

## 百达香港

未经审计半年度报告

瑞士百达策略收益

2023年10月1日至2024年3月31日止期间

瑞士百达亚洲债券收益

2023年10月1日至2024年3月31日止期间

百达香港之子基金

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

目录

	页码
管理及行政	1
管理人报告	2-4
财务状况表(未经审计)	5-6
综合收益表(未经审计)	7-8
归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)	9-13
现金流量表(未经审计)	14-15
投资组合(未经审计)	16-26
投资组合持有变动表(未经审计)	27-28
衍生金融工具详情(未经审计)	29-33
分配披露(未经审计)	34-39
业绩记录(未经审计)	40-44

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

管理及行政

管理人

瑞士百达资产管理(香港)有限公司  
香港中环  
干诺道中 8 号  
遮打大厦 8-9 楼

管理人董事

Cédric Jean-Albert Vermesse  
Hau Keung Yeung  
John Alexander Sample  
Junjie Watkins  
Nicolas Leresche

受托人及注册登记机构

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

托管人

香港上海汇丰银行有限公司  
香港中环  
皇后大道中 1 号

中国内地托管人

汇丰银行(中国)有限公司  
中国  
上海市浦东新区  
世纪大道 8 号  
上海国金中心  
汇丰银行大楼 33 楼

核数师

罗兵咸永道会计师事务所  
香港中环  
太子大厦 22 楼

管理人之律师

的近律师行  
香港中环  
遮打道 18 号  
历山大厦 5 楼

# 瑞士百达策略收益 瑞士百达亚洲债券收益 (百达香港之子基金)

## 管理人报告

### 瑞士百达策略收益

2023 年对于市场来说可谓多事之秋。尽管发生了硅谷银行倒闭、“更长时间维持高利率”的争论以及哈马斯袭击以色列引发的地缘政治动荡等大事件，但风险资产总体表现良好。债券市场在年底表现强劲，扭转了前三个季度的亏损局面。股票市场回报强劲，尤其是科技股。

在经历回报丰厚的一年后，市场非常关注这种良好的表现能否继续保持。部分投资者过度押注美联储降息，将其视作关键（且唯一）的增长支持。瑞士百达策略收益在年初针对市场发表了以下看法：“关注趋势而非具体事件”和“枪炮、病菌与钢铁……以及人工智能……”

- 对于我们的长期增长主题，美联储降息 3 次还是 6 次并无影响（年初预计 6.7 次降息）。市场在通货膨胀应对和货币供应调节方面已取得进展。这一趋势比个别降息事件更为重要。最重要的是，自下而上的基本面表现强劲。
- 正如农业的诞生使人类走出食不果腹的困境，过上了衣食无忧的生活，开始拥有空闲时间，从而释放其在艺术、太空探索、政治等方面的潜力，人工智能的出现可能帮助我们解决信息匮乏问题，获得丰富的知识储备。正如杰米·戴蒙所说，“（人工智能）就像过去几百年的一些重大技术发明一样具有变革性，想想印刷机、蒸汽机、电力、计算机和互联网等。”

因此，瑞士百达策略收益继续关注长期增长主题。我们认为技术领导力的价值不可估量。计算能力至关重要，而半导体是现代科技发展的基石。生态系统、数据和垂直产业也是我们在投资中考虑的因素。

由于实际收益率处于具有吸引力的水平，与 2020-2021 年的负收益率形成鲜明对比，我们认为国债和优质债券的风险调整后回报率是合理的。持有这些债券既能带来收益，又能控制投资组合风险。

基于我们对上述长期增长主题的看法，我们认为错失良机的机会成本可能很高，2023 年的实际情况便是有力的证明。我们倾向于将风险预算用于长期增长型股票，并通过收益良好的短期国库券/国债中风险相对较低的资产来实现平衡。这种杠铃策略是我们在考虑 2024 年投资分配时的重要支撑。

地缘政治是一个重要主题，我们认为“新兵兵外交”将为日本和印度带来有利的投资流量，促进相应地区联盟的成立。日本拥有高质量的制造业。在资本效率的推动下，其拥有巨大的价值增长潜力。国内需求也在复苏。本基金还致力于把握部分基础设施投资机会：电力供应、公用事业、供暖和制冷等。本基金亦在金融、媒体、消费等细分领域寻找高质量的多样化投资机会。我们注重投资质量，在小盘股上的风险敞口较小，因为在这些小盘股中，大部分公司未实现盈利，而且浮动利率的债务比例很高。

总体而言，我们认为风险回报是合理的。投资者应针对长期增长进行战略性配置。在此期间，瑞士百达策略收益还针对长期增长进行了战术性配置。

瑞士百达资产管理（香港）有限公司  
2024 年 5 月 22 日

# 瑞士百达策略收益

## 瑞士百达亚洲债券收益

### (百达香港之子基金)

#### 管理人报告(续)

#### 瑞士百达亚洲债券收益

##### 市场回顾

这一时期以避险情绪开始，由于 10 月 7 日哈马斯对以色列发动的恐怖袭击，引发对地缘政治风险的极大担忧。与此同时，美国经济继续保持韧性，美国国债面临压力。这种情况在 11 月初发生了变化，即 11 月初召开的美联储（FOMC）会议重申了金融环境已“显著”收紧。同样在 11 月，美国 10 月份的 CPI 数据出炉，显示增势放缓，通胀继续。这进一步增加了投资者信心。市场对美联储降息的预期增加，预计最早将于 2024 年 5 月迎来其首次降息。较高的降息预期刺激了包括新兴市场企业在内的全球债券和股票市场。

这种趋势一直持续到年底。市场认为美国经济将在 2024 年“软着陆”，且美联储将在 2024 年最多降息七次。2024 年开局依然强劲，但 1 月和 2 月高于预期的通胀数据再次引发美国国债疲软。市场开始回调关于美联储将在第一季度降息的激进预期。3 月底，市场预计美联储将在 7 月的会议上宣布首次降息，到 2024 年底将降息约 2.5 次。尽管美国国债遭到抛售，但企业债利差依然企稳。

中国方面，尽管对国家经济增长的担忧继续存在，但年度中央经济工作会议对 2024 年确立了“坚持稳中求进”的工作总基调。12 月份的经济增长情况也同样好坏参半。财新制造业 PMI 数据走势与国家统计局公布的制造业 PMI 再次背离，释放的信号让人难以看清中国经济的近期增长趋势。但 2024 年第一季度的增长出乎意料地强劲。该季度国内生产总值（GDP）同比增长 5.3%，制造业 PMI 的新订单指数显示整个上半年都将维持积极的增长势头。

2023 年年末，亚洲其他国家的增长有所放缓，但总体上表现良好。印度和印度尼西亚表现尤为突出。印度 3 月的综合 PMI 再创新高，达到 61.8。2 月，印度尼西亚完成了举国关注的总统大选，最终由普拉博沃·苏比安托（Prabowo Subianto）以 59% 的压倒性优势当选。新任总统将于 10 月才上任。因此大选结果的短期影响有限，市场已转而关注其他话题。在北亚地区，我们注意到 2023 年末和 2024 年初出口增长略有放缓，但已有迹象显示，情况在 2024 年第一季度末开始好转。例如，韩国出口历经 12 月份 24.5% 峰值后的减速期以及 3 月份连续一个月的负增长后，目前已在逐步复苏。这表明，虽然韩国出口在 2023 年第四季度飙升后出现短期回落，但总体仍将保持正增长。

##### 投资组合回顾

在过去 6 个月中，本基金的业绩表现高于基准，即高于摩根大通亚洲信用指数（JACI）企业指数。这主要得益于 2023 年第四季度的突出表现，同时 2024 年第一季度表现与基准持平。

2023 年第四季度业绩的主要支撑是我们增持了对印度尼西亚金属和矿业、泰国石油和天然气、韩国次级金融业务和中国科技业务的投资。这些投资通常为长期投资，且均受益于利差收窄。我们对澳门博彩业务的增持也取得了积极的成果，游客数量的强势反弹继续推动博彩行业发展。

另一方面，我们对中国房地产、台湾工业和韩国公用事业的减持造成了亏损。在香港金融业务方面，我们因证券选择失误而遭遇亏损，主要包括减少了渣打银行的持仓，增加了南洋商业银行及最终表现不及渣打银行的其他国有大行的持仓。

2024 年第一季度的表现与摩根大通亚洲信用指数（JACI）企业指数保持一致。亏损主要源自减持对新加坡房地产和中国金融业的投资。前者是因为我们不看好该领域的发行人，但他们出现了短期反弹。后者是因为这些证券的交易已经严重收紧，我们认为其价值不高。与此同时，我们对香港、印度（主要为非银行机构）、韩国和泰国（主要为次级业务）等其他地区金融业的投资则表现积极。第一季度，久期资产略有亏损。我们保持了小幅超配，但在曲线前端减持了投资级业务，而在曲线腹部增持了高收益业务。

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

管理人报告(续)

瑞士百达亚洲债券收益

市场前景

中国方面，第一季度的市场宏观情绪有所改善，实现 **5.3%** 的强劲增长。同时，高频指标显示该增长势头将延续到第二季度。

亚洲其他国家方面，得益于出口复苏、技术周期改善以及财政刺激政策，这些国家有望在 **2024** 年继续保持 **GDP** 的高速增长，尤其是本年度将举行选举的国家。例如，韩国可能成为出口复苏和存储芯片需求回升的受益国之一。其 **GDP** 增速或将从 **2023** 年的 **1.4%**（估计值）增至 **2.5%**。印度和印度尼西亚等更关注国内市场的国家也将继续保持高速增长。

目前，美联储的降息预期减弱，这也可能推迟亚洲部分国家的降息行动。泰国银行、韩国银行和印度尼西亚银行都将在今年稍晚时候降低基准利率，但具体时间尚不确定，尤其是印度尼西亚银行。降息一旦施行，将支持当地经济的发展，并有助于降低我们所投资企业的境内融资成本。我们发现，我们的部分发行人依然具有本地（再）融资意愿。

虽然 **2024** 年一级市场活动有所回升，但仍低于历史水平，尤其是中国的发行量仍然很低。

我们将持续小幅超配久期资产，但由于预计美联储接下来将继续降息，因此疲软期可能会延长。

中国方面，我们尤其看好 **TMT** 行业。该行业的优势同样来自于其所发行的债券通常为长期债券。房地产行业仍存在诸多不确定性，因此我们对该行业的投资多为投机性投资。

在香港，我们青睐实力较强且得到金管局大力支持的金融产品发行人。此外，我们也投资于与中国大陆需求联系紧密的领域，如消费者部门。

得益于旅游业的复苏和财政刺激，泰国目前形势大好。我们看好泰国的次级金融业务和石油市场。

印度的增长势头强劲。在其金融领域，我们看好资本充足率较高的民营企业和国有企业；在可再生能源领域，我们选择政府大力支持、逾期付款已结清且股权所有者实力雄厚的企业；在基础设施领域，我们看好阿达尼港口和其他运输行业发行人。但印度方面将面临投资估值越来越高的问题。

