

汇丰亚洲债券基金

营销通讯 | 月度报告 2024年10月31日 | 股份类别 BM2-HKD

主要风险

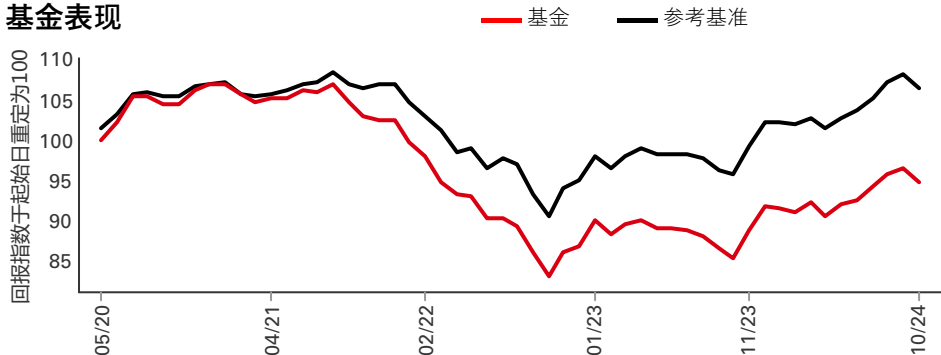
投资目标

本基金透过投资于亚洲区内的定息证券，目标是运用审慎的资本保存策略来获取高水平的合理回报。

投资策略

本基金将广泛投资于有价债券。不过，如经理人认为情况切合谋取最高资本增值的目的，本基金亦可投资于政府债券、其他无报价定息证券及金融票据，及持有现金存款以伺候投资机会。本基金亦可投资于金融衍生工具及或有可转换证券。

基金表现



股份类别详情

关键指标

每股资产净值	港元 7.61
基金表现 1个月	-1.78%
平均到期收益率	6.24%

基金概览

UCITS V合规	否
股息处理	派息
派息频率	每月
除息日	2024年10月31日
股息年化收益率	6.08%
每股股息	0.037500
交易频率	每日
股份类别基本货币	港元
注册地	香港
成立日期	2020年5月19日
基金规模	美元 1,767,596,328
参考基准	100% Markit iBoxx美元亚洲债券

基金经理

Ming Leap
Alex CHOI
Alfred Mui

费用及开支

最高首次认购费	3.000%
管理费	1.000%

代码

ISIN代号	HK0000582004
彭博代号	HSABM2H HK

过往业绩不能预示未来回报。表现以股份类别基本货币计算，资产净值对资产净值，将股息再作投资，并已扣除费用。如投资业绩非以港元或美元计算，以港元或美元作投资的投资者须承受汇率波动的风险。

当计算期超过一年，业绩为累积计算。

保证基金：基金表现数字以资产净值比资产净值。

货币市场基金：基金表现数字以资产净值比资产净值，将股息再作投资计算。

参考表现基准：由2016年4月1日起，基准为Markit iBoxx美元亚洲债券指数。此前为HSBC ADBI。2004年5月31日至2004年12月31日，为70%

HSBC ADBI + 30% USD 2 year Swap rate (mark to market)。此前为HSBC ADBI。1999年12月31日至2001年12月31日，为80% HSBC ADBI

+ 20% JPM ELM1+(Asia)。

资料来源：汇丰投资管理，数据截至 2024年10月31日

基金表现 (%)	年初至今	1个月	3个月	6个月	1年	3年年化	5年年化	成立至今年化
BM2-HKD	3.14	-1.78	0.46	4.74	10.86	-2.71	--	-1.21
参考基准	4.31	-1.45	1.18	4.90	11.26	0.01	--	1.42

年度回报表现 (%)	2019	2020	2021	2022	2023
BM2-HKD	--	--	-4.09	-15.22	5.71
参考基准	--	--	-0.04	-11.19	7.44

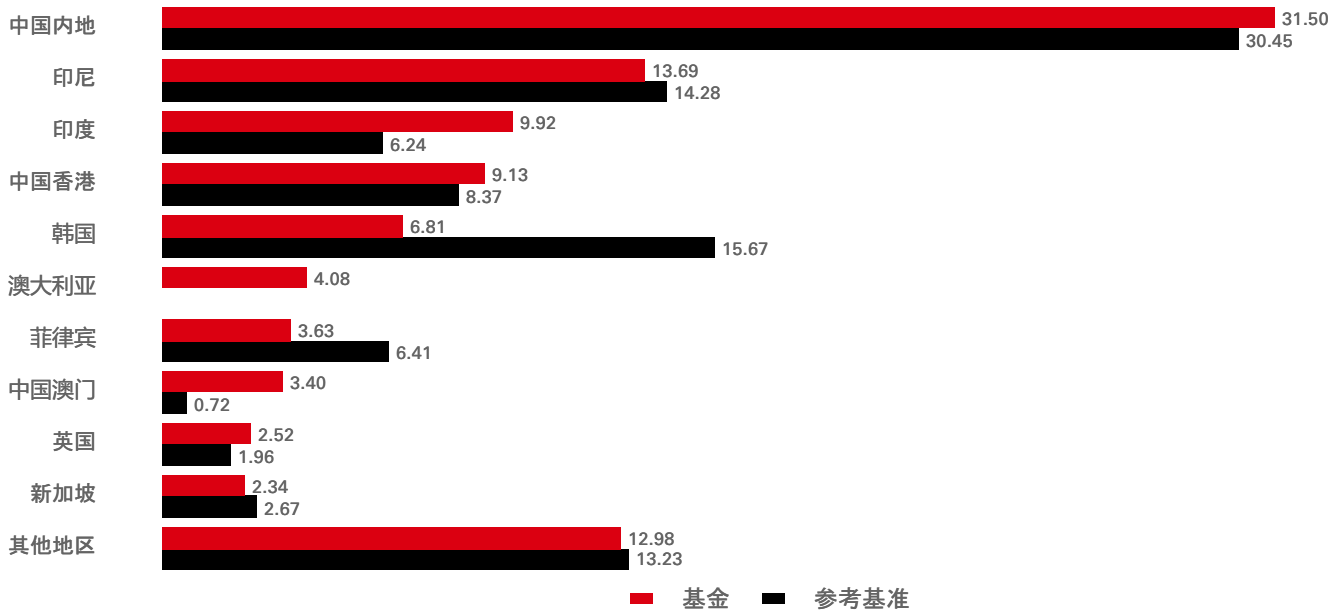
3-年 风险衡量指标	BM2-HKD	参考基准	5年 风险衡量指标	BM2-HKD	参考基准
波幅	6.85%	6.20%	波幅	--	--
夏普比率	-0.92	-0.58	夏普比率	--	--
追踪误差	1.62%	--	追踪误差	--	--
信息比率	-1.67	--	信息比率	--	--

