

百达香港

未经审计半年度报告

瑞士百达策略收益

2022年10月1日至2023年3月31日止期间

瑞士百达亚洲债券收益

2022年10月1日至2023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	2-5
财务状况表(未经审计)	6-7
综合收益表(未经审计)	8-9
归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)	10-14
现金流量表(未经审计)	15-16
投资组合(未经审计)	17-28
投资组合持有变动表(未经审计)	29-30
衍生金融工具详情(未经审计)	31-33
分配披露(未经审计)	34-38
业绩记录(未经审计)	39-43

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

百达策略收益

回顾 2022 年，形容该年是“动荡”的一年也不足以概述全年整体经济形势。去年，全球市场和资产类别饱受央行紧缩政策、通货膨胀、新冠疫情挑战、中国去杠杆化和对科技领域的监管、战争等多重影响。高盛的数据显示，按 12 个月的滚动基础计算，股票和债券的回报率均为负数，在过去 96 年历史当中，出现这种情况的概率仅为 2%！2022 年正属此类情况，全球大多数资产价格暴跌。60/40 比例的投资组合要实现收益也变得异常艰难。

然而，如果有人认为 2022 年的动荡只是暂时性的，2023 年将会迎来峰回路转，那么这种美好的愿景恐怕会落空。事实上，2023 年第一季度经济形势仍持续“动荡”。

- 年初形势的确大为好转。通胀放缓、过度看跌的投资持仓、加息接近尾声的预期以及中国突然放弃“动态清零”政策彻底扭转了市场趋势。1 月，股市回升。
- 2 月，粘性通胀再次引发担忧。美国国债收益率上升，美国 2 年期国债收益率逼近 5%，10 年期国债收益率逼近 4%。各资产类别的门槛收益率也因此有所提高，使市场变得疲弱。
- 3 月，银行系统面临崩溃威胁，老牌银行发生挤兑，硅谷银行、Signature Bank 和瑞士信贷倒闭，近似上世纪三十年代经济大萧条时期的银行危机。美国联邦存款保险公司的保障是否有效以及股票、债券和额外一级资本债券的资本结构是否稳定备受关注。

与此同时，其它问题仍未解决：

- 俄乌冲突仍在持续，而且很可能会延续一段时间。
- 华尔街流传着一种说法，谓美联储将持续收紧货币政策，直至有事发生。摩根大通的 Jamie Dimon 认为，目前银行业危机尚未结束，其产生的余波将持续数年。
- “全球化带来的喜悦”(happy globalization)已结束。集团政治愈加根深蒂固。鉴于全球经济面临通胀压力，石油输出国组织决定减产。
- 气候紧急状态、新冠疫情后续影响等挑战亟待解决。

尽管第一季度经济形势持续“动荡”，但主要资产类别的收益率呈积极回升趋势。美国国债上涨 3.3%，标准普尔 500 指数上涨 7.5%。市场广度持续偏低，只有个别大盘股领先市场。

百达策略收益认为今年有几个投资主题值得关注。

2023 年不同于 2022 年。货币供应量和通胀控制已取得进展。美联储在新冠疫情期间猛踩油门，现在却猛力刹车。我们的流动性研究显示，新冠疫情期间货币供应量超过趋势的 20%。但这一情况正在逆转（且货币供应量可能大幅降低）。这与 2022 年的情况明显不同。因此，尽管存在挑战，投资者应继续投资，尤其是继续投资于特定投资主题和概念。

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)

百达策略收益

我们认为，市场应关注阿尔法(Alpha)收益而非贝塔(Beta)收益，比起广泛的市场风险，投资者应聚焦特定投资主题和概念。去年，受宏观经济和地缘政治影响，投资市场一蹶不振，但正如我们“2023年！=2022年”主题所提及的，我们认为今年会截然不同。长期性、周期性和收益性相关的投资主题或将有突出表现。

我们着重关注以下投资主题。

- 科技创新颠覆领域。以人工智能为例，我们将关注点缩小至关键竞争优势，如基础技术、计算能力、数据，以及垂直产业领域。这些领域蕴藏大量机会，但百达策略收益并不是风投基金。对我们来说，实际最佳的风险回报机会集中在少数几个市场领先的资产类别之中。我们瞄准在各自领域中最具创新性和领先技术的优质公司。一直以来，我们都认为半导体是现代科技发展的根基。
- 粮食和能源自主将会成为日益重要的投资主题。工业动员以及国家层面的“可持续性发展”可能会成为热门的投资主题。毕竟没有国家安全，就谈不上可持续发展。
- 中国的重新开放也是本年的一大投资主题。尽管出现了一些小波折，但中国的经济将持续复苏。
- 优质公司将一骑绝尘。去年，投资者盲目抛售投资资产，市场上不分青红皂白，纷纷低估了商业模式、现金流和资产负债表等重要因素。从宏观和流动性角度出发，我们极为倾向优质的自筹资金公司，规避低质信贷，去繁从简。
- 美国国债的利率吸引，我们认为投资者可把握当下的投资机会。正如汇丰银行的 Steven Major 所说，美国 10 年期国债提供 5 年 5% 的利率和 5 年 3% 的利率，极具吸引力。我们固定收益投资组合的信贷风险敞口很低。目前，我们正致力于构建更为均衡的投资组合，以期在各种经济环境下实现投资回报。

瑞士百达资产管理(香港)有限公司
2023 年 5 月 25 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

过去六个月，市场聚焦中国重新开放。中国的重新开放至关重要，其影响终将惠及周边国家和地区。摩根大通亚洲信用指数企业指数显示，亚洲的信贷市场表现良好。2022年10月至2023年3月期间，摩根大通亚洲信用指数企业指数回报率为5.85%。

2022年第四季度开始，悲观情绪笼罩中国，并在10月份举行中国共产党全国代表大会时达到顶峰。然而，中国随后采取的积极措施彻底扭转了这种情绪：中国国家主席习近平在巴厘岛峰会上同美国总统拜登举行会晤，中方推出多项重要举措以进一步支持房地产行业，并较预期更早地宣布结束“动态清零”政策，在新年前后重启经济。这些举措为中国和周边带来积极正面影响，在广泛意义上增强了投资者承担风险的意愿。

乐观情绪一直持续到2023年初，但在美国的持续通胀再次主导市场的阴霾下戛然而止，并导致对美联储上调最终利率的预期不断高涨。美联储主席鲍威尔似乎验证了这一点，他在半年度国会听证会中表示美联储将准备调升加息的步伐。随着美国硅谷银行倒闭和瑞士信贷的大量存款外流，这一切又迅速发生了变化，投资者对银行业是否稳健的担忧浮出水面。最终，瑞银收购了瑞士信贷，并减记了瑞士信贷的额外一级资本债券(AT1)，这对全球次级银行债券造成冲击。它导致了美国国债止跌回升、信贷利差扩大，但由于国债占市场主导地位，因此市场的整体业绩表现尚算强韧。

从地区来看，中国和韩国表现不佳，而印度尼西亚和香港表现最好。从行业来看，尽管发达市场的金融业遭到抛售，但金融业却不是业绩表现最差的行业，反而是房地产业。

投资组合回顾

在过去6个月中，本基金的业绩表现低于基准，即低于摩根大通亚洲信用指数企业指数。

影响业绩表现的主要因素是我们对中国房地产、印度基础设施和金属与采矿业，以及中国、韩国和香港金融业的配置，以及对台湾产业类的配置较低。

造成负面影响的因素如下：

中国方面，房地产和金融业严重影响了我们过去六个月的整体表现。我们在夏末有选择地增持了一些房地产公司投资，其中旭辉集团在秋季面临巨大压力，出现了亏损，我们随即撤销了对该集团的所有投资。11月，中国进一步实施多种支持措施，我们随后再次增加房地产投资。该增持在2022年底和2023年初表现良好，但较1月的高点，房地产于2月和3月出现了回调，导致我们损失了部分之前收益。在中国表现最好的是科技互联网行业，我们自年初就开始增持该行业。随着阿里巴巴的发展，该行业的前景愈加明朗，我们也在最近的上涨中减持了对该行业的一些长线投资。

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

印度方面，基础设施行业的损失来源于我们对阿达尼港口的投资敞口。2月初，因阿达尼港口公司的基本面较好，我们从阿达尼可再生能源公司转投了阿达尼港口公司的债券；此后该债券一直在一定区间波动。同时，由于我们对印度金属和采矿业的投资比重较低，错过了提振业绩的机会。

最近，继硅谷银行事件和瑞士信贷事件后，发达市场金融业动荡不安，使得我们于当地金融业的投资面临一定压力，但目前已开始恢复。硅谷银行事件和瑞士信贷事件初期，我们超配了少量AT1债券，主要是渣打银行的AT1债券，也有一些如泰国开泰银行等其他银行的AT1债券。我们目前对所持AT1债券暂无顾虑，但为更接近基准指数已予以减持。我们的基金中剩余AT1债券的风险敞口约为3%，而基准指数中为4.6%。

产生正面影响的因素如下：

我们对印尼的投资超配表现良好，特别是石油和天然气行业、互联网行业和房地产行业。例如，我们对印尼石油和天然气公司Pertamina的超配，成为了过去六个月业绩向好的重大贡献因素。

中国重新开放后，我们增持了香港消费（零售）业和房地产行业，以抓住中国内地游客来港旅游带来的增长收益，事实证明这对业绩产生了积极影响。随着市场趋于稳定和美联储加息周期结束，我们认为我们在中国内地/香港地区的投资敞口将进一步恢复。事实上，得益于当地旅游业的增长，我们对澳门博彩业和马来西亚零售业的投资也为业绩作出了积极贡献。

市场前景

我们对亚洲信用市场仍持乐观态度。我们了解到目前亚洲的居民消费价格指数低于预期，各地央行已开始暂停加息周期。例如，印度的通胀率在3月份已放缓至印度储备银行的目标范围内，这一举动证实了我们的观点，即货币政策委员会可能在未来一段时间内保持不变。在马来西亚，马来西亚国家银行首先暂停加息，随着经济势头的放缓，我们认为暂停加息的期间可能会延长甚至降息。

