



INCOME PARTNERS

2022 年中期报告

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)
(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

半年度财务报表 (未经审计)

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)
(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

目录

基金管理与行政管理	1
基金管理人报告	2
2022 年业绩概览	2
市场概述与展望	3
投资组合概况 (截至 2022 年 6 月 30 日)	3
财务报表 (未经审计)	6
财务状况表 (未经审计)	6
损益和其他综合收益表 (未经审计)	7
份额持有人应占资产净值变动表 (未经审计)	8
财务报表附注 (未经审计)	9
投资组合 (未经审计)	28
投资组合持仓变动表 (未经审计)	36
抵押品持仓 (未经审计)	41

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)
(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

基金管理人与行政管理

基金管理人

弘收投资管理(香港)有限公司
香港
英皇道 979 号
太古坊
康桥大厦
3503-4 室

受托人和主要办事处

花旗信托有限公司
香港
中环花园道三号
冠君大厦 50 楼

基金登记机构兼处理代理人

Citicorp Financial Services Limited
香港九龙
观塘
海滨道 83 号
One Bay East 花旗大楼

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

普华永道
香港
中环
太子大厦 22 楼

瑞士代表性代理人

Acolin Fund Services AG, 日内瓦分行
6, Cours de Rive
CH-1204 Geneva
瑞士

基金管理人董事

魏志华
谢汉耀
叶小慧
林杨

行政管理人

花旗银行香港分行
香港
中环花园道三号
冠君大厦 50 楼

基金管理人的律师 (香港法律方面)

艾金岗波律师事务所
香港中环
皇后大道中 15 号置地广场
告罗士打大厦 18 楼 1801-08 及 10 室

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

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

2022 年业绩概览

于 2022 年前六个月，弘收高收益波幅管理债券基金（本“基金”）实现的总回报¹如下表所示：

份额类别	ISIN 编码	彭博代码	基金类别成立日期	2022 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	21.49%	-
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)	21.49%	8.3%
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	-18.13%	8.0%
2A 类累积 (美元) 份额	HK0000421419	IRHY2AA HK	2011 年 7 月 27 日	-21.68%	-
2A 类分派 (美元) 份额	HK0000421401	IPRHY2A HK	2011 年 8 月 3 日	-21.68%	8.3%
2B 类累积 (人民币) 份额	HK0000421435	IRHY2BA HK	2011 年 7 月 27 日	-17.32%	-
2B 类分派 (人民币) 份额	HK0000421427	IPRHY2B HK	2011 年 7 月 27 日	-17.32%	10.6%
2C 类分派 (美元) 份额	HK0000421443	IPRHY2C HK	2011 年 8 月 10 日	-21.68%	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	-21.19%	-
2D 类分派 (港元) 份额	HK0000421450	IPRHY2D HK	2018 年 2 月 9 日	-21.19%	8.2%
2E 类累积 (澳元) 份额	HK0000421484	IRHY2EA HK	2018 年 3 月 7 日	-17.28%	-
2E 类分派 (澳元) 份额	HK0000421476	IPRHY2E HK	2018 年 5 月 4 日	-17.29%	7.6%
2F 类累积 (澳元对冲) 份额	HK0000421500	IRHY2FA HK	2015 年 10 月 13 日	-18.64%	-
2F 类分派 (澳元对冲) 份额	HK0000421492	IPRHY2F HK	2019 年 5 月 2 日	-18.64%	7.4%
2G 类累积 (美元对冲) 份额	HK0000421526	IRHY2GA HK	2015 年 10 月 13 日	-18.34%	-
2G 类分派 (美元对冲) 份额	HK0000421518	IPRHY2G HK	2015 年 10 月 19 日	-18.33%	8.1%
2I 类累积 (新加坡元对冲) 份额	HK0000421567	IRHY2IA HK	2019 年 4 月 30 日	-18.41%	-
2I 类分派 (新加坡元对冲) 份额	HK0000421559	IPRHY2I HK	2019 年 4 月 24 日	-18.40%	7.9%
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	-18.99%	-
2K 类分派 (欧元对冲) 份额	HK0000490026	IPRHY2K HK	2019 年 5 月 7 日	-18.93%	6.1%
2L 类累积 (港元对冲) 份额	HK0000490059	IRHY2LA HK	2019 年 5 月 7 日	-18.59%	-
2L 类分派 (港元对冲) 份额	HK0000490042	IPRHY2L HK	2019 年 4 月 17 日	-18.56%	7.9%
2XB 类累积 (人民币) 份额	HK0000706074	-	2021 年 12 月 22 日	-17.31%	-
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: $[(1 + \text{每份额收益分配} / \text{除息后资产净值})^{\text{收益分配频率}} - 1]$ 。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。

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。

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

市场概述与展望

亚洲高收益债券市场于 2022 年上半年疲软，一直持续到全球风险资产于 6 月出现回撤。

年初又有几家中国房地产开发商陷入流动性紧缩，从而令投资者对于陷入困境的开发商忧心忡忡。中国房地产板块于 3 月进一步疲软，这主要归因于俄乌冲突以及对于中国经济在 5 月陷入低迷的担忧。俄乌冲突导致市场对全球风险资产产生避险情绪。在全球风险资产回撤之际，亚洲高收益债券市场走软。发达市场利率升高，再加上经济增长前景不断恶化，令风险情绪承受压力。另一方面，随着防疫限制措施于 6 月逐步放宽，中国的经济数据有所改善。

货币方面，人民币兑美元在第二季度进一步走软。4 月份，沙特考虑在对中国的石油销售交易中使用人民币结算并且以色列将人民币加入其央行外汇储备，这表明去美元化开始形成趋势以及人民币成为全球储备货币之路依然完好。鉴于人民币短期内走势疲软，我们低配人民币至 80% 左右（而中性水平为 100%），并且于 5 月对人民币低配头寸进行了获利了结。

展望未来，由于涉及融创和绿地等开发商的重大负面新闻频频传出，中国房地产板块仍将疲软。不过，随着上海重新开放以及房地产板块迎来更多扶持举措，我们预计未来几个月内合同销售金额将会企稳。因此，我们依然略微超配中国房地产板块。

我们认为，在当前环境下，最重要的是要审慎挑选债券。展望未来，基金管理人将继续密切关注中国房地产板块内部的违约风险以及中国对于房地产市场的政策立场，并将主动管理风险。

投资组合概况（截至 2022 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) ³ :	到期收益率 (以美元计) ⁴ :
2.7 年	BB	11.1%	10.6%

前 10 大持仓	25.8%
新世界发展有限公司	3.6%
电讯盈科有限公司	2.9%
Vedanta Resources PLC	2.8%
华能香港资本有限公司	2.7%
SMC Global Power Holdings	2.6%
中国工商银行股份有限公司	2.6%
中国农业发展银行	2.4%
Greenko Investment Co	2.2%
巴基斯坦政府债券	2.1%
蒙古国际债券	2.0%

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）。

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）和美元计价（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）。

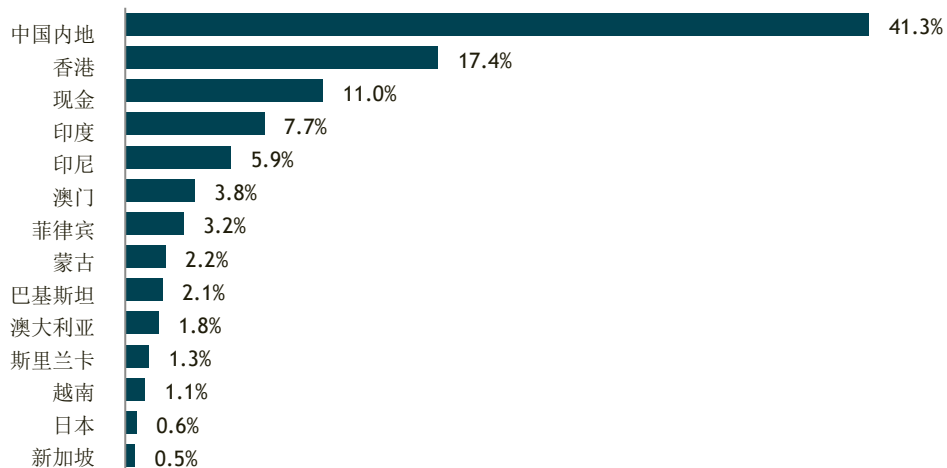
弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

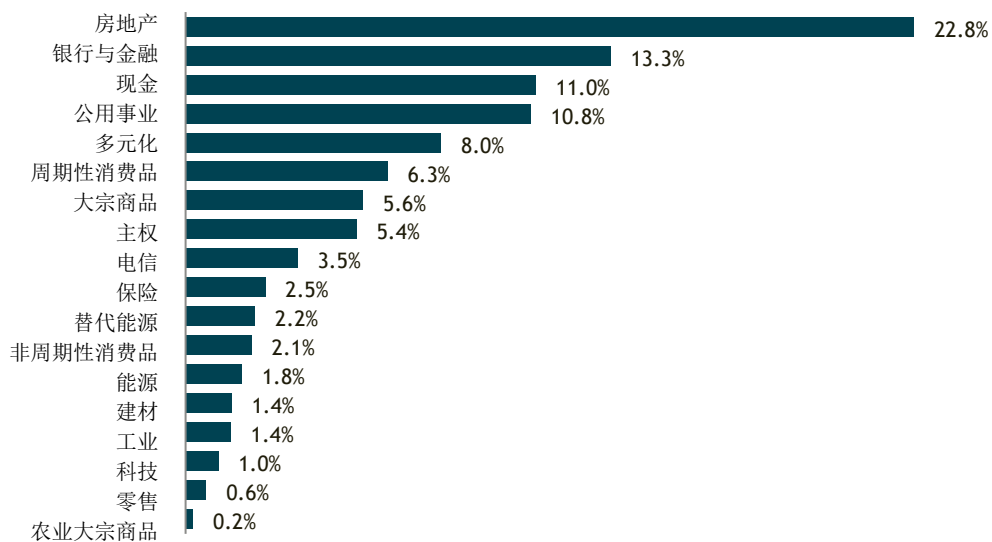
(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

投资组合概况 (截至 2022 年 6 月 30 日) (续)

