

年度报告

*2010*

**中期报告 2024**

**弘收高收益波幅管理债券基金**

**弘收高收益波幅管理债券基金**

（弘收策略基金的子基金）

**半年度财务报表（未经审计）**

**截至2024年6月30日止六个月**

**目录**

[基金管理与行政管理 1](#_Toc459389974)

[基金管理人报告](#_Toc459389975) 2

[2024年业绩概览 2](#_2024年业绩概览)

[市场概述与展望 3](#_市场概述与展望)

[投资组合概况（截至2024年6月30日） 4](#_投资组合概况（截至2024年6月30日）)

[财务报表（未经审计）](#_Toc459389979) 5

[财务状况表（未经审计） 5](#_财务状况表（未经审计）)

[损益和其他全面收益表（未经审计） 6](#_损益和其他全面收益表（未经审计）)

[份额持有人应占资产净值变动表（未经审计） 7](#_份额持有人应占资产净值变动表（未经审计）)

[财务报表（未经审计）附注](#_Toc459389982) 8

[投资组合（未经审计） 2](#_Toc459389983)5

[投资组合持仓变动表（未经审计） 30](#_投资组合持仓变动表（未经审计）)

[抵押品持仓（未经审计） 34](#_抵押品持仓（未经审计）)

**基金管理与行政管理**

|  |  |
| --- | --- |
| **基金管理人** | **基金管理人董事** |
|  |  |
| 弘收投资管理(香港)有限公司 | 魏志华 |
| 香港 | Gregoire Marie Haenni |
| 英皇道979号 | Karl Franklin Dasher |
| 太古坊 | John Blackman Doggett |
| 康桥大厦 |  |
| 3503-4室 |  |
|  |  |
| **受托人和主要办事处** | **行政管理人** |
|  |  |
| 花旗信托有限公司 | 花旗银行香港分行 |
| 香港 | 香港 |
| 中环花园道三号 | 中环花园道三号 |
| 冠君大厦50楼 | 冠君大厦50楼 |
|  |  |
| **基金登记机构兼处理代理人** | **基金管理人的律师** |
|  | **（香港法律方面）** |
| Citicorp Financial Services Limited |  |
| 香港九龙 | 的近律师行 |
| 观塘 | 香港 |
| 海滨道83号 | 中环 |
| One Bay East花旗大楼 | 遮打道18号 |
|  | 历山大厦5楼 |
|  |  |
| **保管人** |  |
|  |  |
| 花旗银行香港分行 |  |
| 香港 |  |
| 中环花园道三号 |  |
| 冠君大厦50楼 |  |
|  |  |
| **审计师** |  |
|  |  |
| 罗兵咸永道会计师事务所 |  |
| 香港 |  |
| 中环 |  |
| 太子大厦22楼 |  |
|  |  |
| **瑞士代表性代理人** |  |
|  |  |
| Acolin Fund Services AG, Geneva Branch |  |
| 6, Cours de Rive |  |
| CH-1204 Geneva |  |
| Switzerland |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |

**基金管理人报告**

**致弘收高收益波幅管理债券基金的份额持有人**

## 2024年业绩概览

**弘收高收益波幅管理债券基金**（本“基金”）于2024年前六个月实现的总回报[[1]](#footnote-2)如下表所示：

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 份额类别 | ISIN编码 | 彭博代码 | 基金类别成立日期 | 2024年 迄今回报率 | 年化红利收益率\* |
| 1A类累积（美元）份额 | HK0000421336 | IRHY1AA HK | 2018年1月8日 | 6.97% | - |
| 1A类分派（美元）份额 | HK0000421328 | IPRHY1A HK | 2013年5月7日  （于2021年8月 3日重新激活） | -2 | - |
| 1B类累积（人民币）份额 | HK0000421351 | IRHY1BA HK | 2019年6月26日 | -2 | - |
| 1E类分派（美元对冲）份额 | HK0000490067 | IPRHY1E HK | 2019年3月25日 | 10.77% | 7.9% |
| 2A类累积（美元）份额 | HK0000421419 | IRHY2AA HK | 2011年7月27日 | 6.72% | - |
| 2A类分派（美元）份额 | HK0000421401 | IPRHY2A HK | 2011年8月3日 | 6.71% | 8.8% |
| 2B类累积（人民币）份额 | HK0000421435 | IRHY2BA HK | 2011年7月27日 | 9.27% | - |
| 2B类分派（人民币）份额 | HK0000421427 | IPRHY2B HK | 2011年7月27日 | 9.27% | 8.2% |
| 2C类分派（美元）份额 | HK0000421443 | IPRHY2C HK | 2011年8月10日 | 6.72% | 7.0%  （按7%的固定 百分比支付） |
| 2D类累积（港元）份额 | HK0000421468 | IRHY2DA HK | 2018年2月21日 | 6.68% | - |
| 2D类分派（港元）份额 | HK0000421450 | IPRHY2D HK | 2018年2月9日 | 6.71% | 8.6% |
| 2E类累积（澳元）份额 | HK0000421484 | IRHY2EA HK | 2018年3月7日 | - | - |
| 2E类分派（澳元）份额 | HK0000421476 | IPRHY2E HK | 2018年5月4日 | 9.02% | 7.0% |
| 2F类累积（澳元对冲）份额 | HK0000421500 | IRHY2FA HK | 2015年10月13日 | 9.79% | - |
| 2F类分派（澳元对冲）份额 | HK0000421492 | IPRHY2F HK | 2019年5月2日 | 9.85% | 6.8% |
| 2G类累积（美元对冲）份额 | HK0000421526 | IRHY2GA HK | 2015年10月13日 | 10.38% | - |
| 2G类分派（美元对冲）份额 | HK0000421518 | IPRHY2G HK | 2015年10月19日 | 10.35% | 8.1% |
| 2I类累积（新加坡元对冲）份额 | HK0000421567 | IRHY2IA HK | 2019年4月30日 | 9.44% | - |
| 2I类分派（新加坡元对冲）份额 | HK0000421559 | IPRHY2I HK | 2019年4月24日 | 9.48% | 6.8% |
| 2J类分派（欧元）份额 | HK0000490000 | IPRHY2J HK | 2019年7月16日 | -2 | - |
| 2K类累积（欧元对冲）份额 | HK0000490034 | IRHY2KA HK | 2019年5月8日 | -2 | - |
| 2K类分派（欧元对冲）份额 | HK0000490026 | IPRHY2K HK | 2019年5月7日 | 9.78% | 5.3% |
| 2L类累积（港元对冲）份额 | HK0000490059 | IRHY2LA HK | 2019年5月7日 | - | - |
| 2L类分派（港元对冲）份额 | HK0000490042 | IPRHY2L HK | 2019年4月17日 | 9.78% | 8.3% |
| 2XB类累积（人民币）份额 | HK0000706074 | - | 2021年12月22日 | - | - |
| 2XG类累积（美元对冲）份额 | HK0000706090 | - | 2021年7月14日 | -2 | - |

\* 年化红利收益率：[(1 + 每份额收益分配 / 除息后资产净值) ^ 收益分配频率] – 1。收益率数据为估计值，依据最近的红利分配及上个月的除息后资产净值。收益率数据仅供参考。红利收益率为正并不意味着回报率为正。不保证分红率，可能会用资本支付收益分配。

## 市场概述与展望

2024年上半年，亚洲高收益债券市场延续自2023年11月以来的上涨势头，以美元计，实现两位数的回报率。

根据下方按地区划分的表现细分表所示，中国内地对本基金今年迄今的回报率作出显著贡献，贡献度为3.5%。单就本基金于中国内地的投资而言，实现高达16.8%的总回报率，超过总体市场的水平，原因在于我们战略性地超配房地产板块以及低配金融和准主权板块。在中央政府出台的一系列扶持政策的推动下，中国内地房地产板块稳健复苏。虽然我们承认，由于购房者需求减弱以及求稳心态作祟，房地产市场持续承压，但部分优质房地产开发商的债券价格依然蕴含着诱人的投资机会。

香港成为本基金表现的第二大贡献者，对本基金今年迄今的回报率的贡献度为2.7%，单就香港而言，实现12.4%的总回报率。另外，印尼对本基金今年迄今表现的贡献度为1.4%，排名第三，而未加权回报率达到惊人的17.3%。针对于香港和印尼的投资，我们精挑细选债券，所取得的表现显著优于总体市场。相比之下，本基金依旧低配印度和澳门，看好这些地区的优质资产，从而导致印度和澳门对于本基金表现的贡献度相对较低。

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 各地表现 | | | | | |  | 对今年迄今回报率的贡献度 | | | | | |
| 地区 | 中国 内地 | 香港 | 印度 | 印尼 | 澳门 |  | 地区 | 中国 内地 | 香港 | 印度 | 印尼 | 澳门 |
| 本基金 | 16.8% | 12.4% | 6.9% | 17.3% | 4.2% |  | 本基金 | 3.5% | 2.7% | 0.8% | 1.4% | 0.3% |
| 总体市场 | 13.4% | 7.8% | 8.1% | 5.5% | 4.9% |  | 总体市场 | 3.3% | 1.4% | 1.4% | 0.3% | 0.5% |

展望未来，过去几个月的一波持续上涨行情过后，要留意将在下半年面临的不确定因素。诸多因素都会令格局变得复杂，例如潜伏的美国经济衰退风险、美联储的潜在降息、美国大选的结果以及不断升级的地缘政治紧张局势等。

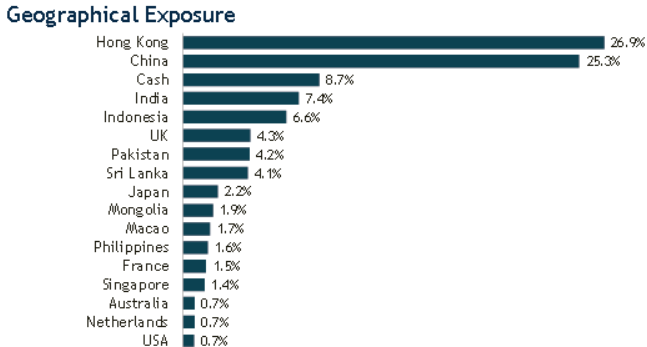
为应对这些动态，我们准备对目前持有的头寸逐步进行获利了结并转向波动性较低的投资。同时，我们有意评估延长投资组合久期的最佳时机，从而进行战略性头寸配置，以期在美元见顶造成货币波动性不断加剧之际，把握随之而来的机会。

## 投资组合概况（截至2024年6月30日）

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 修正久期： | 平均信用评级： | 到期收益率 （以人民币计）[[2]](#footnote-3)3： | 到期收益率 （以美元计）[[3]](#footnote-4)4： |
| 2.6年 | B+ | 7.7% | 10.6% |

|  |  |
| --- | --- |
| 前十大持仓 | 38.1% |
| 巴基斯坦政府债券 | 4.2% |
| Fortune Star BVI Ltd | 4.2% |
| NWD Finance BVI Ltd | 4.2% |
| 利丰有限公司 | 4.1% |
| 斯里兰卡政府债券 | 4.1% |
| LS Finance 2017 Ltd | 3.8% |
| 渣打集团有限公司 | 3.5% |
| 仁恒地产(香港)有限公司 | 3.3% |
| Sun Hung Kai & Co BVI | 3.3% |
| 一嗨汽车租赁有限公司 | 3.1% |