印度尼西亚方面，其同样受益于强劲增长和财政改善。此前我们因该国大选以及证券产品通常较长的持有期限而减少了对该国的投资。目前我们又通过一级市场增加了投资。

瑞士百达资产管理（香港）有限公司  
2024 年 5 月 22 日

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

财务状况表(未经审计)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

	2024 年 3 月 31 日	2023 年 9 月 30 日
	(美元)	(美元)
<b>资产</b>		
投资	409,084,583	326,495,758
衍生金融资产	368,495	394,443
应收认购款	3,551,980	2,315,980
应收经纪款	1,017,818	7,457,087
应收股息	290,396	135,964
应收银行利息	4,438	1,771
应收投资利息	1,239,463	1,621,467
其他应收款	141,899	142,798
保证金	819,437	1,485,727
现金及现金等价物	<u>21,412,990</u>	<u>11,560,924</u>
<b>总资产</b>	<u>437,931,499</u>	<u>351,611,919</u>
<b>负债</b>		
衍生金融负债	1,283,655	241,394
应付赎回款	1,900,290	607,614
应付经纪款	1,017,427	12,134,040
其他应付款	<u>764,152</u>	<u>640,202</u>
<b>负债(不包括归属于份额持有人的净资产)</b>	<u>4,965,524</u>	<u>13,623,250</u>
<b>归属于份额持有人的净资产</b>	<b><u>432,965,975</u></b>	<b><u>337,988,669</u></b>

注：子基金半年度报告采用的会计政策和计算方法与年度报告采用的会计政策和计算方法相同。

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

财务状况表(未经审计)(续)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

	2024 年 3 月 31 日	2023 年 9 月 30 日
	(美元)	(美元)
<b>资产</b>		
投资	25,749,012	31,049,024
衍生金融资产	1,110	3,600
应收认购款	276,242	-
应收经纪款	646,381	570,292
应收银行利息	49	20
应收投资利息	312,728	376,739
其他应收款	17,745	23,660
保证金	88,856	89,875
现金及现金等价物	<u>278,150</u>	<u>195,696</u>
<b>总资产</b>	<u>27,370,273</u>	<u>32,308,906</u>
<b>负债</b>		
衍生金融负债	30,531	9,297
应付赎回款	88,684	209,680
应付经纪款	819,352	199,528
应付成立费用	18,590	23,660
其他应付款	<u>79,464</u>	<u>68,323</u>
<b>负债(不包括归属于份额持有人的净资产)</b>	<u>1,036,621</u>	<u>510,488</u>
<b>归属于份额持有人的净资产</b>	<b><u>26,333,652</u></b>	<b><u>31,798,418</u></b>

注：子基金半年度报告采用的会计政策和计算方法与年度报告采用的会计政策和计算方法相同。

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

综合收益表(未经审计)

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

	2023 年 10 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日期间	2023 年 10 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日期间
	(美元)	(美元)
<b>收益</b>		
股息收入	1,156,966	1,211,026
银行存款利息收益	124,268	145,943
投资利息收益	3,133,587	1,608,475
投资与衍生金融工具公允价值的净变动	52,726,573	37,205,056
汇兑净损失	(22,267)	(526,493)
已收佣金回扣	-	1,756
<b>总投资利润</b>	<b>57,119,127</b>	<b>39,645,763</b>
<b>开支</b>		
管理费用 <sup>注2</sup>	2,567,057	1,994,170
受托人费用 <sup>注1</sup>	175,718	137,915
交易成本 <sup>注1</sup>	151,047	128,220
托管费和银行手续费 <sup>注1</sup>	59,781	68,032
核数师酬金	12,164	19,488
法律及专业服务费	9,074	4,439
其他运营费用 <sup>注1</sup>	36,603	46,382
<b>营业费用总额</b>	<b>3,011,444</b>	<b>2,398,646</b>
<b>经营利润</b>	<b>54,107,683</b>	<b>37,247,117</b>
<b>财务成本</b>		
利息支出 <sup>注1</sup>	-	(2)
对份额持有人派发股息	(11,601,912)	(9,306,973)
<b>收益分配后及税前利润</b>	<b>42,505,771</b>	<b>27,940,142</b>
股息收入预扣税	(238,740)	(137,765)
<b>归属于份额持有人的净资产增加</b>	<b>42,267,031</b>	<b>27,802,377</b>

<sup>注1</sup>截至 2024 年 3 月 31 日和 2023 年 3 月 31 日止期间，向受托人或其关联人士支付了受托人费用、托管费和银行手续费，向受托人或其关联人士支付的其他款项如下：

	2023 年 10 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日期间	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间
交易成本	51,641	26,875
其他运营费用	15,296	17,968
利息支出	-	2

<sup>注2</sup>截至 2024 年 3 月 31 日和 2023 年 3 月 31 日止期间，除向管理人支付了管理费用外，未向管理人或其关联人士支付其他款项。

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

综合收益表(未经审计)(续)

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

	2023 年 10 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日期间	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间
	(美元)	(美元)
<b>收益</b>		
银行存款利息收益	9,264	9,973
投资利息收益	600,649	729,966
投资与衍生金融工具公允价值的净变动	1,426,383	1,322,862
汇兑净损失	(317)	(245)
其他收益	500	1,048
<b>总投资利润</b>	<b>2,036,479</b>	<b>2,063,604</b>
<b>开支</b>		
管理费用 <sup>注2</sup>	84,422	104,693
受托人费用 <sup>注1</sup>	34,691	35,871
托管费和银行手续费 <sup>注1</sup>	6,949	9,103
核数师酬金	10,736	16,599
法律及专业服务费	246	-
成立费	5,915	5,070
其他运营费用 <sup>注1</sup>	22,167	21,805
<b>营业费用总额</b>	<b>165,126</b>	<b>193,141</b>
<b>经营利润</b>	<b>1,871,353</b>	<b>1,870,463</b>
<b>财务成本</b>		
利息支出 <sup>注1</sup>	-	(8,251)
对份额持有人派发股息	(529,223)	(650,867)
<b>归属于份额持有人的净资产增加</b>	<b>1,342,130</b>	<b>1,211,345</b>

<sup>注1</sup>截至 2024 年 3 月 31 日和 2023 年 3 月 31 日止期间，向受托人或其关联人士支付了受托人费用、托管费和银行手续费，向受托人或其关联人士支付的其他款项如下：

	2023 年 10 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日期间	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间
其他运营费用	17,859	18,612
利息支出	-	751

<sup>注2</sup>截至 2024 年 3 月 31 日和 2023 年 3 月 31 日止期间，除向管理人支付了管理费用外，未向管理人或其关联人士支付其他款项。

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

	2023 年 10 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日期间	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间
	(美元)	(美元)
期初余额	337,988,669	285,654,434
分配份额	130,134,109	7,255,845
赎回份额	(77,423,834)	(30,284,903)
份额交易净增加/(减少)	52,710,275	(23,029,058)
归属于份额持有人的净资产增加	42,267,031	27,802,377
期末余额	<b>432,965,975</b>	<b>290,427,753</b>
<b>已发行份额数目</b>	<b>份额</b>	<b>份额</b>
<b>I 累积 美元份额</b>		
期初已发行份额	136,730.1894	155,391.1752
已分配份额	59,866.7098	-
已赎回份额	(132,310.3425)	-
期末已发行份额	<u>64,286.5567</u>	<u>155,391.1752</u>
<b>I 每月派息 美元份额</b>		
期初已发行份额	429,844.8252	429,844.8252
已分配份额	-	-
已赎回份额	-	-
期末已发行份额	<u>429,844.8252</u>	<u>429,844.8252</u>
<b>P 每月派息 港元份额</b>		
期初已发行份额	94,172,193.5879	97,104,120.9363
已分配份额	23,569,443.3443	1,600,546.6078
已赎回份额	(17,652,223.3525)	(8,949,302.9424)
期末已发行份额	<u>100,089,413.5797</u>	<u>89,755,364.6017</u>
<b>P 每月派息 美元份额</b>		
期初已发行份额	14,772,544.7284	13,368,461.8378
已分配份额	4,154,615.0550	256,862.3355
已赎回份额	(3,595,566.3454)	(1,535,704.8666)
期末已发行份额	<u>15,331,593.4380</u>	<u>12,089,619.3067</u>

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)(续)

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

	2023 年 10 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日期间	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间
<b>已发行份额数目(续)</b>	<b>份额</b>	<b>份额</b>
<b>P 每月派息 3 港元份额</b>		
期初已发行份额	40,768.2840	40,768.2840
已分配份额	-	-
已赎回份额	-	-
期末已发行份额	<u>40,768.2840</u>	<u>40,768.2840</u>
<b>P 每月派息 3 美元份额</b>		
期初已发行份额	600.0000	600.0000
已分配份额	-	-
已赎回份额	-	-
期末已发行份额	<u>600.0000</u>	<u>600.0000</u>
<b>HI 累积 新加坡元份额</b>		
期初已发行份额	250,076.2320	338,592.3640
已分配份额	-	-
已赎回份额	-	(88,516.1320)
期末已发行份额	<u>250,076.2320</u>	<u>250,076.2320</u>
<b>HI 每月派息 新加坡元份额</b>		
期初已发行份额	224,770.6280	308,768.9210
已分配份额	13,163.0000	-
已赎回份额	-	-
期末已发行份额	<u>237,933.6280</u>	<u>308,768.9210</u>
<b>HM 人民币份额</b>		
期初已发行份额	456,677.4600	472,762.1200
已分配份额	230,572.5200	94,912.1000
已赎回份额	(329,094.4200)	(94,118.6300)
期末已发行份额	<u>358,155.5600</u>	<u>473,555.5900</u>
<b>HP 每月派息 澳元份额</b>		
期初已发行份额	8,156,050.1673	6,535,929.5889
已分配份额	2,907,971.5463	374,854.6197
已赎回份额	(1,447,211.0310)	(522,616.9557)
期末已发行份额	<u>9,616,810.6826</u>	<u>6,388,167.2529</u>

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)(续)

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

	2023 年 10 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日期间	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间
已发行份额数目(续)	份额	份额
<b>HP 每月派息 瑞士法郎份额</b>		
期初已发行份额	129,576.6452	-
已分配份额	95,283.9299	-
已赎回份额	(5,000.0000)	-
期末已发行份额	<u>219,860.5751</u>	<u>-</u>
<b>HP 每月派息 日元份额</b>		
期初已发行份额	3,003,619.5724	-
已分配份额	4,810,215.9271	-
已赎回份额	(969,544.7626)	-
期末已发行份额	<u>6,844,290.7369</u>	<u>-</u>
<b>HP 每月派息 人民币份额</b>		
期初已发行份额	29,581,091.3783	27,191,093.9675
已分配份额	10,271,807.3477	826,821.7750
已赎回份额	(4,961,517.5084)	(2,827,535.5380)
期末已发行份额	<u>34,891,381.2176</u>	<u>25,190,380.2045</u>
<b>HP 每月派息 3 人民币份额</b>		
期初已发行份额	3,000.0000	3,000.0000
已分配份额	-	-
已赎回份额	-	-
期末已发行份额	<u>3,000.0000</u>	<u>3,000.0000</u>

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)(续)