在中国，随着出口和制造业相继出现疲软迹象，中国人民银行持续维持宽松的流动性，并于上月下调存款准备金率。另一方面，在岸流动性已恢复到2019年的水平，服务行业从中受益，正呈现强劲复苏势头。虽然尚在初期阶段，但房地产行业显示出令人鼓舞的复苏迹象，3月销售同比大幅增长，居民对房价的预期也转向积极。

即使美国的利率还会轻微上调，但美联储现处于紧缩状态的后期阶段，这应该会导导致中期利率波动率有所下降。目前亚洲信贷收益率极具吸引力，且技术面有利，供应量虽高于2022年，但整体供应量仍维持较低水平。中国复苏相关的投资主体或将支持该地区的经济发展。

瑞士百达资产管理(香港)有限公司
2023年5月25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 2023 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

	2023 年 3 月 31 日	2022 年 9 月 30 日
	(美元)	(美元)
资产		
投资	276,277,721	268,813,693
衍生金融资产	311,008	15,502
应收认购款	140,800	16,068
应收经纪款	738,098	256,723
应收股息	186,469	132,905
应收银行利息	20,342	1,423
应收投资利息	492,372	889,297
其他应收款	141,898	142,798
保证金	885,766	1,182,942
现金及现金等价物	<u>18,413,410</u>	<u>17,324,275</u>
总资产	<u>297,607,884</u>	<u>288,775,626</u>
负债		
衍生金融负债	157,342	1,651,195
应付赎回款	1,470,519	622,602
应付经纪款	5,004,941	294,585
其他应付款	<u>547,329</u>	<u>552,810</u>
负债(不包括归属于份额持有人的净资产)	<u>7,180,131</u>	<u>3,121,192</u>
归属于份额持有人的净资产	<u>290,427,753</u>	<u>285,654,434</u>
已发行的份额数目		
- P 每月派息 美元	12,089,619.3067	13,368,461.8378
- P 每月派息 港元	89,755,364.6017	97,104,120.9363
- HP 每月派息 人民币	25,190,380.2045	27,191,093.9675
- HP 每月派息 澳元	6,388,167.2529	6,535,929.5889
- HM 人民币	473,555.5900	472,762.1200
- I 每月派息 美元	429,844.8252	429,844.8252
- I 累计 美元	155,391.1752	155,391.1752
- HI 每月派息 新加坡元	308,768.9210	308,768.9210
- HI 累计 新加坡元	250,076.2320	338,592.3640
- P 每月派息3 美元	600.0000	600.0000
- P 每月派息3 港元	40,768.2840	40,768.2840
- HP 每月派息3 人民币	3,000.0000	3,000.0000

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 2023 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

	2023 年 3 月 31 日	2022 年 9 月 30 日
	(美元)	(美元)
资产		
投资	38,337,872	24,280,878
衍生金融资产	971	1,591
应收认购款	-	92,794
应收经纪款	630,504	-
应收银行利息	2,097	53
应收投资利息	436,194	298,960
其他应收款	27,884	32,955
保证金	247,818	147,060
现金及现金等价物	<u>1,212,183</u>	<u>2,036,808</u>
总资产	<u>40,895,523</u>	<u>26,891,099</u>
负债		
衍生金融负债	18,208	106,433
应付赎回款	3,296,525	93,731
应付经纪款	981,420	445,696
应付成立费用	28,730	33,800
其他应付款	<u>60,805</u>	<u>53,965</u>
负债(不包括归属于份额持有人的净资产)	<u>4,385,688</u>	<u>733,625</u>
归属于份额持有人的净资产	<u>36,509,835</u>	<u>26,157,474</u>
已发行的份额数目		
- P 每月派息 美元	770,368.6124	839,380.0374
- P 每月派息 港元	774,761.2914	834,117.2344
- HP 每月派息 人民币	465,952.1191	174,547.3568
- HP 每月派息 澳元	146,827.3640	134,197.2190
- I 每月派息 美元	1,352,485.3166	1,076,253.0200
- I 累计 美元	1,810,416.0000	884,000.0000
- HI 累计 新加坡元	478,053.8770	550,796.7288

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 2023 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间	2021 年 10 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日期间
	(美元)	(美元)
收益		
股息收入	1,211,026	1,421,147
银行存款利息收益	145,943	820
投资利息收益	1,608,475	503,099
投资与衍生金融工具公允价值的净变动	37,205,056	(12,721,863)
汇兑净损失	(526,493)	(372,519)
已收佣金回扣	1,756	3,021
总投资利润/(亏损)	39,645,763	(11,166,295)
开支		
管理费用 ^{注2}	1,994,170	2,482,861
受托人费用 ^{注1}	137,915	168,834
交易成本 ^{注1}	128,220	268,771
托管费和银行手续费 ^{注1}	68,032	56,399
核数师酬金	19,488	15,998
法律及专业服务费	4,439	5,777
其他运营费用 ^{注1}	46,382	39,715
营业费用总额	2,398,646	3,038,355
经营利润/(亏损)	37,247,117	(14,204,650)
财务成本		
利息支出 ^{注1}	(2)	(11,440)
对份额持有人派发股息	(9,306,973)	(9,259,585)
收益分配后及税前利润/(亏损)	27,940,142	(23,475,675)
股息收入预扣税	(137,765)	(305,670)
归属于份额持有人的净资产增加/(减少)	27,802,377	(23,781,345)

^{注1}截至 2023 年 3 月 31 日和 2022 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：

	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间	2021 年 10 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日期间
交易成本	26,875	53,475
其他运营费用	17,968	15,964
利息支出	2	4,013

^{注2}截至 2023 年 3 月 31 日和 2022 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 2023 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间	2021 年 10 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日期间
	(美元)	(美元)
收益		
银行存款利息收益	9,973	21
投资利息收益	729,966	667,819
投资与衍生金融工具公允价值的净变动	1,322,862	(3,491,181)
汇兑净损失	(245)	(337)
其他收益	1,048	-
总投资利润/(亏损)	<u>2,063,604</u>	<u>(2,823,678)</u>
开支		
管理费用 ^{注2}	104,693	111,843
受托人费用 ^{注1}	35,871	35,627
托管费和银行手续费 ^{注1}	9,103	7,864
核数师酬金	16,599	15,499
法律及专业服务费	-	2,065
成立费	5,070	5,070
其他运营费用 ^{注1}	21,805	22,675
营业费用总额	<u>193,141</u>	<u>200,643</u>
经营利润/(亏损)	<u>1,870,463</u>	<u>(3,024,321)</u>
财务成本		
利息支出 ^{注1}	(8,251)	-
对份额持有人派发股息	(650,867)	(592,922)
归属于份额持有人的净资产增加/(减少)	<u>1,211,345</u>	<u>(3,617,243)</u>

^{注1}截至 2023 年 3 月 31 日和 2022 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：

	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间	2021 年 10 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日期间
其他运营费用	18,612	19,808
利息支出	751	-

^{注2}截至 2023 年 3 月 31 日和 2022 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 2023 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间	2021 年 10 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日期间
	(美元)	(美元)
期初余额	285,654,434	305,271,891
分配份额	7,255,845	151,834,747
赎回份额	<u>(30,284,903)</u>	<u>(51,363,757)</u>
份额交易净(减少)/增加(23,029,058)100,470,990
归属于份额持有人的净资产增加/(减少)27,802,377(23,781,345)
期末余额	<u>290,427,753</u>	<u>381,961,536</u>
已发行份额数目	2023 年 份额	2022 年 份额
P 每月派息 美元份额		
期初已发行份额	13,368,461.8378	9,233,691.9242
已分配份额	256,862.3355	5,826,999.1255
已赎回份额	<u>(1,535,704.8666)</u>	<u>(1,271,187.1695)</u>
期末已发行份额	<u>12,089,619.3067</u>	<u>13,789,503.8802</u>
P 每月派息 港元份额		
期初已发行份额	97,104,120.9363	81,336,356.0050
已分配份额	1,600,546.6078	33,510,989.1518
已赎回份额	<u>(8,949,302.9424)</u>	<u>(11,834,628.2538)</u>
期末已发行份额	<u>89,755,364.6017</u>	<u>103,012,716.9030</u>
HP 每月派息 人民币份额		
期初已发行份额	27,191,093.9675	22,154,763.3018
已分配份额	826,821.7750	9,183,596.0179
已赎回份额	<u>(2,827,535.5380)</u>	<u>(3,629,053.9621)</u>
期末已发行份额	<u>25,190,380.2045</u>	<u>27,709,305.3576</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 2023 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

已发行份额数目(续)	2023 年 份额	2022 年 份额
HP 每月派息 澳元份额		
期初已发行份额	6,535,929.5889	6,028,093.2580
已分配份额	374,854.6197	2,322,898.0247
已赎回份额	(522,616.9557)	(1,772,588.6520)
期末已发行份额	<u>6,388,167.2529</u>	<u>6,578,402.6307</u>
HM 人民币份额		
期初已发行份额	472,762.1200	505,212.1900
已分配份额	94,912.1000	181,538.8200
已赎回份额	(94,118.6300)	(178,698.5700)
期末已发行份额	<u>473,555.5900</u>	<u>508,052.4400</u>
I 每月派息 美元份额		
期初已发行份额	429,844.8252	300,799.3387
已分配份额	-	104,056.1070
已赎回份额	-	-
期末已发行份额	<u>429,844.8252</u>	<u>404,855.4457</u>
I 累计 美元份额		
期初已发行份额	155,391.1752	-
已分配份额	-	177,137.6900
已赎回份额	-	(19,656.6903)
期末已发行份额	<u>155,391.1752</u>	<u>157,480.9997</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 2023 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