**地域敞口**



香港

中国内地

现金

印度

印尼

英国

巴基斯坦

斯里兰卡

日本

蒙古

澳门

菲律宾

法国

新加坡

澳大利亚

荷兰

美国



**信用评级敞口**

AA+

BBB

BBB-

BB+

BB

BB-

B+

B

B-

CCC或以下

现金

**财务报表（未经审计）**

## 财务状况表（未经审计）

**截至2024年6月30日**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  | 附注 | 截至2024年 6月30日  （未经审计） |  | 截至2023年 12月31日  （经审计） |
|  |  | 人民币 |  | 人民币 |
| **资产 – 流动资产** |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 |  | 186,090,868 |  | 195,112,570 |
| 衍生金融工具 |  | 277,562 |  | 770,171 |
| 应收利息 |  | 3,305,011 |  | 3,322,682 |
| 预付款 |  | 937,101 |  | 822,528 |
| 其他应收款项 |  | - |  | 222,507 |
| 经纪机构应付款项 |  | 11,183,864 |  | 1,582,977 |
| 保证金存款 |  | 11,642,878 |  | 18,454,683 |
| 银行结余 |  | 4,484,221 |  | 4,118,767 |
|  |  |  |  |  |
| **资产总计** |  | 217,921,505 |  | 224,406,885 |
|  |  |  |  |  |
| **负债 – 流动负债** |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| 衍生金融工具 |  | 1,663,453 |  | 141,095 |
| 应付经纪机构款项 |  | 5,589,781 |  | 931,593 |
| 其他负债和应计支出 | 2(a)  2(b)  2(g) | 1,169,982 |  | 1,309,587 |
| 应付赎回款项 |  | 1,990,915 |  | 56,444 |
|  |  |  |  |  |
| **负债总计（不含份额持有人应占资产净值）** |  | 10,414,131 |  | 2,438,719 |
|  |  |  |  |  |
| **份额持有人应占资产净值** |  | 207,507,374 |  | 221,968,166 |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  | 217,921,505 |  | 221,968,166 |
| **由以下项目代表：** |  |  |  |  |
| 份额持有人应占资产净值（根据本基金的招募说明书） |  | 207,507,374 |  | 221,968,166 |

随附的附注为该等财务报表的一部分。

## 损益和其他全面收益表（未经审计）

**截至2024年6月30日止六个月**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  | 附注 | 截至2024年 6月30日止六个月  （未经审计） |  | 截至2023年 6月30日止六个月  （未经审计） |
|  |  | 人民币 |  | 人民币 |
|  |  |  |  |  |
| **收入** |  |  |  |  |
| 债务利息收入 |  | 5,926,629 |  | 8,203,369 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和 负债的收益/（亏损）净额 |  | 22,233,458 |  | (51,172,655) |
| 汇兑（亏损）/收益净额 |  | (4,933,096) |  | 18,603,609 |
| 银行利息收入 |  | 382,716 |  | 775,795 |
| 其他应收款项减值损失拨回 |  | 1,112,537 |  | - |
| 其他收入 |  | 2,296 |  | 196,729 |
|  |  |  |  |  |
| **投资收入/（亏损）总计** |  | 24,724,540 |  | (23,393,153) |
|  |  |  |  |  |
| **支出** |  |  |  |  |
| 管理费 | 2(a) | (1,551,670) |  | (2,708,624) |
| 受托人费用 | 2(b) | (36,093) |  | (34,831) |
| 保管人、行政管理、合规监测、财务报表编制费用和 基金登记机构兼处理代理人费用 | 2(g) | (437,209) |  | (430,670) |
| 审计师酬金 |  | (240,760) |  | (238,676) |
| 其他营业支出 |  | (260,541) |  | (293,737) |
| 法律及专业费 |  | (87,214) |  | (109,848) |
|  |  |  |  |  |
| 营业支出总计 |  | (2,613,487) |  | (3,816,386) |
|  |  |  |  |  |
| 营业收入/（亏损） |  | 22,111,053 |  | (27,209,539) |
|  |  |  |  |  |
| **财务费用** |  |  |  |  |
| 向可赎回份额持有人的收益分配 |  | (6,550,172) |  | (8,985,223) |
| 利息支出 |  | - |  | (1,278) |
|  |  |  |  |  |
| **收益分配后的收入/（亏损）** |  | 15,560,881 |  | (36,196,040) |
|  |  |  |  |  |
| **经营活动产生的份额持有人应占资产净值增加/（减少）** |  | 15,560,881 |  | (36,196,040) |
|  |  |  |  |  |

随附的附注为该等财务报表的一部分。

## 份额持有人应占资产净值变动表（未经审计）

**截至2024年6月30日止六个月**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 截至2024年 6月30日止六个月  （未经审计） |  | 截至2023年 6月30日止六个月  （未经审计） |
|  | 人民币 |  | 人民币 |
|  |  |  |  |
| **期初份额持有人应占资产净值** | 221,968,166 |  | 418,113,303 |
|  |  |  |  |
| 发行可赎回份额 | 1,955,926 |  | 29,460,967 |
| 赎回可赎回份额 | (31,977,599) |  | (71,264,903) |
| 经营活动产生的份额持有人应占资产净值增加/（减少） | 15,560,881 |  | (36,196,040) |
|  |  |  |  |
| **期末可赎回份额持有人应占资产净值** | 207,507,374 |  | 340,113,327 |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  | 截至2024年 6月30日止六个月  （未经审计） |  | 截至2023年 6月30日止六个月  （未经审计） |
|  | 份 |  | 份 |
| **期初发行在外的份额** | 2,055,068 |  | 2,675,602 |
|  |  |  |  |
| 发行的份额 | 25,215 |  | 115,509 |
| 赎回的份额 | (232,238) |  | (322,190) |
|  |  |  |  |
| **期末发行在外的份额** | 1,848,045 |  | 2,468,921 |

随附的附注为该等财务报表的一部分。

## 财务报表（未经审计）附注

**截至2024年6月30日止六个月**

1. **主要会计政策**

该等未经审计的中期财务报表根据《国际财务报告准则》（“国际财务报告准则”）编制。财务报表根据历史成本法编制，并经重估以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债（包括衍生工具）作出修订。

所采用的会计政策与截至2024年6月30日止期间的年度财务报表的会计政策保持一致，在该等年度财务报表的财务报表附注中进行了说明。

1. **与基金管理人和关联人士的交易**

受托人和基金管理人的关联方和关联人士为香港证监会颁布的《单位信托及互惠基金守则》中定义的关联方和关联人士。与关联方和关联人士的所有交易均在正常业务过程中按正常商业条款订立。本子基金由弘收投资管理(香港)有限公司管理。与受托人、基金管理人和各自关联方及关联人士的交易如下：

1. **管理费**

本子基金当前的管理费按下表中载明的费率收取：

|  |  |
| --- | --- |
| 类别 | 管理费  （占相关类别资产净值的比例/年） |
|  |  |
| 1A类美元（累积）份额 | 1.00% |
| 1A类美元（分派）份额 | 1.00% |
| 1E类美元（分派）份额 | 1.00% |
| 2A类美元（累积）份额 | 1.50% |
| 2A类美元（分派）份额 | 1.50% |
| 2B类人民币（累积）份额 | 1.50% |
| 2B类人民币（分派）份额 | 1.50% |
| 2C类美元（分派）份额 | 1.50% |
| 2D类港元（累积）份额 | 1.50% |
| 2D类港元（分派）份额 | 1.50% |
| 2E类澳元（累积）份额 | 1.50% |
| 2E类澳元（分派）份额 | 1.50% |
| 2F类澳元对冲（累积）份额 | 1.50% |
| 2F类澳元对冲（分派）份额 | 1.50% |
| 2G类美元对冲（累积）份额 | 1.50% |
| 2G类美元对冲（分派）份额 | 1.50% |
| 2I类新加坡元对冲（累积）份额 | 1.50% |
| 2I类新加坡元对冲（分派）份额 | 1.50% |
| 2J类欧元对冲（分派）份额 | 1.50% |
| 2K类欧元对冲（累积）份额 | 1.50% |
| 2K类欧元对冲（分派）份额 | 1.50% |
| 2L类港元对冲（累积）份额 | 1.50% |
| 2L类港元对冲（分派）份额 | 1.50% |

## 财务报表（未经审计）附注（续）

**截至2024年6月30日止六个月**

**2 与基金管理人和关联人士的交易（续）**

1. **管理费（续）**

|  |  |
| --- | --- |
| 类别 | 管理费  （占相关类别资产净值的比例/年） |
|  |  |
| 2XB类人民币（累积）份额 | 1.50% |
| 2XG类美元对冲（累积）份额 | 1.50% |
| 4C类美元对冲（累积）份额 | 0.00% |

管理费每日应计并应于每月月末支付。

截至2024年6月30日止六个月的管理费总额为1,551,670人民币（截至2023年6月30日止六个月：2,708,624人民币），截至2024年6月30日未偿付的数额为251,054人民币（截至2023年6月  
30日：395,398人民币）。

如果管理费从当前水平上调至不超过每年本子基金资产净值的2%的最高水平，则基金管理人会提前一个月通知份额持有人。

截至2024年6月30日止期间，并无来自本子基金的基金管理人弘收投资管理(香港)有限公司的管理费退费（截至2023年6月30日止期间：零人民币）。管理费退费与本子基金持有的由基金管理人管理的投资基金有关。

1. **受托人费用**

因本子基金的资产而应计的付给受托人的受托人费用以每年本子基金资产净值的0.0075%（截至2023年6月30日止六个月：0.0075%）为基准，每年至少为10,000美元（截至2023年6月30日止六个月：10,000美元）。当前因本子基金的资产而应向受托人支付的费用每年不到本子基金资产净值的1%。如果受托人费用从当前水平上调至不超过每年本子基金资产净值的1%的最高水平，则受托人会提前一个月通知份额持有人。

截至2024年6月30日止六个月的受托人费用总额为36,093人民币（截至2023年6月30日止  
六个月：34,831人民币），截至2024年6月30日未偿付的数额为5,963人民币（截至2023年6月30日：5,893人民币）。

1. **交叉交易**

截至2024年6月30日和2023年6月30日止期间，概无将投资持仓卖给也由本子基金的基金管理人管理的其他基金的交易或向其购买投资持仓的交易。

## 财务报表（未经审计）附注（续）

**截至2024年6月30日止六个月**

**2 与基金管理人和关联人士的交易（续）**

1. **于基金管理人所管理基金的投资**

截至2024年6月30日，本子基金投资弘收人民币债券基金(“IPRMBBF”)，其由本子基金的同一个基金管理人管理。

IPRMBBF按照日期为2014年6月23日的信托契约根据香港法律于香港注册成立。IPRMBBF的主要投资目标是通过投资人民币计价的固定收益类证券，寻求长期利息收入和资本升值。