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

	2023 年 10 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日期间	2023 年 10 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日期间
	(美元)	(美元)
期初余额	31,798,418	26,157,474
分配份额	1,413,339	16,663,912
赎回份额	<u>(8,220,235)</u>	<u>(7,522,896)</u>
份额交易净(减少)/增加	<u>(6,806,896)</u>	<u>9,141,016</u>
归属于份额持有人的净资产增加	1,342,130	1,211,345
期末余额	<u>26,333,652</u>	<u>36,509,835</u>
<b>已发行份额数目</b>	<b>份额</b>	<b>份额</b>
<b>I 累积 美元份额</b>		
期初已发行份额	1,716,097.0000	884,000.0000
已分配份额	-	1,028,928.0000
已赎回份额	<u>(722,325.0000)</u>	<u>(102,512.0000)</u>
期末已发行份额	<u>993,772.0000</u>	<u>1,810,416.0000</u>
<b>I 每月派息 美元份额</b>		
期初已发行份额	1,100,012.3166	1,076,253.0200
已分配份额	23,856.9429	1,009,232.2966
已赎回份额	<u>(71,497.2159)</u>	<u>(733,000.0000)</u>
期末已发行份额	<u>1,052,372.0436</u>	<u>1,352,485.3166</u>
<b>P 每月派息 港元份额</b>		
期初已发行份额	695,746.5814	834,117.2344
已分配份额	411,352.4087	-
已赎回份额	<u>(147,947.6390)</u>	<u>(59,355.9430)</u>
期末已发行份额	<u>959,151.3511</u>	<u>774,761.2914</u>
<b>P 每月派息 美元份额</b>		
期初已发行份额	743,768.6124	839,380.0374
已分配份额	43,620.8557	-
已赎回份额	<u>-</u>	<u>(69,011.4250)</u>
期末已发行份额	<u>787,389.4681</u>	<u>770,368.6124</u>

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)(续)

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

	2023 年 10 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日期间	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间
<u>已发行份额数目</u>	<u>份额</u>	<u>份额</u>
<b>HI 累积 新加坡元份额</b>		
期初已发行份额	440,177.3309	550,796.7288
已分配份额	-	-
已赎回份额	<u>(214,655.7220)</u>	<u>(72,742.8518)</u>
期末已发行份额	<u>225,521.6089</u>	<u>478,053.8770</u>
<b>HP 每月派息 澳元份额</b>		
期初已发行份额	146,827.3640	134,197.2190
已分配份额	38,607.6048	12,630.1450
已赎回份额	<u>(12,630.1450)</u>	<u>-</u>
期末已发行份额	<u>172,804.8238</u>	<u>146,827.3640</u>
<b>HP 每月派息 人民币份额</b>		
期初已发行份额	301,059.5522	174,547.3568
已分配份额	359,502.3541	306,096.8223
已赎回份额	<u>(39,919.8717)</u>	<u>(14,692.0600)</u>
期末已发行份额	<u>620,642.0346</u>	<u>465,952.1191</u>

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

现金流量表

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

	2023 年 10 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日期间	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间
	(美元)	(美元)
<b>经营活动产生的现金流量</b>		
归属于份额持有人的净资产增加	42,267,031	27,802,377
<b>调整:</b>		
股息收入	(1,156,966)	(1,211,026)
银行存款利息收益	(124,268)	(145,943)
投资利息收益	(3,133,587)	(1,608,475)
利息支出	-	2
股息收入预扣税	238,740	137,765
对份额持有人派发股息	11,601,912	9,306,973
以公允价值计量且其变动计入损益的投资及衍生金融工具净增加	(81,520,616)	(9,253,387)
应收经纪款减少/(增加)	6,439,269	(481,375)
其他应收款减少	899	900
保证金减少	666,290	297,176
应付经纪款(减少)/增加	(11,116,613)	4,710,356
其他应付账款增加/(减少)	123,950	(5,481)
已收股息(扣除已付预扣税)	763,794	1,019,697
已收银行存款利息	121,601	127,024
已收投资利息	3,515,591	2,005,400
已付利息	-	(2)
<b>经营活动现金(流出)/流入净额</b>	<b>....(31,312,973)</b>	<b>....32,701,981</b>
<b>融资活动产生的现金流量</b>		
分配份额所得款项	128,898,109	7,131,113
赎回份额付款	(76,131,158)	(29,436,986)
已付收益分配	(11,601,912)	(9,306,973)
<b>融资活动现金流入/(流出)净额</b>	<b>....41,165,039</b>	<b>....(31,612,846)</b>
<b>现金及现金等价物之增加</b>	<b>9,852,066</b>	<b>1,089,135</b>
期初现金及现金等价物	....11,560,924	....17,324,275
<b>期末现金及现金等价物</b>	<b><u>21,412,990</u></b>	<b><u>18,413,410</u></b>
<b>现金及现金等价物余额分析</b>		
银行存款	<b><u>21,412,990</u></b>	<b><u>18,413,410</u></b>

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

现金流量表(未经审计)(续)

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

	2023 年 10 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日期间	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间
	(美元)	(美元)
<b>经营活动产生的现金流量</b>		
归属于份额持有人的净资产增加	1,342,130	1,211,345
<b>调整:</b>		
银行存款利息收益	(9,973)	(9,973)
投资利息收益	(729,966)	(729,966)
利息支出	-	8,251
对份额持有人派发股息	529,223	650,867
以公允价值计量且其变动计入损益的投资及衍生金融 工具净减少/(增加)	5,323,736	(14,144,599)
应收经纪款增加	(76,089)	(630,504)
其他应收款减少	5,915	5,071
保证金减少/(增加)	1,019	(100,758)
应收经纪款增加	619,824	535,724
应付成立费用减少	(5,070)	(5,070)
其他应付账款增加	11,141	6,840
已收银行存款利息	9,944	7,929
已收投资利息	793,977	592,732
已付利息	-	(8,251)
<b>经营活动现金流入/(流出)净额</b>	<b>7,815,811</b>	<b>(12,610,362)</b>
<b>融资活动产生的现金流量</b>		
分配份额所得款项	1,137,097	16,756,706
赎回份额付款	(8,341,231)	(4,320,102)
已付收益分配	(529,223)	(650,867)
<b>融资活动现金(流出)/流入净额</b>	<b>(7,733,357)</b>	<b>11,785,737</b>
<b>现金及现金等价物之增加/(减少)</b>	<b>82,454</b>	<b>(824,625)</b>
期初现金及现金等价物	195,696	2,036,808
<b>期末现金及现金等价物</b>	<b>278,150</b>	<b>1,212,183</b>
<b>现金及现金等价物余额分析</b>		
银行存款	<b>278,150</b>	<b>1,212,183</b>

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
上市股票				
澳大利亚 0.14%				
	Goodman Group Stapled Sec Ord Npv	28,003	617,680	0.14
			<b>617,680</b>	<b>0.14</b>
中国 2.08%				
	Alibaba Group Holding Ltd Ord (每股面值 0.000003125 美元)	188,600	1,692,868	0.39
	Baidu Inc-Class A Ord (每股面值 0.00000625 美元)	46,900	615,430	0.14
	China Construction Bank H Shs Ord (每股面值 1 人民币)	1,000,000	603,083	0.14
	Industrial And Commercial Bank Of China H Shs Ord (每股面值 1 人民币)	1,200,000	604,105	0.14
	Kweichow Moutai Co Ltd Cc Ord (每股面值 1 人民币)	600	140,728	0.03
	Meituan Dianping Ord (每股面值 0.00001 港元)	79,540	983,776	0.23
	Midea Group Co Ltd Szhk Ord (每股面值 1 人民币)	16,900	149,485	0.03
	Miniso Group Holding Ltd-Adr Adr (1 份 ADR 代表 4 份普通股)	10,000	205,000	0.05
	Pinduoduo Inc - Adr (1 份 ADR 代表 4 份普通股)	3,789	440,471	0.10
	Ping An Insurance (Group) Company Of China Limited H 股(每股面值 1 港元)	92,000	388,503	0.09
	Tencent Hldgs Ltd (每股面值 0.0002 港元)	78,900	3,062,668	0.71
	Trip.Com Group Ltd Ord (每股面值 0.00125 美元)	2,900	127,910	0.03
			<b>9,014,027</b>	<b>2.08</b>
丹麦 0.26%				
	Novo Nordisk A/S Sponsored Adr (1 份 ADR 代表 1 份 B 股)	8,600	1,104,240	0.26
			<b>1,104,240</b>	<b>0.26</b>
香港 0.15%				
	AIA Group Ltd	58,800	394,807	0.09
	Hong Kong Exchanges And Clearing Ltd Ord (每股面值 1 港元)	9,500	276,511	0.06
			<b>671,318</b>	<b>0.15</b>
印度尼西亚 0.13%				
	Bank Mandiri Persero Tbk Pt Ord (每股面值 250 印尼盾)	380,000	173,762	0.04
	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk Ord (每股面值 50 印尼盾)	974,910	372,009	0.09
			<b>545,771</b>	<b>0.13</b>
以色列 0.34%				
	Cyberark Software Ltd Com (每股面值 0.01 美元)	5,600	1,487,528	0.34
			<b>1,487,528</b>	<b>0.34</b>

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
上市股票(续)				
日本 7.08%				
	Asahi Group Holdings Limited Ord Npv	27,600	1,017,960	0.24
	Hitachi Ltd	16,100	1,479,206	0.34
	Itochu Corporation Ord Npv	22,000	939,919	0.22
	Marubeni Corporation	60,000	1,042,254	0.24
	Matsukiyococokara & Co Ord Npv	96,300	1,552,241	0.36
	Mitsubishi Corporation	62,200	1,433,093	0.33
	Mitsubishi Estate Company Limited	188,800	3,473,611	0.80
	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	196,000	1,875,886	0.43
	Mitsui And Company Limited	30,200	1,417,960	0.33
	Mitsui Fudosan Company Limited	241,800	2,632,168	0.61
	Nissan Chemical Corp Ord Npv	22,000	832,205	0.19
	Recruit Holdings Co Ltd Ord Npv	44,900	1,989,787	0.46
	Renesas Electronics Corporation Ord Npv	148,000	2,611,477	0.60
	Seven And I Holdings Co Limited Ord Npv	79,800	1,163,162	0.27
	Shin-Etsu Chemical Company Limited Com Npv	52,200	2,270,870	0.52
	Sony Group Corp	11,600	995,249	0.23
	Sumco Corporation	78,300	1,245,288	0.29
	Sumitomo Corporation	41,800	1,008,646	0.23
	Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd Ord Npv	55,800	1,688,250	0.39
			<b>30,669,232</b>	<b>7.08</b>
韩国 4.60%				
	Samsung Electronics Co Ltd Gdr	3,360	4,996,320	1.15
	Samsung Electronics Co Ltd Ord (每股面值 100 韩元)	5,933	363,141	0.08
	Samsung Electronics Company Limited Preference Shares (每股面值 100 韩元)	7,648	386,306	0.09
	SK Hynix Inc Ord (每股面值 5000 韩元)	104,408	14,192,508	3.28
			<b>19,938,275</b>	<b>4.60</b>
荷兰 1.80%				
	ASM International Ord (每股面值 0.04 欧元)	2,000	1,222,344	0.28
	ASML Holding Nv - Ny Reg Shs EUR0.09 (1 份 ADR 代表一份普通股)	6,800	6,599,196	1.52
			<b>7,821,540</b>	<b>1.80</b>
台湾 3.67%				
	Chailease Holdings Co Ltd Ord (每股面值 10 台币)	13,791	74,119	0.02
	联发科技股份有限公司	7,000	261,378	0.06
	台积电	572,000	13,923,102	3.22
	台积电 Spd Adr	11,800	1,605,390	0.37
			<b>15,863,989</b>	<b>3.67</b>
美国 37.83%				
	Adobe Inc Com (每股面值 0.0001 美元)	3,300	1,665,180	0.38
	Advanced Micro Devices Inc	28,000	5,053,720	1.17
	AES Corporation	56,000	1,004,080	0.23
	Alphabet Inc-CI A Com (每股面值 0.001 美元)	96,302	14,534,861	3.36
	Amazon Com Inc Com (每股面值 0.01 美元)	82,300	14,845,274	3.43
	Ameren Corporation	13,000	961,480	0.22

