



高腾亚洲收益基金

（高腾微基金的子基金）

半年度报告（未经审计）

截至 2023 年 6 月 30 日

高腾亚洲收益基金  
(高腾微基金的子基金)

目录

页码

管理和行政	1
财务状况表 (未经审计)	2
损益表及其他综合收益表 (未经审计)	3
基金份额持有人应占资产净值变动表 (未经审计)	4 - 7
财务报表附注 (未经审计)	8 - 14
投资组合明细表 (未经审计)	15 - 19
投资组合所持投资项目变动表 (未经审计)	20

高腾亚洲收益基金

（高腾微基金的子基金）

管理和行政

管理人

高腾国际资产管理有限公司

香港中环

德辅道中 68 号

万宜大厦 21 楼 2105-07 室

受托人、基金登记机构和转让代理人

中国工商银行（亚洲）信托有限公司

香港中环

花园道3号

中国工商银行大厦 33 楼

基金管理人董事

毕万英

李宇

保管人

中国工商银行（亚洲）有限公司

香港中环

花园道3号

中国工商银行大厦 33 楼

基金管理人律师

的近律师行

香港中环

遮打道 18 号

历山大厦 5 楼

审计师

安永会计师事务所

香港鲗鱼涌

英皇道 979 号

太古坊一号 27 楼

高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

财务状况表(未经审计)

截至 2023 年 6 月 30 日

	2023 年 6 月 30 日 美元	2022 年 12 月 31 日 美元
资产		
预付款项	3,606	7,158
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		
— 债务证券	45,226,116	65,020,824
— 货币远期合约	55,398	54,750
— 集体投资计划	6,356,429	6,921,665
应收利息		
— 债务证券	652,520	1,085,857
应收认购款	1,388	7,495
应收经纪款项	5,977,189	2,031,195
其他应收款	23,907	-
现金和现金等价物	1,805,906	2,177,398
资产合计	<u>60,102,459</u>	<u>77,306,342</u>
负债		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		
— 货币远期合约	63,134	1,448
应付赎回款项	1,149	108,901
应付管理费	64,756	33,223
应付受托人费用	8,538	13,175
应付交易手续费	14,460	17,995
应付经纪款项	6,123,066	-
其他应付款	35,170	50,287
负债总额(不包括基金份额持有人应占资产净值)	<u>6,310,273</u>	<u>225,029</u>
基金份额持有人应占资产净值	<u>53,792,186</u>	<u>77,081,313</u>
负债合计	<u>60,102,459</u>	<u>77,306,342</u>

高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

损益表及其他综合收益表 (未经审计)

截至 2023 年 6 月 30 日的六个月

	截至 2023 年 6 月 30 日 美元	截至 2022 年 6 月 30 日 美元
收益		
债务证券利息收入	1,309,938	5,336,064
银行利息收入	4,896	2,077
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净收益/(亏损)	1,164,742	(41,585,492)
外币净收益	277,108	1,751
其他收益	56,868	112,980
总收益/(损失)	<u>2,813,552</u>	<u>(36,132,620)</u>
支出		
管理费#	(195,312)	(504,594)
受托人费用*	(26,458)	(96,849)
行政费*	(38,609)	(51,802)
审计师报酬	(13,015)	(14,284)
法律和专业费用	(5,406)	(72,644)
保管人费用*	(7,493)	(26,630)
交易成本	(385)	(2,240)
交易手续费*	(51,855)	(77,980)
其它费用	(753,633)	(8,174)
费用报销^	23,906	-
总费用	<u>(1,068,260)</u>	<u>(855,197)</u>
税前利润/(亏损)	1,745,292	(36,987,817)
预缴税金	-	(10,400)
本期间基金份额持有人应占净资产增加/减少额	<u>1,745,292</u>	<u>(36,998,217)</u>

# 已支付/应付给基金管理人的费用。

\* 已支付/应付给受托人、保管人或其关联人士的费用。

^ 由管理人自愿承担的费用。

高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

基金份额持有人应占净资产净值变动表 (未经审计)