下表概述由本子基金的同一个基金管理人所管理的投资基金的所有权情况：

截至2024年6月30日

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | 持仓量 |  | 份额价格 |  | 公允价值 |
|  |  |  |  | 人民币 |  | 人民币 |
|  |  |  |  |  |  |  |
| IPRMBBF |  | - |  | - |  | - |
|  |  |  |  |  |  |  |

截至2023年6月30日

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | 持仓量 |  | 份额价格 |  | 公允价值 |
|  |  |  |  | 人民币 |  | 人民币 |
|  |  |  |  |  |  |  |
| IPRMBBF |  | 63,800 |  | 770.71 |  | 49,171,173 | |
|  |  |  |  |  |  |  |

**财务报表（未经审计）附注（续）**

**截至2024年6月30日止六个月**

**2 与基金管理人和关联人士的交易（续）**

1. **本子基金份额持仓**

基金管理人及其关联人士截至2024年6月30日和2023年12月31日于本子基金的份额持仓如下。

基金管理人管理委员会成员持有的份额：

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | 于2024年1月1日发行在外的份额 |  | 期内 认购的份额 |  | 期内 赎回的份额 |  | 于2024年6月30日发行在外的份额 |
| 2024年 |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |
| 4C类美元对冲 （累积）份额 | 6,270 |  | - |  | (5,296) |  | 974 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | 于2023年1月1日发行在外的份额 |  | 年内 认购的份额 |  | 年内 赎回的份额 |  | 于2023年12月31日发行在外的份额 |
| 2023年 |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |
| 4C类美元对冲 （累积）份额 | 6,270 |  | - |  | - |  | 6,270 |

1. **银行结余**

截至2024年6月30日，本子基金存在花旗银行香港分行的银行存款数额为4,484,221人民币  
（截至2023年12月31日：4,118,767人民币），花旗银行香港分行是受托人兼基金登记机构的关联公司。本子基金在截至2024年6月30日止期间赚得的银行利息收入为382,716人民币（截至  
2023年6月30日止期间：775,795人民币）。

**财务报表（未经审计）附注（续）**

**截至2024年6月30日止六个月**

**2 与基金管理人和关联人士的交易（续）**

**(g) 保管人、行政管理、合规监测、财务报表编制费用和基金登记机构兼处理代理人费用**

根据基金管理人和花旗银行香港分行之间的服务协议，花旗银行香港分行担任基金行政管理人，  
已同意向本子基金提供财务服务、会计服务、行政管理服务等服务。

Citicorp Financial Services Limited为本子基金的基金登记机构。

受托人已委任花旗银行香港分行担任本子基金资产的保管人。

保管人、子行政管理人和基金登记机构也有权收取用本子基金的资产支付的应付费用，该等费用的费率在基金管理人、受托人和保管人、子行政管理人或基金登记机构（视情况而定）之间不时商定。行政管理人、保管人、子行政管理人和基金登记机构的费用应按月支付。

保管人、行政管理和基金登记机构费用总额包含合规监测费和财务报表编制费用，截至2024年6月30日止六个月为437,209人民币（截至2023年6月30日止六个月：430,670人民币），截至  
2024年6月30日未偿付的数额为123,574人民币（截至2023年6月30日：105,719人民币）。

截至2024年6月30日止六个月的保管人费用总额为108,280人民币（截至2023年6月30日止  
六个月：104,494人民币），截至2024年6月30日未偿付的数额为17,889人民币（截至2023年  
6月30日：17,678人民币）。

截至2024年6月30日止六个月的行政管理费用总额为259,872人民币（截至2023年6月30日止六个月：250,785人民币），截至2024年6月30日未偿付的数额为46,977人民币（截至2023年  
6月30日：46,470人民币）。

截至2024年6月30日止六个月的基金登记机构费用总额为21,655人民币（截至2023年6月30日止六个月：21,116人民币），截至2024年6月30日未偿付的数额为3,577人民币（截至2023年  
6月30日：3,536人民币）。

截至2024年6月30日止六个月的合规监测费用总额为10,553人民币（截至2023年6月30日止  
六个月：19,030人民币），截至2024年6月30日未偿付的数额为1,701人民币（截至2023年6月30日：2,832人民币）。

截至2024年6月30日止六个月的财务报表编制费用总额为36,849人民币（截至2023年6月30日止六个月：35,245人民币），截至2024年6月30日未偿付的数额为53,430人民币（截至2023年6月30日：35,203人民币）。

**3 软佣金安排**

基金管理人确认，截至2024年6月30日止期间，不存在与通过经纪机构或交易商指导本子基金的交易有关的软佣金安排。

**财务报表（未经审计）附注（续）**

**截至2024年6月30日止六个月**

**4 可赎回份额**

六个月内已发行可赎回份额的变动如下：

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | 于2023年12月31日发行在外的份额 |  | 期内发行的份额 |  | 期内赎回的份额 |  | 于2024年6月30日发行在外的份额 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 截至2024年6月30日 |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 可赎回份额 |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 1A类美元（累积）份额 |  | 10,783 |  | - |  | - |  | 10,783 |
| 1E类美元（分派）份额 |  | 11,146 |  | - |  | (5,149) |  | 5,997 |
| 2A类美元（累积）份额 |  | 12,483 |  | - |  | (1,096) |  | 11,387 |
| 2A类美元（分派）份额 |  | 122,810 |  | 34 |  | (21,008) |  | 101,836 |
| 2B类人民币（累积）份额 |  | 131,540 |  | - |  | (9,534) |  | 122,006 |
| 2B类人民币（分派）份额 |  | 702,660 |  | 20,788 |  | (45,169) |  | 678,279 |
| 2C类美元（分派）份额 |  | 32,329 |  | 110 |  | (8,495) |  | 23,944 |
| 2D类港元（累积）份额 |  | 54,526 |  | 1,756 |  | (3,844) |  | 52,438 |
| 2D类港元（分派）份额 |  | 716,885 |  | - |  | (101,815) |  | 615,069 |
| 2E类澳元（分派）份额 |  | 468 |  | - |  | - |  | 468 |
| 2F类澳元对冲（累积）份额 |  | 9,364 |  | - |  | - |  | 9,364 |
| 2F类澳元对冲（分派）份额 |  | 11,092 |  | - |  | - |  | 11,092 |
| 2G类美元对冲（累积）份额 |  | 17,158 |  | 204 |  | (4,703) |  | 12,659 |
| 2G类美元对冲（分派）份额 |  | 161,519 |  | 2,323 |  | (13,905) |  | 149,937 |
| 2I类新加坡元对冲（累积）份额 |  | 8,722 |  | - |  | (5,189) |  | 3,533 |
| 2I类新加坡元对冲（分派）份额 |  | 19,887 |  | - |  | - |  | 19,887 |

**财务报表（未经审计）附注（续）**

**截至2024年6月30日止六个月**

**4 可赎回份额（续）**

六个月内已发行可赎回份额的变动如下：

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | 于2023年12月31日发行在外的份额 |  | 期内发行的份额 |  | 期内赎回的份额 |  | 于2024年6月30日发行在外的份额 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 截至2024年6月30日 |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 可赎回份额 |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 2K类欧元对冲（分派）份额 |  | 2,004 |  | - |  | - |  | 2,004 |
| 2L类港元对冲（累积）份额 |  | 1,976 |  | - |  | (1,976) |  | - |
| 2L类港元对冲（分派）份额 |  | 16,388 |  | - |  | - |  | 16,388 |
| 2XB类人民币（累积）份额 |  | 5,058 |  | - |  | (5,058) |  | - |
| 4C类美元对冲（累积）份额 |  | 6,270 |  | - |  | (5,297) |  | 974 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 份额总数 |  | 2,055,068 |  | 25,215 |  | (232,238) |  | 1,848,045 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |

**财务报表（未经审计）附注（续）**

**截至2024年6月30日止六个月**

**4 可赎回份额（续）**

年内已发行可赎回份额的变动如下：

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | 于2022年12月31日发行在外的份额 |  | 期内发行的份额 |  | 期内赎回的份额 |  | 于2023年6月30日发行在外的份额 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 截至2023年6月30日 |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 可赎回份额 |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 1A类美元（累积）份额 |  | 104,703 |  | 35,307 |  | (34,168) |  | 105,842 |
| 1A类美元（分派）份额 |  | 20,000 |  | - |  | (20,000) |  | - |
| 1E类美元（分派）份额 |  | 14,475 |  | - |  | - |  | 14,475 |
| 2A类美元（累积）份额 |  | 25,581 |  | 472 |  | (7,893) |  | 18,160 |
| 2A类美元（分派）份额 |  | 147,252 |  | 338 |  | (16,679) |  | 130,911 |
| 2B类人民币（累积）份额 |  | 139,223 |  | - |  | (605) |  | 138,618 |
| 2B类人民币（分派）份额 |  | 797,072 |  | 29,379 |  | (40,943) |  | 785,508 |
| 2C类美元（分派）份额 |  | 36,729 |  | 104 |  | (700) |  | 36,133 |
| 2D类港元（累积）份额 |  | 55,929 |  | 5,059 |  | (5,849) |  | 55,139 |
| 2D类港元（分派）份额 |  | 862,614 |  | 1,390 |  | (65,853) |  | 798,151 |
| 2E类澳元（累积）份额 |  | 114 |  | - |  | - |  | 114 |
| 2E类澳元（分派）份额 |  | 468 |  | - |  | - |  | 468 |
| 2F类澳元对冲（累积）份额 |  | 9,364 |  | - |  | - |  | 9,364 |
| 2F类澳元对冲（分派）份额 |  | 18,813 |  | - |  | (201) |  | 18,612 |
| 2G类美元对冲（累积）份额 |  | 18,986 |  | 332 |  | (1,617) |  | 17,701 |
| 2G类美元对冲（分派）份额 |  | 228,879 |  | 129 |  | (16,885) |  | 212,123 |
| 2I类新加坡元对冲（累积）份额 |  | 11,711 |  | - |  | (2,989) |  | 8,722 |
| 2I类新加坡元对冲（分派）份额 |  | 32,888 |  | - |  | (10,508) |  | 22,380 |

**财务报表（未经审计）附注（续）**

**截至2024年6月30日止六个月**

**4 可赎回份额（续）**

年内已发行可赎回份额的变动如下：

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | 于2022年12月31日发行在外的份额 |  | 期内发行的份额 |  | 期内赎回的份额 |  | 于2023年6月30日发行在外的份额 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 截至2023年6月30日 |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 可赎回份额 |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 2K类欧元对冲（累积）份额 |  | 884 |  | - |  | (884) |  | - |
| 2K类欧元对冲（分派）份额 |  | 12,079 |  | - |  | 1 |  | 12,080 |
| 2L类港元对冲（累积）份额 |  | 3,938 |  | - |  | (1,962) |  | 1,976 |
| 2L类港元对冲（分派）份额 |  | 55,205 |  | - |  | (35,350) |  | 19,855 |
| 2XB类人民币（累积）份额 |  | 72,425 |  | 42,999 |  | (59,106) |  | 56,318 |
| 4C类美元对冲（累积）份额 |  | 6,270 |  | - |  | 1 |  | 6,271 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 份额总数 |  | 2,675,602 |  | 115,509 |  | (322,190) |  | 2,468,921 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |

**财务报表（未经审计）附注（续）**

**截至2024年6月30日止六个月**

**5** **份额持有人应占资产净值**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | 截至2024年 6月30日  （未经审计） |  | 截至2023年 12月31日  （经审计） |
|  |  | 人民币 |  | 人民币 |
| **份额持有人应占份额净值** |  |  |  |  |
| **（根据本基金的招募说明书）** |  |  |  |  |
| 1A类美元（累积）份额 |  | 546.48 |  | 498.79 |
| 1E类美元（分派）份额 |  | 377.12 |  | 345.57 |
| 2A类美元（累积）份额 |  | 851.48 |  | 779.10 |
| 2A类美元（分派）份额 |  | 313.51 |  | 299.39 |
| 2B类人民币（累积）份额 |  | 132.27 |  | 121.03 |
| 2B类人民币（分派）份额 |  | 47.86 |  | 45.58 |
| 2C类美元（分派）份额 |  | 336.97 |  | 319.75 |
| 2D类港元（累积）份额 |  | 66.19 |  | 60.56 |
| 2D类港元（分派）份额 |  | 39.52 |  | 37.71 |
| 2E类澳元（分派）份额 |  | 260.00 |  | 246.15 |
| 2F类澳元对冲（累积）份额 |  | 409.69 |  | 372.18 |
| 2F类澳元对冲（分派）份额 |  | 243.50 |  | 228.68 |
| 2G类美元对冲（累积）份额 |  | 650.95 |  | 575.84 |
| 2G类美元对冲（分派）份额 |  | 330.26 |  | 304.13 |
| 2I类新加坡元对冲（累积）份额 |  | 386.92 |  | 354.44 |
| 2I类新加坡元对冲（分派）份额 |  | 268.18 |  | 254.04 |
| 2K类欧元对冲（分派）份额 |  | 408.88 |  | 385.74 |
| 2L类港元对冲（累积）份额 |  | - |  | 60.51 |
| 2L类港元对冲（分派）份额 |  | 45.97 |  | 42.57 |
| 2XB类人民币（累积）份额 |  | - |  | 96.91 |
| 4C类美元对冲（累积）份额 |  | 612.53 |  | 537.95 |
|  |  |  |  |  |

**财务报表（未经审计）附注（续）**

**截至2024年6月30日止六个月**

**5** **份额持有人应占资产净值（续）**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | 截至2024年 6月30日  （未经审计） |  | 截至2023年 12月31日  （经审计） |
|  |  | 类别货币 |  | 类别货币 |
| **份额持有人应占份额净值** |  |  |  |  |
| **（****根据本基金的招募说明书）** |  |  |  |  |
| 1A类美元（累积）份额 |  | 74.94 |  | 70.04 |
| 1E类美元（分派）份额 |  | 51.72 |  | 48.53 |
| 2A类美元（累积）份额 |  | 116.77 |  | 109.40 |
| 2A类美元（分派）份额 |  | 42.99 |  | 42.04 |
| 2B类人民币（累积）份额 |  | 132.27 |  | 121.03 |
| 2B类人民币（分派）份额 |  | 47.86 |  | 45.58 |
| 2C类美元（分派）份额 |  | 46.21 |  | 44.90 |
| 2D类港元（累积）份额 |  | 70.88 |  | 66.43 |
| 2D类港元（分派）份额 |  | 42.32 |  | 41.36 |
| 2E类澳元（分派）份额 |  | 53.54 |  | 50.81 |
| 2F类澳元对冲（累积）份额 |  | 84.36 |  | 76.82 |
| 2F类澳元对冲（分派）份额 |  | 50.14 |  | 47.20 |
| 2G类美元对冲（累积）份额 |  | 89.27 |  | 80.86 |
| 2G类美元对冲（分派）份额 |  | 45.29 |  | 42.71 |
| 2I类新加坡元对冲（累积）份额 |  | 71.91 |  | 65.70 |
| 2I类新加坡元对冲（分派）份额 |  | 49.84 |  | 47.09 |
| 2K类欧元对冲（分派）份额 |  | 52.36 |  | 48.95 |
| 2L类港元对冲（累积）份额 |  | - |  | 66.37 |
| 2L类港元对冲（分派）份额 |  | 49.23 |  | 46.69 |
| 2XB类人民币（累积）份额 |  | - |  | 96.91 |
| 4C类美元对冲（累积）份额 |  | 84.00 |  | 75.54 |

**财务报表（未经审计）附注（续）**

**截至2024年6月30日止六个月**

**6 向可赎回份额持有人的收益分配**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 截至2024年 6月30日止 六个月  （未经审计）  人民币 |  | 截至2023年 6月30日止 六个月  （未经审计）  人民币 |
|  |  |  |  |
| 于1月1日的未分配收益 | 221,968,166 |  | 418,113,303 |
|  |  |  |  |
| 期内份额持有人应占资产净值减少 | 15,560,880 |  | (36,196,040) |
|  |  |  |  |
| 向份额持有人的收益分配 | 6,550,172 |  | 8,985,223 |
|  |  |  |  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的未变现亏损 | (50,433,719) |  | 22,923,949 |
|  |  |  |  |
| 分配前的未分配收益 | 193,645,499 |  | 413,826,435 |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 就1A类份额于2023年1月3日宣派每份额0.49美元的月度 收益分配 | - |  | (67,816) |
| 就1E类份额于2023年1月3日宣派每份额0.40美元的月度 收益分配 | - |  | (40,066) |
| 就2A类份额于2023年1月3日宣派每份额0.41美元的月度 收益分配 | - |  | (417,782) |
| 就2B类份额于2023年1月3日宣派每份额0.52离岸人民币的月度收益分配 | - |  | (414,478) |
| 就2C类份额于2023年1月3日宣派每份额0.47美元的月度 收益分配 | - |  | (119,456) |
| 就2D类份额于2023年1月3日宣派每份额0.40港元的月度 收益分配 | - |  | (305,553) |
| 就2E类份额于2023年1月3日宣派每份额0.41澳元的月度 收益分配 | - |  | (889) |
| 就2F类份额于2023年1月3日宣派每份额0.37澳元的月度 收益分配 | - |  | (32,292) |
| 就2G类份额于2023年1月3日宣派每份额0.36美元的月度 收益分配 | - |  | (570,180) |
| 就2I类份额于2023年1月3日宣派每份额0.40新加坡元的 月度收益分配 | - |  | (67,612) |
| 就2K类份额于2023年1月3日宣派每份额0.31欧元的月度 收益分配 | - |  | (27,290) |
| 就2L类份额于2023年1月3日宣派每份额0.40港元的月度 收益分配 | - |  | (19,555) |
| 就1A类份额于2023年2月1日宣派每份额0.35美元的月度 收益分配 | - |  | (47,208) |
| 就1E类份额于2023年2月1日宣派每份额0.32美元的月度 收益分配 | - |  | (31,238) |
| 就2A类份额于2023年2月1日宣派每份额0.29美元的月度 收益分配 | - |  | (288,524) |
| 就2B类份额于2023年2月1日宣派每份额0.31离岸人民币的月度收益分配 | - |  | (254,636) |
| 就2C类份额于2023年2月1日宣派每份额0.34美元的月度 收益分配 | - |  | (84,265) |
| 就2D类份额于2023年2月1日宣派每份额0.28港元的月度 收益分配 | - |  | (206,085) |

**财务报表（未经审计）附注（续）**

**截至2024年6月30日止六个月**

**6 向可赎回份额持有人的收益分配（续）**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 截至2024年6月30日止六个月  （未经审计）  人民币 |  | 截至2023年 6月30日止 六个月  （未经审计）  人民币 |
|  |  |  |  |
| 就2E类份额于2023年2月1日宣派每份额0.29澳元的月度 收益分配 | - |  | (647) |
| 就2F类份额于2023年2月1日宣派每份额0.26澳元的月度 收益分配 | - |  | (23,345) |
| 就2G类份额于2023年2月1日宣派每份额0.28美元的月度 收益分配 | - |  | (432,440) |
| 就2I类份额于2023年2月1日宣派每份额0.26新加坡元的 月度收益分配 | - |  | (43,930) |
| 就2K类份额于2023年2月1日宣派每份额0.22欧元的月度 收益分配 | - |  | (19,522) |
| 就2L类份额于2023年2月1日宣派每份额0.31港元的月度 收益分配 | - |  | (14,717) |
| 就1A类份额于2023年3月1日宣派每份额0.35美元的月度 收益分配 | - |  | (48,133) |
| 就1E类份额于2023年3月1日宣派每份额0.32美元的月度 收益分配 | - |  | (31,850) |
| 就2A类份额于2023年3月1日宣派每份额0.29美元的月度 收益分配 | - |  | (273,217) |
| 就2B类份额于2023年3月1日宣派每份额0.31离岸人民币的月度收益分配 | - |  | (249,343) |
| 就2C类份额于2023年3月1日宣派每份额0.34美元的月度 收益分配 | - |  | (85,950) |
| 就2D类份额于2023年3月1日宣派每份额0.28港元的月度 收益分配 | - |  | (209,420) |
| 就2E类份额于2023年3月1日宣派每份额0.29澳元的月度 收益分配 | - |  | (631) |
| 就2F类份额于2023年3月1日宣派每份额0.26澳元的月度 收益分配 | - |  | (22,763) |
| 就2G类份额于2023年3月1日宣派每份额0.28美元的月度 收益分配 | - |  | (425,100) |
| 就2I类份额于2023年3月1日宣派每份额0.26新加坡元的 月度收益分配 | - |  | (29,853) |
| 就2K类份额于2023年3月1日宣派每份额0.22欧元的月度 收益分配 | - |  | (19,495) |
| 就2L类份额于2023年3月1日宣派每份额0.31港元的月度 收益分配 | - |  | (8,580) |
| 就1E类份额于2023年4月3日宣派每份额0.32美元的月度 收益分配 | - |  | (31,924) |
| 就2A类份额于2023年4月3日宣派每份额0.29美元的月度 收益分配 | - |  | (272,250) |
| 就2B类份额于2023年4月3日宣派每份额0.31离岸人民币的月度收益分配 | - |  | (247,092) |
| 就2C类份额于2023年4月3日宣派每份额0.34美元的月度 收益分配 | - |  | (86,186) |