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
上市股票(续)				
美国 37.83% (续)				
	American Water Works Co Inc Com (每股面值 0.01 美元)	8,100	989,901	0.23
	Amgen Inc Com (每股面值 0.0001 美元)	1,900	540,208	0.12
	Apple Inc Com Npv	102,600	17,593,848	4.06
	Applied Materials Inc Com (每股面值 0.01 美元)	32,000	6,599,360	1.52
	Bank Of America Corporation	53,800	2,040,096	0.47
	Centerpoint Energy Inc	36,000	1,025,640	0.24
	Chevron Corp Com (每股面值 0.75 美元)	4,400	694,056	0.16
	Coca-Cola Co/The Com (每股面值 0.25 美元)	20,784	1,271,565	0.29
	Costco Wholesale Corporation	330	241,768	0.06
	Crowdstrike Holdings Inc Com Npv	1,800	577,062	0.13
	Danaher Corporation	1,900	474,468	0.11
	Disney (Walt) Productions Del Com	26,000	3,181,360	0.73
	Edison International	15,500	1,096,315	0.25
	Eli Lilly & Co	5,600	4,356,576	1.01
	Eversource Energy	18,600	1,111,722	0.26
	Exelon Corporation	29,000	1,089,530	0.25
	Exxon Mobil Corporation	32,830	3,816,159	0.88
	JPMorgan Chase And Co Com (每股面值 1 美元)	10,600	2,123,180	0.49
	Kla Corp Com (每股面值 0.001 美元)	2,900	2,025,853	0.47
	Lam Research Corporation	2,130	2,069,444	0.48
	Lockheed Martin Corporation	3,300	1,501,071	0.35
	Meta Platforms Inc Com (每股面值 0.000006 美元)	33,800	16,412,604	3.79
	Microsoft Corp	31,623	13,304,429	3.07
	Morgan Stanley Com (每股面值 0.01 美元)	26,000	2,448,160	0.57
	Nvidia Corporation	19,180	17,330,281	4.00
	Palo Alto Networks Inc Com (每股面值 0.0001 美元)	7,100	2,017,323	0.47
	Raytheon Technologies Corporation	21,000	2,048,130	0.47
	Salesforce.Com Inc	13,600	4,096,048	0.95
	ServiceNow Inc Com (每股面值 0.001 美元)	3,800	2,897,120	0.67
	Synopsys Inc Com (每股面值 0.01 美元)	10,100	5,772,150	1.33
	Thermo Fisher Scientific Inc Com (每股面值 1 美元)	2,600	1,511,146	0.35
	Wells Fargo & Co Com (每股面值 1.666 美元)	38,100	2,208,276	0.51
	Xcel Energy Inc	23,800	1,279,250	0.30
			<b>163,808,694</b>	<b>37.83</b>

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
<b>固定收益</b>				
<b>美国 28.94%</b>				
	美国国库 3.5% 15/02/2033	30,600,000	28,998,289	6.70
	美国国库 3.625% 15/02/2053	6,600,000	5,801,298	1.34
	美国国库 3.875% 15/05/2043	7,600,000	7,019,903	1.62
	美国国库 4% 31/01/2029	12,000,000	11,880,942	2.74
	美国国库 4.125% 15/11/2032	22,130,000	21,991,699	5.08
	美国国库 5% 31/08/2025	16,800,000	16,835,440	3.89
	美国国库证券 4.75% 15/02/2041	31,300,000	32,772,086	7.57
			<b><u>125,299,657</u></b>	<b><u>28.94</u></b>
<b>浮动收益</b>				
<b>美国 4.18%</b>				
	JP Morgan Chase & Co (Reg) Var 09/08/2025	3,600,000	3,532,829	0.82
	JP Morgan Chase & Co Var 15/12/2025	6,800,000	6,796,926	1.57
	JP Morgan Chase & Co Var 26/04/2033	8,090,000	7,754,767	1.79
			<b><u>18,084,522</u></b>	<b><u>4.18</u></b>
<b>上市/报价投资基金</b>				
<b>爱尔兰 0.79%</b>				
	景顺实物黄金 Etc ETF	16,000	3,427,040	0.79
			<b><u>3,427,040</u></b>	<b><u>0.79</u></b>
<b>卢森堡 2.03%</b>				
	百达-人民币债券 - Z 每月派息 人民币	18,023	1,877,405	0.43
	百达-新兴地方债券 - Z 美元	26,073	5,386,421	1.24
	百达-全球环境机会-Z 美元	3,300	1,563,573	0.36
			<b><u>8,827,399</u></b>	<b><u>2.03</u></b>
<b>美国 0.44%</b>				
	BlackRock Fund Advisors - iShares MSCI India ETF	36,900	1,903,671	0.44
			<b><u>1,903,671</u></b>	<b><u>0.44</u></b>

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
期货合约				
印度 0.04%	IFSC Nifty 50 Fut 25/04/2024	313	156,543	0.04
			<u>156,543</u>	<u>0.04</u>
日本 0.04%	Nikkei 225 (OSE) 13/06/2024	23	152,697	0.04
			<u>152,697</u>	<u>0.04</u>
远期外汇合约(0.28%)			<u>(1,224,400)</u>	<u>(0.28)</u>
上市股票合计			<u>251,542,294</u>	
固定收益合计			<u>125,299,657</u>	
浮动收益合计			<u>18,084,522</u>	
投资基金合计			<u>14,158,110</u>	
期货合约合计			<u>309,240</u>	
远期外汇合约合计			<u>(1,224,400)</u>	
组合投资合计			<u>408,169,423</u>	
组合投资合计, 按成本			<u>409,393,823</u>	

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产 百分比
固定收益				
百慕大 0.71%				
	Star Energy Co Issue SER (Reg) (Reg S) 4.85% 14/10/2038	200,000	185,708	0.71
			<b>185,708</b>	<b>0.71</b>
英属维尔京群岛 8.19%				
	CCTHK 2021 Ltd SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2% 19/01/2025	200,000	194,040	0.74
	Cheung Kong Infra Fin Bv (Reg) (Reg S) 4% 永续债 31/12/2049	200,000	132,766	0.50
	China Cinda 2020 I Mngmn SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 3.25% 28/01/2027	200,000	187,375	0.71
	China Cinda Finance 2015 SER Regs 4.25% 23/04/2025	300,000	295,524	1.12
	CNPC HK Overseas Capital Ltd SER Regs 5.95Pct 28/04/2041	400,000	438,526	1.67
	Gz Mtr Fin BVI SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.31% 17/09/2030	200,000	165,096	0.63
	Huarong Finance II ER 欧洲中期债券 (Reg) (Regs) 5.5% 16/01/2025	200,000	198,560	0.75
	LS Finance 2017 Ltd (Reg) (Reg S) 4.8% 18/06/2026	200,000	176,066	0.67
	Nan Fung Treasury Ltd SER 欧洲中期债券 (Reg) (Regs) 3.625% 27/08/2030	200,000	173,622	0.66
	Sinopec Group Overseas Development 2012 Regs 4.875% 17/05/20	200,000	194,105	0.74
			<b>2,155,680</b>	<b>8.19</b>
开曼群岛 7.02%				
	Alibaba Group Holding (Reg) 3.6% 28/11/2024	300,000	296,233	1.12
	Alibaba Group Holding (Reg) 3.15% 09/02/2051	200,000	133,397	0.51
	CCBL Cayman 1 Corp SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 3.5% 16/05/2024	300,000	299,132	1.13
	CCBL Cayman 1 Corp SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.55% 28/09/2030	300,000	254,402	0.97
	Meituan SER (Reg) (Reg S) 3.05% 28/10/2030	400,000	343,142	1.30
	Tencent Holdings Ltd SER (Reg S) 3.24% 03/06/2050	200,000	136,208	0.52
	Wynn Macau Ltd SER Regs (Reg) (Reg S) 5.5% 15/01/2026	200,000	195,341	0.74
	Wynn Macau Ltd SER Regs (Reg) (Reg S) 5.5% 01/10/2027	200,000	191,611	0.73
			<b>1,849,466</b>	<b>7.02</b>

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

国家	投资	单位数目	市值(美元)	占净资产百分比
<b>固定收益</b>				
<b>中国 12.61%</b>				
	Bank of China SER Regs 5% 13/11/2024	200,000	199,296	0.76
	CICC HK Finance 2016 Mtn SER Gmtn (Reg) (Reg S) 5.442% 18/07/2026	300,000	301,180	1.14
	Fortune Star BVI Ltd (Reg) (Reg S) 5.05% 27/01/2027	200,000	162,687	0.62
	绿城中国控股 (Reg) (Reg S) 5.65% 13/07/2025	200,000	184,571	0.70
	Huarong Finance 2019 SER 欧洲中期债券 (Reg S) 3.25% 13/11/2024	200,000	196,200	0.74
	Huarong Finance II SER 欧洲中期债券 (Reg) (Regs) 4.875% 22/11/2026	200,000	192,054	0.73
	Huarong Finance II SER 欧洲中期债券 (Reg) (Regs) 5% 19/11/2025	200,000	195,344	0.74
	ICBCIL Finance Co Ltd SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 1.625% 02/11/2024	200,000	195,246	0.74
	龙湖集团控股有限公司 (Reg) (Reg S) 3.375% 13/04/2027	200,000	128,502	0.49
	Meituan SER Regs (Reg) (Reg S) 2.125% 28/10/2025	400,000	379,220	1.44
	中化离岸资本有限公司 SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.375% 23/09/2031	200,000	166,548	0.63
	Tencent Holdings Ltd SER Regs (Reg S) 2.39% 03/06/2030	200,000	170,984	0.65
	Tencent Holdings Ltd SER Regs (Reg S) 3.84% 22/04/2051	200,000	152,275	0.58
	Weibo Corp (Reg) 3.375% 08/07/2030	400,000	347,943	1.32
	仁恒地产(香港)有限公司 (Reg) (Reg S) 5.125% 20/05/2026	200,000	160,077	0.61
	Zhongan Online P&C Insur 3.5% 08/03/2026	200,000	189,349	0.72
			<b>3,321,476</b>	<b>12.61</b>
<b>香港 3.68%</b>				
	友邦保险控股有限公司 SER Regs (Reg S) 5.375% 05/04/2034	200,000	200,601	0.76
	Celestial Dynasty Ltd (Reg S) 4.25% 27/06/2029	360,000	324,294	1.23
	中信银行股份有限公司 SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.45% 25/02/2025	200,000	194,427	0.74
	Xiaomi Best Time Intl Ser (Reg) (Reg S) 2.875% 14/07/2031	300,000	250,057	0.95
			<b>969,379</b>	<b>3.68</b>