截至 2023 年 6 月 30 日的六个月

	A 类港元对冲 (累积) 美元	A 类港元对冲 (派息) 美元	A 类美元(累积) 美元	A 类美元(派 息) 美元	B 类美元(累积) 美元	I 类离岸人民币 对冲(累积) 美元	I 类美元(累积) 美元	I 类美元(派 息) 美元
于 2023 年 1 月 1 日	6,173,679	7,187,352	6,870,179	8,698,394	21,037,159	280,196	23,841,886	-
认购份额^	190,542	306,628	358,236	72,786	-	-	464,339	-
赎回份额	(393,251)	(493,073)	(1,346,830)	(686,643)	(21,908,380)	-	(296,667)	-
股利	-	(195,580)	-	(232,941)	-	-	-	-
	5,970,970	6,805,327	5,881,585	7,851,596	(871,221)	280,196	24,009,558	-
基金份额持有人应占 净资产增加/减少额	39,093	59,685	151,329	172,017	871,221	(12,802)	498,407	
于 2023 年 6 月 30 日	6,010,063	6,865,012	6,032,914	8,023,613	-	267,394	24,507,965	-
	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额
于 2023 年 1 月 1 日	5,217,851.04	6,802,905.42	671,197.08	1,133,368.98	2,220,074.72	196,276.22	2,339,689.85	-
认购份额^	155,311.25	282,000.85	33,564.18	9,221.39	-	-	32,198.71	-
于 2023 年 6 月 30 日	(323,513.54)	(461,322.34)	(126,092.88)	(88,238.37)	(2,220,074.72)	-	(16,992.35)	-
赎回份额	5,049,648.75	6,623,583.93	578,668.38	1,054,352.00	-	196,276.22	2,354,896.21	-

^包括股息再投资

高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

基金份额持有人应占净资产净值变动表 (未经审计)

截至 2023 年 6 月 30 日的六个月

	M类人民币 (累积) 美元	M类人民币对冲 (累积) 美元	M类美元 (累积) 美元	总计 美元
于 2023 年 1 月 1 日	1,212,424	1,780,044	-	77,081,313
认购份额^	-	-	-	1,392,531
赎回份额	-	(873,585)	-	(25,998,429)
股利	-	-	-	(428,521)
	1,212,424	906,459	-	52,046,894
于 2023 年 6 月 30 日	22,462	(56,120)	-	1,745,292
基金份额持有人应占净资产增加/减少额	1,234,886	850,339	-	53,792,186
	基金份额	基金份额	基金份额	
于 2023 年 1 月 1 日	998,851.17	1,496,410.24	-	
认购份额^	-	-	-	
于 2023 年 6 月 30 日	-	(747,700.00)	-	
赎回份额	998,851.17	748,710.24	-	

^包括股息再投资

高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

基金份额持有人应占净资产净值变动表 (未经审计) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日的六个月

	A 类港元对冲 (累积) 美元	A 类港元对冲 (派息) 美元	A 类美元(累积) 美元	A 类美元(派 息) 美元	B 类美元(累积) 美元	I 类离岸人民币对 冲(累积) 美元	I 类美元(累积) 美元	I 类美元(派 息) 美元
截至 2022 年 1 月 1 日	14,258,735	12,325,965	17,199,449	16,008,228	67,509,784	37,832	68,204,295	22,698,467
认购份额^	15,167,154	1,395,854	358,300	123,200	800,000	-	130,000	-
赎回份额	(18,656,487)	(3,374,507)	(6,486,507)	(3,399,948)	-	-	(9,273,652)	-
股利	-	(279,121)	-	(360,246)	-	-	-	(560,233)
	10,769,402	10,068,191	11,071,242	12,371,234	68,309,784	37,832	59,060,643	22,138,234
截至 2022 年 6 月 30 日	(2,140,607)	(1,823,413)	(2,186,894)	(2,190,263)	(10,191,048)	(7,250)	(9,199,939)	(3,391,784)
基金份额持有人 应占净资产减 少额	8,628,795	8,244,778	8,884,348	10,180,971	58,118,736	30,582	49,860,704	18,746,450
	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额
截至 2022 年 1 月 1 日	9,984,184.41	9,168,243.88	1,401,071.05	1,648,285.39	6,000,000.00	20,458.40	5,619,925.29	2,104,555.41
认购份额^	11,749,595.11	1,128,583.75	32,012.65	13,728.70	79,760.71	-	10,951.97	-
截至 2022 年 6 月 30 日	(14,529,355.57)	(2,787,033.30)	(577,010.84)	(388,331.81)	-	-	(787,936.98)	-
赎回份额	7,204,423.95	7,509,794.33	856,072.86	1,273,682.28	6,079,760.71	20,458.40	4,842,940.28	2,104,555.41

^包括股息再投资

高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

基金份额持有人应占净资产净值变动表 (未经审计) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日的六个月

	M 类人民币 (累积) 美元	M 类人民币对冲 (累积) 美元	M 类美元 (累积) 美元	总计 美元
截至 2022 年 1 月 1 日	1,454,098	17,662,608	14,469,318	251,828,779
认购份额 <sup>^</sup>	-	27,675,408	599,900	46,249,816
赎回份额	-	(36,057,670)	(13,506,003)	(90,754,774)
股利	-	-	-	(1,199,600)
	1,454,098	9,280,346	1,563,215	206,124,221
截至 2022 年 6 月 30 日	(224,808)	(4,078,996)	(1,563,215)	(36,998,217)
净资产减少额	1,229,290	5,201,350	-	169,126,004
	基金份额	基金份额	基金份额	
截至 2022 年 1 月 1 日	998,851.17	11,794,306.76	1,541,066.34	
认购份额 <sup>^</sup>	-	18,990,190.13	66,141.12	
截至 2022 年 6 月 30 日	-	(26,649,203.34)	(1,607,207.46)	
赎回份额	998,851.17	4,135,293.55	-	