地域敞口



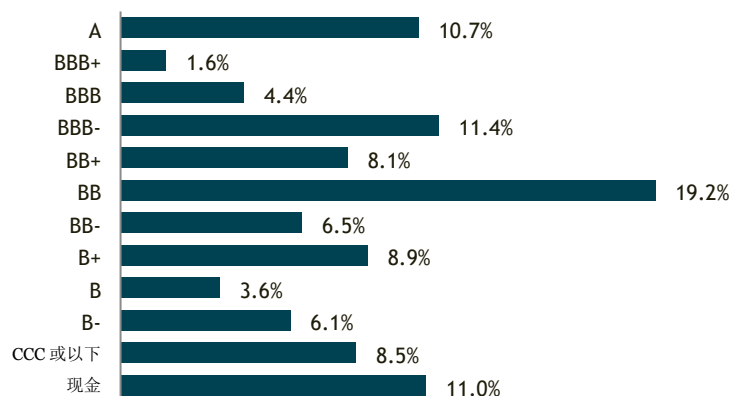
行业敞口



弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)
(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

投资组合概况 (截至 2022 年 6 月 30 日) (续)

信用评级敞口



*由于四舍五入，总敞口可能并不相同。请注意，此处所示的评级敞口包括一部分弘收投资自身的隐含内部评级。如果债券持仓没有标普/穆迪/惠誉的评级，则适用弘收投资的内部信用评级。

资料来源：弘收投资，基于 2022 年 6 月 30 日

企业行动

根据日期为 2022 年 6 月 1 日的《致份额持有人的通知》(Notice to Shareholders)，本子基金日期为 2022 年 4 月的基金说明书 (“基金说明书”) 已进行更新，以声明自 2022 年 6 月 1 日起，匡正先生辞任基金管理人投资委员会成员一职。本子基金日期为 2022 年 4 月的基金说明书 (“基金说明书”) 将进行更新，以反映这一变化。

修订后的基金说明书和产品资料概要可见于基金管理人的网站 (www.incomepartners.com)。

如欲了解有关上述调整的进一步详情，请参阅相应的《致份额持有人的通知》。

弘收高收益波幅管理债券基金
 (弘收策略基金的子基金)
 (根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表 (未经审计)

财务状况表 (未经审计)

截至 2022 年 6 月 30 日

	截至 2022 年 6 月 30 日 (未经审计) 人民币	截至 2021 年 12 月 31 日 (经审计) 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	437,436,195	592,012,535
衍生金融工具	286,661	5,480,592
应收利息	8,991,883	10,064,520
预付款和其他应收款项	1,621,669	1,232,384
经纪机构应付款项	18,036,223	3,350,538
应收认购款项	-	331,642
保证金存款	30,000,113	23,747,735
银行结余	25,122,842	65,614,408
资产总计	<u>521,495,586</u>	<u>701,834,354</u>
负债 - 流动负债		
衍生金融工具	9,121,840	845,963
应付经纪机构款项	6,661,494	2,018,626
	2(a)	
	2(b)	
其他负债和应计支出	1,394,813	1,701,347
应付赎回款项	4,110,274	2,464,402
	2(g)	
负债 (不含份额持有人应占资产净值)	<u>21,288,421</u>	<u>7,030,338</u>
份额持有人应占资产净值	<u>500,207,165</u>	<u>694,804,016</u>
	<u>521,495,586</u>	<u>701,834,354</u>
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)	5 500,281,605	694,992,168
针对本基金用于得出份额持有人应占资产净值的不同基准所作的调整	5 (74,440)	(188,152)

随附的附注属于该等财务报表的一部分。

弘收高收益波幅管理债券基金
 (弘收策略基金的子基金)
 (根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

损益和其他综合收益表 (未经审计)

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月

	截至 2022 年 6 月 30 日止 附注 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2021 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币
收入		
债务利息收入	14,258,592	26,523,547
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 亏损净额	(151,655,398)	(18,685,827)
外汇收益 / (亏损) 净额	33,684,209	(5,649,125)
银行利息收入	50,269	19,624
退费	-	89,315
其他收入	79,013	106,351
投资 (亏损) / 收入总计	(103,583,315)	2,403,885
支出		
管理费	2(a) (4,191,498)	(6,445,052)
受托人费用	2(b) (33,523)	(33,469)
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) (489,982)	(653,505)
审计师酬金	(193,417)	(147,978)
其他营业支出	(210,967)	(173,203)
法律及专业费	(162,130)	(271,336)
营业支出总计	(5,281,517)	(7,724,543)
营业亏损	(108,864,832)	(5,320,658)
财务费用		
向可赎回份额持有人的收益分配	(15,789,305)	(24,205,442)
利息支出	-	-
收益分配后的亏损	(124,654,137)	(29,526,100)
经香港证监会认可费用的调整	(113,712)	(113,348)
份额持有人应占来自经营活动的资产净值减少	(124,767,849)	(29,639,448)

随附的附注属于该等财务报表的一部分。

弘收高收益波幅管理债券基金
 (弘收策略基金的子基金)
 (根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

份额持有人应占资产净值变动表 (未经审计)

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月

	截至 2022 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2021 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币
期初份额持有人应占资产净值	694,992,168	976,077,829
发行可赎回份额	32,257,219	107,122,290
赎回可赎回份额	(102,199,933)	(263,780,321)
份额持有人应占来自经营活动的资产净值减少	(124,767,849)	(29,639,448)
期末可赎回份额持有人应占资产净值	<u>500,281,605</u>	<u>789,780,350</u>
	截至 2022 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 份额	截至 2021 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 份额
期初已发行份额	4,214,950	4,791,083
发行的份额	103,429	485,123
赎回的份额	(616,584)	(978,911)
期末已发行份额	<u>3,701,795</u>	<u>4,297,295</u>

随附的附注属于该等财务报表的一部分。

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)
(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注 (未经审计)

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月

1 主要会计政策概要

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 2022 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。

2 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一般商业条款订立。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:

(a) 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%

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)
(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注(未经审计)(续)

截至 2022 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)

(a) 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 2022 年 6 月 30 日止六个月的管理费总额为 4,191,498 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日止六个月: 6,445,052 人民币), 截至 2022 年 6 月 30 日未偿付的数额为 612,638 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日: 970,430 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 2022 年 6 月 30 日止期间内, 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 2021 年 6 月 30 日止期间: 89,315 人民币)。管理费退费与本子基金持有的以及由基金管理人管理的投资基金有关。

(b) 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 2021 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 2021 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 2022 年 6 月 30 日止六个月的受托人费用总额为 33,523 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日止六个月: 33,469 人民币), 截至 2022 年 6 月 30 日未偿付的数额为 5,503 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日: 5,283 人民币)。

(c) 交叉交易

截至 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 6 月 30 日止期间内, 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。

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)
(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注 (未经审计) (续)

截至 2022 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)

(d) 于基金管理人所管理基金的投资

截至 2022 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 2022 年 6 月 30 日

	持仓量	份额价格 人民币	公允价值 人民币
IPRMBBF	<u>53,140</u>	<u>755.41</u>	<u>40,142,258</u>

截至 2021 年 6 月 30 日

	持仓量	份额价格 人民币	公允价值 人民币
IPRMBBF	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>

弘收高收益波幅管理债券基金
 (弘收策略基金的子基金)
 (根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注 (未经审计) (续)

截至 2022 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)

(e) 本子基金份额持仓

基金管理人及其关联人士截至 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日于本子基金的份额持仓如下。

基金管理人董事的关联方持有的份额:

	于 2022 年 1 月 1 日的 已发行份额	期间认购的 份额	期间赎回的 份额	于 2022 年 6 月 30 日的 已发行份额
2022 年				
2B 类人民币 (分派) 份额	<u>56,097</u>	-	<u>56,097</u>	-

	于 2021 年 1 月 1 日的 已发行份额	年内认购的 份额	年内赎回的 份额	于 2021 年 12 月 31 日的 已发行份额
2021 年				
2B 类人民币 (分派) 份额	-	<u>56,097</u>	-	<u>56,097</u>

基金管理人管理委员会成员持有的份额:

	于 2022 年 1 月 1 日的 已发行份额	期间认购的 份额	期间赎回的 份额	于 2022 年 6 月 30 日的 已发行份额
2022 年				
4C 类美元对冲 (累积) 份额	<u>3,514</u>	<u>5,298</u>	<u>3,514</u>	<u>5,298</u>

	于 2021 年 1 月 1 日的 已发行份额	年内认购的 份额	年内赎回的 份额	于 2021 年 12 月 31 日的 已发行份额
2021 年				
4C 类美元对冲 (累积) 份额	<u>3,514</u>	-	-	<u>3,514</u>

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)
(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注(未经审计)(续)

截至 2022 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)

(f) 银行结余

截至 2022 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 25,122,842 人民币(截至 2021 年 12 月 31 日: 65,614,408 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 2022 年 6 月 30 日止期间赚得的银行利息收入为 50,269 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日止期间: 19,624 人民币)。

(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金融服务、会计服务、行政管理服务和其他服务。

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

受托人已委任 Citibank N.A. (“花旗银行”) 担任本子基金资产的保管人, 通过其香港分行行事。

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 2022 年 6 月 30 日止六个月为 489,982 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日止六个月: 653,505 人民币), 截至 2022 年 6 月 30 日未偿付的数额为 88,522 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日: 113,386 人民币)。

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月的保管人费用总额为 98,176 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日止六个月: 96,285 人民币), 截至 2022 年 6 月 30 日未偿付的数额为 16,508 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日: 15,848 人民币)。

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月的行政管理费用总额为 305,173 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日止六个月: 442,419 人民币), 截至 2022 年 6 月 30 日未偿付的数额为 47,475 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日: 70,848 人民币)。

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月的基金登记机构费用总额为 21,589 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日止六个月: 39,390 人民币), 截至 2022 年 6 月 30 日未偿付的数额为 3,302 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日: 3,170 人民币)。

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月的合规监测费用总额为 30,518 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日止六个月: 44,241 人民币), 截至 2022 年 6 月 30 日未偿付的数额为 4,343 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日: 6,680 人民币)。

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月的财务报表编制费用总额为 34,526 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日止六个月: 31,170 人民币), 截至 2022 年 6 月 30 日未偿付的数额为 16,894 人民币(截至 2021 年 6 月 30 日: 16,840 人民币)。

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)
(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注(未经审计)(续)