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

国家	投资	单位数目	市值 (美元)	占净资产 百分比
固定收益(续)				
印度 10.93%				
	10 Renew Power Subsidiar Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.5% 14/07/2028	200,000	183,133	0.69
	Adani Electricity Mumbai Ser Regs (Reg S) 3.867% 22/07/2031	200,000	164,942	0.63
	Adani Green Energy Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.375% 08/09/2024	200,000	197,834	0.75
	Adani Ports and Special Ser Reg (Reg S) 4% 30/07/2027	200,000	183,837	0.70
	Adani Electricity Mumbai Ser Regs (Reg S) 3.1% 02/02/2031	200,000	159,679	0.61
	India Green Power Hold Ser Regs (Reg S) 4% 22/02/2027	250,000	216,526	0.82
	Indiabulls Housing Finance Ser Regs (Reg) (Reg S) 9.7% 03/07/2027	289,000	288,856	1.10
	JSW Infrastructure Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.95% 21/01/2029	200,000	187,913	0.71
	Power Finance Corp Ltd Ser Regs (Reg S) 3.95% 23/04/2030	400,000	365,543	1.39
	REC Limited Ser Gmtn (Reg) (Reg S) 2.25% 01/09/2026	200,000	184,877	0.70
	REC Limited Ser Gmtn (Reg) (Reg S) 2.75% 13/01/2027	200,000	185,033	0.70
	Reliance Industries Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.875% 12/01/2032	250,000	212,599	0.81
	Shriram Transport Fin Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.15% 18/07/2025	200,000	193,930	0.74
	Vedanta Resources Ser Regs (Reg) (Reg S) 13.875% 09/12/2028	200,000	153,025	0.58
			<b>2,877,727</b>	<b>10.93</b>
印度尼西亚 6.62%				
	Freeport Indonesia Pt Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.315% 14/04/2032	200,000	195,885	0.74
	Freeport Indonesia Pt Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.2% 14/04/2052	200,000	198,979	0.76
	Indofood Cbp Sukses Makm (Reg) (Reg S) 3.541% 27/04/2032	200,000	173,000	0.66
	Indofood Cbp Sukses Makm (Reg) (Reg S) 4.805% 27/04/2052	200,000	163,999	0.62
	Medco Maple Tree Pte Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 8.96% 27/04/2029	250,000	260,526	0.99
	Minejesa Capital Bv Ser Regs (Regs) 4.625% 10/08/2030	200,000	176,955	0.67
	PT Bank Tabungan Negara (Reg) (Reg S) 4.2% 23/01/2025	200,000	196,858	0.75
	PT Pakuwon Jati (Reg S) 4.875% 29/04/2028	200,000	187,647	0.71
	Tower Bersama Infrastruc (Reg) (Reg S) 2.75% 20/01/2026	200,000	189,139	0.72
			<b>1,742,988</b>	<b>6.62</b>

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

国家	投资	单位数目	市值 (美元)	占净资产 百分比
<b>固定收益(续)</b>				
<b>韩国 8.62%</b>				
	Hana Bank Ser Regs 4.375% 30/09/2024	400,000	397,034	1.51
	Hyundai Capital Services Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.125% 24/04/2025	200,000	192,798	0.73
	Hyundai Capital Services Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.125% 05/02/2029	200,000	198,141	0.75
	Keb Hana Bank (Reg) (Regs) 4.25% 14/10/2024	200,000	198,225	0.75
	Kookmin Bank Ser Gmtn (Reg) (Reg S) 4.5% 01/02/2029	200,000	191,455	0.73
	Mirae Asset Securities (Reg) (Reg S) 6.875% 26/07/2026	200,000	203,164	0.77
	Shinhan Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) 4% 23/04/2026	200,000	186,699	0.71
	SK Hynix Inc Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.25% 17/01/2026	200,000	202,459	0.77
	SK Hynix Inc Ser Regs (Reg S) 5.5% 16/01/2027	200,000	200,233	0.76
	Woori Bank Ser Regs 4.75% 30/04/2027	300,000	299,669	1.14
			<b><u>2,269,877</u></b>	<b><u>8.62</u></b>
<b>澳门 4.28%</b>				
	Melco Resorts Finance Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.375% 04/12/2029	400,000	366,603	1.39
	MGM China Holdings Ltd Ser Regs (Reg S) 4.75% 01/02/2027	200,000	190,842	0.72
	Sands China Ltd Ser Wi (Reg) 5.4% 08/08/2028	200,000	196,327	0.75
	Sands China Ltd Ser Wi (Reg) 4.375% 18/06/2030	200,000	183,661	0.70
	Studio City Finance Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.5% 15/01/2028	200,000	190,805	0.72
			<b><u>1,128,238</u></b>	<b><u>4.28</u></b>
<b>马来西亚 1.39%</b>				
	GENM Capital Labuan Ser Regs (Reg S) 3.882% 19/04/2031	200,000	175,420	0.67
	Misc Capital Two Labuan Ser Regs (Reg S) 3.75% 06/04/2027	200,000	191,161	0.72
			<b><u>366,581</u></b>	<b><u>1.39</u></b>
<b>毛里求斯 0.75%</b>				
	Greenko Wind Projects Mu Ser Regs (Reg S) 5.5% 06/04/2025	200,000	196,500	0.75
			<b><u>196,500</u></b>	<b><u>0.75</u></b>
<b>菲律宾 0.76%</b>				
	Metropolitan Bank & Trus Ser Emtn (Reg S) 5.5% 06/03/2034	200,000	200,846	0.76
			<b><u>200,846</u></b>	<b><u>0.76</u></b>
<b>新加坡 1.63%</b>				
	BOC Aviation Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3% 11/09/2029	200,000	180,224	0.69
	BOC Aviation USA Corp Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.75% 09/11/2028	242,000	248,391	0.94
			<b><u>428,615</u></b>	<b><u>1.63</u></b>
<b>泰国 2.43%</b>				
	GC Treasury Centre Co Ser Regs (Reg S) 4.4% 30/03/2032	200,000	181,765	0.69
	Thaioil Treasury Center Ser Regs (Reg S) 3.5% 17/10/2049	400,000	272,264	1.04
	Thaioil Trsry Center Ser Regs 5.375% 20/11/2048	200,000	184,903	0.70
			<b><u>638,932</u></b>	<b><u>2.43</u></b>
<b>美国 0.69%</b>				
	Resorts World/Rwlv Cap Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 16/04/2029	200,000	182,577	0.69
			<b><u>182,577</u></b>	<b><u>0.69</u></b>
<b>越南 0.84%</b>				
	Mong Duong Finance Holdings BV Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.125% 07/05/2029	250,000	220,626	0.84
			<b><u>220,626</u></b>	<b><u>0.84</u></b>

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

国家	投资	单位数目	市值 (美元)	占净资产 百分比
浮动收益				
英属维尔京群岛 1.42%				
	China Huaneng Gp HK Treasury (Reg) (Reg S) Var Perpetual 31/12/2049	200,000	192,000	0.73
	Elect Global Investments Ltd (Reg) (Reg S) Var Perpetual 31/12/2049	200,000	182,250	0.69
			<b>374,250</b>	<b>1.42</b>
中国 2.23%				
	CDB Financial Leasing (Reg) (Reg S) Var 28/09/2030	200,000	191,615	0.73
	Ind & Comm Bk Chn Macau (Reg) (Reg S) Var 12/09/2029	400,000	395,176	1.50
			<b>586,791</b>	<b>2.23</b>
香港 5.15%				
	Bank of East Asia Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	250,000	246,250	0.93
	CAS Capital No.1 Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	200,000	183,236	0.70
	Nanyang Commercial Bank (Reg) (Reg S) Var 20/11/2029	500,000	492,989	1.87
	Nanyang Commercial Bank (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	250,000	257,342	0.98
	NWD Finance (BVI) Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	200,000	177,000	0.67
			<b>1,356,817</b>	<b>5.15</b>
印度 1.40%				
	Axis Bank Gift City Ser Regs (Reg S) Var Perp 31/12/2049	200,000	185,650	0.70
	HDFC Bank Ltd Ser Regs (Reg S) Var Perp 31/12/2049	200,000	184,576	0.70
			<b>370,226</b>	<b>1.40</b>
印度尼西亚 0.71%				
	Bank Negara Indonesia (Reg S) Var Perpetual 31/12/2049	200,000	185,962	0.71
			<b>185,962</b>	<b>0.71</b>
毛里求斯 1.51%				
	Network I2I Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	400,000	396,503	1.51
			<b>396,503</b>	<b>1.51</b>
菲律宾 2.21%				
	Petron Corp (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	200,000	192,765	0.73
	Rizal Commercial Banking (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	200,000	196,000	0.74
	SMC Global Power Holdings (Reg S) Var Perpetual 31/12/2049	200,000	195,202	0.74
			<b>583,967</b>	<b>2.21</b>
新加坡 1.44%				
	Oversea-Chinese Banking (Reg S) Var 15/06/2032	200,000	195,540	0.74
	United Overseas Bank Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) Var14/10/2031	200,000	183,329	0.70
			<b>378,869</b>	<b>1.44</b>
泰国 3.52%				
	Bangkok Bank PCL Var 23/09/2036	200,000	168,892	0.64
	Bangkok Bank PCL/HK Ser Regs (Reg S) Var Perp 31/12/2049	200,000	195,329	0.74
	Bangkok Bank PCL/HK Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 25/09/2034	200,000	178,508	0.68
	Kasikornbank PCL HK Ser Emtn (Reg) (Reg S) Var 02/10/2031	200,000	186,138	0.71
	TMB Thanachart Bank Var Perpetual 31/12/2049	200,000	198,500	0.75
			<b>927,367</b>	<b>3.52</b>

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

国家	投资	单位数目	市值 (美元)	占净资产 百分比
浮动收益(续)				
英国 7.04%				
	Standard Chartered Plc Ser Emtn (Reg S) Var 12/02/2030	200,000	194,539	0.74
	Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg S) Var 15/03/2033	400,000	381,766	1.45
	Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 12/01/2033	600,000	508,645	1.93
	Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 18/02/2036	400,000	336,204	1.28
	Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049	468,000	431,890	1.64
			<b><u>1,853,044</u></b>	<b><u>7.04</u></b>
期货合约				
美国 0.00%				
	US 10YR NOTE (CBT) 18/06/2024	7	750	0.00
			<b><u>750</u></b>	<b><u>0.00</u></b>
远期外汇合约(0.11%)			<b><u>(30,171)</u></b>	<b><u>(0.11)</u></b>
固定收益合计			<b><u>18,735,216</u></b>	
浮动收益合计			<b><u>7,013,796</u></b>	
期货合约合计			<b><u>750</u></b>	
远期外汇合约合计			<b><u>(30,171)</u></b>	
组合投资合计			<b><u>25,719,591</u></b>	
组合投资合计, 按成本			<b><u>25,294,826</u></b>	