<sup>^</sup>包括股息再投资

## 高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

财务报表附注(未经审计)

### 1. 重要会计政策摘要

高腾亚洲受益基金(以下简称“子基金”)的中期财务报表采用与子基金年度财务报表相同的会计政策及计算方法。

### 2. 基金份额持有人派息

基金管理人可在考虑子基金的净收益及资本资产后酌情按其认为适当的情况每月向基金份额持有人派息。

截至 2023 年 6 月 30 日

	美元
截至 2023 年 1 月 1 日的未分配收益	64,433
本期间基金份额持有人应占净资产增加额	1,745,292
减: 外币净收益	(277,108)
减: 金融资产以公允价值计入损益的未变现盈利净额	(2,846,334)
期内收益分配前的未分配损失	(1,313,717)
期内向基金份额持有人分配的收益	(428,521)
于 2023 年 6 月 30 日	(1,742,238)

截至 2022 年 6 月 30 日

	美元
截至 2022 年 1 月 1 日的未分配收益	225,552
期内基金份额持有人应占净资产减少额	(36,998,217)
减: 外币净收益	(1,751)
加: 金融资产以公允价值计入损益的未变现亏损净额	22,460,500
期内收益分配前的未分配损失	(14,313,916)
期内向基金份额持有人分配的收益	(1,199,600)
截至 2022 年 6 月 30 日	(15,513,516)

高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

财务报表附注(未经审计)(续)

2. 基金份额持有人派息(续)

	2023 美元
<b>A类港元对冲(派息)</b>	
2023年1月12日按每基金份额0.0367港元支付	31,938
2023年2月15日按每基金份额0.0392港元支付	34,491
2023年3月15日按每基金份额0.0377港元支付	32,890
2023年4月13日按每基金份额0.0377美元支付	32,939
2023年5月17日按每基金份额0.0369港元支付	31,781
2023年6月14日按每基金份额0.0368港元支付	31,541
	<hr/> 195,580
<b>A类美元(派息)</b>	
2023年1月12日按每基金份额0.0344美元支付	38,990
2023年2月15日按每基金份额0.0364美元支付	41,175
2023年3月15日按每基金份额0.0356美元支付	40,498
2023年4月13日按每基金份额0.0350美元支付	39,612
2023年5月17日按每基金份额0.0347美元支付	36,628
2023年6月14日按每基金份额0.0342美元支付	36,038
	<hr/> 232,941
总计	<hr/> <hr/> 428,521

高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

财务报表附注(未经审计)(续)

2. 基金份额持有人派息(续)

	2022 美元
<b>A类港元对冲(派息)</b>	
2022年1月6日按每基金份额0.0460港元支付	53,854
2022年2月9日按每基金份额0.0444港元支付	50,165
2022年3月8日按每基金份额0.0422港元支付	47,446
2022年4月6日按每基金份额0.0423港元支付	44,318
2022年5月4日按每基金份额0.0416港元支付	43,690
2022年6月8日按每基金份额0.0400港元支付	39,648
	<hr/> 279,121 <hr/>
<b>A类美元(派息)</b>	
2022年1月6日按每基金份额0.0431美元支付	71,101
2022年2月9日按每基金份额0.0414美元支付	66,291
2022年3月8日按每基金份额0.0392美元支付	62,235
2022年4月6日按每基金份额0.0395美元支付	61,022
2022年5月4日按每基金份额0.0386美元支付	50,561
2022年6月8日按每基金份额0.0375美元支付	49,036
	<hr/> 360,246 <hr/>
<b>I类美元(派息)</b>	
2022年1月6日按每基金份额0.0478美元支付	100,598
2022年2月9日按每基金份额0.0460美元支付	96,810
2022年3月8日按每基金份额0.0436美元支付	91,759
2022年4月6日按每基金份额0.0440美元支付	92,600
2022年5月4日按每基金份额0.0430美元支付	90,496
2022年6月8日按每基金份额0.0418美元支付	87,970
	<hr/> 560,233 <hr/>
总计	<hr/> <hr/> 1,199,600 <hr/> <hr/>

## 高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

财务报表附注 (未经审计) (续)

### 3. 基金份额持有人应占资产净值

对于分别发行或回购的基金份额, 收到或支付的对价基于子基金在交易日的基金份额资产净值。根据信托契约的规定, 基于最终交易的市场价格或收盘价, 对子基金投资头寸进行估值以确定认购和赎回的每一基金份额交易资产净值。子基金的基金份额资产净值的计算方法是将子基金的净资产除以未偿基金份额总数。