已发行份额数目(续)	2023 年 份额	2022 年 份额
HI 每月派息 新加坡元份额		
期初已发行份额	308,768.9210	232,000.0000
已分配份额	-	76,768.9210
已赎回份额	-	-
期末已发行份额	<u>308,768.9210</u>	<u>308,768.9210</u>
HI 累计 新加坡元份额		
期初已发行份额	338,592.3640	130,000.0000
已分配份额	-	208,592.3640
已赎回份额	(88,516.1320)	-
期末已发行份额	<u>250,076.2320</u>	<u>338,592.3640</u>
P 每月派息 3 美元份额		
期初已发行份额	600.0000	-
已分配份额	-	-
已赎回份额	-	-
期末已发行份额	<u>600.0000</u>	<u>-</u>
P 每月派息 3 港元份额		
期初已发行份额	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>-</u>
HP 每月派息 3 人民币份额		
期初已发行份额	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>-</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 2023 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间	2021 年 10 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日期间
	(美元)	(美元)
期初余额	26,157,474	37,566,723
分配份额	16,663,912	683,085
赎回份额	<u>(7,522,896)</u>	<u>(4,749,923)</u>
份额交易净增加/(减少)	..9,141,016	..(4,066,838)
归属于份额持有人的净资产增加/(减少)	1,211,345	(3,617,243)
期末余额	<u>36,509,835</u>	<u>29,882,642</u>
	2023 年 份额	2022 年 份额
已发行份额数目		
P 每月派息 美元份额		
期初已发行份额	839,380.0374	1,202,493.1330
已分配份额	-	34,659.6547
已赎回份额	<u>(69,011.4250)</u>	<u>(369,449.7006)</u>
期末已发行份额	<u>770,368.6124</u>	<u>867,703.0871</u>
P 每月派息 港元份额		
期初已发行份额	834,117.2344	1,725,018.1380
已分配份额	-	-
已赎回份额	<u>(59,355.9430)</u>	<u>(753,080.7046)</u>
期末已发行份额	<u>774,761.2914</u>	<u>971,937.4334</u>
HP 每月派息 人民币份额		
期初已发行份额	174,547.3568	122,061.7790
已分配份额	306,096.8223	-
已赎回份额	<u>(14,692.0600)</u>	<u>-</u>
期末已发行份额	<u>465,952.1191</u>	<u>122,061.7790</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 2023 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

已发行份额数目(续)	2023 年 份额	2022 年 份额
HP 每月派息 澳元份额		
期初已发行份额	134,197.2190	150,934.8300
已分配份额	12,630.1450	28,938.1354
已赎回份额	-	(65,568.1354)
期末已发行份额	<u>146,827.3640</u>	<u>114,304.8300</u>
I 每月派息 美元份额		
期初已发行份额	1,076,253.0200	1,057,277.7470
已分配份额	1,009,232.2966	18,975.2730
已赎回份额	(733,000.0000)	-
期末已发行份额	<u>1,352,485.3166</u>	<u>1,076,253.0200</u>
I 累计 美元份额		
期初已发行份额	884,000.0000	887,968.6080
已分配份额	1,028,928.0000	-
已赎回份额	(102,512.0000)	(3,968.6080)
期末已发行份额	<u>1,810,416.0000</u>	<u>884,000.0000</u>
HI 累计 新加坡元份额		
期初已发行份额	550,796.7288	552,302.0080
已分配份额	-	-
已赎回份额	(72,742.8518)	(1,505.2792)
期末已发行份额	<u>478,053.8770</u>	<u>550,796.7288</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 2023 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间	2021 年 10 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日期间
	(美元)	(美元)
经营活动产生的现金流量		
归属于份额持有人的净资产增加/(减少)	27,802,377	(23,781,345)
调整:		
股息收入	(1,211,026)	(1,421,147)
银行存款利息收益	(145,943)	(820)
投资利息收益	(1,608,475)	(503,099)
利息支出	2	11,440
股息收入预扣税	137,765	305,670
对份额持有人派发股息	9,306,973	9,259,585
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	(9,253,387)	(84,131,589)
应收经纪款(增加)/减少	(481,375)	5,516,906
其他应收款减少	900	1,103
保证金减少	297,176	944,580
应付经纪款增加/(减少)	4,710,356	(2,706,584)
其他应付账款(减少)/增加	(5,481)	1,715,088
已收股息(扣除已付预扣税)	1,019,697	1,053,913
已收银行存款利息	127,024	492
已收投资利息	2,005,400	382,353
已付利息	(2)	(11,440)
经营活动现金流入/(流出)净额	<u>32,701,981</u>	<u>(93,364,894)</u>
融资活动产生的现金流量		
分配份额所得款项	7,131,113	154,797,415
赎回份额付款	(29,436,986)	(51,771,721)
已付收益分配	(9,306,973)	(9,259,585)
融资活动现金(流出)/流入净额	<u>(31,612,846)</u>	<u>93,766,109</u>
现金及现金等价物之增加	1,089,135	401,215
期初现金及现金等价物	17,324,275	28,257,004
期末现金及现金等价物	<u>18,413,410</u>	<u>28,658,219</u>
现金及现金等价物余额分析		
银行存款	<u>18,413,410</u>	<u>28,658,219</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(未经审计)(续)

截至 2023 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

	2022 年 10 月 1 日至 2023 年 3 月 31 日期间	2021 年 10 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日期间
	(美元)	(美元)
经营活动产生的现金流量		
归属于份额持有人的净资产增加/(减少)	1,211,345	(3,617,243)
调整:		
银行存款利息收益	(9,973)	(21)
投资利息收益	(729,966)	(667,819)
利息支出	8,251	-
对份额持有人派发股息	650,867	592,922
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)/减少	(14,144,599)	8,908,884
应收经纪款(增加)/减少	(630,504)	3,488,232
其他应收款减少	5,071	5,070
保证金增加	(100,758)	(28,545)
应付经纪款增加	535,724	696,778
应付成立费用减少	(5,070)	(5,070)
其他应付账款增加/(减少)	6,840	(18,441)
已收银行存款利息	7,929	15
已收投资利息	592,732	822,330
已付利息	(8,251)	-
经营活动现金(流出)/流入净额	<u>(12,610,362)</u>	<u>10,177,092</u>
融资活动产生的现金流量		
分配份额所得款项	16,756,706	683,085
赎回份额付款	(4,320,102)	(8,877,221)
已付收益分配	(650,867)	(592,922)
融资活动现金流入/(流出)净额	<u>11,785,737</u>	<u>(8,787,058)</u>
现金及现金等价物之(减少)/增加	(824,625)	1,390,034
期初现金及现金等价物	2,036,808	2,270,655
期末现金及现金等价物	<u>1,212,183</u>	<u>3,660,689</u>
现金及现金等价物余额分析		
银行存款	<u>1,212,183</u>	<u>3,660,689</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)

于 2023 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 2.21%				
	BHP Group Ltd	101,000	3,194,862	1.10
	Goodman Group Stapled Sec Ord Npv	59,003	742,529	0.25
	Rio Tinto Limited Ord Npv	31,000	2,494,377	0.86
			6,431,768	2.21
加拿大 0.96%				
	Barrick Gold Corporation	76,600	1,420,101	0.49
	Enbridge Inc Com Npv	36,000	1,370,732	0.47
			2,790,833	0.96
开曼群岛 5.74%				
	Alibaba Group Holding Ltd Ord (每股面值 0.000003125 美元)	280,300	3,585,006	1.23
	Chailease Holdings Co Ltd Ord(每股面值 10 台币)	13,521	99,251	0.04
	China Lesso Group Holdings Ltd Ord(每股面值 0.05 港元)	72,000	64,388	0.02
	China Resources Land Limited(每股面值 0.1 港元)	136,000	620,233	0.21
	JD.Com Inc - Cl A Ord (每股面值 0.00002 美元)	62,300	1,365,053	0.47
	Meituan Dianping Ord(每股面值 0.00001 港元)	138,330	2,528,724	0.87
	Netease.Com Inc ADR(1 份 ADR 代表 25 份普通股)	15,900	1,406,196	0.48
	Shenzhou International Group Ord(每股面值 0.1 港元)	21,000	220,435	0.08
	Silergy Corp Ord Npv	33,000	519,698	0.18
	Tencent Hldgs Ltd(每股面值 0.0002 港元)	127,900	6,285,877	2.16
			16,694,861	5.74

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 2023 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)				
中国 3.60%				
	百度集团-A 股普通股 (每股面值 0.000000625 美元)	150,800	2,856,574	0.98
	中国招商银行 H 股普通股 (每股面值 1 人民币)	52,000	265,632	0.09
	华润万象生活有限公司普通股 (每股面值 0.00001 港元)	176,800	929,051	0.32
	宁德时代新能源科技股份有限公司深港通普通股 (每股面值 1 人民币)	2,500	147,820	0.05
	恒生电子股份有限公司 CC 普通股 (每股面值 1 人民币)	16,640	128,956	0.04
	信达生物制药普通股 (每股面值 0.00001 港元)	153,000	685,094	0.24
	江苏洋河酒厂股份有限公司-A 股普通股 (每股面值 1 人民币) (深港通)	5,900	142,154	0.05
	贝壳开曼公司 ADR (1 份 ADR 代表 3.0000 份普通股)	6,655	125,380	0.04
	贵州茅台酒股份有限公司 CC 普通股 (每股面值 1 人民币)	600	159,015	0.06
	美的集团股份有限公司深港通普通股 (每股面值 1 人民币)	30,200	236,638	0.08
	明阳智慧能源集团股份有限公司-A 股 CC	36,900	120,953	0.04
	国电南瑞科技股份有限公司-A 股普通股 (每股面值 1 人民币)	27,200	107,377	0.04
	拼多多控股公司-ADR (1 份 ADR 代表 4 份普通股)	30,399	2,307,284	0.79
	平安银行股份有限公司深港通普通股 (每股面值 1 人民币)	49,500	90,317	0.03
	中国平安保险(集团)股份有限公司 H 股 (每股面值 1 港元)	271,000	1,764,100	0.61
	深圳迈瑞生物医疗电子股份有限公司深港通普通股 (每股面值 1 人民币)	3,753	170,350	0.06
	阳光电源股份有限公司-A 股普通股 (每股面值 1 人民币) (深港通)	7,300	111,467	0.04
	携程集团有限公司普通股 (每股面值 0.001250000 美元)	2,900	108,538	0.04
			10,456,700	3.60
英属格恩西岛 0.23%				
	Tufton Oceanic Assets Ltd Ord Npv	582,865	670,295	0.23
			670,295	0.23
香港 0.95%				
	友邦保险控股有限公司	210,800	2,219,456	0.76
	香港交易及结算所有限公司普通股 (每股面值 1 港元)	12,200	541,155	0.19
			2,760,611	0.95
印度尼西亚 0.06%				
	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk Ord (每股面值 50 印尼盾)	554,910	175,046	0.06
			175,046	0.06
日本 0.94%				
	Hoya Corporation	9,800	1,072,116	0.37
	Shin-Etsu Chemical Company Limited Com Npv	42,500	1,365,148	0.47
	Sumco Corporation	20,300	302,159	0.10
			2,739,423	0.94