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月

3 成立和认可费用

本子基金的成立费用(含法律费、结构费和顾问费)估计约为 50,000 美元。费用将自首次发售期结束之后的营业日(即 2011 年 7 月 26 日)起在 5 年内或在经受托人批准、由基金管理人确定的此等其他时期内摊销。于 2017 年 11 月 14 日,本信托获香港证监会认可,因获得认可而发生的费用约为 150,000 美元。认可费用将自认可之日起在 5 年内摊销。应该要注意的是,根据《国际财务报告准则》,不允许采用以上与摊销初步开支有关的政策,《国际财务报告准则》要求初步开支在发生时予以支出。基金管理人认为,与在全额发生时予以支出相比,该等处理对于初始的投资者而言更加公平,并认为对于本子基金的总体财务报表而言,偏差不太可能会重大。

如果本子基金在成立和认可费用全额摊销之前清盘,则未摊销的金额将由本子基金在其终止之前承担。

4 软佣金安排

基金管理人确认,截至 2022 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。

5 根据资产负债表的资产净值与已发布资产净值之间对账(因摊销香港证监会认可费用)

香港证监会认可费用将自认可之日起在 5 年内摊销。截至 2022 年 6 月 30 日,未摊销金额为 74,440 人民币。本基金就依据《国际财务报告准则》编制财务报表的会计政策是在香港证监会认可费用发生时在综合收益表中进行支出。根据《国际财务报告准则》在香港证监会认可费用发生时进行支出与本基金的招募说明书中指定的香港证监会认可费用的资本化和摊销有诸多不同之处,导致对资产净值进行调整。

	截至 2022 年 6 月 30 日 (未经审计) 人民币	截至 2021 年 12 月 31 日 (经审计) 人民币
根据资产负债表的资产净值与已发布资产净值之间 对账(因摊销香港证监会认可费用)		
财务状况表中列报的份额持有人应占资产净值会计 针对本子基金用于得出份额持有人应占资产净值的 不同基准所作的调整	500,207,165	694,804,016
	<u>74,440</u>	<u>188,152</u>
份额持有人应占资产净值(根据本基金的招募说明书)	<u>500,281,605</u>	<u>694,992,168</u>

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注 (未经审计) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月

6 可赎回份额

六个月内已发行可赎回份额的变动如下:

	于 2021 年 12 月 31 日 的已发行份额	期间发行的份额	期间赎回的份额	于 2022 年 6 月 30 日 的已发行份额
截至 2022 年 6 月 30 日				
<u>可赎回份额</u>				
1A 类美元 (累积) 份额	75,737	38,005	-	113,742
1A 类美元 (分派) 份额	20,000	-	-	20,000
1E 类美元 (分派) 份额	24,477	-	-	24,477
2A 类美元 (累积) 份额	33,033	-	(4,814)	28,219
2A 类美元 (分派) 份额	200,768	976	(30,674)	171,070
2B 类人民币 (累积) 份额	198,106	-	(50,313)	147,793
2B 类人民币 (分派) 份额	1,430,312	26,310	(230,988)	1,225,634
2C 类美元 (分派) 份额	42,544	100	(3,453)	39,191
2D 类港元 (累积) 份额	57,461	2,467	(603)	59,325
2D 类港元 (分派) 份额	1,030,267	17,605	(134,641)	913,231
2E 类澳元 (累积) 份额	114	-	-	114
2E 类澳元 (分派) 份额	1,957	122	(798)	1,281
2F 类澳元对冲 (累积) 份额	9,364	-	-	9,364
2F 类澳元对冲 (分派) 份额	23,767	57	-	23,824
2G 类美元对冲 (累积) 份额	27,655	303	(7,342)	20,616
2G 类美元对冲 (分派) 份额	278,887	10,458	(41,200)	248,145
2I 类新加坡元对冲 (累积) 份额	11,711	-	-	11,711
2I 类新加坡元对冲 (分派) 份额	37,801	-	-	37,801

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注(未经审计)(续)

截至2022年6月30日止六个月

6 可赎回份额(续)

六个月内已发行可赎回份额的变动如下:

	于2021年12月31日 的已发行份额	期间发行的份额	期间赎回的份额	于2022年6月30日 的已发行份额
截至2022年6月30日				
可赎回份额				
2K类欧元对冲(累积)份额	4,907	-	(4,023)	884
2K类欧元对冲(分派)份额	14,807	-	(2,727)	12,080
2L类港元对冲(累积)份额	10,856	-	(6,918)	3,938
2L类港元对冲(分派)份额	120,646	7,026	(44,578)	83,094
2XB类人民币(累积)份额	499,990	-	-	499,990
2XG类美元对冲(累积)份额	49,999	-	(49,999)	-
4C类美元对冲(累积)份额	9,784	-	(3,513)	6,271
份额总数	<u>4,214,950</u>	<u>103,429</u>	<u>(616,584)</u>	<u>3,701,795</u>

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注 (未经审计) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月

6 可赎回份额 (续)

年内已发行可赎回份额的变动如下:

	于 2020 年 12 月 31 日 的已发行份额	期间发行的份额	期间赎回的份额	于 2021 年 6 月 30 日 的已发行份额
截至 2021 年 6 月 30 日				
<u>可赎回份额</u>				
1A 类美元 (累积) 份额	42,155	302	-	42,457
1A 类美元 (分派) 份额	1,867	-	(1,867)	-
1E 类美元 (分派) 份额	42,784	3,500	(10,982)	35,302
2A 类美元 (累积) 份额	39,152	4,682	(7,299)	36,535
2A 类美元 (分派) 份额	241,411	32,649	(35,528)	238,532
2B 类人民币 (累积) 份额	208,360	9,744	(35,630)	182,474
2B 类人民币 (分派) 份额	1,468,901	238,802	(113,933)	1,593,770
2C 类美元 (分派) 份额	43,796	11,696	(16,914)	38,578
2D 类港元 (累积) 份额	64,781	6,923	(6,783)	64,921
2D 类港元 (分派) 份额	1,735,984	82,703	(434,465)	1,384,222
2E 类澳元 (累积) 份额	2,000	-	-	2,000
2E 类澳元 (分派) 份额	5,064	-	(2,009)	3,055
2F 类澳元对冲 (累积) 份额	14,848	-	(1,280)	13,568
2F 类澳元对冲 (分派) 份额	47,015	67	(22,713)	24,369
2G 类美元对冲 (累积) 份额	73,931	30,888	(69,472)	35,347
2G 类美元对冲 (分派) 份额	422,145	1,821	(122,250)	301,716
2I 类新加坡元对冲 (累积) 份额	17,176	-	(5,465)	11,711
2I 类新加坡元对冲 (分派) 份额	63,762	6,199	(29,135)	40,826

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注(未经审计)(续)

截至2022年6月30日止六个月

6 可赎回份额(续)

年内已发行可赎回份额的变动如下:

	于2020年12月31日 的已发行份额	期间发行的份额	期间赎回的份额	于2021年6月30日 的已发行份额
截至2021年6月30日				
<u>可赎回份额</u>				
2J类欧元对冲(分派)份额	1,700	-	(1,700)	-
2K类欧元对冲(累积)份额	31,197	18,301	(27,730)	21,768
2K类欧元对冲(分派)份额	14,807	-	-	14,807
2L类港元对冲(累积)份额	63,105	-	-	63,105
2L类港元对冲(分派)份额	135,358	36,846	(33,756)	138,448
4C类美元对冲(累积)份额	9,784	-	-	9,784
份额总数	<u>4,791,083</u>	<u>485,123</u>	<u>(978,911)</u>	<u>4,297,295</u>

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注(未经审计)(续)

截至2022年6月30日止六个月

7 份额持有人应占资产净值

	截至 2022年6月30日 (未经审计) 人民币	截至 2021年12月31日 (经审计) 人民币
份额持有人每份额应占资产净值 (根据本基金的招募说明书)		
1A类美元(累积)份额	547.27	660.23
1A类美元(分派)份额	449.95	564.55
1E类美元(分派)份额	391.03	469.42
2A类美元(累积)份额	861.28	1,041.63
2A类美元(分派)份额	375.62	471.30
2B类人民币(累积)份额	133.79	161.81
2B类人民币(分派)份额	57.78	73.33
2C类美元(分派)份额	405.38	510.13
2D类港元(累积)份额	66.95	80.97
2D类港元(分派)份额	47.29	59.32
2E类澳元(累积)份额	408.78	494.36
2E类澳元(分派)份额	302.24	377.95
2F类澳元对冲(累积)份额	389.66	479.11
2F类澳元对冲(分派)份额	266.15	338.51
2G类美元对冲(累积)份额	582.99	676.23
2G类美元对冲(分派)份额	346.84	417.23
2I类新加坡元对冲(累积)份额	346.23	414.64
2I类新加坡元对冲(分派)份额	276.59	343.56
2K类欧元对冲(累积)份额	478.27	608.86
2K类欧元对冲(分派)份额	408.06	534.04
2L类港元对冲(累积)份额	61.71	72.25
2L类港元对冲(分派)份额	48.95	59.42
2XB类人民币(累积)份额	82.49	99.76
2XG类美元对冲(累积)份额	-	556.23
4C类美元对冲(累积)份额	532.56	613.32

弘收高收益波幅管理债券基金
 (弘收策略基金的子基金)
 (根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注 (未经审计) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月

7 份额持有人应占资产净值 (续)

	截至 2022 年 6 月 30 日 (未经审计) 类别货币	截至 2021 年 12 月 31 日 (经审计) 类别货币
份额持有人每份额应占资产净值		
(根据本基金的招募说明书)		
1A 类美元 (累积) 份额	81.60	103.93
1A 类美元 (分派) 份额	67.09	88.87
1E 类美元 (分派) 份额	58.31	73.90
2A 类美元 (累积) 份额	128.43	163.98
2A 类美元 (分派) 份额	56.01	74.19
2B 类人民币 (累积) 份额	133.79	161.81
2B 类人民币 (分派) 份额	57.78	73.33
2C 类美元 (分派) 份额	60.45	80.31
2D 类港元 (累积) 份额	78.33	99.39
2D 类港元 (分派) 份额	55.33	72.81
2E 类澳元 (累积) 份额	88.65	107.17
2E 类澳元 (分派) 份额	65.54	81.93
2F 类澳元对冲 (累积) 份额	84.50	103.86
2F 类澳元对冲 (分派) 份额	57.72	73.38
2G 类美元对冲 (累积) 份额	86.93	106.45
2G 类美元对冲 (分派) 份额	51.72	65.68
2I 类新加坡元对冲 (累积) 份额	71.89	88.10
2I 类新加坡元对冲 (分派) 份额	57.43	73.00
2K 类欧元对冲 (累积) 份额	68.57	84.64
2K 类欧元对冲 (分派) 份额	58.50	74.23
2L 类港元对冲 (累积) 份额	72.20	88.69
2L 类港元对冲 (分派) 份额	57.27	72.94
2XB 类人民币 (累积) 份额	82.49	99.76
2XG 类美元对冲 (累积) 份额	-	87.56
4C 类美元对冲 (累积) 份额	79.41	96.55