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

投资组合持有变动表(未经审计)

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

	于 2024 年 3 月 31 日 占净资产百分比	于 2023 年 9 月 30 日 占净资产百分比
<b>上市股票</b>		
澳大利亚	0.14	0.41
中国	2.08	5.57
丹麦	0.26	-
英属格恩西岛	-	0.11
香港	0.15	0.93
印度尼西亚	0.13	0.10
以色列	0.34	-
日本	7.08	3.22
韩国	4.60	2.99
荷兰	1.80	0.51
台湾	3.67	2.56
美国	37.83	19.56
	<b><u>58.08</u></b>	<b><u>35.96</u></b>
<b>固定收益</b>		
美国	28.94	55.95
	<b><u>28.94</u></b>	<b><u>55.95</u></b>
<b>浮动收益</b>		
美国	4.18	0.78
	<b><u>4.18</u></b>	<b><u>0.78</u></b>
<b>上市/报价投资基金</b>		
爱尔兰	0.79	1.02
卢森堡	2.03	2.89
美国	0.44	-
	<b><u>3.26</u></b>	<b><u>3.91</u></b>
<b>期货合约</b>		
印度	0.04	(0.01)
日本	0.04	(0.02)
	<b><u>0.08</u></b>	<b><u>(0.03)</u></b>
<b>远期外汇合约</b>	<b><u>(0.28)</u></b>	<b><u>0.07</u></b>
<b>组合投资合计</b>	<b><u>94.26</u></b>	<b><u>96.64</u></b>

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

投资组合持有变动表(未经审计)(续)

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

	于 2024 年 3 月 31 日 占净资产百分比	于 2023 年 9 月 30 日 占净资产百分比
<b>固定收益</b>		
百慕大	0.71	1.42
英属维尔京群岛	8.19	8.07
开曼群岛	7.02	11.46
中国	12.61	12.84
香港	3.68	5.43
印度	10.93	7.95
印度尼西亚	6.62	4.94
韩国	8.62	12.61
澳门	4.28	0.56
马来西亚	1.39	1.09
毛里求斯	0.75	1.21
菲律宾	0.76	-
新加坡	1.63	1.87
台湾	-	0.76
泰国	2.43	1.36
英国	-	-
美国	0.69	0.90
越南	0.84	-
	<b><u>71.15</u></b>	<b><u>72.47</u></b>
<b>浮动收益</b>		
英属维尔京群岛	1.42	2.92
中国	2.23	3.05
香港	5.15	4.70
印度	1.40	1.09
印度尼西亚	0.71	0.52
毛里求斯	1.51	1.23
菲律宾	2.21	0.55
新加坡	1.44	3.41
泰国	3.52	2.22
英国	7.04	5.48
	<b><u>26.63</u></b>	<b><u>25.17</u></b>
<b>期货合约</b>		
美国	0.00	(0.02)
	<b><u>0.00</u></b>	<b><u>(0.02)</u></b>
<b>远期外汇合约</b>		
	(0.11)	0.01
	<b><u>(0.11)</u></b>	<b><u>0.01</u></b>
<b>组合投资合计</b>	<b><u>97.67</u></b>	<b><u>97.63</u></b>

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

衍生金融工具详情(未经审计)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

期货合约

于 2024 年 3 月 31 日，子基金持有的远期外汇合约详情如下：

于 2024 年 3 月 31 日

说明	相关资产	合约规模	名义市值 美元	持仓量	交易对手	公允价值 美元
<b>金融资产：</b>						
IFSC NIFTY 50 FUT 25/04/2024	IFSC NIFTY 50 FUT	2	14,077,488	313	瑞银期货有限责任 公司	156,543
NIKKEI 225 (OSE) 13/06/2024	NIKKEI 225 (OSE)	1,000	6,138,095	23	瑞银期货有限责任 公司	<u>152,697</u> <u>309,240</u>

远期外汇合约

于 2024 年 3 月 31 日，子基金持有的远期外汇合约详情如下：

于 2024 年 3 月 31 日

交割合约	折算额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
<b>金融资产：</b>				
澳元 55,697	美元 36,444	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	79
澳元 76,199	美元 49,847	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	95
离岸人民币 2,162,282	美元 299,840	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	1,707
离岸人民币 24,000,000	美元 3,334,992	2024 年 4 月 26 日	香港上海汇丰银行有限公司	26,399
离岸人民币 3,001	美元 414	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	0
离岸人民币 638,155	美元 88,643	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	655
港元 45,000,000	美元 5,757,449	2024 年 4 月 26 日	香港上海汇丰银行有限公司	3,158
日元 30,512,789	美元 202,529	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	57
日元 710,000,000	美元 4,734,192	2024 年 4 月 26 日	香港上海汇丰银行有限公司	25,748

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

衍生金融工具详情(未经审计)(续)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

远期外汇合约(续)

于 2024 年 3 月 31 日(续)

交割合约	折算额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
<b>金融资产:</b>				
美元 189,934	澳元 291,036	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	89
美元 310,836	离岸人民币 2,256,117	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	234
美元 315,954	日元 47,698,076	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	554
美元 55,878	澳元 85,587	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	4
美元 6,913	日元 1,042,297	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	4
美元 710,578	日元 107,155,000	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	466
美元 9,500	日元 1,432,634	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	6
				<u>59,255</u>

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

衍生金融工具详情(未经审计)(续)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

远期外汇合约(续)

于 2024 年 3 月 31 日(续)

交割合约	折算额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
<b>金融负债:</b>				
澳元 27,556	美元 17,984	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(8)
离岸人民币 10,022	美元 1,381	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(1)
离岸人民币 59,004	美元 8,129	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(6)
美元 1,029,335	日元 155,010,408	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(738)
美元 1,528	离岸人民币 11,075	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(1)
美元 1,541,967	新加坡元 2,060,856	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(12,962)
美元 1,901,713	新加坡元 2,541,660	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(15,986)
美元 11,723	离岸人民币 84,394	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(87)
美元 12,374	离岸人民币 89,227	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(71)
美元 140,570	澳元 215,123	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(112)
美元 142,239	离岸人民币 1,024,011	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(1,050)
美元 167,463	澳元 256,002	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(314)
美元 2,589,096	瑞士法郎 2,284,864	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(44,449)
美元 26,866	离岸人民币 194,708	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(20)
美元 308,933	离岸人民币 2,236,863	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(517)
美元 4,355	离岸人民币 31,326	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(36)

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

衍生金融工具详情(未经审计)(续)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

远期外汇合约(续)

于 2024 年 3 月 31 日(续)

交割合约	折算额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
<b>金融负债:</b>				
美元 4,505	离岸人民币 32,594	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(11)
美元 45,158,571	日元 6,801,991,743	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(22,866)
美元 47,509,358	离岸人民币 341,748,919	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(389,429)
美元 5,493	离岸人民币 39,611	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(32)
美元 52,712,153	澳元 79,522,782	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(789,979)
美元 585,562	离岸人民币 4,211,886	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(4,832)
美元 6,038	离岸人民币 43,722	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(10)
美元 69,077	离岸人民币 500,002	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(138)
				<u>(1,283,655)</u>

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

衍生金融工具详情(未经审计)(续)

于 2024 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

期货合约

于 2024 年 3 月 31 日，子基金持有的远期外汇合约详情如下：

于 2024 年 3 月 31 日

说明	相关资产	合约规模	名义市值 美元	持仓量	交易对手	公允价值 美元
<b>金融资产：</b>						
US 10YR NOTE (CBT) 18/06/2024	美国国库票据	1,000	110,797	1	J. P. Morgan Securities Ltd	750
US 10YR NOTE (CBT) 18/06/2024	美国国库票据	1,000	221,594	2	J. P. Morgan Securities Ltd	0
US 10YR NOTE (CBT) 18/06/2024	美国国库票据	1,000	221,594	2	J. P. Morgan Securities Ltd	<u>344</u>
						<u>1,094</u>
<b>金融负债：</b>						
US 10YR NOTE (CBT) 18/06/2024	美国国库票据	1,000	221,594	2	J. P. Morgan Securities Ltd	<u>(344)</u>
						<u>(344)</u>

远期外汇合约

于 2024 年 3 月 31 日，子基金持有的远期外汇合约详情如下：

于 2024 年 3 月 31 日

交割合约	折算额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
<b>金融资产：</b>				
美元 21,171	离岸人民币 153,660	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	<u>16</u>
				<u>16</u>
<b>金融负债：</b>				
美元 790,612	澳元 1,192,196	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(12,201)
美元 580,682	离岸人民币 4,177,015	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(4,760)
美元 1,493,128	新加坡元 1,994,686	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	(13,216)
美元 13,688	离岸人民币 99,200	2024 年 4 月 30 日	香港上海汇丰银行有限公司	<u>(10)</u>
				<u>(30,187)</u>

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

分配披露(未经审计)

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

I 每月派息 美元

记录日	除息日	派息日	每份额派息额(美元)	有权收取派息之份额	总派息额(美元)	总派息额(美元)
2023年10月19日	2023年10月20日	2023年10月27日	0.045	429,844.8252	19,343.02	19,343.02
2023年11月17日	2023年11月20日	2023年11月24日	0.045	429,844.8252	19,343.02	19,343.02
2023年12月19日	2023年12月20日	2023年12月28日	0.045	429,844.8252	19,343.02	19,343.02
2024年1月19日	2024年1月22日	2024年1月26日	0.045	429,844.8252	19,343.02	19,343.02
2024年2月19日	2024年2月20日	2024年2月24日	0.045	429,844.8252	19,343.02	19,343.02
2024年3月19日	2024年3月20日	2024年3月26日	0.045	429,844.8252	19,343.02	19,343.02

P 每月派息 港元

记录日	除息日	派息日	每份额派息额(港元)	有权收取派息之份额	总派息额(港元)	总派息额(美元)
2023年10月19日	2023年10月20日	2023年10月27日	0.045	94,355,074.2086	4,245,978.36	542,672.52
2023年11月17日	2023年11月20日	2023年11月24日	0.045	95,036,884.2457	4,276,659.80	548,310.81
2023年12月19日	2023年12月20日	2023年12月28日	0.045	95,465,003.0781	4,295,925.13	550,854.97
2024年1月19日	2024年1月22日	2024年1月26日	0.045	96,891,360.1896	4,360,111.22	557,558.98
2024年2月19日	2024年2月20日	2024年2月24日	0.045	98,174,993.3973	4,417,874.70	564,866.16
2024年3月19日	2024年3月20日	2024年3月26日	0.045	99,530,570.1895	4,478,875.66	572,537.59