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 2023 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)				
韩国 2.26%				
	LG Chemical Ord (每股面值 5,000 韩元)	237	129,619	0.04
	Samsung Electronics Co Ltd Gdr (1/2 表决权股份)	4,420	5,429,970	1.87
	Samsung Electronics Co Ltd Ord (每股面值 100 韩元)	14,933	734,118	0.25
	Samsung Electronics Company Limited Preference Shares (每股面值 100 韩元)	1,848	76,512	0.03
	SK Hynix Inc Ord (每股面值 5,000 韩元)	1,748	118,964	0.04
	S-Oil Corp Ord (每股面值 2,500 韩元)	1,289	79,309	0.03
			<u>6,568,492</u>	<u>2.26</u>
荷兰 1.24%				
	ASM International Ord (每股面值 0.04 欧元)	3,900	1,575,798	0.54
	ASML Holding Nv - Ny Reg Shs (每股面值 0.09 欧元) (1 份 ADR 代表 1 份普通股)	3,000	2,042,130	0.70
			<u>3,617,928</u>	<u>1.24</u>
新西兰 0.90%				
	Auckland International Airport	393,000	2,139,160	0.74
	Freightways Group Ltd Ord Npv	82,000	484,816	0.16
			<u>2,623,976</u>	<u>0.90</u>
新加坡 0.04%				
	Singapore Telecommunications Ltd Ord Npv	62,800	116,196	0.04
			<u>116,196</u>	<u>0.04</u>
台湾 4.25%				
	联发科技股份有限公司	55,000	1,421,627	0.49
	台湾积体电路制造公司	454,000	7,947,516	2.73
	台湾积体电路制造公司 Spd Adr	11,800	1,097,636	0.38
	联华电子股份有限公司普通股 (每股面值 10 台币)	1,083,000	1,881,623	0.65
			<u>12,348,402</u>	<u>4.25</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 2023 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 28.79%				
	Adobe Inc Com (每股面值 0.0001 美元)	1,600	616,592	0.21
	Advanced Micro Devices Inc	94,800	9,291,348	3.20
	Alphabet Inc-Cl A Com (每股面值 0.001 美元)	91,000	9,439,430	3.25
	Amazon Com Inc Com (每股面值 0.01 美元)	85,500	8,831,295	3.04
	Apple Inc Com Npv	54,980	9,066,202	3.12
	Applied Materials Inc Com (每股面值 0.01 美元)	7,320	899,116	0.31
	Bank of America Corporation	14,200	406,120	0.14
	Boeing Co (1987 年 8 月 7 日至 1997 年 8 月 7 日期间 享有优先股购买权)	3,000	637,290	0.22
	Chevron Corp Com (每股面值 0.75 美元)	21,600	3,524,256	1.21
	Coca-Cola Co/The Com (每股面值 0.25 美元)	4,284	265,736	0.09
	Costco Wholesale Corporation	330	163,967	0.05
	Deere And Co	330	136,250	0.05
	Exxon Mobil Corporation	31,000	3,399,460	1.17
	Home Depot Inc Com (每股面值 0.05 美元)	400	118,048	0.04
	JPMorgan Chase And Co Com (每股面值 1 美元)	2,600	338,806	0.12
	KLA Corp Com (每股面值 0.001 美元)	1,800	718,506	0.25
	Lam Research Corporation	1,160	614,939	0.21
	Lockheed Martin Corporation	1,400	661,822	0.23
	Mastercard Incorporated A Shrs Com (每股面值 0.0001 美元)	3,200	1,162,912	0.40
	Meta Platforms Inc Com (每股面值 0.000006 美元)	37,300	7,905,362	2.72
	Microsoft Corp	33,483	9,653,149	3.32
	Morgan Stanley Com (每股面值 0.01 美元)	4,100	359,980	0.12
	Nvidia Corporation	32,390	8,996,970	3.10
	Raytheon Technologies Corporation	6,600	646,338	0.22
	Salesforce.Com Inc	14,300	2,856,854	0.98
	Simon Property Group Inc	4,100	459,077	0.16
	Synopsys Inc Com (每股面值 0.01 美元)	3,900	1,506,375	0.52
	Visa Inc Com Cl A	2,500	563,650	0.19
	Wells Fargo & Co Com (每股面值 1.666 美元)	11,700	437,346	0.15
			83,677,196	28.79

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 2023 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
固定收益				
美国 31.36%				
	美国国库 1.125% 15/01/2033	30,300,000	30,368,206	10.45
	美国国库 1.75% 15/03/2025	3,200,000	3,061,688	1.05
	美国国库 3% 30/06/2024	13,300,000	13,066,731	4.50
	美国国库 3.5% 15/02/2033	2,860,000	2,865,585	0.99
	美国国库 3.625% 15/02/2053	3,000,000	2,978,672	1.02
	美国国库 4.125% 15/11/2032	1,300,000	1,366,625	0.47
	美国国库证券 4.75% 15/02/2041	4,000,000	4,560,470	1.57
	美国国库浮动利率债券 31/10/2024	16,880,000	16,878,937	5.81
	美国国库 N/B 2.625% 30/06/2023	8,100,000	8,060,112	2.77
	美国国库 N/B 2.875% 30/09/2023	8,000,000	7,930,816	2.73
			91,137,842	31.36
浮动收益				
美国 0.98%				
	JPMorgan Chase & Co Var 26/04/2033	2,940,000	2,850,083	0.98
			2,850,083	0.98
上市/报价投资基金				
英属格恩西岛 0.08%				
	Sequoia Economic Infrastructure Inc Fd Ltd Ord Npv	238,276	236,871	0.08
			236,871	0.08
爱尔兰 4.32%				
	景顺实物黄金 Etc ETF	50,502	9,650,932	3.32
	Lantern Structured Asset Management Ltd-Ubs (Irl) Fund Solutions Plc ETF	29,210	2,895,003	1.00
			12,545,935	4.32
卢森堡 6.14%				
	百达-人民币债券	18,023	1,956,291	0.67
	百达-新兴市场多元资产- Z 美元	18,400	1,532,904	0.53
	百达-全球环境机会-Z 美元	5,139	2,021,991	0.70
	Pictet Asset Management Europe SA-百达-Emerg Local Ccy-Z 美 元	26,073	5,174,187	1.78
	Pictet Asset Management Europe SA-百达-全球新兴债券-Z 美元	20,198	7,149,890	2.46
			17,835,263	6.14

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 2023 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				
德国 0.05%	欧洲斯托克 50 指数 16/06/2023	99	145,780	0.05
			145,780	0.05
美国 0.05%	标准普尔 500 小股指期货 16/06/2023	15	131,700	0.05
			131,700	0.05
远期外汇合约(0.04%)				
	买澳元沽美元 28/04/2023		31,262	0.01
	买离岸人民币沽美元 28/04/2023		0	0.00
	买离岸人民币沽美元 28/04/2023		0	0.00
	买离岸人民币沽美元 28/04/2023		(14)	(0.00)
	买离岸人民币沽美元 28/04/2023		(113,830)	(0.04)
	买离岸人民币沽美元 28/04/2023		(2,588)	(0.00)
	买离岸人民币沽美元 28/04/2023		(3)	(0.00)
	买离岸人民币沽美元 28/04/2023		(0)	(0.00)
	买新加坡元沽美元 28/04/2023		(2,708)	(0.00)
	买新加坡元沽美元 28/04/2023		(3,262)	(0.00)
	买美元沽澳元 28/04/2023		22	0.00
	买美元沽澳元 28/04/2023		(503)	(0.00)
	买美元沽澳元 28/04/2023		(681)	(0.00)
	买美元沽澳元 28/04/2023		(20,241)	(0.01)
	买美元沽离岸人民币 28/04/2023		(104)	(0.00)
	买美元沽离岸人民币 28/04/2023		(12,211)	(0.00)
	买美元沽离岸人民币 28/04/2023		(26)	(0.00)
	买美元沽离岸人民币 28/04/2023		(2)	(0.00)
	买美元沽离岸人民币 28/04/2023		(70)	(0.00)
	买美元沽离岸人民币 28/04/2023		(21)	(0.00)
	买美元沽港元 28/04/2023		2,244	0.00
	买美元沽新加坡元 28/04/2023		(1,078)	(0.00)
			(123,814)	(0.04)
			上市股票合计	151,671,727
			固定收益合计	91,137,842
			浮动收益合计	2,850,083
			投资基金合计	30,618,069
			期货合约合计	277,480
			远期外汇合约合计	(123,814)
			组合投资合计	276,431,387
			组合投资合计, 按成本	271,151,643