**财务报表（未经审计）附注（续）**

**截至2024年6月30日止六个月**

**6 向可赎回份额持有人的收益分配（续）**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 截至2024年 6月30日止 六个月  （未经审计）  人民币 |  | 截至2023年 6月30日止 六个月  （未经审计）  人民币 |
|  |  |  |  |
| 就2D类份额于2023年4月3日宣派每份额0.29港元的月度收益分配 | - |  | (211,144) |
| 就2E类份额于2023年4月3日宣派每份额0.29澳元的月度收益分配 | - |  | (629) |
| 就2F类份额于2023年4月3日宣派每份额0.26澳元的月度收益分配 | - |  | (22,675) |
| 就2G类份额于2023年4月3日宣派每份额0.28美元的月度收益分配 | - |  | (419,057) |
| 就2I类份额于2023年4月3日宣派每份额0.26新加坡元的月度收益分配 | - |  | (30,136) |
| 就2K类份额于2023年4月3日宣派每份额0.22欧元的月度收益分配 | - |  | (19,912) |
| 就2L类份额于2023年4月3日宣派每份额0.31港元的月度收益分配 | - |  | (5,404) |
| 就1E类份额于2023年5月4日宣派每份额0.32美元的月度收益分配 | - |  | (32,047) |
| 就2A类份额于2023年5月4日宣派每份额0.29美元的月度收益分配 | - |  | (273,305) |
| 就2B类份额于2023年5月4日宣派每份额0.31离岸人民币的月度收益分配 | - |  | (243,892) |
| 就2C类份额于2023年5月4日宣派每份额0.34美元的月度收益分配 | - |  | (86,557) |
| 就2D类份额于2023年5月4日宣派每份额0.29港元的月度收益分配 | - |  | (206,638) |
| 就2E类份额于2023年5月4日宣派每份额0.29澳元的月度收益分配 | - |  | (626) |
| 就2F类份额于2023年5月4日宣派每份额0.26澳元的月度收益分配 | - |  | (22,583) |
| 就2G类份额于2023年5月4日宣派每份额0.28美元的月度收益分配 | - |  | (420,669) |
| 就2I类份额于2023年5月4日宣派每份额0.26新加坡元的月度收益分配 | - |  | (30,329) |
| 就2K类份额于2023年5月4日宣派每份额0.22欧元的月度收益分配 | - |  | (20,338) |
| 就2L类份额于2023年5月4日宣派每份额0.31港元的月度收益分配 | - |  | (5,426) |
| 就1E类份额于2023年6月1日宣派每份额0.32美元的月度收益分配 | - |  | (32,985) |
| 就2A类份额于2023年6月1日宣派每份额0.29美元的月度收益分配 | - |  | (274,432) |
| 就2B类份额于2023年6月1日宣派每份额0.31离岸人民币的月度收益分配 | - |  | (243,543) |
| 就2C类份额于2023年6月1日宣派每份额0.34美元的月度收益分配 | - |  | (87,440) |
| 就2D类份额于2023年6月1日宣派每份额0.29港元的月度收益分配 | - |  | (211,513) |

**财务报表（未经审计）附注（续）**

**截至2024年6月30日止六个月**

**6 向可赎回份额持有人的收益分配（续）**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 截至2024年6月30日止六个月  （未经审计）  人民币 |  | 截至2023年6月30日止六个月  （未经审计）  人民币 |
|  |  |  |  |
| 就2E类份额于2023年6月1日宣派每份额0.30澳元的月度收益分配 | - |  | (652) |
| 就2F类份额于2023年6月1日宣派每份额0.26澳元的月度收益分配 | - |  | (22,472) |
| 就2G类份额于2023年6月1日宣派每份额0.28美元的月度收益分配 | - |  | (432,987) |
| 就2I类份额于2023年6月1日宣派每份额0.26新加坡元的月度收益分配 | - |  | (30,656) |
| 就2K类份额于2023年6月1日宣派每份额0.22欧元的月度收益分配 | - |  | (20,267) |
| 就2L类份额于2023年6月1日宣派每份额0.31港元的月度收益分配 | - |  | (5,596) |
| 就1E类份额于2024年1月2日宣派每份额0.32美元的月度收益分配 | (25,472) |  | - |
| 就2A类份额于2024年1月2日宣派每份额0.30美元的月度收益分配 | (263,103) |  | - |
| 就2B类份额于2024年1月2日宣派每份额0.31离岸人民币的月度收益分配 | (217,825) |  | - |
| 就2C类份额于2024年1月2日宣派每份额0.34美元的月度收益分配 | (78,494) |  | - |
| 就2D类份额于2024年1月2日宣派每份额0.29港元的月度收益分配 | (189,450) |  | - |
| 就2E类份额于2024年1月2日宣派每份额0.30澳元的月度收益分配 | (683) |  | - |
| 就2F类份额于2024年1月2日宣派每份额0.27澳元的月度收益分配 | (14,579) |  | - |
| 就2G类份额于2024年1月2日宣派每份额0.29美元的月度收益分配 | (334,498) |  | - |
| 就2I类份额于2024年1月2日宣派每份额0.27新加坡元的月度收益分配 | (28,978) |  | - |
| 就2K类份额于2024年1月2日宣派每份额0.22欧元的月度收益分配 | (3,466) |  | - |
| 就2L类份额于2024年1月2日宣派每份额0.32港元的月度收益分配 | (4,792) |  | - |
| 就1E类份额于2024年2月1日宣派每份额0.32美元的月度收益分配 | (13,810) |  | - |
| 就2A类份额于2024年2月1日宣派每份额0.30美元的月度收益分配 | (256,790) |  | - |
| 就2B类份额于2024年2月1日宣派每份额0.31离岸人民币的月度收益分配 | (209,092) |  | - |
| 就2C类份额于2024年2月1日宣派每份额0.26美元的月度收益分配 | (60,531) |  | - |
| 就2D类份额于2024年2月1日宣派每份额0.29港元的月度收益分配 | (185,456) |  | - |
| 就2E类份额于2024年2月1日宣派每份额0.30澳元的月度收益分配 | (657) |  | - |
| 就2F类份额于2024年2月1日宣派每份额0.27澳元的月度收益分配 | (14,034) |  | - |
| 就2G类份额于2024年2月1日宣派每份额0.29美元的月度收益分配 | (336,789) |  | - |
| 就2I类份额于2024年2月1日宣派每份额0.27新加坡元的月度收益分配 | (28,808) |  | - |
| 就2K类份额于2024年2月1日宣派每份额0.22欧元的月度收益分配 | (3,425) |  | - |

**财务报表（未经审计）附注（续）**

**截至2024年6月30日止六个月**

**6 向可赎回份额持有人的收益分配（续）**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 截至2024年 6月30日止 六个月  （未经审计）  人民币 |  | 截至2023年 6月30日止 六个月  （未经审计）  人民币 |
|  |  |  |  |
| 就2L类份额于2024年2月1日宣派每份额0.32港元的月度收益分配 | (4,826) |  | - |
| 就1E类份额于2024年3月1日宣派每份额0.32美元的月度收益分配 | (13,842) |  | - |
| 就2A类份额于2024年3月1日宣派每份额0.30美元的月度收益分配 | (257,396) |  | - |
| 就2B类份额于2024年3月1日宣派每份额0.31离岸人民币的月度收益分配 | (208,829) |  | - |
| 就2C类份额于2024年3月1日宣派每份额0.26美元的月度收益分配 | (48,070) |  | - |
| 就2D类份额于2024年3月1日宣派每份额0.29港元的月度收益分配 | (182,755) |  | - |
| 就2E类份额于2024年3月1日宣派每份额0.30澳元的月度收益分配 | (658) |  | - |
| 就2F类份额于2024年3月1日宣派每份额0.27澳元的月度收益分配 | (14,052) |  | - |
| 就2G类份额于2024年3月1日宣派每份额0.29美元的月度收益分配 | (337,569) |  | - |
| 就2I类份额于2024年3月1日宣派每份额0.27新加坡元的月度收益分配 | (28,765) |  | - |
| 就2K类份额于2024年3月1日宣派每份额0.22欧元的月度收益分配 | (3,439) |  | - |
| 就2L类份额于2024年3月1日宣派每份额0.32港元的月度收益分配 | (4,832) |  | - |
| 就1E类份额于2024年4月2日宣派每份额0.32美元的月度收益分配 | (13,938) |  | - |
| 就2A类份额于2024年4月2日宣派每份额0.30美元的月度收益分配 | (244,673) |  | - |
| 就2B类份额于2024年4月2日宣派每份额0.31离岸人民币的月度收益分配 | (207,475) |  | - |
| 就2C类份额于2024年4月2日宣派每份额0.26美元的月度收益分配 | (48,435) |  | - |
| 就2D类份额于2024年4月2日宣派每份额0.29港元的月度收益分配 | (180,948) |  | - |
| 就2E类份额于2024年4月2日宣派每份额0.30澳元的月度收益分配 | (663) |  | - |
| 就2F类份额于2024年4月2日宣派每份额0.27澳元的月度收益分配 | (14,147) |  | - |
| 就2G类份额于2024年4月2日宣派每份额0.29美元的月度收益分配 | (332,875) |  | - |
| 就2I类份额于2024年4月2日宣派每份额0.27新加坡元的月度收益分配 | (28,831) |  | - |
| 就2K类份额于2024年4月2日宣派每份额0.22欧元的月度收益分配 | (3,441) |  | - |
| 就2L类份额于2024年4月2日宣派每份额0.32港元的月度收益分配 | (4,865) |  | - |
| 就1E类份额于2024年5月2日宣派每份额0.32美元的月度收益分配 | (13,879) |  | - |

**财务报表（未经审计）附注（续）**

**截至2024年6月30日止六个月**

**6 向可赎回份额持有人的收益分配（续）**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 截至2024年 6月30日止 六个月  （未经审计）  人民币 |  | 截至2023年 6月30日止 六个月  （未经审计）  人民币 |
|  |  |  |  |
| 就2A类份额于2024年5月2日宣派每份额0.30美元的月度收益分配 | (228,451) |  | - |
| 就2B类份额于2024年5月2日宣派每份额0.31离岸人民币的月度收益分配 | (211,910) |  | - |
| 就2C类份额于2024年5月2日宣派每份额0.26美元的月度收益分配 | (48,263) |  | - |
| 就2D类份额于2024年5月2日宣派每份额0.29港元的月度收益分配 | (177,928) |  | - |
| 就2E类份额于2024年5月2日宣派每份额0.30澳元的月度收益分配 | (662) |  | - |
| 就2F类份额于2024年5月2日宣派每份额0.27澳元的月度收益分配 | (14,130) |  | - |
| 就2G类份额于2024年5月2日宣派每份额0.29美元的月度收益分配 | (318,439) |  | - |
| 就2I类份额于2024年5月2日宣派每份额0.27新加坡元的月度收益分配 | (28,566) |  | - |
| 就2K类份额于2024年5月2日宣派每份额0.22欧元的月度收益分配 | (3,414) |  | - |
| 就2L类份额于2024年5月2日宣派每份额0.32港元的月度收益分配 | (4,851) |  | - |
| 就1E类份额于2024年6月3日宣派每份额0.32美元的月度收益分配 | (13,930) |  | - |
| 就2A类份额于2024年6月3日宣派每份额0.30美元的月度收益分配 | (229,222) |  | - |
| 就2B类份额于2024年6月3日宣派每份额0.31离岸人民币的月度收益分配 | (211,918) |  | - |
| 就2C类份额于2024年6月3日宣派每份额0.26美元的月度收益分配 | (45,158) |  | - |
| 就2D类份额于2024年6月3日宣派每份额0.29港元的月度收益分配 | (172,454) |  | - |
| 就2E类份额于2024年6月3日宣派每份额0.30澳元的月度收益分配 | (677) |  | - |
| 就2F类份额于2024年6月3日宣派每份额0.27澳元的月度收益分配 | (14,448) |  | - |
| 就2G类份额于2024年6月3日宣派每份额0.29美元的月度收益分配 | (318,618) |  | - |
| 就2I类份额于2024年6月3日宣派每份额0.27新加坡元的月度收益分配 | (28,861) |  | - |
| 就2K类份额于2024年6月3日宣派每份额0.22欧元的月度收益分配 | (3,469) |  | - |
| 就2L类份额于2024年6月3日宣派每份额0.32港元的月度收益分配 | (4,868) |  | - |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 于6月30日的未分配收益 | 187,095,327 |  | 404,841,212 |