弘收高收益波幅管理债券基金
 (弘收策略基金的子基金)
 (根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注 (未经审计) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月

8 向可赎回份额持有人的收益分配

	截至 2022 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2021 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	694,992,168	96,848,227
期间份额持有人应占资产净值减少	(124,767,849)	(29,639,448)
向份额持有人的收益分配	15,789,305	24,205,442
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	151,757,484	47,581,316
分配前的未分配收益	737,771,108	138,995,537
就 1A 类份额于 2021 年 1 月 4 日宣派每份额 0.85 美元的月度收益分配	-	(10,232)
就 1E 类份额于 2021 年 1 月 4 日宣派每份额 0.61 美元的月度收益分配	-	(168,263)
就 2A 类份额于 2021 年 1 月 4 日宣派每份额 0.53 美元的月度收益分配	-	(824,917)
就 2B 类份额于 2021 年 1 月 4 日宣派每份额 0.63 离岸人民币的月度收益分配	-	(925,407)
就 2C 类份额于 2021 年 1 月 4 日宣派每份额 0.54 美元的月度收益分配	-	(152,477)
就 2D 类份额于 2021 年 1 月 4 日宣派每份额 0.52 港元的月度收益分配	-	(750,762)
就 2E 类份额于 2021 年 1 月 4 日宣派每份额 0.48 澳元的月度收益分配	-	(12,119)
就 2F 类份额于 2021 年 1 月 4 日宣派每份额 0.48 澳元的月度收益分配	-	(112,527)
就 2G 类份额于 2021 年 1 月 4 日宣派每份额 0.55 美元的月度收益分配	-	(1,496,927)
就 2I 类份额于 2021 年 1 月 4 日宣派每份额 0.52 新加坡元的月度收益分配	-	(162,400)
就 2J 类份额于 2021 年 1 月 4 日宣派每份额 0.37 欧元的月度收益分配	-	(4,984)
就 2K 类份额于 2021 年 1 月 4 日宣派每份额 0.36 欧元的月度收益分配	-	(42,247)
就 2L 类份额于 2021 年 1 月 4 日宣派每份额 0.61 港元的月度收益分配	-	(68,670)
就 1A 类份额于 2021 年 2 月 1 日宣派每份额 0.76 美元的月度收益分配	-	(9,184)
就 1E 类份额于 2021 年 2 月 1 日宣派每份额 0.49 美元的月度收益分配	-	(146,791)
就 2A 类份额于 2021 年 2 月 1 日宣派每份额 0.46 美元的月度收益分配	-	(719,012)
就 2B 类份额于 2021 年 2 月 1 日宣派每份额 0.63 离岸人民币的月度收益分配	-	(999,850)
就 2C 类份额于 2021 年 2 月 1 日宣派每份额 0.54 美元的月度收益分配	-	(186,046)

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注(未经审计)(续)

截至2022年6月30日止六个月

8 向可赎回份额持有人的收益分配(续)

	截至2022年 6月30日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至2021年 6月30日止 六个月 (未经审计) 人民币
就2D类份额于2021年2月1日宣派每份额0.45港元的月度收益分配	-	(637,798)
就2E类份额于2021年2月1日宣派每份额0.44澳元的月度收益分配	-	(10,997)
就2F类份额于2021年2月1日宣派每份额0.45澳元的月度收益分配	-	(71,041)
就2G类份额于2021年2月1日宣派每份额0.44美元的月度收益分配	-	(1,058,815)
就2I类份额于2021年2月1日宣派每份额0.48新加坡元的月度收益分配	-	(127,192)
就2K类份额于2021年2月1日宣派每份额0.37欧元的月度收益分配	-	(42,838)
就2L类份额于2021年2月1日宣派每份额0.48港元的月度收益分配	-	(65,010)
就1A类份额于2021年3月1日宣派每份额0.76美元的月度收益分配	-	(9,188)
就1E类份额于2021年3月1日宣派每份额0.49美元的月度收益分配	-	(146,843)
就2A类份额于2021年3月1日宣派每份额0.47美元的月度收益分配	-	(731,586)
就2B类份额于2021年3月1日宣派每份额0.63离岸人民币的月度收益分配	-	(1,001,853)
就2C类份额于2021年3月1日宣派每份额0.55美元的月度收益分配	-	(181,443)
就2D类份额于2021年3月1日宣派每份额0.45港元的月度收益分配	-	(596,902)
就2E类份额于2021年3月1日宣派每份额0.44澳元的月度收益分配	-	(11,161)
就2F类份额于2021年3月1日宣派每份额0.45澳元的月度收益分配	-	(60,655)
就2G类份额于2021年3月1日宣派每份额0.44美元的月度收益分配	-	(969,185)
就2I类份额于2021年3月1日宣派每份额0.48新加坡元的月度收益分配	-	(127,209)
就2K类份额于2021年3月1日宣派每份额0.37欧元的月度收益分配	-	(42,726)
就2L类份额于2021年3月1日宣派每份额0.49港元的月度收益分配	-	(66,919)
就1A类份额于2021年4月1日宣派每份额0.77美元的月度收益分配	-	(9,468)
就1E类份额于2021年4月1日宣派每份额0.49美元的月度收益分配	-	(149,353)
就2A类份额于2021年4月1日宣派每份额0.47美元的月度收益分配	-	(739,697)
就2B类份额于2021年4月1日宣派每份额0.63离岸人民币的月度收益分配	-	(973,526)
就2C类份额于2021年4月1日宣派每份额0.55美元的月度收益分配	-	(177,952)

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注(未经审计)(续)

截至2022年6月30日止六个月

8 向可赎回份额持有人的收益分配(续)

	截至2022年 6月30日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至2021年 6月30日止 六个月 (未经审计) 人民币
就2D类份额于2021年4月1日宣派每份额0.45港元的月度收益分配	-	(564,461)
就2E类份额于2021年4月1日宣派每份额0.44澳元的月度收益分配	-	(11,095)
就2F类份额于2021年4月1日宣派每份额0.45澳元的月度收益分配	-	(60,322)
就2G类份额于2021年4月1日宣派每份额0.44美元的月度收益分配	-	(967,127)
就2I类份额于2021年4月1日宣派每份额0.49新加坡元的月度收益分配	-	(138,791)
就2K类份额于2021年4月1日宣派每份额0.38欧元的月度收益分配	-	(43,493)
就2L类份额于2021年4月1日宣派每份额0.49港元的月度收益分配	-	(67,798)
就1A类份额于2021年5月3日宣派每份额0.77美元的月度收益分配	-	(9,315)
就1E类份额于2021年5月3日宣派每份额0.49美元的月度收益分配	-	(146,945)
就2A类份额于2021年5月3日宣派每份额0.47美元的月度收益分配	-	(742,944)
就2B类份额于2021年5月3日宣派每份额0.63离岸人民币的月度收益分配	-	(996,379)
就2C类份额于2021年5月3日宣派每份额0.55美元的月度收益分配	-	(137,377)
就2D类份额于2021年5月3日宣派每份额0.46港元的月度收益分配	-	(567,493)
就2E类份额于2021年5月3日宣派每份额0.44澳元的月度收益分配	-	(11,167)
就2F类份额于2021年5月3日宣派每份额0.45澳元的月度收益分配	-	(58,801)
就2G类份额于2021年5月3日宣派每份额0.44美元的月度收益分配	-	(916,763)
就2I类份额于2021年5月3日宣派每份额0.49新加坡元的月度收益分配	-	(138,122)
就2K类份额于2021年5月3日宣派每份额0.38欧元的月度收益分配	-	(43,958)
就2L类份额于2021年5月3日宣派每份额0.49港元的月度收益分配	-	(58,162)
就1A类份额于2021年6月1日宣派每份额0.77美元的月度收益分配	-	(9,176)
就1E类份额于2021年6月1日宣派每份额0.49美元的月度收益分配	-	(144,756)
就2A类份额于2021年6月1日宣派每份额0.47美元的月度收益分配	-	(723,662)
就2B类份额于2021年6月1日宣派每份额0.63离岸人民币的月度收益分配	-	(997,868)
就2C类份额于2021年6月1日宣派每份额0.55美元的月度收益分配	-	(135,381)
就2D类份额于2021年6月1日宣派每份额0.46港元的月度收益分配	-	(539,854)

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注(未经审计)(续)

截至2022年6月30日止六个月

8 向可赎回份额持有人的收益分配(续)