可赎回基金份额可在每个估值日 (即日历年的每个工作日) 发行和赎回。可赎回份额持有人可在工作日下午 4 时之前 (香港时间) 认购或赎回可赎回份额。认购及赎回价格均参照估值日有关类别的每一基金份额资产净值计算。

为保护所有份额持有人的利益, 基金管理人可将任一赎回日赎回的任何子基金份额数量限制在相关已发行子基金份额总数的 10%。在此情况下, 有关限额将按比例适用, 以便所有在赎回当日提出有效赎回要求的有关子基金份额持有人可赎回相同比例的基金份额。

每一基金份额资产净值计算如下:

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
基金份额持有人应占资产净值 (美元)		
A 类港元对冲 (累积)	6,010,063	6,173,679
A 类港元对冲 (派息)	6,865,012	7,187,352
A 类美元 (累积)	6,032,914	6,870,179
A 类美元 (派息)	8,023,613	8,698,394
B 类美元 (累积)	-	21,037,159
I 类离岸人民币对冲 (累积)	267,394	280,196
I 类美元 (累积)	24,507,965	23,841,886
I 类美元 (派息)	-	-
M 类人民币 (累积)	1,234,886	1,212,424
M 类人民币 (派息)	-	-
M 类人民币对冲 (累积)	850,339	1,780,044
M 类美元 (累积)	-	-
发行的基金份额数量 (基金份额)		
A 类港元对冲 (累积)	5,049,648.75	5,217,851.04
A 类港元对冲 (派息)	6,623,583.93	6,802,905.42
A 类美元 (累积)	578,668.38	671,197.08
A 类美元 (派息)	1,054,352.00	1,133,368.98
B 类美元 (累积)	-	2,220,074.72
I 类离岸人民币对冲 (累积)	196,276.22	196,276.22
I 类美元 (累积)	2,354,896.21	2,339,689.85
I 类美元 (派息)	-	-
M 类人民币 (累积)	998,851.17	998,851.17
M 类人民币 (派息)	-	-
M 类人民币对冲 (累积)	748,710.24	1,496,410.24
M 类美元 (累积)	-	-

## 高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

财务报表附注(未经审计)(续)

### 3. 基金份额持有人应占资产净值(续)

	2023年 6月30日	2022年 12月31日
每一基金份额资产净值		
A类港元对冲(累积)	9.32 港元	9.23 港元
A类港元对冲(派息)	8.12 港元	8.24 港元
A类美元(累积)	10.42 美元	10.23 美元
A类美元(派息)	7.60 美元	7.67 美元
B类美元(累积)	-	9.47 美元
I类离岸人民币对冲(累积)	离岸人民币 9.91 元	离岸人民币 9.87 元
I类美元(累积)	10.40 美元	10.19 美元
I类美元(派息)	-	-
M类人民币(累积)	离岸人民币 8.99 元	离岸人民币 8.39 元
M类人民币(派息)	-	-
M类人民币对冲(累积)	离岸人民币 8.26 元	离岸人民币 8.23 元
M类美元(累积)	-	-

财务状况表中列报的归属于基金份额持有人的净资产与为处理基金份额认购和赎回而确定的归属于基金份额持有人的净资产的对账如下:

	2023年 6月30日 美元	2022年 12月31日 美元
基金份额持有人应占公布净资产增加额 (按照子基金的信托契约计算)	53,802,170	77,101,118
设立费用调整数(附注(a))	(9,984)	(19,805)
基金份额持有人应占资产净值 (按香港财务报告准则计算)	<u>53,792,186</u>	<u>77,081,313</u>

备注:

- (a) 解释性备忘录规定于子基金运作的首5年摊销成立成本,而非按香港财务报告准则规定于本期间发生的金额作为费用。

## 高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

财务报表附注(未经审计)(续)

### 3. 基金份额持有人应占资产净值(续)

	2023年6月30日	
	基金份额价格 (在财务报表中列报)	公布基金份额价格:
A类港元对冲(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	9.32 港元*	9.32 港元
A类港元对冲(派息)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	8.12 港元*	8.12 港元
A类美元(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	10.42 美元*	10.42 美元
A类美元(派息)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	7.60 美元	7.61 美元
B类美元(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	-	-
I类离岸人民币对冲(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	离岸人民币 9.91 元*	离岸人民币 9.91 元
I类美元(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	10.40 美元*	10.40 美元
I类美元(派息)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	-	-
M类人民币(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	离岸人民币 8.99 元*	离岸人民币 8.99 元
M类人民币(派息)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	-	-
M类人民币对冲(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	离岸人民币 8.26 元*	离岸人民币 8.26 元
M类美元(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	-	-