P 每月派息 美元

记录日	除息日	派息日	每份额派息额(美元)	有权收取派息之份额	总派息额(美元)	总派息额(美元)
2023年10月19日	2023年10月20日	2023年10月27日	0.045	15,133,215.5468	680,994.69	680,994.69
2023年11月17日	2023年11月20日	2023年11月24日	0.045	15,171,028.3760	682,696.26	682,696.26
2023年12月19日	2023年12月20日	2023年12月28日	0.045	14,678,938.4060	660,552.23	660,552.23
2024年1月19日	2024年1月22日	2024年1月26日	0.045	15,013,166.6212	675,592.49	675,592.49
2024年2月19日	2024年2月20日	2024年2月24日	0.045	15,085,675.6826	678,855.40	678,855.40
2024年3月19日	2024年3月20日	2024年3月26日	0.045	15,388,499.7875	692,482.47	692,482.47

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

分配披露(未经审计)(续)

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

**P 每月派息 3 港元**

记录日	除息日	派息日	每份额 派息额 (港元)	有权收取派息 之份额	总派息额 (港元)	总派息额 (美元)
2023 年 10 月 19 日	2023 年 10 月 20 日	2023 年 10 月 27 日	0.017	40,768.2840	693.06	88.58
2023 年 11 月 17 日	2023 年 11 月 20 日	2023 年 11 月 24 日	0.017	40,768.2840	693.06	88.86
2023 年 12 月 19 日	2023 年 12 月 20 日	2023 年 12 月 28 日	0.017	40,768.2840	693.06	88.87
2024 年 1 月 19 日	2024 年 1 月 22 日	2024 年 1 月 26 日	0.017	40,768.2840	693.06	88.63
2024 年 2 月 19 日	2024 年 2 月 20 日	2024 年 2 月 24 日	0.017	40,768.2840	693.06	88.61
2024 年 3 月 19 日	2024 年 3 月 20 日	2024 年 3 月 26 日	0.017	40,768.2840	693.06	88.59

**P 每月派息 3 美元**

记录日	除息日	派息日	每份额 派息额 (美元)	有权收取派息 之份额	总派息额 (美元)	总派息额 (美元)
2023 年 10 月 19 日	2023 年 10 月 20 日	2023 年 10 月 27 日	0.017	600.0000	10.20	10.20
2023 年 11 月 17 日	2023 年 11 月 20 日	2023 年 11 月 24 日	0.017	600.0000	10.20	10.20
2023 年 12 月 19 日	2023 年 12 月 20 日	2023 年 12 月 28 日	0.017	600.0000	10.20	10.20
2024 年 1 月 19 日	2024 年 1 月 22 日	2024 年 1 月 26 日	0.017	600.0000	10.20	10.20
2024 年 2 月 19 日	2024 年 2 月 20 日	2024 年 2 月 26 日	0.017	600.0000	10.20	10.20
2024 年 3 月 19 日	2024 年 3 月 20 日	2024 年 3 月 26 日	0.017	600.0000	10.20	10.20

**HI 每月派息 新加坡元**

记录日	除息日	派息日	每份额 派息额 (新加坡元)	有权收取派息 之份额	总派息额 (新加坡元)	总派息额 (美元)
2023 年 10 月 19 日	2023 年 10 月 20 日	2023 年 10 月 27 日	0.045	224,770.6280	10,114.68	7,374.37
2023 年 11 月 17 日	2023 年 11 月 20 日	2023 年 11 月 24 日	0.045	224,770.6280	10,114.68	7,527.20
2023 年 12 月 19 日	2023 年 12 月 20 日	2023 年 12 月 28 日	0.045	224,770.6280	10,114.68	7,613.61
2024 年 1 月 19 日	2024 年 1 月 22 日	2024 年 1 月 26 日	0.045	224,770.6280	10,114.68	7,538.42
2024 年 2 月 19 日	2024 年 2 月 20 日	2024 年 2 月 26 日	0.045	224,770.6280	10,114.68	7,512.11
2024 年 3 月 19 日	2024 年 3 月 20 日	2024 年 3 月 26 日	0.045	237,933.6280	10,707.01	7,975.72

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

分配披露(未经审计)(续)

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

HP 每月派息 澳元

记录日	除息日	派息日	每份额 派息额 (澳元)	有权收取派息 之份额	总派息额 (澳元)	总派息额 (美元)
2023年10月19日	2023年10月20日	2023年10月27日	0.050	8,531,779.2650	426,588.96	269,625.55
2023年11月17日	2023年11月20日	2023年11月24日	0.050	8,550,769.2091	427,538.46	278,006.88
2023年12月19日	2023年12月20日	2023年12月28日	0.050	8,586,556.3938	429,327.82	290,719.33
2024年1月19日	2024年1月22日	2024年1月29日	0.050	8,921,210.1357	446,060.51	293,708.54
2024年2月19日	2024年2月20日	2024年2月26日	0.050	9,316,624.2794	465,831.22	304,490.58
2024年3月19日	2024年3月20日	2024年3月26日	0.050	9,534,812.1213	476,740.61	311,216.27

HP 每月派息 瑞士法郎

记录日	除息日	派息日	每份额 派息额 (瑞士法郎)	有权收取派息 之份额	总派息额 (瑞士法郎)	总派息额 (美元)
2023年10月19日	2023年10月20日	2023年10月27日	0.050	129,576.6452	6,478.83	7,266.93
2023年11月17日	2023年11月20日	2023年11月24日	0.050	129,576.6452	6,478.83	7,308.32
2023年12月19日	2023年12月20日	2023年12月28日	0.050	139,672.6857	6,983.63	8,109.66
2024年1月19日	2024年1月22日	2024年1月26日	0.050	139,672.6857	6,983.63	8,037.32
2024年2月19日	2024年2月20日	2024年2月26日	0.050	160,295.7471	8,014.79	9,086.55
2024年3月19日	2024年3月20日	2024年3月26日	0.050	219,860.5751	10,993.03	12,376.75

HP 每月派息 日元

记录日	除息日	派息日	每份额 派息额 (日元)	有权收取派息 之份额	总派息额 (日元)	总派息额 (美元)
2023年10月19日	2023年10月20日	2023年10月27日	5.000	3,270,387.1968	16,351,936.00	109,089.27
2023年11月17日	2023年11月20日	2023年11月24日	5.000	3,483,328.0207	17,416,640.00	116,440.85
2023年12月19日	2023年12月20日	2023年12月28日	5.000	3,975,426.5470	19,877,133.00	138,328.63
2024年1月19日	2024年1月22日	2024年1月26日	5.000	4,545,729.7899	22,728,649.00	153,463.08
2024年2月19日	2024年2月20日	2024年2月26日	5.000	5,526,219.3028	27,631,097.00	184,004.91
2024年3月19日	2024年3月20日	2024年3月26日	5.000	6,276,421.6884	31,382,108.00	208,207.72

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

分配披露(未经审计)(续)

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

HP 每月派息 人民币

记录日	除息日	派息日	每份额 派息额 (人民币)	有权收取派息 之份额	总派息额 (人民币)	总派息额 (美元)
2023年10月19日	2023年10月20日	2023年10月27日	0.050	30,181,093.2764	1,509,054.64	206,088.84
2023年11月17日	2023年11月20日	2023年11月24日	0.050	31,205,997.9419	1,560,299.88	216,182.87
2023年12月19日	2023年12月20日	2023年12月28日	0.050	31,223,867.9599	1,561,193.40	219,190.23
2024年1月19日	2024年1月22日	2024年1月26日	0.050	31,387,028.8135	1,569,351.44	217,758.30
2024年2月19日	2024年2月20日	2024年2月26日	0.050	32,370,289.2242	1,618,514.46	224,422.75
2024年3月19日	2024年3月20日	2024年3月26日	0.050	34,420,245.4964	1,721,012.26	238,572.22

HP 每月派息 3 人民币

记录日	除息日	派息日	每份额 派息额 (人民币)	有权收取派息 之份额	总派息额 (人民币)	总派息额 (美元)
2023年10月19日	2023年10月20日	2023年10月27日	0.017	3,000.0000	51.00	6.97
2023年11月17日	2023年11月20日	2023年11月24日	0.017	3,000.0000	51.00	7.07
2023年12月19日	2023年12月20日	2023年12月28日	0.017	3,000.0000	51.00	7.16
2024年1月19日	2024年1月22日	2024年1月26日	0.017	3,000.0000	51.00	7.08
2024年2月19日	2024年2月20日	2024年2月26日	0.017	3,000.0000	51.00	7.07
2024年3月19日	2024年3月20日	2024年3月26日	0.017	3,000.0000	51.00	7.07

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

分配披露(未经审计)(续)

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

I 每月派息 美元

记录日	除息日	派息日	每份额 派息额 (美元)	有权收取派息 之份额	总派息额 (美元)	总派息额 (美元)
2023年10月19日	2023年10月20日	2023年10月27日	0.042	1,100,012.3166	46,200.52	46,200.52
2023年11月17日	2023年11月20日	2023年11月24日	0.042	1,109,522.2595	46,599.93	46,599.93
2023年12月19日	2023年12月20日	2023年12月28日	0.042	1,109,522.2595	46,599.93	46,599.93
2024年1月19日	2024年1月22日	2024年1月26日	0.042	1,111,102.2595	46,666.29	46,666.29
2024年2月19日	2024年2月20日	2024年2月26日	0.042	1,095,949.0436	46,029.86	46,029.86
2024年3月19日	2024年3月20日	2024年3月26日	0.042	1,052,372.0436	44,199.63	44,199.63

P 每月派息 港元

记录日	除息日	派息日	每份额 派息额 (港元)	有权收取派息 之份额	总派息额 (港元)	总派息额 (美元)
2023年10月19日	2023年10月20日	2023年10月27日	0.042	597,298.9424	25,086.56	3,205.83
2023年11月17日	2023年11月20日	2023年11月24日	0.042	597,298.9424	25,086.56	3,216.35
2023年12月19日	2023年12月20日	2023年12月28日	0.042	597,298.9424	25,086.56	3,216.78
2024年1月19日	2024年1月22日	2024年1月26日	0.042	637,349.1318	26,768.67	3,423.10
2024年2月19日	2024年2月20日	2024年2月26日	0.042	637,349.1318	26,768.67	3,422.62
2024年3月19日	2024年3月20日	2024年3月26日	0.042	848,365.5221	35,631.36	4,554.78

P 每月派息 美元

记录日	除息日	派息日	每份额 派息额 (美元)	有权收取派息 之份额	总派息额 (美元)	总派息额 (美元)
2023年10月19日	2023年10月20日	2023年10月27日	0.042	743,768.6124	31,238.28	31,238.28
2023年11月17日	2023年11月20日	2023年11月24日	0.042	743,768.6124	31,238.28	31,238.28
2023年12月19日	2023年12月20日	2023年12月28日	0.042	745,472.6124	31,309.85	31,309.85
2024年1月19日	2024年1月22日	2024年1月26日	0.042	747,353.9590	31,388.87	31,388.87
2024年2月19日	2024年2月20日	2024年2月26日	0.042	754,957.7444	31,708.23	31,708.23
2024年3月19日	2024年3月20日	2024年3月26日	0.042	757,599.5534	31,819.18	31,819.18

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

分配披露(未经审计)(续)