	截至2022年 6月30日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至2021年 6月30日止 六个月 (未经审计) 人民币
就2E类份额于2021年6月1日宣派每份额0.44澳元的月度收益分配	-	(10,998)
就2F类份额于2021年6月1日宣派每份额0.45澳元的月度收益分配	-	(54,109)
就2G类份额于2021年6月1日宣派每份额0.44美元的月度收益分配	-	(882,360)
就2I类份额于2021年6月1日宣派每份额0.49新加坡元的月度收益分配	-	(124,908)
就2K类份额于2021年6月1日宣派每份额0.38欧元的月度收益分配	-	(43,900)
就2L类份额于2021年6月1日宣派每份额0.49港元的月度收益分配	-	(55,785)
就1A类份额于2022年1月3日宣派每份额0.48美元的月度收益分配	(98,069)	-
就1E类份额于2022年1月3日宣派每份额0.40美元的月度收益分配	(77,935)	-
就2A类份额于2022年1月3日宣派每份额0.40美元的月度收益分配	(600,898)	-
就2B类份额于2022年1月3日宣派每份额0.52离岸人民币的月度收益分配	(915,400)	-
就2C类份额于2022年1月3日宣派每份额0.47美元的月度收益分配	(149,007)	-
就2D类份额于2022年1月3日宣派每份额0.39港元的月度收益分配	(387,050)	-
就2E类份额于2022年1月3日宣派每份额0.41澳元的月度收益分配	(4,066)	-
就2F类份额于2022年1月3日宣派每份额0.48澳元的月度收益分配	(50,476)	-
就2G类份额于2022年1月3日宣派每份额0.55美元的月度收益分配	(781,429)	-
就2I类份额于2022年1月3日宣派每份额0.39新加坡元的月度收益分配	(87,352)	-
就2K类份额于2022年1月3日宣派每份额0.31欧元的月度收益分配	(40,688)	-
就2L类份额于2022年1月3日宣派每份额0.39港元的月度收益分配	(48,280)	-
就1A类份额于2022年2月4日宣派每份额0.48美元的月度收益分配	(61,090)	-
就1E类份额于2022年2月4日宣派每份额0.40美元的月度收益分配	(62,303)	-
就2A类份额于2022年2月4日宣派每份额0.40美元的月度收益分配	(509,889)	-
就2B类份额于2022年2月4日宣派每份额0.51离岸人民币的月度收益分配	(717,216)	-
就2C类份额于2022年2月4日宣派每份额0.46美元的月度收益分配	(117,552)	-
就2D类份额于2022年2月4日宣派每份额0.39港元的月度收益分配	(316,030)	-

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注(未经审计)(续)

截至2022年6月30日止六个月

8 向可赎回份额持有人的收益分配(续)

	截至2022年 6月30日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至2021 年6月30日止 六个月 (未经审计) 人民币
就2E类份额于2022年2月4日宣派每份额0.40澳元的月度收益分配	(3,543)	-
就2F类份额于2022年2月4日宣派每份额0.36澳元的月度收益分配	(38,780)	-
就2G类份额于2022年2月4日宣派每份额0.35美元的月度收益分配	(594,099)	-
就2I类份额于2022年2月4日宣派每份额0.39新加坡元的月度收益分配	(69,563)	-
就2K类份额于2022年2月4日宣派每份额0.30欧元的月度收益分配	(31,884)	-
就2L类份额于2022年2月4日宣派每份额0.39港元的月度收益分配	(35,614)	-
就1A类份额于2022年3月1日宣派每份额0.48美元的月度收益分配	(60,566)	-
就1E类份额于2022年3月1日宣派每份额0.40美元的月度收益分配	(61,769)	-
就2A类份额于2022年3月1日宣派每份额0.40美元的月度收益分配	(499,968)	-
就2B类份额于2022年3月1日宣派每份额0.52离岸人民币的月度收益分配	(718,891)	-
就2C类份额于2022年3月1日宣派每份额0.47美元的月度收益分配	(116,587)	-
就2D类份额于2022年3月1日宣派每份额0.39港元的月度收益分配	(307,005)	-
就2E类份额于2022年3月1日宣派每份额0.41澳元的月度收益分配	(3,655)	-
就2F类份额于2022年3月1日宣派每份额0.36澳元的月度收益分配	(39,067)	-
就2G类份额于2022年3月1日宣派每份额0.35美元的月度收益分配	(582,146)	-
就2I类份额于2022年3月1日宣派每份额0.39新加坡元的月度收益分配	(68,529)	-
就2K类份额于2022年3月1日宣派每份额0.31欧元的月度收益分配	(26,524)	-
就2L类份额于2022年3月1日宣派每份额0.39港元的月度收益分配	(33,154)	-
就1A类份额于2022年4月1日宣派每份额0.48美元的月度收益分配	(60,967)	-
就1E类份额于2022年4月1日宣派每份额0.40美元的月度收益分配	(62,178)	-
就2A类份额于2022年4月1日宣派每份额0.40美元的月度收益分配	(475,488)	-
就2B类份额于2022年4月1日宣派每份额0.52离岸人民币的月度收益分配	(681,002)	-

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注(未经审计)(续)

截至2022年6月30日止六个月

8 向可赎回份额持有人的收益分配(续)

	截至2022年 6月30日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至2021年 6月30日止 六个月 (未经审计) 人民币
就2C类份额于2022年4月1日宣派每份额0.47美元的月度收益分配	(116,824)	-
就2D类份额于2022年4月1日宣派每份额0.39港元的月度收益分配	(305,154)	-
就2E类份额于2022年4月1日宣派每份额0.41澳元的月度收益分配	(2,498)	-
就2F类份额于2022年4月1日宣派每份额0.36澳元的月度收益分配	(40,791)	-
就2G类份额于2022年4月1日宣派每份额0.35美元的月度收益分配	(602,031)	-
就2I类份额于2022年4月1日宣派每份额0.39新加坡元的月度收益分配	(69,135)	-
就2K类份额于2022年4月1日宣派每份额0.31欧元的月度收益分配	(26,381)	-
就2L类份额于2022年4月1日宣派每份额0.39港元的月度收益分配	(29,001)	-
就1A类份额于2022年5月3日宣派每份额0.48美元的月度收益分配	(64,054)	-
就1E类份额于2022年5月3日宣派每份额0.40美元的月度收益分配	(65,327)	-
就2A类份额于2022年5月3日宣派每份额0.40美元的月度收益分配	(498,074)	-
就2B类份额于2022年5月3日宣派每份额0.52离岸人民币的月度收益分配	(663,412)	-
就2C类份额于2022年5月3日宣派每份额0.47美元的月度收益分配	(122,791)	-
就2D类份额于2022年5月3日宣派每份额0.39港元的月度收益分配	(315,829)	-
就2E类份额于2022年5月3日宣派每份额0.41澳元的月度收益分配	(2,479)	-
就2F类份额于2022年5月3日宣派每份额0.45澳元的月度收益分配	(40,482)	-
就2G类份额于2022年5月3日宣派每份额0.35美元的月度收益分配	(633,015)	-
就2I类份额于2022年5月3日宣派每份额0.39新加坡元的月度收益分配	(71,006)	-
就2K类份额于2022年5月3日宣派每份额0.31欧元的月度收益分配	(26,301)	-
就2L类份额于2022年5月3日宣派每份额0.39港元的月度收益分配	(28,997)	-
就1A类份额于2022年6月1日宣派每份额0.48美元的月度收益分配	(64,057)	-
就1E类份额于2022年6月1日宣派每份额0.40美元的月度收益分配	(65,329)	-
就2A类份额于2022年6月1日宣派每份额0.40美元的月度收益分配	(472,070)	-

弘收高收益波幅管理债券基金
 (弘收策略基金的子基金)
 (根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

财务报表附注 (未经审计) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月

8 向可赎回份额持有人的收益分配 (续)

	截至 2022 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2021 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币
就 2B 类份额于 2022 年 6 月 1 日宣派每份额 0.52 离岸人民币的月度收益分配	(657,145)	-
就 2C 类份额于 2022 年 6 月 1 日宣派每份额 0.47 美元的月度收益分配	(122,851)	-
就 2D 类份额于 2022 年 6 月 1 日宣派每份额 0.39 港元的月度收益分配	(306,620)	-
就 2E 类份额于 2022 年 6 月 1 日宣派每份额 0.41 澳元的月度收益分配	(2,518)	-
就 2F 类份额于 2022 年 6 月 1 日宣派每份额 0.36 澳元的月度收益分配	(42,266)	-
就 2G 类份额于 2022 年 6 月 1 日宣派每份额 0.35 美元的月度收益分配	(611,135)	-
就 2I 类份额于 2022 年 6 月 1 日宣派每份额 0.39 新加坡元的月度收益分配	(71,739)	-
就 2K 类份额于 2022 年 6 月 1 日宣派每份额 0.31 欧元的月度收益分配	(26,727)	-
就 2L 类份额于 2022 年 6 月 1 日宣派每份额 0.39 港元的月度收益分配	(27,557)	-
于 6 月 30 日的未分配收益	<u>721,981,803</u>	<u>114,790,095</u>

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。

弘收高收益波幅管理债券基金
 (弘收策略基金的子基金)
 (根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

投资组合 (未经审计)

截至 2022 年 6 月 30 日

	持仓量	公允价值 人民币	占资产净值 百分比
有报价投资			
公司债券 (74.08%)			
澳大利亚 (1.82%)			
NEWCASTLE COAL NCI AU 4.4 09/29/27	1,000,000	5,926,390	1.18
PERENTI FINANCE ASLAU 6 1/2 10/07/25	500,000	3,212,607	0.64
百慕大 (0.59%)			
CHINA OIL CHIOIL 4.7 06/30/26	500,000	2,966,079	0.59
香港 (16.78%)			
BANK OF EAST ASIA LTD FRN 31DEC2049	1,500,000	9,831,568	1.97
CAS CAPITAL NO1 CASHLD 4 PERP	2,500,000	14,212,399	2.84
CELESTIAL DYNASTY LTD 4.25% 27JUN2029	255,000	1,559,404	0.31
CHINA SOUTH CITY CSCHCN 7 1/4 11/20/22	200,000	1,036,557	0.21
CHINA WATER AFF CWAHK 4.85 05/18/26	500,000	2,731,019	0.55
CHONG HING BANK CHOHIN 3.876 07/26/27	1,000,000	6,707,620	1.34
FEC FINANCE LTD FAEACO 7 3/8 PERP	850,000	5,627,030	1.12
FWD LTD FWDINS 5 1/2 PERP	950,000	6,232,330	1.25
NANYANG COMMERC NANYAN 6 1/2 PERP	1,000,000	6,774,148	1.35
NWD MTN LTD NWDEVL 4 1/8 07/18/29	3,000,000	17,819,812	3.56
RH INTL FINANCE LTD 6.5% 31DEC2049	600,000	3,030,642	0.61
TCCL FINANCE LTD PANVA 4 04/26/27	1,250,000	8,181,321	1.64
YANGO JUSTICE SUNSHI 9 1/4 04/15/23	250,000	128,277	0.03
印度 (7.60%)			
ADANI TRANSMISSI ADTIN 4 1/4 05/21/36	1,000,000	4,914,191	0.98
GREENKO INVESTMENT CO 4 7/8 08/16/23	1,659,000	10,745,321	2.15
JSW STEEL LTD JSTLIN 5.95 04/18/24	500,000	3,322,257	0.66
POWER FIN CORP POWFIN 3.35 05/16/31	1,000,000	5,555,257	1.11
VEDANTA RESOURCE VEDLN 6 3/8 07/30/22	1,250,000	8,335,653	1.67
VEDANTA RESOURCES PLC 6.125% 09AUG2024	1,250,000	5,138,119	1.03
印尼 (5.15%)			
BUKIT MAKMUR MAN DOIDIJ 7 3/4 02/10/26	600,000	3,444,213	0.69
DELTA MERLIN DUN DUNIAT 0 06/26/32	1,675,000	710,053	0.14
INDIKA ENERGY IV INDYIJ 8 1/4 10/22/25	850,000	5,556,287	1.11
INDOFOOD CBP SUK ICBPIJ 3.398 06/09/31	1,000,000	5,241,800	1.05
JABABEKA INTL BV KIJAIJ 6 1/2 10/05/23	500,000	2,204,767	0.44
MINEJESA CAPITAL BV 4.625% 10AUG2030	1,000,000	6,025,042	1.20
PAKUWON JATI PWONIJ 4 7/8 04/29/28	200,000	1,146,542	0.23
THETA CAPITAL PTE LTD 8.125% 22JAN2025	250,000	1,448,937	0.29
日本 (0.60%)			
SOFTBANK GROUP CORP FRN 31DEC2049	500,000	3,005,379	0.60