\*基金份额价格设立成本调整的影响小于小数点后两位。

## 高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

财务报表附注(未经审计)(续)

### 3. 基金份额持有人应占资产净值(续)

	2022年12月31日	
	基金份额价格(在财务报表 中列报)	公布基金份额 价格:
A类港元对冲(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	9.23 港元*	9.23 港元
A类港元对冲(派息)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	8.24 港元*	8.24 港元
A类美元(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	10.23 美元*	10.23 美元
A类美元(派息)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	7.67 美元*	7.67 美元
B类美元(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	9.47 美元*	9.47 美元
I类离岸人民币对冲(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	离岸人民币9.87元*	离岸人民币9.87元*
I类美元(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	10.19 美元*	10.19 美元
I类美元(派息)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	-	-
M类人民币(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	离岸人民币8.39元*	离岸人民币8.39元*
M类人民币(派息)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	-	-
M类人民币对冲(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	离岸人民币8.23元*	离岸人民币8.23元*
M类美元(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	-	-

\*基金份额价格设立成本调整的影响小于小数点后两位。

高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

投资组合明细表 (未经审计)

截至 2023 年 6 月 30 日

债务证券 (报价)	持有量/面值	公允价值 美元	应计利息 美元	占净资产 百分比
<b>澳大利亚</b>				
麦格理集团有限公司 5.887% 15062034	500,000	491,395	1,308	0.91
西太平洋银行公司 5.405% 10082033	300,000	283,785	6,351	0.53
<b>巴林</b>				
巴林政府国际债券 6.25% 18102030	500,000	503,535	6,337	0.94
<b>法国</b>				
法国电力公司 9.125% PERP	500,000	512,845	2,028	0.95
<b>香港</b>				
机场管理局 2.1% PERP	1,000,000	916,080	1,342	1.70
机场管理局 4.875% 12012033	500,000	509,405	11,443	0.95
Elect Global Investments Ltd 4.1% PERP	450,000	403,672	6,048	0.75
富卫有限公司 6.675% PERP	400,000	362,376	11,125	0.67
港灯电力投资有限公司 2.25% 09062030	250,000	210,057	344	0.39
香港政府国际债券 5.25% 11012053	200,000	225,478	4,958	0.42
<b>印度</b>				
ABJA Investment Co Pte Ltd 5.95% 31072024	400,000	398,948	9,983	0.74
其力行有限公司 6.25% 25102025	450,000	437,063	5,156	0.81
Continuum Energy Levanter Pte Ltd 4.5% 09022027	300,000	259,688	4,952	0.48
Diamond II Ltd 7.95% 28072026	400,000	393,964	5,565	0.73
印度进出口银行 3.25% 15012030	200,000	177,212	2,997	0.33
印度进出口银行 5.5% 18012033	250,000	250,725	6,226	0.47
GMR 海得拉巴国际机场有限公司 4.25% 27102027	200,000	178,250	1,511	0.33
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd 5.5% 06042025	200,000	192,166	2,597	0.36
印度绿色能源控股公司 4% 22022027	200,000	175,334	2,867	0.33
JSW 钢铁有限公司 5.375% 04042025	300,000	294,750	3,897	0.55
Network i2i Ltd 5.65% PERP	350,000	339,874	4,175	0.63
印度电力金融股份有限公司 3.35% 16052031	500,000	423,375	2,094	0.79
信实工业有限公司 2.875% 12012032	250,000	208,645	3,374	0.39
信实工业有限公司 4.875% 10022045	250,000	226,370	4,773	0.42
印度国家银行/伦敦 4.875% 05052028	500,000	493,200	3,792	0.92
Vedanta Resources Finance II PLC 8.95% 11032025	400,000	303,500	10,939	0.56
<b>印度尼西亚</b>				
ABM Investama Tbk PT 9.5% 05082026	250,000	226,878	9,632	0.42
Adaro Indonesia PT 4.25% 31102024	300,000	290,700	2,160	0.54
曼底利银行有限责任公司 5.5% 04042026	600,000	600,192	7,975	1.12
印尼自由港有限公司 5.315% 14042032	250,000	237,178	2,842	0.44
Indika Energy Capital IV Pte Ltd 8.25% 22102025	350,000	348,358	5,534	0.65

高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

投资组合明细表 (未经审计) (续)