可用于收益分配的金额为本子基金就相关期间应收的总净额（“总收益”）与针对收益应支付的支出之差，有可能会根据信托契约做出调整。总收益将包括以利息（例如银行存款和债务证券所实现的利息）或基金管理人确定符合收益性质的其他收入的形式应收的款项。未变现资本收益或亏损不构成总收益的一部分，因此不会对可用于收益分配的金额产生影响。

**投资组合（未经审计）**

**截至2024年6月30日**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  | **持仓量** | **公允价值** |  | **占资产净额百分比(%)** |
|  |  | **人民币** |  |  |
| **有报价投资** |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| **公司债券**(80.66%) |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| **澳大利亚** (0.72%) |  |  |  |  |
| MINERAL RESOURCE MINAU 8 11/01/27 | 200,000 | 1,489,569 |  | 0.72 |
|  |  |  |  |  |
| **百慕大** (2.91%) |  |  |  |  |
| CHINA OIL CHIOIL 4.7 06/30/26 | 700,000 | 4,700,288 |  | 2.26 |
| CHINA WATER AFF CWAHK 4.85 05/18/26 | 200,000 | 1,345,710 |  | 0.65 |
|  |  |  |  |  |
| **法国** (1.44%) |  |  |  |  |
| BNP PARIBAS BNP 8 PERP | 200,000 | 1,465,286 |  | 0.71 |
| SOCIETE GENERALE SOCGEN 10 PERP | 200,000 | 1,514,887 |  | 0.73 |
|  |  |  |  |  |
| **香港** (14.62%) |  |  |  |  |
| EHI CAR SERVICES EHICAR 12 09/26/27 | 568,000 | 3,806,824 |  | 1.83 |
| FWD LTD FWDINS 5 1/2 PERP | 400,000 | 2,610,508 |  | 1.26 |
| GLP CHINA GLPCHI 2.95 03/29/26 | 200,000 | 1,258,293 |  | 0.61 |
| JSW STEEL LTD JSTLIN 5.05 04/05/32 | 500,000 | 3,226,091 |  | 1.55 |
| LAI SUN MTN LTD LASUDE 5 07/28/26 | 1,250,000 | 6,105,571 |  | 2.94 |
| RH INTL FINANCE LTD 6.5% 31DEC2049 | 900,000 | 3,200,649 |  | 1.54 |
| VEDANTA RESOURCE | 550,000 | 3,249,649 |  | 1.58 |
| YANLORD LAND HK YLLGSP 5 1/8 05/20/26 | 1,100,000 | 6,873,687 |  | 3.31 |
|  |  |  |  |  |
| **印度** (2.53%) |  |  |  |  |
| ADANI RENEW ENER ARENRJ 4 5/8 10/15/39 | 200,000 | 1,016,182 |  | 0.49 |
| JABABEKA INTL BV KIJAIJ 7 12/15/27 | 600,000 | 4,232,224 |  | 2.04 |
|  |  |  |  |  |
| **印尼** (3.41%) |  |  |  |  |
| INDIKA INTI ENEG INDYIJ 8 3/4 05/07/29 | 350,000 | 2,556,032 |  | 1.23 |
| LONGFOR HOLDINGS LNGFOR 3.95 09/16/29 | 850,000 | 4,531,371 |  | 2.18 |
|  |  |  |  |  |
| **日本** (2.18%) |  |  |  |  |
| RAKUTEN GROUP RAKUTN 9 3/4 04/15/29 | 600,000 | 4,519,809 |  | 2.18 |
|  |  |  |  |  |
| **泽西岛** (1.15%) |  |  |  |  |
| WEST CHINA CEM WESCHI 4.95 07/08/26 | 400,000 | 2,389,354 |  | 1.15 |
|  |  |  |  |  |
| **毛里求斯** (0.71%) |  |  |  |  |
| DIAMOND II LTD RNW 7.95 07/28/26 | 200,000 | 1,480,104 |  | 0.71 |
|  |  |  |  |  |
| **蒙古** (1.66%) |  |  |  |  |
| MODERNLAND OVERS MDLNIJ 6.95 04/13/24 | 1,350,000 | 3,444,132 |  | 1.66 |
|  |  |  |  |  |
| **荷兰** (0.64%) |  |  |  |  |
| MINEJESA CAPITAL MINCAP 5 5/8 08/10/37 | 200,000 | 1,323,922 |  | 0.64 |
|  |  |  |  |  |

## 投资组合（未经审计）（续）

**截至2024年6月30日**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  | **持仓量** | **公允价值** |  | **占资产净额百分比(%)** |
|  |  | **人民币** |  |  |
| **公司债券**(80.66%) **（续）** |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| **中国内地** (44.38%) |  |  |  |  |
| AGILE GROUP AGILE 5 1/2 04/21/25 | 500,000 | 254,494 |  | 0.12 |
| BANK OF EAST ASIA LTD FRN 31DEC2049 | 500,000 | 3,573,924 |  | 1.72 |
| CA MAGNUM HLDING HEXWIN 5 3/8 10/31/26 | 200,000 | 1,396,245 |  | 0.67 |
| CAS CAPITAL NO1 CASHLD 4 PERP | 550,000 | 3,748,791 |  | 1.81 |
| CIFI HOLDINGS GROUP | 700,000 | 563,379 |  | 0.27 |
| EHI CAR SERVICES EHICAR 7 09/21/26 | 400,000 | 2,522,507 |  | 1.22 |
| ESTATE SKY LTD CSIPRO 5.45 07/21/25 | 200,000 | 1,306,712 |  | 0.63 |
| FORTUNE STAR FOSUNI 5 05/18/26 | 200,000 | 1,361,024 |  | 0.66 |
| FORTUNE STAR FOSUNI 5.05 01/27/27 | 1,100,000 | 7,255,580 |  | 3.50 |
| GREENKO DUTCH BV GRNKEN 3.85 03/29/26 | 500,000 | 3,133,257 |  | 1.51 |
| GREENTOWN CHINA GRNCH 5.65 07/13/25 | 400,000 | 2,776,797 |  | 1.34 |
| ING GROEP NV INTNED 8 PERP | 200,000 | 1,488,839 |  | 0.72 |
| LI & FUNG LTD LIFUNG 5 1/4 12/29/49 | 2,450,000 | 8,453,469 |  | 4.07 |
| LS FINANCE 2017 LIHHK 4.8 06/18/26 | 1,200,000 | 7,967,331 |  | 3.84 |
| MELCO RESORTS MPEL 5 3/4 07/21/28 | 200,000 | 1,365,632 |  | 0.66 |
| MONGO MIN/ENG RE MONMIN 12 1/2 09/13/26 | 500,000 | 3,887,629 |  | 1.87 |
| NEW METRO GLOBAL FTLNHD 4 1/2 05/02/26 | 500,000 | 2,224,049 |  | 1.07 |
| NWD FINANCE (BVI) LTD FRN 31DEC2049 | 1,000,000 | 5,953,987 |  | 2.88 |
| NWD FINANCE(BVI) NWDEVL 4.8 PERP | 850,000 | 2,641,951 |  | 1.27 |
| RKPF OVRS 2020 A ROADKG 5 1/8 07/26/26 | 200,000 | 470,733 |  | 0.23 |
| SHUI ON DEVELOP SHUION 5 1/2 03/03/25 | 650,000 | 3,910,380 |  | 1.88 |
| SHUI ON DEVELOP SHUION 5 1/2 06/29/26 | 400,000 | 2,098,749 |  | 1.01 |
| SMC GLOBAL POWER SMCGL 5.95 PERP | 450,000 | 3,239,403 |  | 1.56 |
| STANDARD CHART STANLN 7 3/4 PERP | 800,000 | 5,890,604 |  | 2.84 |
| STUDIO CITY FIN STCITY 5 01/15/29 | 200,000 | 1,286,076 |  | 0.62 |
| SUN HUNG KAI BVI SUNHKC 5 09/07/26 | 1,000,000 | 6,730,813 |  | 3.24 |
| SUNAC CHINA HLDG SUNAC 6 1/2 09/30/27 | 462,233 | 370,771 |  | 0.18 |
| VANKE REAL ESTAT VNKRLE 3.975 11/09/27 | 400,000 | 1,864,178 |  | 0.90 |
| WANDA PROP GLOBA DALWAN 11 02/13/26 | 350,000 | 2,200,864 |  | 1.06 |
| WYNN MACAU LTD WYNMAC 5 1/2 01/15/26 | 300,000 | 2,145,317 |  | 1.03 |
|  |  |  |  |  |
| **新加坡** (2.97%) |  |  |  |  |
| CONTINUUM ENERGY COGREN 9 1/2 02/24/27 | 200,000 | 1,499,982 |  | 0.72 |
| GLP PTE LTD GLPSP 4.6 PERP | 600,000 | 2,713,487 |  | 1.31 |
| MEDCO MAPLE TREE MEDCIJ 8.96 04/27/29 | 250,000 | 1,907,682 |  | 0.92 |
| MODERNLAND OVERS MDLNIJ 3 04/30/27 | 20,250 | 51,068 |  | 0.02 |
|  |  |  |  |  |
| **英国** (1.34%) |  |  |  |  |
| BARCLAYS PLC BACR 9 5/8 PERP | 200,000 | 1,580,180 |  | 0.76 |
| STANDARD CHART STANLN 4 3/4 PERP | 200,000 | 1,206,067 |  | 0.58 |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| 公司债券总计 |  | 167,382,093 |  | 80.66 |
|  |  |  |  |  |

## 投资组合（未经审计）（续）

**截至2024年6月30日**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  | **持仓量** | **公允价值** |  | **占资产净额百分比(%)** |
|  |  | **人民币** |  |  |
| **政府债券** (9.02%) |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| **巴基斯坦** (4.21%) |  |  |  |  |
| REP OF PAKISTAN PKSTAN 6 7/8 12/05/27 | 1,200,000 | 7,581,959 |  | 3.65 |
| REP OF PAKISTAN PKSTAN 7 3/8 04/08/31 | 200,000 | 1,152,995 |  | 0.56 |
|  |  |  |  |  |
| **斯里兰卡** (4.14%) |  |  |  |  |
| REP OF SRI LANKA 0.00% 11MAY2027 | 2,000,000 | 8,581,325 |  | 4.14 |
|  |  |  |  |  |
| **美国** (0.67%) |  |  |  |  |
| STRIP PRINC 0% 15FEB2054 | 700,000 | 1,392,496 |  | 0.67 |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| 政府债券总计 |  | 18,708,775 |  | 9.02 |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |

## 投资组合（未经审计）（续）

**截至2024年6月30日**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |  |
| **衍生金融工具** (-0.67%) | |  |  |  |  |
| **基础资产** | **对手方** | **未偿付合约名义值** | **公允价值** |  | **占资产净额百分比(%)** |
|  |  |  | **人民币** |  |  |
| **外汇远期合约** | |  |  |  |  |
| 买入澳元/卖出美元 | 花旗银行 | 5,910澳元 | (1,521,869) |  | (0.73) |
| 买入澳元/卖出人民币 | 花旗银行 | 544,883澳元 | 26,322 |  | 0.01 |
| 买入澳元/卖出人民币 | 花旗银行 | 774,591澳元 | 37,418 |  | 0.02 |
| 买入澳元/卖出人民币 | 花旗银行 | 9,242澳元 | 109 |  | 0.00 |
| 买入人民币/卖出人民币 | 渣打银行 | 117,000,000人民币 | - |  | - |
| 买入人民币/卖出人民币 | 花旗银行 | 176,642人民币 | - |  | - |
| 买入人民币/卖出人民币 | 巴克莱银行 | 47,000,000人民币 | - |  | - |
| 买入人民币/卖出人民币 | 巴克莱银行 | 47,000,000人民币 | - |  | - |
| 买入欧元/卖出人民币 | 花旗银行 | 1,227欧元 | (4) |  | (0.00) |
| 买入欧元/卖出人民币 | 花旗银行 | 103,643欧元 | 1,273 |  | 0.00 |
| 买入港元/卖出人民币 | 花旗银行 | 794,935港元 | 2,020 |  | 0.00 |
| 买入港元/卖出人民币 | 花旗银行 | 8,130港元 | (3) |  | (0.00) |
| 买入新加坡元/卖出人民币 | 花旗银行 | 10,754新加坡元 | 15 |  | 0.00 |
| 买入新加坡元/卖出人民币 | 花旗银行 | 2,673新加坡元 | 7 |  | 0.00 |
| 买入新加坡元/卖出人民币 | 花旗银行 | 249,959新加坡元 | 2,825 |  | 0.00 |
| 买入新加坡元/卖出人民币 | 花旗银行 | 972,872新加坡元 | 10,993 |  | 0.01 |
| 买入美元/卖出人民币 | 花旗银行 | 1,133,213美元 | 27,083 |  | 0.01 |
| 买入美元/卖出人民币 | 花旗银行 | 12,624美元 | 92 |  | 0.00 |
| 买入美元/卖出人民币 | 花旗银行 | 3,449美元 | 38 |  | 0.00 |

**投资组合（未经审计）（续）**

**截至2024年6月30日**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **衍生金融工具** (-0.67%) **（续）** | |  |  |  |  |
| **基础资产** | **对手方** | **未偿付合约名义值** | **公允价值** |  | **占资产净额百分比(%)** |
|  |  |  | **人民币** |  |  |
| **外汇远期合约（续）** | |  |  |  |  |
| 买入美元/卖出人民币 | 花旗银行 | 303,588美元 | 7,255 |  | 0.00 |
| 买入美元/卖出人民币 | 花旗银行 | 6,681,889美元 | 159,691 |  | 0.07 |
| 买入美元/卖出美元 | 花旗银行 | 68,425美元 | (113) |  | (0.00) |
| 买入美元/卖出美元 | 花旗银行 | 80,032美元 | (67,889) |  | (0.03) |
| 买入美元/卖出美元 | 花旗银行 | 901美元 | (71,154) |  | (0.03) |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 衍生金融工具总计 |  | (1,385,891) |  | (0.67) |
|  |  |  |  |  |
| **资产净额总计** |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| 投资总计，按公允价值 |  | 186,090,868 |  | 89.68 |
|  |  |  |  |  |
| 衍生金融工具 |  | (1,385,891) |  | (0.67) |
|  |  |  |  |  |
| 银行结余 |  | 4,484,221 |  | 2.16 |
|  |  |  |  |  |
| 其他资产净额 |  | 18,318,176 |  | 8.83 |
|  |  |  |  |  |
| 资产净额总计 |  | 207,507,374 |  | 100.00 |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| 投资总计，按成本 |  | 172,198,289 |  |  |
|  |  |  |  |  |

## 投资组合持仓变动表（未经审计）

**截至2024年6月30日止六个月**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  | **截至2024年 1月1日** | **增添** | **出售** | **截至2024年6月30日** |
| **有报价投资** |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| **公司债券** |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| **澳大利亚** |  |  |  |  |
| MACQUARIE BANK LONDON FRN 31DEC2049 | - | 200,000 | (200,000) | - |
| MINERAL RESOURCE MINAU 8 11/01/27 | 200,000 | - | - | 200,000 |
|  |  |  |  |  |
| **百慕大** |  |  |  |  |
| CHINA OIL CHIOIL 4.7 06/30/26 | 400,000 | 700,000 | (400,000) | 700,000 |
| CHINA WATER AFF CWAHK 4.85 05/18/26 | 200,000 | - | - | 200,000 |
| LI & FUNG LTD LIFUNG 4 1/2 08/18/25 | 200,000 | - | (200,000) | - |
| LONGFOR PROPERTI LNGFOR 4 1/2 01/16/28 | - | 400,000 | (400,000) | - |
|  |  |  |  |  |
| **英国** |  |  |  |  |
| HSBC HOLDINGS HSBC 6 3/8 12/29/49 | 200,000 | - | (200,000) | - |
|  |  |  |  |  |
| **中国内地** |  |  |  |  |
| BANK OF COMMUNICATIONS FRN 31DEC2020 | 350,000 | - | (350,000) | - |
|  |  |  |  |  |
| **法国** |  |  |  |  |
| BNP PARIBAS BNP 8 PERP | - | 200,000 | - | 200,000 |
| SOCIETE GENERALE SOCGEN 10 PERP | - | 200,000 | - | 200,000 |
|  |  |  |  |  |
| **香港** |  |  |  |  |
| CHONG HING BANK LTD FRN 31DEC2049 | 250,000 | - | (250,000) | - |
| CTHY PCFC MTN HK CATHAY 4 7/8 08/17/26 | 200,000 | - | (200,000) | - |
| EHI CAR SERVICES EHICAR 12 09/26/27 | - | 568,000 | - | 568,000 |
| FWD LTD FWDINS 5 1/2 PERP | 950,000 | 600,000 | (1,150,000) | 400,000 |
| GLP CHINA GLPCHI 2.95 03/29/26 | - | 200,000 | - | 200,000 |
| JSW STEEL LTD JSTLIN 5.05 04/05/32 | 700,000 | - | (200,000) | 500,000 |
| LAI SUN MTN LTD LASUDE 5 07/28/26 | 200,000 | 1,050,000 | - | 1,250,000 |
| LENOVO GROUP LTD 5.875% 24APR2025 | 200,000 | - | (200,000) | - |
| NANYANG COMMERC NANYAN 6 1/2 PERP | 300,000 | - | (300,000) | - |
| RH INTL FINANCE LTD 6.5% 31DEC2049 | 600,000 | 300,000 | - | 900,000 |
| VEDANTA RESOURCE | - | 950,000 | (400,000) | 550,000 |
| YANLORD LAND HK YLLGSP 5 1/8 05/20/26 | - | 1,100,000 | - | 1,100,000 |
|  |  |  |  |  |
| **印度** |  |  |  |  |
| ADANI RENEW ENER ARENRJ 4 5/8 10/15/39 | - | 200,000 | - | 200,000 |
| JABABEKA INTL BV KIJAIJ 7 12/15/27 | 300,000 | 300,000 | - | 600,000 |
| KWG PROPERTY KWGPRO 0% 11/10/24 | 500,000 | - | (500,000) | - |
| MEDCO BELL MEDCIJ 6 3/8 01/30/27 | 300,000 | - | (300,000) | - |
|  |  |  |  |  |
| **印尼** |  |  |  |  |
| ALAM SUTERA REAL ASRIIJ 8 1/4 11/02/25 | 200,000 | - | (200,000) | - |
| CELESTIAL DYNASTY LTD 4.25% 27JUN2029 | 255,000 | - | (255,000) | - |
| DELHI INTL AIRPORT 6.125% 31OCT2026 | 200,000 | - | (200,000) | - |
| INDIKA INTI ENEG INDYIJ 8 3/4 05/07/29 | - | 600,000 | (250,000) | 350,000 |
| LONGFOR HOLDINGS LNGFOR 3.95 09/16/29 | - | 850,000 | - | 850,000 |

## 投资组合持仓变动表（未经审计）（续）

**截至2024年6月30日止六个月**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  | **截至2024年 1月1日** | **增添** | **出售** | **截至2024年6月30日** |
| **公司债券（续）** |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| **日本** |  |  |  |  |
| RAKUTEN GROUP RAKUTN 9 3/4 04/15/29 | - | 600,000 | - | 600,000 |
|  |  |  |  |  |
| **泽西岛** |  |  |  |  |
| WEST CHINA CEM WESCHI 4.95 07/08/26 | 200,000 | 200,000 | - | 400,000 |
|  |  |  |  |  |
| **毛里求斯** |  |  |  |  |
| DIAMOND II LTD RNW 7.95 07/28/26 | 200,000 | - | - | 200,000 |
|  |  |  |  |  |
| **蒙古** |  |  |  |  |
| MGM CHINA HOLDIN MGMCHI 5 7/8 05/15/26 | 500,000 | - | (500,000) | - |
| MODERNLAND OVERS MDLNIJ 6.95 04/13/24 | - | 1,350,000 | - | 1,350,000 |
|  |  |  |  |  |
| **荷兰** |  |  |  |  |
| MINEJESA CAPITAL MINCAP 5 5/8 08/10/37 | 200,000 | - | - | 200,000 |
|  |  |  |  |  |
| **巴基斯坦** |  |  |  |  |
| NETWORK I2I LTD FRN 31DEC2049 | 300,000 | - | (300,000) | - |
|  |  |  |  |  |
| **中国内地** |  |  |  |  |
| AGILE GROUP AGILE 5 1/2 04/21/25 | 500,000 | - | - | 500,000 |
| AGILE GROUP HOLDINGS LTD 6.05% 13OCT2025 | 300,000 | - | (300,000) | - |
| BANK OF EAST ASIA LTD FRN 31DEC2049 | 500,000 | 250,000 | (250,000) | 500,000 |
| BUKIT MAKMUR MAN DOIDIJ 7 3/4 02/10/26 | 300,000 | - | (300,000) | - |
| CA MAGNUM HLDING HEXWIN 5 3/8 10/31/26 | 400,000 | 200,000 | (400,000) | 200,000 |
| CAS CAPITAL NO1 CASHLD 4 PERP | 550,000 | - | - | 550,000 |
| CELESTIAL NWSZF 5 3/4 PERP | 200,000 | - | (200,000) | - |
| CFLD CAYMAN INV CHFOTN 0 01/31/31 | - | 50,000 | (50,000) | - |
| CFLD CAYMAN INV CHFOTN 9 07/31/21 | 1,000,000 | - | (1,000,000) | - |
| CFLD CAYMAN INVESTMENT 0.00% 31 JAN2031 | - | 1,000,000 | (1,000,000) | - |
| CHAMPION PATH SOCJOG 4 1/2 01/27/26 | 200,000 | - | (200,000) | - |
| CIFI HOLDINGS GROUP | 1,400,000 | - | (700,000) | 700,000 |
| EHI CAR SERVICES EHICAR 7 09/21/26 | 200,000 | 200,000 | - | 400,000 |
| EHI CAR SERVICES EHICAR 7 3/4 11/14/24 | - | 200,000 | (200,000) | - |
| ESTATE SKY LTD CSIPRO 5.45 07/21/25 | - | 200,000 | - | 200,000 |
| FORTUNE STAR FOSUNI 5 05/18/26 | 200,000 | - | - | 200,000 |
| FORTUNE STAR FOSUNI 5.05 01/27/27 | 500,000 | 600,000 | - | 1,100,000 |
| GLP PTE LTD GLPSP 4 1/2 PERP | - | 250,000 | (250,000) | - |
| GREENKO DUTCH BV GRNKEN 3.85 03/29/26 | 1,100,000 | - | (600,000) | 500,000 |
| GREENTOWN CHINA GRNCH 5.65 07/13/25 | - | 400,000 | - | 400,000 |
| HDFC BANK LTD HDFCB 3.7 PERP | 400,000 | - | (400,000) | - |
| HILONG HOLDING HILOHO 9 3/4 11/18/24 | 400,000 | - | (400,000) | - |
| HUARONG FINANCE HRAM 4 1/4 11/07/27 | 1,000,000 | - | (1,000,000) | - |
| ICBC LTD ICBCAS 3.2 PERP | 500,000 | - | (500,000) | - |
| ING GROEP NV INTNED 8 PERP | - | 200,000 | - | 200,000 |
| KAISA GROUP 0% 30JUN2099 | 550,000 | - | (550,000) | - |
| KAISA GROUP KAISAG 9 3/4 09/28/99 | 2,500,000 | - | (2,500,000) | - |
| KWG GROUP KWGPRO 5.95 08/10/25 | 250,000 | - | (250,000) | - |