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 2023 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 1.24%				
	Li & Fung Ltd Ser Emtn (Reg) (Reg S) 4.5% 18/08/2025	300,000	280,836	0.77
	Star Energy Co Issue Ser (Reg) (Reg S) 4.85% 14/10/2038	200,000	170,546	0.47
			451,382	1.24
英属维尔京群岛 12.80%				
	CCTHK 2021 Ltd SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2% 19/01/2025	200,000	188,762	0.52
	Cheung Kong Infra Fin Bv (Reg) (Reg S) 4%永续债 31/12/2049	200,000	145,865	0.40
	China Cinda 2020 I Mngmn Ser Emtn (Reg) (Reg S) 3.25% 28/01/2027	200,000	184,480	0.51
	China Cinda Finance 2015 Ser Regs 4.25% 23/04/2025	300,000	292,124	0.80
	Chinalco Capital Holding (Reg S) 2.125% 03/06/2026	400,000	368,013	1.01
	CLP Power HK Financing SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.5% 30/06/2035	200,000	157,700	0.43
	CNPC HK Overseas Capital Ltd Ser Regs 5.95Pct 28/04/2041	400,000	438,889	1.20
	Contempry Ruidng Develop (Reg) (Reg S) 1.5% 09/09/2026	200,000	177,292	0.49
	ENN Clean Energy Ser Regs (Reg S) 3.375% 12/05/2026	200,000	180,039	0.49
	GZ Mtr Fin Bvi SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.31% 17/09/2030	200,000	164,995	0.45
	Hongkong Electric Fin SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.25% 09/06/2030	400,000	340,214	0.93
	Huarong Finance 2019 SER 欧洲中期债券 (Reg S) 3.375% 24/02/2030	200,000	136,250	0.37
	Huarong Finance II SER 欧洲中期债券 (Reg) (Regs) 5.5% 16/06/2025	200,000	184,671	0.51
	Joy Trsr Assets Hld (Reg) (Reg S) 2.75% 17/11/2030	200,000	156,297	0.43
	LS Finance 2017 Ltd (Reg) (Reg S) 4.8% 18/06/2026	200,000	169,000	0.46
	Nan Fung Treasury Ltd SER 欧洲中期债券 (Reg) (Regs) 3.625% 27/08/2030	200,000	173,353	0.47
	New Metro Global Ltd (Reg) (Reg S) 4.8% 15/12/2024	200,000	146,817	0.40
	Sinochem Offshore Capita SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.25% 24/11/2026	200,000	180,816	0.50
	Studio City Finance Ltd Ser (Reg) (Regs) 5% 15/01/2029	200,000	153,757	0.42
	Studio City Finance Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 6% 15/07/2025	400,000	366,992	1.01
	Wharf Reic Finance Bvi SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 3.5% 17/01/2028	200,000	190,138	0.52
	Yuexiu REIT MTN Co SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.65% 02/02/2026	200,000	175,292	0.48
			4,671,756	12.80
开曼群岛 16.03%				
	Agile Group Holdings Ltd (Reg) (Reg S) 5.75% 02/01/2025	200,000	110,813	0.30
	Alibaba Group Holding (Reg) 2.125% 09/02/2031	200,000	165,676	0.45
	Alibaba Group Holding (Reg) 3.6% 28/11/2024	300,000	293,320	0.80
	Alibaba Group Holding 3.15% 09/02/2051	200,000	131,015	0.36
	Azure Nova International SER 欧洲中期债券(Reg S) 4.25% 21/03/2027	200,000	194,450	0.53
	CCBL Cayman 1 Corp SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.55% 28/09/2030	300,000	251,766	0.69
	CCBL Cayman 1 Corp SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 3.5% 16/05/2024	500,000	491,431	1.35
	China Mengniu Dairy (Reg) (Reg S) 1.875% 17/06/2025	400,000	373,376	1.02
	CK Hutchison Intl 20 Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.5% 08/05/2030	200,000	174,626	0.48
	ENN Energy Holdings Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 17/05/2027	200,000	197,914	0.54
	Greentown China Hldgs (Reg) (Reg S) 4.7% 29/04/2025	200,000	184,000	0.50
	JD.com Inc 4.125% 14/01/2050	200,000	155,041	0.43
	Meituan Ser (Reg) (Reg S) 3.05% 28/10/2030	300,000	240,747	0.66

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 2023 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)				
开曼群岛 16.03%(续)				
	Melco Resorts Finance Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.25% 26/04/2026	600,000	541,352	1.48
	MGM China Holdings Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.375% 15/05/2024	200,000	195,549	0.54
	Sands China Ltd Ser Wi (Reg) 3.8% 08/01/2026	200,000	187,957	0.52
	Shui On Development Hldg (Reg) (Reg S) 6.15% 24/08/2024	200,000	183,500	0.50
	Tencent Holdings Ltd Ser (Reg) (Reg S) 3.24% 03/06/2050	200,000	131,665	0.36
	Tencent Holdings Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.88% 22/04/2031	400,000	347,384	0.95
	Tencent Holdings Ltd Ser Regs (Reg) (Regs) 3.595% 19/01/2028	400,000	377,899	1.04
	Weibo Corp (Reg) 3.5% 05/07/2024	200,000	194,689	0.53
	Wynn Macau Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.5% 01/10/2027	400,000	349,440	0.96
	Wynn Macau Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.5% 15/01/2026	200,000	185,739	0.51
	Wynn Macau Ltd Ser Regs (Reg) 4.875% 01/10/2024	200,000	194,251	0.53
			5,853,600	16.03
中国 11.06%				
	交银租赁管理 SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 4.375% 22/01/2024	200,000	198,837	0.55
	Charming Light Invst Ltd SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 4.375% 21/12/2027	200,000	187,354	0.51
	China Cinda 2020 I Mngmn SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 1.25% 20/01/2024	200,000	193,483	0.53
	China Grt Wall Intl Iii SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 4.375% 25/05/2023	200,000	199,193	0.55
	China Overseas Fin (Reg) (Reg S) 4.75% 26/04/2028	200,000	197,456	0.54
	中骏集团控股有限公司 (Reg) (Reg S) 7.375% 09/04/2024	200,000	136,500	0.37
	CNPC Global Capital (Reg) (Reg S) 2% 23/06/2030	200,000	171,923	0.47
	碧桂园控股有限公司 (Reg) (Reg S) 4.2% 06/02/2026	200,000	117,155	0.32
	碧桂园控股有限公司 (Reg) (Reg S) 5.125% 14/01/2027	200,000	114,248	0.31
	碧桂园控股有限公司 (Reg) (Reg S) 7.25% 08/04/2026	200,000	127,000	0.35
	怡略有限公司 7.5% 11/07/2028	207,500	49,053	0.13
	Huarong Finance 2017 Co 4.75% 27/04/2027	200,000	161,750	0.44
	Huarong Finance 2019 2.125% 30/09/2023	200,000	192,962	0.53
	Huarong Finance 2019 SER 欧洲中期债券 (Reg S) 3.25% 13/11/2024	200,000	179,750	0.49
	Huarong Finance li SER 欧洲中期债券 (Reg) (Regs) 5% 19/11/2025	200,000	173,525	0.48
	龙湖集团控股有限公司 (Reg) (Reg S) 3.375% 13/04/2027	200,000	164,299	0.45
	RKPF Overseas 2019 A Ltd (Reg) (Reg S) 6.7% 30/09/2024	200,000	186,086	0.51
	Shanghai Port Group Bv (Reg) (Reg S) 2.375% 13/07/2030	200,000	173,628	0.48
	Sino Ocean Lnd Trs Fin I SER 欧洲中期债券 (Regs) (Reg) 6% 30/07/2024	200,000	122,000	0.33
	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	400,000	317,400	0.87
	Tencent Holdings Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.68% 22/04/2041	200,000	153,326	0.42
	Wanda Properties Oversea (Reg) (Reg S) 6.875% 23/07/2023	200,000	191,000	0.52
	Weibo Corp (Reg) 3.375% 08/07/2030	200,000	162,872	0.45
	仁恒地产(香港)有限公司 (Reg) (Reg S) 5.125% 20/05/2026	200,000	168,560	0.46
			4,039,360	11.06

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 2023 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)	净资产 百分比
固定收益(续)				
香港 11.06%				
	友邦保险控股有限公司 SER Regs (Reg S) 5.625% 25/10/2027	200,000	208,396	0.57
	友邦保险控股有限公司 SER Regs (Reg) (Reg S) 3.2% 16/09/2040	200,000	149,908	0.41
	友邦保险控股有限公司 SER Regs (Reg) (Reg S) 3.375% 07/04/2030	200,000	184,063	0.50
	香港机场管理局 SER Regs (Reg) (Reg S) 4.875% 12/01/2033	200,000	206,553	0.57
	Champion Mtn Ltd SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.95% 15/06/2030	200,000	172,743	0.47
	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	400,000	381,898	1.05
	中信银行股份有限公司 SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.85% 25/02/2030	200,000	176,590	0.48
	CK Hutchison Intntl 21 Ser Regs (Reg S) 2.5% 25/04/2031	200,000	171,956	0.47
	金地永隆 SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 4.95% 12/08/2024	200,000	184,500	0.50
	HKT Capital No 4 Ltd (Reg) (Regs) 3% 14/07/2026	200,000	188,392	0.52
	Hongkong Land Finance Co Ltd 4.5Pct 07/10/2025	200,000	198,675	0.54
	Hutchison Whampoa Finance Ser Regs 7.5Pct 01/08/2027 (C 系列)	200,000	222,393	0.61
	工银国际租赁财务有限公司 SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.7% 27/01/2027	300,000	279,441	0.77
	Lai Sun MTN Ltd (Reg) (Reg S) 5% 28/07/2026	200,000	158,000	0.43
	NWD MTN Ltd (Reg) (Reg S) 4.125% 18/07/2029	400,000	335,182	0.92
	Powerlong Real Estate (Reg) (Reg S) 7.125% 15/01/2024	200,000	52,422	0.14
	Swire Pacific MTN FinSER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.875% 30/01/2030	200,000	178,410	0.49
	万科地产(香港)有限公司 SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 3.975% 09/11/2027	200,000	178,356	0.49
	Westwood Grp Hold Ltd SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 2.8% 20/01/2026	200,000	181,778	0.50
	Xiaomi Best Time Intl Ser (Reg) (Reg S) 2.875% 14/07/2031	300,000	228,789	0.63
			4,038,445	11.06
印度 6.49%				
	ABJA Investment Co (Regs) (Reg) 5.95% 31/07/2024	200,000	199,208	0.55
	ABJA Investment Co (Reg) (Reg S) 5.45% 24/01/2028	200,000	194,959	0.53
	Adani Ports and Special Ser Reg (Reg S) 4% 30/07/2027	400,000	318,400	0.87
	Adani Ports and Special Ser Regs (Reg S) 3.1% 02/02/2031	600,000	387,038	1.06
	Export-Import Bk India Ser Regs (Reg S) 5.5% 18/01/2033	400,000	402,871	1.10
	Power Finance Corp Ltd (Reg S) 3.9% 16/09/2029	400,000	360,005	0.99
	Reliance Industries Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.875% 12/01/2032	250,000	208,032	0.57
	Renew Power Pvt Ltd Ser (Reg) (Reg S) 5.875% 05/03/2027	200,000	113,169	0.31
	Shriram Transport Fin Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.15% 18/07/2025	200,000	184,750	0.51
			2,368,432	6.49
印度尼西亚 6.39%				
	Bank Mandiri Pt SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 5.5% 04/04/2026	200,000	202,866	0.56
	Bank Negara Indonesia SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 3.75% 30/03/2026	200,000	183,289	0.50
	Freeport Indonesia Pt Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.315% 14/04/2032	200,000	187,218	0.51
	Indofood Cbp Sukses Makm (Reg) (Reg S) 3.541% 27/04/2032	200,000	165,855	0.46
	Indofood Cbp Sukses Makm (Reg) (Reg S) 4.805% 27/04/2052	200,000	145,632	0.40
	Indonesia (Rep of) (Reg) 5.65% 11/01/2053	200,000	209,513	0.57
	Minejesa Capital Bv Ser Regs (Regs) 4.625% 10/08/2030	400,000	353,435	0.97
	PT Bank Tabungan Negara (Reg) (Reg S) 4.2% 23/01/2025	200,000	186,250	0.51
	PT Pertamina (Persero) Ser Regs (Reg S) 4.175% 21/01/2050	200,000	156,659	0.43