固定收益特点	基金	参考基准	相对
持仓数量 (不包括现金)	362	1,155	--
投资组合收益率	6.11%	5.18%	0.92%
平均到期收益率	6.24%	5.19%	1.05%
平均到期日	7.67	7.03	0.63
平均信贷评级	BBB/BBB-	A-/BBB+	--
发行人数量	206	376	--

信用评级分布 (%)	基金	参考基准	相对	到期日分布 (期权调整久期)	基金	参考基准	相对
AAA	0.02	1.23	-1.21	0-2年	0.26	0.32	-0.06
AA	1.31	15.25	-13.95	2-5年	0.88	1.10	-0.23
A	23.18	35.63	-12.46	5-10年	2.05	1.29	0.76
BBB	50.51	41.45	9.05	10+年	2.58	2.32	0.26
BB	14.99	2.19	12.80	总计	5.76	5.03	0.73
B	3.50	0.64	2.86				
CCC	3.22	0.91	2.30				
CC	--	0.05	-0.05				
没有评级	1.65	2.63	-0.98				
现金	1.63	--	1.63				

货币分布 (%)	基金	参考基准	相对
美元	97.93	100.00	-2.07
韩圆	1.46	--	1.46
菲律宾比索	0.98	--	0.98
马来西亚元	0.51	--	0.51
印尼盾	0.37	--	0.37
欧元	0.00	--	0.00
澳元	0.00	--	0.00
印度卢比	0.00	--	0.00
新加坡元	0.00	--	0.00
英镑	0.00	--	0.00
其他货币	-1.26	--	-1.26

国家/地区配置 (%)



行业分布 (%)

行业分布 (%)	基金	参考基准	相对
银行	16.04	8.80	7.24
消费类, 周期	12.88	8.84	4.04
政府	11.02	26.34	-15.31
多元化金融服务	9.35	8.27	1.09
房地产	8.63	4.04	4.60
能源	8.26	9.54	-1.28
通信	6.65	6.55	0.09
工业	5.27	4.07	1.19
基础物料	5.05	3.48	1.57
公用事业	4.17	7.18	-3.01
其他行业	11.05	12.89	-1.84
现金	1.63	--	1.63

十大持仓	比重 (%)
REC LTD 4.750 27/09/29	1.35
PHILIPPINES(REP) 4.200 29/03/47	1.31
BANK OF CHINA 5.000 13/11/24	1.20
SK HYNIX INC 6.500 17/01/33	1.13
SANDS CHINA LTD 5.125 08/08/25	1.09
GEELY AUTOMOBILE 4.000	1.04
AAC TECHNOLOGIES 3.000 27/11/24	1.00
BANK BUKOPIN 5.658 30/10/27	1.00
CK HUTCHISON 24 4.750 13/09/34	0.99
AUST & NZ BANK 5.204 30/09/35	0.95

重要信息

本文所示资料仅用于营销目的，仅供参考。本文件不具备合同效力，亦非法律要求提供的材料。概不构成对任何读者的法律、税务、投资建议，亦非向读者推荐买入或卖出投资。因此，不得将本文件内容作为任何投资决策的依据。

本文件只提供一般性资料，并不针对任何可能收到本文件的人士的具体投资目标、财务状况和特别需求。在此表达之意见可因应情况修改而不作另行通知。本文件并非销售文件，且不构成建议、要约出售或招揽购买或认购任何投资。本文件所载任何预测、预计或目标仅供说明用途，且并非任何形式的保证。汇丰环球投资管理（香港）有限公司（「汇丰环球投资管理」）就预测、预计或目标未能达成概不承担任何责任。本文件内的资料乃取自汇丰环球投资管理合理地相信可靠的来源。然而，无论明示或暗示，汇丰环球投资管理不保证、担保或代表本文件内该等资料的准确性、有效性或完整性。投资附带风险，过去的业绩并不代表将来的表现。请参阅销售文件以便获取其它资料，包括风险因素。此文件并未经证券及期货事务监察委员会批阅。版权 © HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited（汇丰环球投资管理（香港）有限公司）2021。版权所有。本文件由HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited（汇丰环球投资管理（香港）有限公司）刊发。

资料来源：汇丰投资管理，数据截至 2024年10月31日