## 投资组合持仓变动表（未经审计）（续）

**截至2024年6月30日止六个月**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  | **截至2024年 1月1日** | **增添** | **出售** | **截至2024年6月30日** |
| **公司债券（续）** |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| **中国内地（续）** |  |  |  |  |
| LI & FUNG LTD LIFUNG 5 1/4 12/29/49 | - | 2,450,000 | - | 2,450,000 |
| LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.25% 19JUN2024 | 200,000 | - | (200,000) | - |
| LOGAN GROUP CO LTD 0.00% 12JUL2025 | 750,000 | - | (750,000) | - |
| LS FINANCE 2017 LIHHK 4.8 06/18/26 | 400,000 | 800,000 | - | 1,200,000 |
| MELCO RESORTS MPEL 5 3/4 07/21/28 | 1,200,000 | - | (1,000,000) | 200,000 |
| MGM CHINA HOLDIN MGMCHI 5 1/4 06/18/25 | 200,000 | - | (200,000) | - |
| MONG DUONG FIN MONDFI 5 1/8 05/07/29 | 1,000,000 | - | (1,000,000) | - |
| MONGO MIN/ENG RE MONMIN 12 1/2 09/13/26 | 200,000 | 300,000 | - | 500,000 |
| NEW METRO GLOBAL FTLNHD 4 1/2 05/02/26 | 300,000 | 200,000 | - | 500,000 |
| NEW METRO GLOBAL FTLNHD 4 5/8 10/15/25 | 300,000 | - | (300,000) | - |
| NWD FINANCE (BVI) LTD FRN 31DEC2049 | 450,000 | 550,000 | - | 1,000,000 |
| NWD FINANCE(BVI) NWDEVL 4.8 PERP | - | 1,550,000 | (700,000) | 850,000 |
| RAKUTEN GROUP RAKUTN 11 1/4 02/15/27 | - | 400,000 | (400,000) | - |
| RENEW POWER PVT LTD 5.875% 05MAR2027 | 208,000 | - | (208,000) | - |
| RKPF OVRS 2020 A ROADKG 5 1/8 07/26/26 | 500,000 | 400,000 | (700,000) | 200,000 |
| SHUI ON DEVELOP SHUION 5 1/2 03/03/25 | 550,000 | 700,000 | (600,000) | 650,000 |
| SHUI ON DEVELOP SHUION 5 1/2 06/29/26 | - | 400,000 | - | 400,000 |
| SMC GLOBAL POWER SMCGL 5.95 PERP | 1,000,000 | 250,000 | (800,000) | 450,000 |
| STANDARD CHART STANLN 7 3/4 PERP | 500,000 | 300,000 | - | 800,000 |
| STUDIO CITY FIN STCITY 5 01/15/29 | 400,000 | - | (200,000) | 200,000 |
| STUDIO CITY FIN STCITY 6 07/15/25 | 300,000 | - | (300,000) | - |
| SUN HUNG KAI BVI SUNHKC 5 09/07/26 | 500,000 | 500,000 | - | 1,000,000 |
| SUNAC CHINA HLDG SUNAC 1 09/30/32 | 276,698 | - | (276,698) | - |
| SUNAC CHINA HLDG SUNAC 6 1/2 09/30/27 | 447,683 | 14,550 | - | 462,233 |
| SUNAC CHINA HLDG SUNAC 6 1/4 09/30/26 | 223,841 | - | (223,841) | - |
| SUNAC CHINA HLDG SUNAC 6 3/4 09/30/28 | 671,525 | 22,665 | (694,190) | - |
| THETA CAPITAL PTE LTD 8.125% 22JAN2025 | 250,000 | - | (250,000) | - |
| VANKE REAL ESTAT VNKRLE 3.975 11/09/27 | 200,000 | 400,000 | (200,000) | 400,000 |
| WANDA PROP GLOBA DALWAN 11 02/13/26 | - | 550,000 | (200,000) | 350,000 |
| WYNN MACAU LTD WYNMAC 5 1/2 01/15/26 | 1,300,000 | - | (1,000,000) | 300,000 |
|  |  |  |  |  |
| **新加坡** |  |  |  |  |
| CONTINUUM ENERGY COGREN 9 1/2 02/24/27 | 200,000 | - | - | 200,000 |
| GLP PTE LTD GLPSP 4.6 PERP | - | 600,000 | - | 600,000 |
| LLPL CAPITAL PTE LTD 6.875% 04FEB2039 | 200,000 | - | (200,000) | - |
| LMIRT CAPITAL LMRTSP 7 1/2 02/09/26 | - | 850,000 | (850,000) | - |
| MEDCO MAPLE TREE MEDCIJ 8.96 04/27/29 | 250,000 | - | - | 250,000 |
| MODERNLAND OVERS MDLNIJ 3 04/30/27 | - | 40,500 | (20,250) | 20,250 |
|  |  |  |  |  |
| **斯里兰卡** |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| **瑞士** |  |  |  |  |
| UBS GROUP UBS 7 3/4 PERP | - | 200,000 | (200,000) | - |
|  |  |  |  |  |
| **英国** |  |  |  |  |
| BARCLAYS PLC BACR 9 5/8 PERP | - | 200,000 | - | 200,000 |
| STANDARD CHART STANLN 4 3/4 PERP | - | 200,000 | - | 200,000 |

## 投资组合持仓变动表（未经审计）（续）

**截至2024年6月30日止六个月**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  | **截至2024年 1月1日** | **增添** | **出售** | **截至2024年6月30日** |
| **政府债券** |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| **蒙古** |  |  |  |  |
| MONGOLIA MONGOL 7 7/8 06/05/29 | 200,000 | - | (200,000) | - |
|  |  |  |  |  |
| **巴基斯坦** |  |  |  |  |
| REP OF PAKISTAN PKSTAN 6 7/8 12/05/27 | 1,600,000 | - | (400,000) | 1,200,000 |
| REP OF PAKISTAN PKSTAN 7 3/8 04/08/31 | - | 200,000 | - | 200,000 |
|  |  |  |  |  |
| **斯里兰卡** |  |  |  |  |
| REP OF SRI LANKA 0.00% 11MAY2027 | 2,400,000 | - | (400,000) | 2,000,000 |
|  |  |  |  |  |
| **美国** |  |  |  |  |
| STRIP PRINC 0% 15FEB2054 | - | 700,000 | - | 700,000 |
|  |  |  |  |  |
| **投资基金** |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| **香港** |  |  |  |  |
| INCOME PART RMB BOND-4A USDA | 32,500 | - | (32,500) | - |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |

## 抵押品持仓（未经审计）

**截至2024年6月30日**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **抵押品提供方** | **抵押品 性质** | **信用 评级** | **评级 机构** | **到期 期限** | **计价 货币** | **占抵押品 所覆盖资产 净值的比例(%)** | **抵押品价值 人民币** |
| 巴克莱银行 | 现金 | N/A | N/A | N/A | 美元 | 1.28% | 2,646,826 |
| 渣打银行 | 现金 | N/A | N/A | N/A | 美元 | 4.32% | 8,974,371 |
| 瑞银 | 现金 | N/A | N/A | N/A | 美元 | 0.00% | 169 |
| "KGI Securities (Singapore) Pte.Ltd." | 现金 | N/A | N/A | N/A | 美元 | 0.01% | 21,512 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |

**有关现金抵押品再投资的详情**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **进行再投资的 已收取现金抵押品** | **发行文件中指明的 最高金额** | **进行再投资的已收取现金 抵押品占发行文件中指明的 最高金额的比例** | **现金抵押品 再投资产生的回报** |
| - | N/A | - | - |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |

1. 经每月红利分配调整

   2 根据香港证监会适用于集合投资计划的广告宣传指引，份额类别的投资往绩记录超过6个月之后，可呈列业绩表现信息。 [↑](#footnote-ref-2)
2. 3 以人民币计的到期收益率适用于以美元计价（1A类）、美元计价（2A类）、人民币计价（2B类）、美元计价（2C类）、港元计价（2D类）、澳元计价（2E类）、新加坡元计价（2H类）、欧元计价（2J类）、美元计价（2XA类）和人民币计价（2XB类）的所有未对冲份额类别，因投资者面临人民币风险。在适用情况下，偿债日期用于计算可赎回债券的到期收益率（源自彭博）。 [↑](#footnote-ref-3)
3. 4 以美元计的到期收益率适用于以美元对冲计价（1E类）、澳元对冲计价（2F类）、美元对冲计价（2G类）、新加坡元对冲计价（2I类）、欧元对冲计价（2K类）、港元对冲计价（2L类）、人民币计价（美元敞口）（2X类）、美元计价（2XG类）的  
   所有已对冲份额类别，因投资者不面临人民币风险。在适用情况下，偿债日期用于计算可赎回债券的到期收益率（源自彭博）。 [↑](#footnote-ref-4)