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 2023 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)				
印度尼西亚 6.39%(续)				
	PT Pertamina (Persero) Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.3% 09/02/2031	200,000	165,333	0.45
	Tower Bersama Infrastruc (Reg) (Reg S) 2.75% 20/01/2026	200,000	182,772	0.50
	Tower Bersama Infrastruc (Reg) (Reg S) 4.25% 21/01/2025	200,000	194,129	0.53
			2,332,951	6.39
马恩岛 1.25%				
	GOHL Capital Ltd 4.25% 24/01/2027	500,000	458,011	1.25
			458,011	1.25
韩国 7.40%				
	Hana Bank Ser Regs 4.375% 30/09/2024	200,000	196,802	0.54
	Hyundai Capital Services Ser Regs (Reg) (Reg S) 1.25% 08/02/2026	200,000	179,667	0.49
	Kookmin Bank Ser Gmtn (Reg) (Reg S) 4.5% 01/02/2029	600,000	574,963	1.58
	Korea Housing Finance Co Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 24/02/2028	200,000	200,131	0.55
	Korea Housing Finance Co Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 24/02/2033	200,000	200,712	0.55
	Shinhan Bank Ser Gmtn (Reg) (Reg S) 4.5% 26/03/2028	200,000	191,176	0.52
	Shinhan Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) 4% 23/04/2029	400,000	369,019	1.01
	Shinhan Bank Ser Regs 3.75% 20/09/2027	200,000	186,344	0.51
	SK Hynix Inc Ser Regs (Reg S) 6.375% 17/01/2028	400,000	402,460	1.10
	SK Hynix Inc Ser Regs (Reg S) 6.5% 17/01/2033	200,000	198,694	0.55
			2,699,968	7.40
马来西亚 1.30%				
	GENM Capital Labuan Ser Regs (Reg S) 3.882% 19/04/2031	200,000	155,619	0.43
	Petronas Capital Ltd Ser Regs (Reg S) 2.48% 28/01/2032	200,000	171,757	0.47
	Petronas Capital Ltd Ser Regs (Reg S) 3.404% 28/04/2061	200,000	148,092	0.40
			475,468	1.30
毛里求斯 1.05%				
	Greenko Solar Mauritius Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.55% 29/01/2025	200,000	192,500	0.53
	Greenko Wind Projects Mu Ser Regs (Reg S) 5.5% 06/04/2025	200,000	190,132	0.52
			382,632	1.05
菲律宾 1.01%				
	Philippines (Rep Of) (Reg) 3.556% 29/09/2032	400,000	368,225	1.01
			368,225	1.01
新加坡 2.14%				
	Flex Ltd (Reg) 6% 15/01/2028	200,000	205,081	0.56
	Global Prime Capital (Reg S) 5.95% 23/01/2025	200,000	193,010	0.53
	Medco Oak Tree Pte Ltd Ser (Reg) (Reg S) 7.375% 14/05/2026	400,000	381,609	1.05
			779,700	2.14
泰国 1.29%				
	Pttep Treasury Center Co Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.993% 15/01/2030	200,000	178,005	0.49
	Thaioil Trsry Center Ser (Reg S) 3.75% 18/06/2050	200,000	129,581	0.35
	Thaioil Trsry Center Ser Regs 5.375% 20/11/2048	200,000	164,824	0.45
			472,410	1.29

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 2023 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 3.11%				
	Bluestar Fin Holdings (Reg) (Reg S) VAR 永续债 31/12/2049	600,000	579,299	1.59
	China Huaneng Gp HK Treasury (Reg) (Reg S) VAR 永续债 31/12/2049	400,000	376,000	1.03
	Elect Global Investments Ltd (Reg) (Reg S) VAR 永续债 31/12/2049	200,000	179,100	0.49
			1,134,399	3.11
中国 3.65%				
	国银金融租赁股份有限公司 (Reg) (Reg S) VAR 28/09/2030	700,000	658,941	1.81
	中国建设银行 (Reg) (Reg S) VAR 21/01/2032	300,000	280,732	0.77
	中国建设银行 (Reg) (Reg S) VAR 27/02/2029	200,000	198,863	0.54
	中国工商银行(澳门)股份有限公司 (Reg) (Reg S) VAR 12/09/2029	200,000	192,911	0.53
			1,331,447	3.65
香港 3.79%				
	香港机场管理局 (Reg) (Reg S) VAR 永续债 31/12/2049	300,000	263,374	0.72
	中国银行(香港)有限公司 (Reg) (Reg S) VAR 永续债 08/07/2031	500,000	453,863	1.24
	东亚银行有限公司 SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) VAR 29/05/2030	250,000	229,046	0.63
	交银租赁管理 SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) 浮动利率债券 10/12/2024	200,000	199,526	0.55
	南洋商业银行 (Reg) (Reg S) VAR 20/11/2029	250,000	239,654	0.65
			1,385,463	3.79
印度 0.46%				
	HDFC Bank Ltd Ser Regs (Reg S) VAR 永续债 31/12/2049	200,000	167,907	0.46
			167,907	0.46
印度尼西亚 0.45%				
	Bank Negara Indonesia (Reg S) VAR 永续债 31/12/2049	200,000	164,280	0.45
			164,280	0.45
日本 1.09%				
	Shanghai Commercial Bank (Reg) (Reg S) VAR 28/02/2033	400,000	398,116	1.09
			398,116	1.09
韩国 0.52%				
	Kookmin Bank Ser Regs (Reg) (Reg_S) VAR 永续债 31/12/2049	200,000	189,974	0.52
			189,974	0.52
毛里求斯 1.05%				
	Network i2i Ltd Ser (Reg) (Reg S) VAR 永续债 31/12/2049	400,000	382,000	1.05
			382,000	1.05
菲律宾 0.98%				
	Globe Telecom Inc (Reg) (Reg S) VAR 永续债 31/12/2049	200,000	183,000	0.50
	SMC Global Power Hldgs (Reg) (Reg S) VAR 永续债 31/12/2049	200,000	174,000	0.48
			357,000	0.98
新加坡 3.09%				
	Oversea-Chinese Banking (Reg S) VAR 15/06/2032	600,000	585,983	1.60
	United Overseas Bank Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) VAR 07/10/2032	200,000	188,948	0.52
	United Overseas Bank Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) VAR 14/10/2031	400,000	354,548	0.97
			1,129,479	3.09

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 2023 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)				
泰国 2.84%				
	Bangkok Bank PCL/HK Ser Regs (Reg) (Reg S) VAR 25/09/2034	600,000	509,787	1.40
	Kasikornbank PCL HK SER 欧洲中期债券 (Reg S) VAR 永续债 31/12/2049	200,000	166,805	0.46
	Kasikornbank PCL HK SER 欧洲中期债券 (Reg) (Reg S) VAR 02/10/2031	200,000	176,779	0.48
	TMB Thanachart Bank VAR 永续债 31/12/2049	200,000	184,048	0.50
			1,037,419	2.84
英国 3.47%				
	Standard Chartered Plc SER 欧洲中期债券 (Reg S) VAR 12/02/2030	200,000	185,008	0.51
	Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg S) VAR 09/01/2029	400,000	409,127	1.12
	Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg S) VAR 15/03/2033	200,000	183,854	0.50
	Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) VAR 18/02/2036	200,000	156,726	0.43
	Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) VAR 永续债 31/12/2049	200,000	147,500	0.40
	Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) VAR 永续债 31/12/2049	200,000	185,833	0.51
			1,268,048	3.47
期货合约				
美国(0.04%)				
	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2023	9	(12,141)	(0.04)
			(12,141)	(0.04)
远期外汇合约(0.01%)				
	买澳元沽美元 28/04/2023		971	0.00
	买离岸人民币沽美元 28/04/2023		(1,565)	(0.00)
	买离岸人民币沽美元 28/04/2023		(162)	(0.00)
	买新加坡元沽美元 28/04/2023		(3,493)	(0.01)
	买美元沽新加坡元 28/04/2023		(847)	(0.00)
			(5,096)	(0.01)
			29,392,340	
			8,945,532	
			(12,141)	
			(5,096)	
			38,320,635	
			38,793,758	

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 2023 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

	于 2023 年 3 月 31 日 占净资产百分比	于 2022 年 9 月 30 日 占净资产百分比
上市股票		
澳大利亚	2.21	2.15
加拿大	0.96	0.23
开曼群岛	5.74	-
中国	3.60	4.01
英属格恩西岛	0.23	0.73
香港	0.95	0.54
印度尼西亚	0.06	0.06
日本	0.94	0.34
韩国	2.26	0.35
荷兰	1.24	0.52
新西兰	0.90	0.92
新加坡	0.04	0.06
台湾	4.25	1.93
美国	28.79	25.14
	52.17	36.98
固定收益		
澳大利亚	-	11.97
日本	-	3.25
美国	31.36	31.47
	31.36	46.69
浮动收益		
美国	0.98	0.63
	0.98	0.63
上市/报价投资基金		
英属格恩西岛	0.08	-
爱尔兰	4.32	1.58
卢森堡	6.14	8.14
英国	-	0.08
	10.54	9.80
期货合约		
德国	0.05	-
日本	-	(0.02)
美国	0.05	(0.17)
	0.10	(0.19)
远期外汇合约		
	(0.04)	(0.38)
	(0.04)	(0.38)
组合投资合计	95.11	93.53

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 2023 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