截至 2024 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

HP 每月派息 澳元

记录日	除息日	派息日	每份额 派息额 (澳元)	有权收取派息 之份额	总派息额 (澳元)	总派息额 (美元)
2023年10月19日	2023年10月20日	2023年10月27日	0.047	146,827.3640	6,900.89	4,358.26
2023年11月17日	2023年11月20日	2023年11月24日	0.047	146,827.3640	6,900.89	4,487.30
2023年12月19日	2023年12月20日	2023年12月28日	0.047	146,827.3640	6,900.89	4,667.42
2024年1月19日	2024年1月22日	2024年1月29日	0.047	139,857.9770	6,573.33	4,328.21
2024年2月19日	2024年2月20日	2024年2月26日	0.047	166,832.3547	7,841.12	5,125.35
2024年3月19日	2024年3月20日	2024年3月26日	0.047	172,804.8238	8,121.83	5,301.93

HP 每月派息 人民币

记录日	除息日	派息日	每份额 派息额 (人民币)	有权收取派息 之份额	总派息额 (人民币)	总派息额 (美元)
2023年10月19日	2023年10月20日	2023年10月27日	0.047	301,059.5522	14,149.80	1,928.04
2023年11月17日	2023年11月20日	2023年11月24日	0.047	301,059.5522	14,149.80	1,960.48
2023年12月19日	2023年12月20日	2023年12月28日	0.047	301,059.5522	14,149.80	1,986.62
2024年1月19日	2024年1月22日	2024年1月26日	0.047	328,371.7621	15,433.47	2,141.50
2024年2月19日	2024年2月20日	2024年2月26日	0.047	473,547.8500	22,256.76	3,086.12
2024年3月19日	2024年3月20日	2024年3月26日	0.047	585,285.0712	27,508.40	3,813.30

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

业绩记录(未经审计)

瑞士百达策略收益

		2024年3月31日	2023年9月30日	2022年9月30日
净资产总额		美元 432,965,975	美元 337,988,669	美元 285,654,434
每份额最低资产净值				
I 累计 美元	美元	10.1305	8.7243	7.7220
I 每月派息 美元	美元	8.5366	7.6048	7.2219
P 每月派息 港元	港元	9.8225	8.7484	8.3097
P 每月派息 美元	美元	9.6790	8.6180	8.1740
P 每月派息 3 港元	港元	10.9336	9.5517	8.7198
P 每月派息 3 美元	美元	10.9654	9.5726	8.7149
HI 累计 新加坡元	新加坡元	10.2683	8.9202	7.9849
HI 每月派息 新加坡元	新加坡元	8.7509	7.8547	7.5248
HM 人民币	人民币	12.3343	10.7956	9.8749
HP 每月派息 澳元	澳元	8.4269	7.6177	7.4711
HP 每月派息 瑞士法郎	瑞士法郎	10.4877	9.5333	不适用
HP 每月派息 日元	日元	1,038.5627	953.1872	不适用
HP 每月派息 人民币	人民币	10.0116	9.0445	8.8290
HP 每月派息 3 人民币	人民币	10.5293	9.3121	8.7053

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

业绩记录(未经审计)(续)

瑞士百达亚洲债券收益

		2024年3月31日	2023年9月30日	2022年9月30日
净资产总额		美元 26,333,652	美元 31,798,418	美元 26,157,474
每份额最低资产净值				
I 累计 美元	美元	9.0175	8.3926	8.1470
I 每月派息 美元	美元	7.4407	7.1677	7.4496
P 每月派息 港元	港元	7.3937	7.1466	7.4792
P 每月派息 美元	美元	7.3130	7.0659	7.3829
HI 累计 新加坡元	新加坡元	8.8841	8.3357	8.1647
HP 每月派息 澳元	澳元	6.9300	6.7777	7.2553
HP 每月派息 人民币	人民币	7.1551	7.0274	7.5895

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

业绩记录(未经审计)(续)

瑞士百达策略收益

每份额最高/最低资产净值(自成立以来)

	财务期截止日	每份额最高资产净值	每份额最低资产净值
I 累计 美元	2024年3月31日	美元 10.1293	美元 8.4911
	2023年9月30日	美元 9.2299	美元 7.6538
	2022年9月30日	美元 10.1201	美元 7.7220
I 每月派息 美元	2024年3月31日	美元 8.5356	美元 7.3572
	2023年9月30日	美元 8.1573	美元 7.1198
	2022年9月30日	美元 10.1635	美元 7.2219
	2021年9月30日	美元 10.0200	美元 9.6038
P 每月派息 港元	2024年3月31日	港元 9.8171	港元 8.4548
	2023年9月30日	港元 9.3645	港元 8.1935
	2022年9月30日	港元 11.5894	港元 8.3097
	2021年9月30日	港元 11.5827	港元 9.6904
	2020年9月30日	港元 10.1189	港元 8.3032
	2019年9月30日	港元 10.0475	港元 9.1808
	2018年9月30日	港元 10.8433	港元 9.9794
	2017年9月30日	港元 10.1609	港元 9.5253
P 每月派息 美元	2024年3月31日	美元 9.6790	美元 8.3391
	2023年9月30日	美元 9.2384	美元 8.0591
	2022年9月30日	美元 11.4960	美元 8.1740
	2021年9月30日	美元 11.5467	美元 9.6576
	2020年9月30日	美元 10.0910	美元 8.2699
	2019年9月30日	美元 9.9269	美元 9.0702
	2018年9月30日	美元 10.7456	美元 9.8417
	2017年9月30日	美元 10.0694	美元 9.5151
P 每月派息 3 港元	2024年3月31日	港元 10.9276	港元 9.2627
	2023年9月30日	港元 10.1097	港元 8.6279
	2022年9月30日	港元 10.0190	港元 10.7198
P 每月派息 3 美元	2024年3月31日	美元 10.9654	美元 9.2953
	2023年9月30日	美元 10.1742	美元 8.6234
	2022年9月30日	美元 10.0181	美元 8.7149
HI 累计 新加坡元	2024年3月31日	新加坡元 10.2705	新加坡元 8.6720
	2023年9月30日	新加坡元 9.4668	新加坡元 7.9102
	2022年9月30日	新加坡元 10.6310	新加坡元 7.9849
	2021年9月30日	新加坡元 10.0000	新加坡元 10.0000

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

业绩记录(未经审计)(续)

瑞士百达策略收益

每份额最高/最低资产净值(自成立以来)

	财务期截止日	每份额最高资产净值	每份额最低资产净值
HI 每月派息 新加坡元	2024年3月31日	新加坡元 8.7528	新加坡元 7.5920
	2023年9月30日	新加坡元 8.4561	新加坡元 7.4182
	2022年9月30日	新加坡元 10.5845	新加坡元 7.5248
	2021年9月30日	新加坡元 10.0000	新加坡元 10.0000
HM 人民币	2024年3月31日	人民币 12.3468	人民币 10.4934
	2023年9月30日	人民币 11.4869	人民币 9.7840
	2022年9月30日	人民币 13.0378	人民币 9.8749
	2021年9月30日	人民币 12.6958	人民币 10.1741
	2020年9月30日	人民币 10.4957	人民币 10.0149
HP 每月派息 澳元	2024年3月31日	澳元 8.4329	澳元 7.3523
	2023年9月30日	澳元 8.2463	澳元 7.3472
	2022年9月30日	澳元 10.7455	澳元 7.4711
	2021年9月30日	澳元 10.8503	澳元 9.1813
	2020年9月30日	澳元 9.5697	澳元 7.9808
	2019年9月30日	澳元 9.8450	澳元 9.1565
	2018年9月30日	澳元 10.7144	澳元 9.7659
	2017年9月30日	澳元 10.0260	澳元 9.5342
HP 每月派息 瑞士法郎	2024年3月31日	瑞士法郎 10.5020	瑞士法郎 9.1996
	2023年9月30日	瑞士法郎 10.2117	瑞士法郎 9.5133
HP 每月派息 日元	2024年3月31日	日元 1,041.5756	日元 918.0991
	2023年9月30日	日元 1,021.0830	日元 951.0621
HP 每月派息 人民币	2024年3月31日	人民币 10.0297	人民币 8.7418
	2023年9月30日	人民币 9.7785	人民币 8.6988
	2022年9月30日	人民币 12.2902	人民币 8.8290
	2021年9月30日	人民币 12.1353	人民币 10.0983
	2020年9月30日	人民币 10.5191	人民币 8.6004
	2019年9月30日	人民币 10.3085	人民币 9.7658
	2018年9月30日	人民币 11.0396	人民币 10.2153
	2017年9月30日	人民币 10.2390	人民币 9.5287
HP 每月派息 3 人民币	2024年3月31日	人民币 10.5399	人民币 9.0345
	2023年9月30日	人民币 9.9449	人民币 8.6092
	2022年9月30日	人民币 10.0156	人民币 8.7053

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

业绩记录(未经审计)(续)

瑞士百达亚洲债券收益

每份额最高/最低资产净值(自成立以来)

	财务期截止日	每份额最高资产净值	每份额最低资产净值
I 累计 美元	2024年3月31日	美元 9.0166	美元 8.2871
	2023年9月30日	美元 8.7522	美元 7.6791
	2022年9月30日	美元 9.8327	美元 8.1470
	2021年9月30日	美元 10.0801	美元 9.8146
I 每月派息 美元	2024年3月31日	美元 7.4528	美元 7.0373
	2023年9月30日	美元 7.8287	美元 6.9806
	2022年9月30日	美元 9.5434	美元 7.4496
	2021年9月30日	美元 10.0801	美元 9.5258
P 每月派息 港元	2024年3月31日	港元 7.4052	港元 7.0076
	2023年9月30日	港元 7.8341	港元 7.0051
	2022年9月30日	港元 9.5491	港元 7.4791
	2021年9月30日	港元 10.0745	港元 9.5297
P 每月派息 美元	2024年3月31日	美元 7.3319	美元 6.9349
	2023年9月30日	美元 7.7488	美元 6.9145
	2022年9月30日	美元 9.5084	美元 7.3829
	2021年9月30日	美元 10.0746	美元 9.4916
HI 累计 新加坡元	2024年3月31日	新加坡元 8.8849	新加坡元 8.2215
	2023年9月30日	新加坡元 8.7603	新加坡元 7.6957
	2022年9月30日	新加坡元 9.8408	新加坡元 8.1647
	2021年9月30日	新加坡元 10.0802	新加坡元 9.8222
HP 每月派息 澳元	2024年3月31日	澳元 6.9850	澳元 6.6387
	2023年9月30日	澳元 7.5663	澳元 6.7717
	2022年9月30日	澳元 9.4629	澳元 7.2553
	2021年9月30日	澳元 10.0378	澳元 9.4456
HP 每月派息 人民币	2024年3月31日	人民币 7.2390	人民币 6.8864
	2023年9月30日	人民币 7.8964	人民币 7.0198
	2022年9月30日	人民币 9.6514	人民币 7.5895
	2021年9月30日	人民币 10.1072	人民币 9.6329

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

欲知更多信息，  
请访问我们的网站：

[www.assetmanagement.pictet](http://www.assetmanagement.pictet)  
[www.pictet.com](http://www.pictet.com)