弘收高收益波幅管理债券基金
 (弘收策略基金的子基金)
 (根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

投资组合 (未经审计) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日

	持仓量	公允价值 人民币	占资产净值 百分比
公司债券 (74.08%) (续)			
蒙古 (0.23%)			
MONGO MIN/ENG RE MONMIN 9 1/4 04/15/24	250,000	1,146,093	0.23
中国内地 (35.87%)			
AAC TECHNOLOGIES AACTEC 3 3/4 06/02/31	1,000,000	5,138,856	1.03
AGILE GROUP AGILE 5 1/2 04/21/25	500,000	1,114,941	0.22
AGILE GROUP HOLDINGS LTD 6.05% 13OCT2025	300,000	652,286	0.13
AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN 31DEC2049	1,000,000	1,490,031	0.30
AOYUAN PROPERTY CAPG 5 3/8 09/13/22	2,000,000	1,582,714	0.32
ARES CAPITAL EUROPE V (E) Unlevered	2,000,000	1,001,170	0.20
BANK OF COMMUNICATIONS FRN 31DEC2020	1,000,000	6,581,003	1.32
CENTRAL CHINA CENCHI 7 1/4 07/16/24	300,000	651,159	0.13
CFLD CAYMAN INV CHFOTN 9 07/31/21	1,000,000	641,804	0.13
CHAMPION PATH SOCJOG 4 1/2 01/27/26	500,000	2,098,973	0.42
CHINA AOYUAN GROUP LTD 7.95% 19FEB2023	500,000	326,121	0.07
CHINA AOYUAN GRP CAPG 5.88 03/01/27	750,000	490,809	0.10
CHINA EVERGRANDE 0% 22JAN2023	2,995,000	1,606,857	0.32
CHINA SCE GRP CHINSC 5.95 09/29/24	250,000	531,433	0.11
CHINA SCE GRP CHINSC 6 02/04/26	750,000	1,462,065	0.29
CHINA SCE GRP CHINSC 7 05/02/25	250,000	496,375	0.10
CIFI HOLDINGS CIFIHG 4.45 08/17/26	500,000	1,920,482	0.38
CIFI HOLDINGS CIFIHG 5 1/4 05/13/26	300,000	1,150,438	0.23
CMNWLTH BK OF AUST-0 NCD 21/03/22	2,000,000	12,714,957	2.54
COUNTRY GARDEN COGARD 3 1/8 10/22/25	250,000	845,863	0.17
DEXIN CHINA HLDN DEXICN 9.95 12/03/22	500,000	2,045,456	0.41
EASY TACTIC LTD GZRFPR 5 7/8 02/13/23	250,000	380,289	0.08
EASY TACTIC LTD GZRFPR 8 1/8 02/27/23	750,000	1,119,133	0.22
EHI CAR SERVICES EHCAR 7 09/21/26	400,000	1,598,675	0.32
FANTASIA HOLDING 0.00% 01JUN2023	1,000,000	604,349	0.12
FORTUNE STAR FOSUNI 5 05/18/26	500,000	2,019,703	0.40
FORTUNE STAR FOSUNI 5.05 01/27/27	1,050,000	4,206,521	0.84
FRANSHION BRILLA CHJMAO 4 1/4 07/23/29	636,000	3,350,718	0.67
GOLDEN EAGLE RET GERGHK 4 5/8 05/21/23	300,000	1,942,995	0.39
GRNLGR 5.875% 03JUL2024	1,250,000	2,439,290	0.49
HUANENG HK CAPITAL LTD FRN 31DEC2049	2,000,000	13,414,302	2.68
KAISA GROUP 0% 30JUN2022	1,250,000	1,180,916	0.24
KAISA GROUP KAISAG 9 3/4 09/28/23	2,500,000	2,325,117	0.46
KAISA GROUP KAISAG 9 3/8 06/30/24	250,000	235,362	0.05
KAISA GROUP KAISAG 9.95 07/23/25	750,000	704,576	0.14
KING TALENT MANAGEMENT L FRN 31DEC2049	250,000	1,611,216	0.32
KWG GROUP KWGPRO 5.95 08/10/25	250,000	331,515	0.07
KWG GROUP KWGPRO 6 08/14/26	500,000	654,412	0.13
KWG GROUP KWGPRO 6.3 02/13/26	1,000,000	1,243,101	0.25
KWG PROPERTY KWGPRO 5 7/8 11/10/24	500,000	622,154	0.12

弘收高收益波幅管理债券基金
 (弘收策略基金的子基金)
 (根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

投资组合 (未经审计) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日

	持仓量	公允价值 人民币	占资产净值 百分比
公司债券 (74.08%) (续)			
中国内地 (35.87%) (续)			
LOGAN GROUP CO LOGPH 4 1/4 07/12/25	750,000	1,093,632	0.22
LOGAN GROUP CO LOGPH 4.7 07/06/26	1,000,000	1,416,313	0.28
LOGAN PROPERTY H LOGPH 5 1/4 02/23/23	1,000,000	1,410,023	0.28
LS FINANCE 2017 LIHKK 4.8 06/18/26	500,000	2,892,141	0.58
MELCO RESORTS MPEL 5 3/4 07/21/28	2,000,000	8,557,786	1.71
MGM CHINA HOLDIN MGMCHI 5 1/4 06/18/25	500,000	2,590,620	0.52
NEW METRO GLOBAL FTLNHD 4 1/2 05/02/26	250,000	772,797	0.15
NEW METRO GLOBAL FTLNHD 4 5/8 10/15/25	500,000	1,613,865	0.32
NEW METRO GLOBAL FTLNHD 4.8 12/15/24	500,000	1,879,238	0.38
POSTAL SAVINGS BK CHINA FRN 29DEC2049	1,000,000	6,723,045	1.34
POWERLONG PWRLNG 4.9 05/13/26	250,000	268,877	0.05
POWERLONG PWRLNG 5.95 04/30/25	750,000	809,296	0.16
POWERLONG REAL ESTATE 6.25% 10AUG2024	400,000	458,182	0.09
RED SUN PROPRTI REDSUN 10 1/2 10/03/22	250,000	427,534	0.09
RED SUN PROPRTI REDSUN 7.3 01/13/25	500,000	471,461	0.09
RED SUN PROPERTIES GRP 9.7% 16APR2023	250,000	259,874	0.05
RKPF 2019 E LTD ROADKG 7 3/4 PERP	2,800,000	8,267,371	1.65
RONSHINE CHINA RONXIN 7.1 01/25/25	250,000	176,798	0.04
RONSHINE CHINA RONXIN 7.35 12/15/23	500,000	460,597	0.09
RONSHINE CHINA RONXIN 8.95 01/22/23	750,000	804,770	0.16
SANDS CHINA LTD SANLTD 4 3/8 06/18/30	1,000,000	4,882,738	0.98
SHIMAO PROPERTY SHIMAO 6 1/8 02/21/24	1,500,000	1,169,960	0.23
SHUI ON DEVELOP SHUION 5 1/2 03/03/25	800,000	4,049,762	0.81
SINO OCEAN LAND SINOCE 4 3/4 08/05/29	1,600,000	4,740,522	0.95
STUDIO CITY FIN STCITY 6 07/15/25	500,000	2,195,076	0.44
SUN HUNG KAI BVI SUNHK 5 09/07/26	1,000,000	6,235,422	1.25
SUNAC CHINA HLDG SUNAC 6 1/2 07/09/23	250,000	255,682	0.05
SUNAC CHINA HLDG SUNAC 6.8 10/20/24	2,500,000	2,514,905	0.50
SUNAC CHINA HLDG SUNAC 7.95 08/08/22	500,000	509,628	0.10
SUNAC CHINA HLDG SUNAC 8.35 04/19/23	250,000	255,682	0.05
TIMES CHINA HLDG LTD 6.75% 08JUL2025	750,000	734,151	0.15
TIMES CN HLDG TPHL 6.2 03/22/26	500,000	487,254	0.10
WANDA PROPERTIES DALWAN 6 7/8 07/23/23	800,000	4,278,584	0.86
WENS FOODSTUFF GWFOOD 3.258 10/29/30	250,000	1,199,677	0.24
WEST CHINA CEM WESCHI 4.95 07/08/26	700,000	3,780,331	0.76
WYNN MACAU LTD WYNNAC 5 1/2 01/15/26	1,500,000	7,048,876	1.41
YANGO CAYMAN YANGOG 11 3/4 09/08/22	500,000	176,043	0.03
YANGO JUSTICE INTL 8.25% 25NOV2023	1,750,000	858,270	0.17
YUZHOU GROUP YUZHOU 6.35 01/13/27	1,000,000	487,221	0.10
YUZHOU PROPRTIE YUZHOU 6 10/25/23	1,000,000	502,981	0.10
YUZHOU PROPRTIE YUZHOU 7 3/8 01/13/26	1,000,000	487,757	0.10
YUZHOU PROPRTIE YUZHOU 8 1/2 02/04/23	250,000	155,924	0.03
YUZHOU PROPRTIE YUZHOU 8 3/8 10/30/24	250,000	129,937	0.03
ZHENRO PROPRTIE ZHPRHK 8.3 09/15/23	500,000	268,257	0.05
ZHONGAN ONLINE ZHONAN 3 1/2 03/08/26	1,000,000	6,107,665	1.22