截至 2023 年 6 月 30 日

债务证券 (续) (报价)	持有量/面值	公允价值 美元	应计利息 美元	占净资产 百分比
<b>印度尼西亚 (续)</b>				
印度尼西亚阿萨汉铝业公司 5.8% 15052050	250,000	222,465	1,853	0.41
印尼政府国际债券 4.85% 11012033	400,000	401,624	9,161	0.75
印尼政府国际债券 5.65% 11012053	200,000	211,498	5,336	0.39
JGC Ventures Pte Ltd 0% 30062025*	11,951	2,405	-	0.00
JGC Ventures Pte Ltd 3% 30062025*	342,545	119,161	-	0.22
LLPL Capital Pte Ltd 6.875% 04022039 (82.71%)	300,000	224,424	6,966	0.42
Medco Platinum Road Pte Ltd 6.75% 30012025	241,000	239,494	6,823	0.45
Modernland Overseas Pte Ltd 3% 30042027*	1,532,974	521,671	-	0.97
Modernland Overseas Pte Ltd 3.00% 30042027*	63,835	21,324	-	0.04
Pertamina Persero PT 6.5% 07112048	300,000	316,995	2,925	0.59
Tower Bersama Infrastructure Tbk PT 4.25% 21012025	300,000	293,625	5,667	0.55
<b>爱尔兰</b>				
SMBC Aviation Capital Finance DAC 5.45% 03052028	500,000	490,650	4,390	0.91
<b>日本</b>				
朝日生命保险公司 6.9% PERP	500,000	507,250	14,854	0.94
农林中央金库 5.43% 09032028	200,000	201,948	3,379	0.38
乐天集团 10.25% 30112024	200,000	198,724	1,765	0.37
<b>约旦</b>				
约旦政府国际债券 7.5% 13012029	300,000	299,865	4,875	0.56
<b>澳门</b>				
冠途控股有限公司 4.5% 27012026	500,000	440,455	9,625	0.82
Melco Resorts Finance Ltd 4.875% 06062025	200,000	189,930	677	0.35
Melco Resorts Finance Ltd 5.25% 26042026	300,000	279,963	2,844	0.52
Melco Resorts Finance Ltd 5.75% 21072028	300,000	261,714	7,667	0.49
美高梅中国控股有限公司 4.75% 01022027	200,000	181,480	3,958	0.34
美高梅中国控股有限公司 5.875% 15052026	400,000	382,332	3,003	0.71
金沙中国有限公司 3.8% 08012026	300,000	282,267	6,199	0.52
金沙中国有限公司 5.4% 08082028	700,000	667,184	16,405	1.24
Studio City Finance Ltd 5% 15012029	200,000	149,538	4,611	0.28
永利澳门有限公司 5.5% 15012026	500,000	464,375	12,681	0.86
永利澳门有限公司 5.625% 26082028	500,000	433,525	9,766	0.81
<b>马来西亚</b>				
国库控股有限公司 4.876% 01062023	1,000,000	994,380	4,063	1.85
Petronas Capital Ltd 2.48% 28012032	300,000	251,610	3,162	0.47
<b>新西兰</b>				
西太平洋银行新西兰有限公司 4.902% 15022028	400,000	391,636	7,407	0.73

## 高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

投资组合明细表 (未经审计) (续)