	于 2023 年 3 月 31 日 占净资产百分比	于 2022 年 9 月 30 日 占净资产百分比
固定收益		
百慕大	1.24	1.56
英属维尔京群岛	12.80	10.34
开曼群岛	16.03	18.45
中国	11.06	-
香港	11.06	10.95
印度	6.49	4.80
印度尼西亚	6.39	2.67
马恩岛	1.25	1.60
韩国	7.40	2.62
马来西亚	1.30	1.25
毛里求斯	1.05	2.26
菲律宾	1.01	0.59
新加坡	2.14	2.70
泰国	1.29	1.06
英国	-	0.71
美国	-	1.33
	80.51	62.89
浮动收益		
英属维尔京群岛	3.11	4.27
中国	3.65	5.32
香港	3.79	7.89
印度	0.46	-
印度尼西亚	0.45	-
日本	1.09	-
韩国	0.52	2.27
毛里求斯	1.05	0.70
菲律宾	0.98	2.10
新加坡	3.09	5.41
泰国	2.84	1.98
英国	3.47	-
	24.50	29.94
期货合约		
美国	(0.04)	(0.23)
	(0.04)	(0.23)
远期外汇合约		
	(0.01)	(0.17)
	(0.01)	(0.17)
组合投资合计	104.96	92.43

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 2023 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

期货合约

于 2023 年 3 月 31 日，子基金持有的期货合约详情如下：

于 2023 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)
金融资产：						
欧洲斯托克 50 指数 16/06/2023	欧洲斯托克	10	4,583,070	99	瑞银期货有限责任公司	145,780
标准普尔 500 小股指期货 16/06/2023	标准普尔 500	50	3,103,313	15	瑞银期货有限责任公司	<u>131,700</u>
						<u>277,480</u>

远期外汇合约

于 2023 年 3 月 31 日，子基金持有的远期外汇合约详情如下：

于 2023 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)
金融资产：				
澳元 9,692	美元 6,519	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	22
港元 80,000,000	美元 10,207,541	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	2,244
美元 68	离岸人民币 468	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	0
美元 57	离岸人民币 391	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	0
美元 34,268,993	澳元 51,165,774	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	<u>31,262</u>
				<u>33,528</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 2023 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

远期外汇合约(续)

交割合约	折算额	结算日期	交易对手	公允价值 (美元)
金融负债:				
澳元 7,080,000	美元 4,726,014	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(20,241)
澳元 96,486	美元 64,179	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(503)
澳元 124,147	美元 82,544	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(681)
离岸人民币 27,800,000	美元 4,044,213	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(12,211)
离岸人民币 251,221	美元 36,553	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(104)
离岸人民币 169,588	美元 24,719	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(26)
离岸人民币 13,634	美元 1,987	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(2)
离岸人民币 260,104	美元 37,883	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(70)
离岸人民币 78,940	美元 11,497	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(21)
新加坡元 786,519	美元 590,978	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(1,078)
美元 34,796,915	离岸人民币 237,694,491	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(113,830)
美元 791,098	离岸人民币 5,403,914	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(2,588)
美元 4,168	离岸人民币 28,468	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(14)
美元 410	离岸人民币 2,789	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(3)
美元 394	离岸人民币 2,699	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(0)
美元 1,885,482	新加坡元 2,501,179	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(2,708)
美元 2,271,119	新加坡元 3,012,743	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(3,262)
				<u>(157,342)</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 2023 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

期货合约

于 2023 年 3 月 31 日，子基金持有的期货合约详情如下：

于 2023 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)
金融负债：						
US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2023	美国国库票据	3,000	997,711	9	J. P. Morgan Securities Ltd	(12,141)
						<u>(12,141)</u>

远期外汇合约

于 2023 年 3 月 31 日，子基金持有的远期外汇合约详情如下：

于 2023 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)
金融资产：				
美元 713,530	澳元 1,065,823	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	971
				<u>971</u>
金融负债：				
新加坡元 618,554	美元 464,772	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(847)
美元 496,029	离岸人民币 3,388,724	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(1,565)
美元 20,385	离岸人民币 138,600	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(162)
美元 3,548,045	新加坡元 4,708,774	2023 年 4 月 28 日	香港上海汇丰银行有限公司	(3,493)
				<u>(6,067)</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 2023 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

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)
2022年10月19日	2022年10月20日	2022年10月26日	0.045	13,274,190.7493	597,338.58	597,338.58
2022年11月18日	2022年11月21日	2022年11月25日	0.045	13,220,657.4223	594,929.59	594,929.59
2022年12月19日	2022年12月20日	2022年12月28日	0.045	13,125,266.7635	590,637.00	590,637.00
2023年1月19日	2023年1月20日	2023年1月31日	0.045	12,865,080.6483	578,928.64	578,928.64
2023年2月17日	2023年2月20日	2023年2月24日	0.045	12,533,827.4649	564,022.23	564,022.23
2023年3月17日	2023年3月20日	2023年3月24日	0.045	12,282,836.4875	552,727.65	552,727.65

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)
2022年10月19日	2022年10月20日	2022年10月26日	0.045	96,072,861.0070	4,323,278.74	550,736.15
2022年11月18日	2022年11月21日	2022年11月25日	0.045	95,212,463.2409	4,284,560.85	547,677.20
2022年12月19日	2022年12月20日	2022年12月28日	0.045	95,124,850.0352	4,280,618.26	550,445.02
2023年1月19日	2023年1月20日	2023年1月31日	0.045	92,609,566.7644	4,167,430.51	532,310.27
2023年2月17日	2023年2月20日	2023年2月24日	0.045	91,897,291.7242	4,135,378.14	527,162.40
2023年3月17日	2023年3月20日	2023年3月24日	0.045	91,153,844.7383	4,101,923.02	522,587.89

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)
2022年10月19日	2022年10月20日	2022年10月26日	0.05	26,997,649.1897	1,349,882.48	185,810.10
2022年11月18日	2022年11月21日	2022年11月25日	0.05	26,646,498.7280	1,332,324.95	187,144.00
2022年12月19日	2022年12月20日	2022年12月28日	0.05	26,585,399.5864	1,329,269.99	190,206.84
2023年1月19日	2023年1月20日	2023年1月31日	0.05	26,285,542.6116	1,314,277.14	193,716.18
2023年2月17日	2023年2月20日	2023年2月24日	0.05	25,622,568.9713	1,281,128.46	186,264.68
2023年3月17日	2023年3月20日	2023年3月24日	0.05	25,311,408.0755	1,265,570.41	183,663.55

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 2023 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)
2022年10月19日	2022年10月20日	2022年10月26日	0.05	6,468,513.6184	323,425.67	203,483.26
2022年11月18日	2022年11月21日	2022年11月25日	0.05	6,453,046.9784	322,652.35	215,886.69
2022年12月19日	2022年12月20日	2022年12月28日	0.05	6,421,895.1346	321,094.75	215,053.21
2023年1月19日	2023年1月20日	2023年1月31日	0.05	6,464,907.3102	323,245.37	222,699.90
2023年2月17日	2023年2月20日	2023年2月24日	0.05	6,441,662.4967	322,083.13	220,739.67
2023年3月17日	2023年3月20日	2023年3月24日	0.05	6,426,747.1946	321,337.37	214,765.83

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)
2022年10月19日	2022年10月20日	2022年10月26日	0.045	429,844.8252	19,343.02	19,343.02
2022年11月18日	2022年11月21日	2022年11月25日	0.045	429,844.8252	19,343.02	19,343.02
2022年12月19日	2022年12月20日	2022年12月28日	0.045	429,844.8252	19,343.02	19,343.02
2023年1月19日	2023年1月20日	2023年1月31日	0.045	429,844.8252	19,343.02	19,343.02
2023年2月17日	2023年2月20日	2023年2月24日	0.045	429,844.8252	19,343.02	19,343.02
2023年3月17日	2023年3月20日	2023年3月24日	0.045	429,844.8252	19,343.02	19,343.02

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)
2022年10月19日	2022年10月20日	2022年10月26日	0.045	308,768.9210	13,894.60	9,759.16
2022年11月18日	2022年11月21日	2022年11月25日	0.045	308,768.9210	13,894.60	10,118.41
2022年12月19日	2022年12月20日	2022年12月28日	0.045	308,768.9210	13,894.60	10,231.66
2023年1月19日	2023年1月20日	2023年1月31日	0.045	308,768.9210	13,894.60	10,494.41
2023年2月17日	2023年2月20日	2023年2月24日	0.045	308,768.9210	13,894.60	10,389.26
2023年3月17日	2023年3月20日	2023年3月24日	0.045	308,768.9210	13,894.60	10,349.02

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 2023 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 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)
2022年10月19日	2022年10月20日	2022年10月26日	0.017	600.0000	10.20	10.20
2022年11月18日	2022年11月21日	2022年11月25日	0.017	600.0000	10.20	10.20
2022年12月19日	2022年12月20日	2022年12月28日	0.017	600.0000	10.20	10.20
2023年1月19日	2023年1月20日	2023年1月31日	0.017	600.0000	10.20	10.20
2023年2月17日	2023年2月20日	2023年2月24日	0.017	600.0000	10.20	10.20
2023年3月17日	2023年3月20日	2023年3月24日	0.017	600.0000	10.20	10.20

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)
2022年10月19日	2022年10月20日	2022年10月26日	0.017	40,768.2840	693.06	88.29
2022年11月18日	2022年11月21日	2022年11月25日	0.017	40,768.2840	693.06	88.59
2022年12月19日	2022年12月20日	2022年12月28日	0.017	40,768.2840	693.06	89.12
2023年1月19日	2023年1月20日	2023年1月31日	0.017	40,768.2840	693.06	88.53
2023年2月17日	2023年2月20日	2023年2月24日	0.017	40,768.2840	693.06	88.35
2023年3月17日	2023年3月20日	2023年3月24日	0.017	40,768.2840	693.06	88.30

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)
2022年10月19日	2022年10月20日	2022年10月26日	0.017	3,000.0000	51.00	7.02
2022年11月18日	2022年11月21日	2022年11月25日	0.017	3,000.0000	51.00	7.16
2022年12月19日	2022年12月20日	2022年12月28日	0.017	3,000.0000	51.00	7.30
2023年1月19日	2023年1月20日	2023年1月31日	0.017	3,000.0000	51.00	7.52
2023年2月17日	2023年2月20日	2023年2月24日	0.017	3,000.0000	51.00	7.41
2023年3月17日	2023年3月20日	2023年3月24日	0.017	3,000.0000	51.00	7.40

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 2023 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