弘收高收益波幅管理债券基金
 (弘收策略基金的子基金)
 (根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

投资组合 (未经审计) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日

	持仓量	公允价值 人民币	占资产净值 百分比
公司债券 (74.08%) (续)			
菲律宾 (3.20%)			
JOLIBEE WORLDWIDE PTE L FRN 31DEC2049	500,000	3,201,005	0.64
SMC GLOBAL POWER SMCGL 5.95 PERP	2,000,000	12,821,723	2.56
新加坡 (1.15%)			
LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.25% 19JUN2024	450,000	2,658,969	0.53
MEDCO PLATINUM R MEDCIJ 6 3/4 01/30/25	500,000	3,126,195	0.62
越南 (1.09%)			
MONG DUONG FIN MONDFI 5 1/8 05/07/29	1,000,000	5,433,938	1.09
		<hr/>	<hr/>
公司债券总计		<u>370,553,606</u>	<u>74.08</u>
政府债券 (5.34%)			
蒙古 (1.99%)			
MONGOLIA MONGOL 5 1/8 12/05/22	500,000	3,341,605	0.67
MONGOLIA MONGOL 5 5/8 05/01/23	1,000,000	6,620,236	1.32
巴基斯坦 (2.05%)			
REP OF PAKISTAN PKSTAN 6 7/8 12/05/27	2,250,000	10,259,454	2.05
斯里兰卡 (1.30%)			
REP OF SRI LANKA SRILAN 6.2 05/11/27	3,000,000	6,519,036	1.30
		<hr/>	<hr/>
政府债券总计		<u>26,740,331</u>	<u>5.34</u>
投资基金 (8.02%)			
香港 (8.02%)			
INCOME PART RMB BOND-4A USDA	53,140	40,142,258	8.02
		<hr/>	<hr/>
投资基金总计		<u>40,142,258</u>	<u>8.02</u>

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

投资组合 (未经审计) (续)**截至 2022 年 6 月 30 日****衍生金融工具 (-1.77%)**

标的资产	对手方	未偿付合约名义值	公允价值 人民币	占资产净值 百分比
外汇远期合约				
买入人民币/卖出美元	巴克莱银行	61,000,000 人民币	(2,998,862)	(0.60)
买入人民币/卖出美元	瑞银	61,500,000 人民币	(3,024,512)	(0.60)
买入人民币/卖出美元	瑞银	20,000,000 人民币	(978,819)	(0.20)
买入人民币/卖出美元	巴克莱银行	20,000,000 人民币	(977,537)	(0.20)
买入美元/卖出人民币	巴克莱银行	701,435 美元	205,846	0.04
买入人民币/卖出美元	花旗银行	60,000,000 人民币	(157,282)	(0.03)
买入人民币/卖出美元	巴克莱银行	74,000,000 人民币	(304,996)	(0.06)
买入人民币/卖出美元	花旗银行	13,000,000 人民币	72,628	0.01
买入港元/卖出人民币	花旗银行	5,006,079 港元	(11,255)	(0.00)
买入欧元/卖出人民币	花旗银行	743,833 欧元	(21,420)	(0.00)
买入美元/卖出人民币	花旗银行	13,688,496 美元	(246,874)	(0.05)
买入美元/卖出人民币	花旗银行	2,305,856 美元	(41,586)	(0.01)
买入美元/卖出人民币	花旗银行	523,131 美元	(9,435)	(0.00)
买入港元/卖出人民币	花旗银行	299,064 港元	(672)	(0.00)
买入新加坡元/卖出人民币	花旗银行	885,336 新加坡元	(24,950)	(0.01)
买入欧元/卖出人民币	花旗银行	63,792 欧元	(1,837)	(0.00)
买入美元/卖出人民币	花旗银行	1,499,907 美元	(27,051)	(0.01)
买入澳元/卖出人民币	花旗银行	1,446,278 澳元	(127,183)	(0.03)
买入新加坡元/卖出人民币	花旗银行	2,282,942 新加坡元	(64,338)	(0.01)
买入澳元/卖出人民币	花旗银行	832,267 澳元	(73,188)	(0.01)
买入人民币/卖出美元	花旗银行	80,834 人民币	105	0.00

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

投资组合 (未经审计) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日

衍生金融工具 (-1.76%) (续)

标的资产	对手方	未偿付合约名义值	公允价值 人民币	占资产净值 百分比
外汇远期合约 (续)				
买入人民币/卖出美元	花旗银行	165,077 人民币	471	0.00
买入人民币/卖出美元	花旗银行	38,132 人民币	(86)	(0.00)
买入人民币/卖出欧元	花旗银行	59,375 人民币	587	0.00
买入人民币/卖出美元	花旗银行	110,429 人民币	(249)	(0.00)
买入人民币/卖出美元	花旗银行	1,012,805 人民币	(2,286)	(0.00)
买入人民币/卖出新加坡元	花旗银行	124,508 人民币	232	0.00
买入人民币/卖出澳元	花旗银行	43,922 人民币	575	0.00
买入人民币/卖出美元	花旗银行	168,961 人民币	(381)	(0.00)
买入人民币/卖出港元	花旗银行	48,162 人民币	(123)	(0.00)
买入人民币/卖出港元	花旗银行	2,878 人民币	(7)	(0.00)
买入人民币/卖出欧元	花旗银行	5,085 人民币	50	0.00
买入人民币/卖出新加坡元	花旗银行	48,284 人民币	90	0.00
买入人民币/卖出澳元	花旗银行	76,494 人民币	1,001	0.00
买入人民币/卖出美元	花旗银行	18,865 人民币	(33)	(0.00)
买入人民币/卖出新加坡元	花旗银行	122,140 人民币	275	0.00
买入人民币/卖出美元	花旗银行	1,012,365 人民币	879	0.00
买入人民币/卖出港元	花旗银行	2,869 人民币	1	0.00
买入人民币/卖出美元	花旗银行	110,262 人民币	96	0.00
买入人民币/卖出澳元	花旗银行	74,672 人民币	82	0.00
买入人民币/卖出美元	花旗银行	37,991 人民币	33	0.00
买入人民币/卖出欧元	花旗银行	59,209 人民币	573	0.00

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

投资组合 (未经审计) (续)**截至 2022 年 6 月 30 日****衍生金融工具 (-1.76%) (续)**

标的资产	对手方	未偿付合约名义值	公允价值 人民币	占资产净值 百分比
外汇远期合约 (续)				
买入人民币/卖出欧元	花旗银行	5,078 人民币	49	0.00
买入人民币/卖出港元	花旗银行	48,025 人民币	25	0.00
买入人民币/卖出澳元	花旗银行	42,971 人民币	47	0.00
买入人民币/卖出新加坡元	花旗银行	47,366 人民币	107	0.00
买入人民币/卖出美元	花旗银行	167,773 人民币	146	0.00
买入美元/卖出人民币	花旗银行	2,019 美元	(33)	(0.00)
买入人民币/卖出美元	花旗银行	130,000,000 人民币	(15,884)	(0.00)
买入美元/卖出人民币	巴克莱银行	2,087,424 美元	1,286	0.00
买入人民币/卖出美元	花旗银行	12,070 人民币	(5)	(0.00)
买入人民币/卖出美元	花旗银行	929,941 人民币	(2,810)	(0.00)
买入人民币/卖出澳元	花旗银行	69,032 人民币	238	0.00
买入人民币/卖出港元	花旗银行	2,599 人民币	(8)	(0.00)
买入人民币/卖出新加坡元	花旗银行	43,941 人民币	84	0.00
买入人民币/卖出欧元	花旗银行	4,686 人民币	61	0.00
买入人民币/卖出港元	花旗银行	43,509 人民币	(136)	(0.00)
买入人民币/卖出美元	花旗银行	35,273 人民币	(107)	(0.00)
买入人民币/卖出美元	花旗银行	101,644 人民币	(307)	(0.00)
买入人民币/卖出欧元	花旗银行	54,634 人民币	711	0.00
买入人民币/卖出新加坡元	花旗银行	113,307 人民币	216	0.00
买入人民币/卖出澳元	花旗银行	39,726 人民币	137	0.00
买入人民币/卖出美元	花旗银行	154,055 人民币	(466)	(0.00)

弘收高收益波幅管理债券基金
 (弘收策略基金的子基金)
 (根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

投资组合 (未经审计) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日

衍生金融工具 (-1.77%) (续)

标的资产	对手方	未偿付合约名义值	公允价值 人民币	占资产净值 百分比
外汇远期合约 (续)				
买入人民币/卖出美元	花旗银行	9,777 人民币	(24)	(0.00)
买入美元/卖出人民币	花旗银行	1,704 美元	31	0.00
买入人民币/卖出美元	花旗银行	2,474,095 人民币	(7,099)	(0.00)
衍生金融工具总计			(8,835,179)	(1.77)
资产净值总计				
投资总计, 按公允价值			437,436,195	87.44
衍生金融工具			(8,835,179)	(1.77)
银行结余			25,122,842	5.02
其他资产净值			49,557,747	9.31
资产净值总计			<u>500,281,605</u>	<u>100.00</u>
投资总计, 按成本			<u>622,716,726</u>	

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)
(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

投资组合持仓变动表 (未经审计)