截至 2023 年 6 月 30 日

债务证券 (续) (报价)	持有量/面值	公允价值 美元	应计利息 美元	占净资产 百分比
<b>中华人民共和国</b>				
雅居乐集团控股有限公司 5.5% 17052026	200,000	42,500	1,344	0.08
阿里巴巴集团控股有限公司 2.125% 09022031	400,000	325,012	3,353	0.60
阿里巴巴集团控股有限公司 3.6% 28112024	1,000,000	969,400	3,300	1.80
中银航空租赁有限公司 3.25% 29042025	500,000	476,900	2,799	0.89
中银航空租赁美国分公司 4.875% 03052033	400,000	387,956	3,142	0.72
建业地产股份有限公司 7.25% 13082024*	300,000	30,954	-	0.06
中环广场发展有限公司 5.75% PERP	200,000	175,998	1,501	0.33
中国信达 2020 I 管理有限公司 3.125% 18032030	400,000	335,856	3,576	0.62
中国宏桥集团有限公司 6.25% 08062024	250,000	244,895	998	0.46
中国石油天然气集团有限公司 4.7% 30062026	500,000	428,440	65	0.80
中国海外宏洋财务 IV 开曼有限公司 2.45% 09022026	700,000	617,120	6,765	1.15
中国水务集团有限公司 4.85% 18052026	400,000	346,788	2,317	0.64
创兴银行有限公司 5.7% PERP	250,000	244,225	6,571	0.45
中金香港金融 5.493% 01032026	-	-	7,324	0.00
中国中信股份有限公司 2.85% 25022030	250,000	219,358	2,494	0.41
时代瑞鼎发展有限公司 2.625% 17092030	250,000	211,712	1,896	0.39
碧桂园控股有限公司 3.125% 22102025	-	-	1,797	0.00
碧桂园控股有限公司 4.2% 06022026	200,000	65,416	3,383	0.12
碧桂园控股有限公司 6.15% 17092025	600,000	199,500	10,660	0.37
大发地产集团有限公司 12.5% 30062022*	1,536,000	85,417	-	0.16
怡略有限公司 6.5% 11072025*	637,328	63,733	-	0.12
怡略有限公司 6.5% 11072027*	49	4	-	0.00
复星国际 (BVI) 有限公司 5% 18052026	400,000	295,528	2,389	0.55
方兴光耀有限公司 4.25% 23072029	424,000	333,077	7,909	0.62
吉利汽车控股有限公司 4% PERP	500,000	477,710	1,222	0.89
绿地香港控股有限公司 10.21% PERP	500,000	158,745	21,838	0.30
绿城中国控股有限公司 4.7% 29042025	450,000	405,823	3,642	0.75
海底捞国际控股有限公司 2.15% 14012026	500,000	453,250	4,987	0.84
合生创展集团有限公司 6.8% 28122023	300,000	269,124	170	0.50
恒以德国际控股有限公司 3.1% 28042026	250,000	227,420	1,356	0.42
佳源国际控股有限公司 12% 30102022*	1,000,000	85,540	-	0.16
佳源国际控股有限公司 12.5% 08042023*	1,350,000	106,205	-	0.20
联想集团有限公司 6.536% 27072032	300,000	302,781	8,388	0.56
龙湖集团控股有限公司 3.95% 16092029	200,000	149,400	2,304	0.28
美团点评 3.05% 28102030	500,000	395,295	2,669	0.73
当代置业中国有限公司 7% 30122023*	199,694	12,299	-	0.02
当代置业中国有限公司 8% 30122024*	518,667	30,264	-	0.06
当代置业中国有限公司 9% 30122025*	598,461	35,710	-	0.07
当代置业中国有限公司 9% 30122026*	797,950	48,348	-	0.09
当代置业中国有限公司 9% 30122027*	1,563,952	92,930	-	0.17
金辉控股集团有限公司 7.8% 20032024	1,200,000	887,004	26,260	1.65
力高地产集团有限公司 10.5% 06012023*	17,000,000	-	-	0.00
力高地产集团有限公司 11% 06082023*	611,366	47,498	-	0.09
弘阳地产集团有限公司 10.5% 03102022*	840,000	71,644	-	0.13

高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

投资组合明细表 (未经审计) (续)

截至 2023 年 6 月 30 日

债务证券 (续) (报价)	持有量/面 值	公允价值 美元	应计利息 美元	以公允价 值计量的 净资产%
<b>中华人民共和国 (续)</b>				
弘阳地产集团有限公司 7.3% 21052024*	700,000	59,864	-	0.11
RKPF Overseas 2019 A Ltd 6% 04092025	200,000	115,000	3,900	0.21
RKPF Overseas 2020 A Ltd 5.125% 26072026	300,000	144,858	6,620	0.27
融信中国控股有限公司 8.1% 09062023*	200,000	12,182	-	0.02
世茂集团控股有限公司 3.45% 11012031*	300,000	28,650	-	0.05
祥生控股集团有限公司 10.5% 07062022*	1,300,000	43,212	-	0.08
瑞安房地产控股有限公司 5.5% 29062026	300,000	225,438	92	0.42
瑞安房地产控股有限公司 6.15% 24082024	200,000	171,022	4,339	0.32
远洋地产宝财 IV 有限公司 2.7% 13012025	450,000	140,346	5,670	0.26
腾讯控股有限公司 2.88% 22042031	400,000	340,468	2,208	0.63
腾讯音乐娱乐集团 2% 03092030	500,000	394,890	3,278	0.73
Xiaomi Best Time International Ltd 2.875% 14072031	200,000	151,436	2,667	0.28
阳光城嘉世国际有限公司 10.25% 15092022*	500,000	9,665	-	0.02
阳光城嘉世国际有限公司 9.25% 15042023*	800,000	15,368	-	0.03
正荣地产集团有限公司 7.1% 10092024*	500,000	22,835	-	0.04
正荣地产集团有限公司 8% 03062023*	1,000,000	39,130	-	0.07
正荣地产集团有限公司 9.15% 06052023*	600,000	27,546	-	0.05
中原志诚有限公司 3.2% 06072026	400,000	369,800	6,222	0.69
<b>菲律宾</b>				
菲律宾政府国际债券 5% 17072033	400,000	405,440	9,111	0.75
菲律宾政府国际债券 5.5% 17012048	300,000	309,015	7,517	0.57
菲律宾中华银行 6.5% PERP	500,000	444,325	11,194	0.83
<b>沙特阿拉伯</b>				
Saudi Electricity Sukuk Programme Co 4.632% 11042033	500,000	495,125	5,147	0.92
<b>新加坡</b>				
大华银行有限公司 5.25% PERP	250,000	191,530	4,331	0.36
<b>韩国</b>				
韩国进出口银行 5% 11012028	400,000	401,880	9,444	0.75
Kodit Global 2023-1 Co Ltd 4.954% 25052026	200,000	196,496	991	0.37
韩国产业银行 4.25% 08092032	500,000	482,085	6,670	0.90
韩国住房金融公司 4.625% 24022028	300,000	295,134	4,895	0.55
韩国国家石油公司 4.875% 03042028	1,000,000	992,460	11,917	1.84
韩国海洋商业公司 4.5% 03052028	300,000	292,317	4,350	0.54
SK On Co Ltd 5.375% 11052026	400,000	396,928	2,986	0.74
<b>泰国</b>				
泰华农民银行/香港 3.343% 02102031	200,000	176,804	1,653	0.33
泰华农民银行/香港 5.458% 07032028	400,000	401,100	6,913	0.75
Thaioil Treasury Center Co Ltd 4.625% 20112028	500,000	471,365	2,634	0.88