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)
2022年10月19日	2022年10月20日	2022年10月26日	0.042	839,380.0374	35,253.96	35,253.96
2022年11月18日	2022年11月21日	2022年11月25日	0.042	839,380.0374	35,253.96	35,253.96
2022年12月19日	2022年12月20日	2022年12月28日	0.042	839,380.0374	35,253.96	35,253.96
2023年1月19日	2023年1月20日	2023年1月31日	0.042	836,662.0374	35,139.80	35,139.80
2023年2月17日	2023年2月20日	2023年2月24日	0.042	777,178.3564	32,641.49	32,641.49
2023年3月17日	2023年3月20日	2023年3月24日	0.042	777,178.3564	32,641.49	32,641.49

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)
2022年10月19日	2022年10月20日	2022年10月26日	0.042	784,617.2344	32,953.92	4,197.95
2022年11月18日	2022年11月21日	2022年11月25日	0.042	784,617.2344	32,953.92	4,212.36
2022年12月19日	2022年12月20日	2022年12月28日	0.042	784,617.2344	32,953.92	4,237.55
2023年1月19日	2023年1月20日	2023年1月31日	0.042	784,617.2344	32,953.92	4,209.24
2023年2月17日	2023年2月20日	2023年2月24日	0.042	784,617.2344	32,953.92	4,200.84
2023年3月17日	2023年3月20日	2023年3月24日	0.042	774,761.2914	32,539.97	4,145.62

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)
2022年10月19日	2022年10月20日	2022年10月26日	0.047	159,855.2968	7,513.20	1,034.19
2022年11月18日	2022年11月21日	2022年11月25日	0.047	379,643.2461	17,843.24	2,506.34
2022年12月19日	2022年12月20日	2022年12月28日	0.047	447,643.2461	21,039.24	3,010.53
2023年1月19日	2023年1月20日	2023年1月31日	0.047	447,643.2461	21,039.24	3,101.05
2023年2月17日	2023年2月20日	2023年2月24日	0.047	447,643.2461	21,039.24	3,058.92
2023年3月17日	2023年3月20日	2023年3月24日	0.047	447,643.2461	21,039.24	3,053.28

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 2023 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)
2022年10月19日	2022年10月20日	2022年10月26日	0.047	134,197.2190	6,307.27	3,968.22
2022年11月18日	2022年11月21日	2022年11月25日	0.047	134,197.2190	6,307.27	4,220.19
2022年12月19日	2022年12月20日	2022年12月28日	0.047	134,197.2190	6,307.27	4,224.29
2023年1月19日	2023年1月20日	2023年1月31日	0.047	146,827.3640	6,900.89	4,754.37
2023年2月17日	2023年2月20日	2023年2月24日	0.047	146,827.3640	6,900.89	4,729.53
2023年3月17日	2023年3月20日	2023年3月24日	0.047	146,827.3640	6,900.89	4,612.21

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)
2022年10月19日	2022年10月20日	2022年10月26日	0.042	1,076,253.0200	45,202.63	45,202.63
2022年11月18日	2022年11月21日	2022年11月25日	0.042	1,321,832.0200	55,516.94	55,516.94
2022年12月19日	2022年12月20日	2022年12月28日	0.042	1,370,736.3166	57,570.93	57,570.93
2023年1月19日	2023年1月20日	2023年1月31日	0.042	1,721,300.3166	72,294.61	72,294.61
2023年2月17日	2023年2月20日	2023年2月24日	0.042	1,728,485.3166	72,596.38	72,596.38
2023年3月17日	2023年3月20日	2023年3月24日	0.042	1,762,485.3166	74,024.38	74,024.38

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)

于 2023 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

资产净值

	资产净值	每份额资产净值
P 每月派息 美元		
2023 年 3 月 31 日	美元 108,056,291	美元 8.9379
2022 年 9 月 30 日	美元 109,274,880	美元 8.1740
2021 年 9 月 30 日	美元 100,346,073	美元 10.8673
P 每月派息 港元		
2023 年 3 月 31 日	美元 103,937,985	港元 9.0903
2022 年 9 月 30 日	美元 102,792,528	港元 8.3097
2021 年 9 月 30 日	美元 114,388,076	港元 10.9480
HP 每月派息 人民币		
2023 年 3 月 31 日	美元 34,919,057	人民币 9.5194
2022 年 9 月 30 日	美元 33,674,641	人民币 8.8290
2021 年 9 月 30 日	美元 39,746,503	人民币 11.5787
HP 每月派息 澳元		
2023 年 3 月 31 日	美元 34,346,318	澳元 8.0277
2022 年 9 月 30 日	美元 31,395,672	澳元 7.4711
2021 年 9 月 30 日	美元 44,278,544	澳元 10.1687
HM 人民币		
2023 年 3 月 31 日	美元 758,706	人民币 11.0024
2022 年 9 月 30 日	美元 654,845	人民币 9.8749
2021 年 9 月 30 日	美元 957,407	人民币 12.2307
I 每月派息 美元		
2023 年 3 月 31 日	美元 3,391,984	美元 7.8911
2022 年 9 月 30 日	美元 3,104,328	美元 7.2219
2021 年 9 月 30 日	美元 2,888,818	美元 9.6038
I 累计 美元		
2023 年 3 月 31 日	美元 1,359,258	美元 8.7473
2022 年 9 月 30 日	美元 1,199,936	美元 7.7220
HI 每月派息 新加坡元		
2023 年 3 月 31 日	美元 1,903,863	新加坡元 8.1979
2022 年 9 月 30 日	美元 1,619,229	新加坡元 7.5248
2021 年 9 月 30 日	美元 1,708,898	新加坡元 10.0000
HI 累计 新加坡元		
2023 年 3 月 31 日	美元 1,693,710	新加坡元 9.0047
2022 年 9 月 30 日	美元 1,884,196	新加坡元 7.9849
2021 年 9 月 30 日	美元 957,572	新加坡元 10.0000
P 每月派息 3 美元		
2023 年 3 月 31 日	美元 5,838	美元 9.7306
2022 年 9 月 30 日	美元 5,229	美元 8.7149
P 每月派息 3 港元		
2023 年 3 月 31 日	美元 50,552	港元 9.7337
2022 年 9 月 30 日	美元 45,286	港元 8.7198
HP 每月派息 3 人民币		
2023 年 3 月 31 日	美元 4,191	人民币 9.5941
2022 年 9 月 30 日	美元 3,663	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)

于 2023 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

资产净值

	资产净值	每份额资产净值
P 每月派息 美元		
2023 年 3 月 31 日	美元 5,755,463	美元 7.4546
2022 年 9 月 30 日	美元 6,197,122	美元 7.3829
2021 年 9 月 30 日	美元 11,427,716	美元 9.5033
P 每月派息 港元		
2023 年 3 月 31 日	美元 747,245	港元 7.5544
2022 年 9 月 30 日	美元 794,727	港元 7.4792
2021 年 9 月 30 日	美元 2,114,408	港元 9.5418
HP 每月派息 人民币		
2023 年 3 月 31 日	美元 513,071	人民币 7.5451
2022 年 9 月 30 日	美元 185,820	人民币 7.5895
2021 年 9 月 30 日	美元 182,385	人民币 9.6435
HP 每月派息 澳元		
2023 年 3 月 31 日	美元 713,453	澳元 7.2391
2022 年 9 月 30 日	美元 626,009	澳元 7.2553
2021 年 9 月 30 日	美元 1,031,131	澳元 9.4575
I 每月派息 美元		
2023 年 3 月 31 日	美元 10,226,470	美元 7.5446
2022 年 9 月 30 日	美元 8,017,728	美元 7.4496
2021 年 9 月 30 日	美元 10,084,047	美元 9.5377
I 累计 美元		
2023 年 3 月 31 日	美元 15,480,537	美元 8.5320
2022 年 9 月 30 日	美元 7,201,960	美元 8.1470
2021 年 9 月 30 日	美元 8,726,007	美元 9.8269
HI 累计 新加坡元		
2023 年 3 月 31 日	美元 3,073,596	新加坡元 8.5293
2022 年 9 月 30 日	美元 3,134,108	新加坡元 8.1647
2021 年 9 月 30 日	美元 4,001,029	新加坡元 9.8348

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)

于 2023 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

每份额最高/最低资产净值

	财务期截止日	每份额最高资产净值	每份额最低资产净值
P 每月派息 美元	2023 年 3 月 31 日	美元 9.0448	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 港元	2023 年 3 月 31 日	港元 9.1886	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
HP 每月派息 人民币	2023 年 3 月 31 日	人民币 9.6769	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 澳元	2023 年 3 月 31 日	澳元 8.1679	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
HM 人民币	2023 年 3 月 31 日	人民币 11.0634	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

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)

于 2023 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

每份额最高/最低资产净值(续)

	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 每月派息 美元	2023 年 3 月 31 日	美元 7.9878	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
I 累计 美元	2023 年 3 月 31 日	美元 8.7510	美元 7.6538
	2022 年 9 月 30 日	美元 10.1201	美元 7.7220
HI 每月派息 新加坡元	2023 年 3 月 31 日	新加坡元 8.3075	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
HI 累计 新加坡元	2023 年 3 月 31 日	新加坡元 9.0234	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
P 每月派息 3 美元	2023 年 3 月 31 日	美元 9.7797	美元 8.6234
	2022 年 9 月 30 日	美元 10.0181	美元 8.7198
P 每月派息 3 港元	2023 年 3 月 31 日	港元 9.7743	港元 8.6279
	2022 年 9 月 30 日	港元 10.0190	港元 8.7198
HP 每月派息 3 人民币	2023 年 3 月 31 日	人民币 9.6825	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)

于 2023 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

每份额最高/最低资产净值

	财务期截止日	每份额最高资产净值	每份额最低资产净值
P 每月派息 美元	2023 年 3 月 31 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
P 每月派息 港元	2023 年 3 月 31 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
HP 每月派息 人民币	2023 年 3 月 31 日	人民币 7.8964	人民币 7.1022
	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
HP 每月派息 澳元	2023 年 3 月 31 日	澳元 7.5663	澳元 6.7813
	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
I 每月派息 美元	2023 年 3 月 31 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
I 累计 美元	2023 年 3 月 31 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
HI 累计 新加坡元	2023 年 3 月 31 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

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
www.pictet.com