.081	9.565	9.081	9.565
2021年3月31日	8.759	9.821	8.759	9.821
2020年3月31日	8.707	10.003	8.707	10.003
	=====	=====	=====	=====
截至下列日期止的财务期间/年度	BC类 - 港元			
	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2021年9月30日	10.781	11.157	10.781	11.157
2021年3月31日	9.949	11.210	9.949	11.210
2020年3月31日	-	-	-	-
	=====	=====	=====	=====
截至下列日期止的财务期间/年度	BC类 - 人民币			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2021年9月30日	9.819	10.244	9.819	10.244
2021年3月31日	10.000	10.821	-	10.821
2020年3月31日	-	-	-	-
	=====	=====	=====	=====
截至下列日期止的财务期间/年度	BC类 - 美元			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2021年9月30日	10.737	11.135	10.737	11.135
2021年3月31日	9.949	11.206	9.949	11.206
2020年3月31日	-	-	-	-
	=====	=====	=====	=====

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(交易份额净值)(续)

BCO 类 - 人民币				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2021年9月30日	11.080	11.444	11.080	11.444
2021年3月31日	10.000	11.442	10.000	11.442
2020年3月31日	-	-	-	-
	=====	=====	=====	=====
BM2 类 - 港元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2021年9月30日	10.076	10.584	10.076	10.584
2021年3月31日	9.947	10.842	9.947	10.842
2020年3月31日	-	-	-	-
	=====	=====	=====	=====
BM2 类 - 人民币				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2021年9月30日	9.187	9.791	9.187	9.791
2021年3月31日	9.666	10.686	9.666	10.686
2020年3月31日	-	-	-	-
	=====	=====	=====	=====
BM2 类 - 美元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2021年9月30日	10.035	10.567	10.035	10.567
2021年3月31日	9.949	10.846	9.949	10.846
2020年3月31日	-	-	-	-
	=====	=====	=====	=====

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(交易份额净值)(续)

BM30 类 - 澳元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2021年9月30日	10.024	10.561	10.024	10.561
2021年3月31日	10.000	10.874	10.000	10.874
2020年3月31日	-	-	-	-
	=====	=====	=====	=====
BM30 类 - 人民币				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2021年9月30日	10.057	10.602	10.057	10.602
2021年3月31日	9.986	10.894	9.986	10.894
2020年3月31日	-	-	-	-
	=====	=====	=====	=====
IM2 类 - 美元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2021年9月30日	9.506	9.994	9.506	9.994
2021年3月31日	9.867	10.222	9.867	10.222
2020年3月31日	-	-	-	-
	=====	=====	=====	=====
IC 类 - 美元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2021年9月30日	9.689	10.035	9.689	10.035
2021年3月31日	-	-	-	-
2020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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月12日	0.0367	2,032,253.27
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0364	2,151,610.14
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0371	2,259,400.90
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0358	2,269,221.07
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0357	2,376,690.05
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0357	2,444,785.70

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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月15日	0.0346	221,323.44
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0343	222,504.39
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0349	228,563.61
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0333	217,495.08
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0337	231,859.94
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0342	240,590.75

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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月15日	0.0566	2,831,382.93
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0594	3,050,238.66
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0557	3,199,165.23
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0546	3,137,747.80
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0513	3,118,109.43
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0566	3,620,220.30

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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月11日	0.0368	9,954,297.50
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0365	10,243,223.81
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0371	10,878,634.43
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0358	10,834,995.23
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0358	11,416,549.86
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0358	11,683,302.83

分派披露(续)

AM2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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月11日	0.0329	12,943.80
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0325	12,958.51
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0331	13,197.74
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0310	12,360.42
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0314	12,519.91
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0322	12,976.31

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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月11日	0.0304	15,334.58
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0296	17,238.71
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0302	17,788.85
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0290	16,138.04
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0294	17,526.20
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0287	20,673.24

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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月11日	0.0384	53,171.52
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0378	54,726.84
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0377	57,251.80
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0353	54,869.86
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0353	62,250.71
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0358	69,392.04

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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月11日	0.0343	264,901.89
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0341	287,830.59
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0346	301,261.63
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0335	295,108.02
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0333	299,100.55
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0335	310,977.59

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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月12日	0.0352	14,966.57
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0345	15,132.03
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0348	15,475.71
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0328	14,961.04
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0334	18,839.73
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0341	20,095.83

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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月12日	0.0364	171,896.00
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0357	172,781.08
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0361	181,533.01
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0349	174,037.27
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0342	170,562.00
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0343	180,315.32

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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月11日	0.0352	125,247.83
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0347	131,590.15
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0351	161,514.25
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0345	163,117.25
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0340	150,836.64
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0338	159,026.58

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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月11日	0.0363	38,995.21
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0356	38,242.95
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0368	39,985.24
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0356	38,682.59
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0354	38,465.01
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0367	39,569.91

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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月13日	0.0398	46,212.78
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0395	46,021.31
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0402	47,104.94
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0388	45,748.02
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0387	43,242.83
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0387	41,343.75

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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月13日	0.0364	27,761.04
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0362	28,147.15
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0368	38,221.14
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0351	36,470.48
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0355	36,866.28
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0360	33,247.91

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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月13日	0.0624	110,848.59
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0654	118,873.96
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0614	116,799.36
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0602	110,625.64
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0566	110,592.65
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0624	121,186.38

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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月13日	0.0399	20,262.66
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0396	20,020.49
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0402	20,812.58
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0389	19,716.24
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0388	16,060.25
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0389	15,660.04

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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月13日	0.0379	6,894.77
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0376	7,193.88
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0382	7,308.31
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0371	7,074.94
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0368	5,712.01
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0370	3,358.31

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
2021年9月派息	2021年9月30日	2021年10月12日	0.0377	13,856.53
2021年8月派息	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0374	13,746.26
2021年7月派息	2021年7月30日	2021年8月10日	0.0380	13,966.79
2021年6月派息	2021年6月30日	2021年7月9日	0.0367	13,488.98
2021年5月派息	2021年5月31日	2021年6月9日	0.0366	13,452.22
2021年4月派息	2021年4月30日	2021年5月11日	0.0366	13,452.22

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 (于 2021 年 2 月 1 日获委任)
刘嘉燕
叶士奇 (于 2021 年 2 月 1 日获委任)
鲍国贤 (已于 2020 年 8 月 28 日辞职)
巴培卓 (已于 2021 年 6 月 2 日辞职)
马浩德 (已于 2021 年 2 月 1 日辞职)
谭振邦 (已于 2021 年 6 月 2 日辞职)

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