高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

投资组合明细表 (未经审计) (续)

截至 2023 年 6 月 30 日

债务证券 (续) (报价)	持有量/面值	公允价值 美元	应计利 息 美元	占净资产 百分比
<b>阿拉伯联合酋长国</b>				
Mashreqbank PSC 7.875% 24022033	400,000	417,500	11,112	0.78
MDGH GMTN RSC Ltd 4.375% 22112033	300,000	289,056	2,370	0.54
<b>英国</b>				
巴克莱集团 9.25% PERP	200,000	230,689	1,031	0.43
CK Hutchison International 23 Ltd 4.75% 21042028	500,000	494,265	4,618	0.92
CK Hutchison International 23 Ltd 4.875% 21042033	600,000	593,184	5,687	1.10
汇丰控股有限公司 6.547% 20062034	300,000	298,053	600	0.55
劳埃德银行集团 8% PERP	350,000	318,080	311	0.59
渣打集团有限公司 7.776% 16112025	500,000	510,530	4,860	0.95
<b>美利坚合众国</b>				
AIR Lease Corp Sukuk Ltd 5.85% 01042028	500,000	505,960	8,613	0.94
现代资本美国 5.5% 30032026	500,000	495,790	6,951	0.92
辉瑞投资有限公司 4.45% 19052028	500,000	490,490	2,596	0.91
美国国库券/债券 3.375% 15052033	1,500,000	1,443,516	6,466	2.68
		45,226,116	640,770	84.08%
<b>集体投资计划</b>				
高腾中国人民币债券基金 - B 类 (离岸人民币) - ACC	600,000	830,538		1.54
高腾中国人民币债券基金 - B 类 (美元对冲) - ACC	90,000	914,400		1.70
高腾大中华区精选债券基金-B 类 (美元) -ACC	545,965	4,611,491		8.57
		6,356,429	-	11.81
<b>外币远期合约</b>				
	离岸人民币			
买入离岸人民币/美元 - 高盛	8,020,000 元	(24,498)		-0.04
买入港元/美元 - 高盛	105,700,000 港元	(31,335)		-0.06
	离岸人民币			
卖出离岸人民币/美元 - 高盛	6,156,413 元	53,275		0.10
卖出英镑/美元 - 高盛	400,000 英镑	(7,301)		-0.01
卖出港元/美元 - 高盛	3,000,000 港元	413		0.00
卖出新加坡元/美元 - 高盛	250,000 新加坡元	1,710		0.00
		(7,736)		-0.01
总投资		51,574,809	640,770	95.88
其他净资产		2,217,377		4.12
基金份额持有人应占资产净值		53,792,186		100.00
按成本计算投资总额		68,429,686		

高腾亚洲收益基金

(高腾微基金的子基金)

投资组合所持投资项目变动表 (未经审计)

截至 2023 年 6 月 30 日的六个月

	截至 2023 年 6 月 30 日的净资产 百分比	截至 2022 年 12 月 31 日的净 资产百分比
债务证券		
(按风险国家分列)		
澳大利亚	1.44	1.29
巴林	0.94	-
法国	0.95	2.76
加纳	-	0.45
香港	4.88	7.16
印度	8.84	9.94
印度尼西亚	7.96	8.62
爱尔兰	0.91	-
日本	1.69	2.89
约旦	0.56	-
科威特	-	0.48
澳门	6.94	3.63
马来西亚	2.32	0.25
新西兰	0.73	-
中华人民共和国	23.53	34.62
菲律宾	2.15	2.32
沙特阿拉伯	0.92	-
新加坡	0.36	0.23
韩国	5.69	1.71
西班牙	-	0.48
瑞士	-	1.21
泰国	1.96	2.98
阿拉伯联合酋长国	1.32	1.34
英国	4.54	1.99
美利坚合众国	5.45	-
外币远期合约	(0.01)	0.07
集体投资计划	11.81	8.98
总投资	95.88	93.40
其他资产	4.12	6.60
	100.00	100.00