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月

	截至 2022 年 1 月 1 日	增添	出售	截至 2022 年 6 月 30 日
有报价投资				
公司债券				
澳大利亚				
NEWCASTLE COAL NCI AU 4.4 09/29/27	1,000,000	-	-	1,000,000
PERENTI FINANCE AS LAU 6 1/2 10/07/25	500,000	-	-	500,000
百慕大				
CHINA OIL CHIOIL 4.7 06/30/26	500,000	-	-	500,000
香港				
BANK OF EAST ASIA LTD FRN 29DEC2049	2,000,000	-	(2,000,000)	-
BANK OF EAST ASIA LTD FRN 31DEC2049	-	1,500,000	-	1,500,000
BK OF EAST ASIA BNKEA 4 7/8 04/22/32	-	650,000	(650,000)	-
CAS CAPITAL NO1 CASHLD 4 PERP	2,500,000	-	-	2,500,000
CELESTIAL DYNASTY LTD 4.25% 27JUN2029	1,000,000	-	(745,000)	255,000
CHALIECO HK CORP CHALUM 5 PERP	2,000,000	-	(2,000,000)	-
CHINA SOUTH CITY CSCHCN 7 1/4 11/20/22	-	500,000	(300,000)	200,000
CHINA WATER AFF CWAHK 4.85 05/18/26	500,000	-	-	500,000
CHONG HING BANK CHOHIN 3.876 07/26/27	1,000,000	-	-	1,000,000
FEC FINANCE LTD FAEACO 7 3/8 PERP	850,000	-	-	850,000
FWD LTD FWDINS 5 1/2 PERP	950,000	-	-	950,000
FWD LTD FWDINS 6 1/4 12/31/49	1,700,000	-	(1,700,000)	-
NANYANG COMMERC NANYAN 6 1/2 PERP	-	1,000,000	-	1,000,000
NANYANG COMMERCIAL BANK FRN 31DEC2049	2,000,000	-	(2,000,000)	-
NWD MTN LTD NWDEVL 4 1/8 07/18/29	3,000,000	-	-	3,000,000
RH INTL FINANCE LTD 6.5% 31DEC2049	600,000	-	-	600,000
TCCL FINANCE LTD PANVA 4 04/26/27	-	1,250,000	-	1,250,000
YANGO JUSTICE SUNSHI 9 1/4 04/15/23	250,000	250,000	(250,000)	250,000
印度				
ADANI TRANSMISSI ADTIN 4 1/4 05/21/36	1,000,000	-	-	1,000,000
GREENKO INVESTMENT CO 4 7/8 08/16/23	1,000,000	659,000	-	1,659,000
JSW STEEL LTD JSTLIN 5.95 04/18/24	-	500,000	-	500,000
POWER FIN CORP POWFIN 3.35 05/16/31	1,000,000	-	-	1,000,000
VEDANTA RESOURCE VEDLN 6 3/8 07/30/22	1,250,000	-	-	1,250,000
VEDANTA RESOURCES PLC 6.125% 09AUG2024	1,250,000	-	-	1,250,000
印尼				
APL REALTY HLDG APLNIJ 5.95 06/02/24	250,000	-	(250,000)	-
BUKIT MAKMUR MAN DOIDIJ 7 3/4 02/10/26	600,000	-	-	600,000
DELTA MERLIN DUN DUNIAT 0 06/26/32	1,675,000	-	-	1,675,000
DELTA MERLIN DUNIA TEXTI FRN 26JUN2028	1,675,000	-	(1,675,000)	-
INDIKA ENERGY IV INDYIJ 8 1/4 10/22/25	850,000	-	-	850,000
INDOFOOD CBP SUK ICBPIJ 3.398 06/09/31	1,000,000	-	-	1,000,000
JABABEKA INTL BV KIJAIJ 6 1/2 10/05/23	500,000	-	-	500,000
MINEJESA CAPITAL BV 4.625% 10AUG2030	1,000,000	-	-	1,000,000
PAKUWON JATI PWONIJ 4 7/8 04/29/28	-	200,000	-	200,000
THETA CAPITAL PTE LTD 8.125% 22JAN2025	250,000	-	-	250,000

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

投资组合持仓变动表 (未经审计) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月

	截至 2022 年 1 月 1 日	增添	出售	截至 2022 年 6 月 30 日
公司债券 (续)				
日本				
SOFTBANK GROUP CORP FRN 31DEC2049	500,000	-	-	500,000
SOFTBANK GRP COR SOFTBK 5 3/8 07/30/22	2,000,000	-	(2,000,000)	-
蒙古				
MONGO MIN/ENG RE MONMIN 9 1/4 04/15/24	250,000	-	-	250,000
巴基斯坦				
THRD PKSTN SUKUK PKSTAN 5 5/8 12/05/22	1,000,000	-	(1,000,000)	-
中国内地				
AAC TECHNOLOGIES AACTEC 3 3/4 06/02/31	1,000,000	-	-	1,000,000
AGILE GROUP AGILE 4.85 08/31/22	200,000	-	(200,000)	-
AGILE GROUP AGILE 5 1/2 04/21/25	-	500,000	-	500,000
AGILE GROUP HOLDINGS LTD 6.05% 13OCT2025	-	300,000	-	300,000
AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN 31DEC2049	1,000,000	-	-	1,000,000
AOYUAN PROPERTY CAPG 5 3/8 09/13/22	1,000,000	1,000,000	-	2,000,000
ARES CAPITAL EUROPE V (E) Unlevered	1,000,000	2,000,000	(1,000,000)	2,000,000
BANK OF COMMUNICATIONS FRN 31DEC2020	-	1,000,000	-	1,000,000
CENTRAL CHINA CENCHI 7 1/4 07/16/24	-	300,000	-	300,000
CFLD CAYMAN INV CHFOTN 9 07/31/21	1,000,000	-	-	1,000,000
CHAMPION PATH SOCJOG 4 1/2 01/27/26	-	500,000	-	500,000
CHAMPION PATH SOCJOG 4.85 01/27/28	500,000	-	(500,000)	-
CHINA AOYUAN GROUP LTD 7.95% 19FEB2023	500,000	500,000	(500,000)	500,000
CHINA AOYUAN GRP CAPG 5.88 03/01/27	750,000	750,000	(750,000)	750,000
CHINA EVERGRANDE 0% 22JAN2023	2,995,000	-	-	2,995,000
CHINA SCE GRP CHINSC 5.95 09/29/24	250,000	-	-	250,000
CHINA SCE GRP CHINSC 6 02/04/26	750,000	-	-	750,000
CHINA SCE GRP CHINSC 7 05/02/25	250,000	-	-	250,000
CIFI HOLDINGS CIFIHG 4.45 08/17/26	-	500,000	-	500,000
CIFI HOLDINGS CIFIHG 5 1/4 05/13/26	-	300,000	-	300,000
CMNWLTH BK OF AUST-0 NCD 21/03/22	2,500,000	-	(500,000)	2,000,000
COUNTRY GARDEN COGARD 3 1/8 10/22/25	-	250,000	-	250,000
DEXIN CHINA HLDN DEXICN 9.95 12/03/22	500,000	-	-	500,000
EASY TACTIC LTD GZRFPR 5 7/8 02/13/23	250,000	-	-	250,000
EASY TACTIC LTD GZRFPR 8 1/8 02/27/23	-	750,000	-	750,000
EHI CAR SERVICES EHICAR 7 09/21/26	400,000	-	-	400,000
FANTASIA HOLDING 0.00% 01JUN2023	-	1,000,000	-	1,000,000
FAR EAST HORIZON LTD FRN 29DEC2049	1,000,000	-	(1,000,000)	-
FORTUNE STAR FOSUNI 5 05/18/26	-	500,000	-	500,000
FORTUNE STAR FOSUNI 5 1/4 03/23/22	2,000,000	-	(2,000,000)	-
FORTUNE STAR FOSUNI 5.05 01/27/27	-	1,050,000	-	1,050,000
FRANSHION BRILLA CHJMAO 4 1/4 07/23/29	1,436,000	-	(800,000)	636,000
GOLDEN EAGLE RET GERGHK 4 5/8 05/21/23	-	300,000	-	300,000
GREENLAND GLB GRNLGR 5.6 11/13/22	250,000	-	(250,000)	-
GRNLGR 5.875% 03JUL2024	1,000,000	250,000	-	1,250,000
HUANENG HK CAPITAL LTD FRN 31DEC2049	2,500,000	-	(500,000)	2,000,000

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

投资组合持仓变动表 (未经审计) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月

公司债券 (续)	截至 2022 年 1 月 1 日	增添	出售	截至 2022 年 6 月 30 日
中国内地 (续)				
KAISA GROUP 0% 30JUN2022	1,250,000	-	-	1,250,000
KAISA GROUP KAISAG 9 3/4 09/28/23	2,500,000	-	-	2,500,000
KAISA GROUP KAISAG 9 3/8 06/30/24	250,000	-	-	250,000
KAISA GROUP KAISAG 9.95 07/23/25	750,000	-	-	750,000
KING TALENT MANAGEMENT L FRN 31DEC2049	250,000	-	-	250,000
KWG GROUP KWGPRO 5.95 08/10/25	250,000	-	-	250,000
KWG GROUP KWGPRO 6 08/14/26	500,000	-	-	500,000
KWG GROUP KWGPRO 6.3 02/13/26	1,000,000	-	-	1,000,000
KWG PROPERTY KWGPRO 5 7/8 11/10/24	-	500,000	-	500,000
LOGAN GROUP CO LOGPH 4 1/4 07/12/25	500,000	250,000	-	750,000
LOGAN GROUP CO LOGPH 4.7 07/06/26	-	1,000,000	-	1,000,000
LOGAN PROPERTY H LOGPH 5 1/4 02/23/23	-	1,000,000	-	1,000,000
LS FINANCE 2017 LIHKK 4.8 06/18/26	500,000	-	-	500,000
MELCO RESORTS MPEL 5 3/4 07/21/28	2,000,000	-	-	2,000,000
MGM CHINA HOLDIN MGMCHI 5 1/4 06/18/25	500,000	-	-	500,000
NEW METRO GLOBAL FTLNHD 4 1/2 05/02/26	250,000	-	-	250,000
NEW METRO GLOBAL FTLNHD 4 5/8 10/15/25	500,000	-	-	500,000
NEW METRO GLOBAL FTLNHD 4.8 12/15/24	-	500,000	-	500,000
POSTAL SAVINGS BK CHINA FRN 29DEC2049	2,500,000	-	(1,500,000)	1,000,000
POWERLONG PWRLNG 4.9 05/13/26	250,000	-	-	250,000
POWERLONG PWRLNG 5.95 04/30/25	250,000	500,000	-	750,000
POWERLONG REAL ESTATE 6.25% 10AUG2024	-	400,000	-	400,000
RED SUN PROPRTI REDSUN 10 1/2 10/03/22	250,000	-	-	250,000
RED SUN PROPRTI REDSUN 7.3 01/13/25	500,000	-	-	500,000
RED SUN PROPERTIES GRP 9.7% 16APR2023	-	250,000	-	250,000
RKPF 2019 E LTD ROADKG 7 3/4 PERP	2,800,000	-	-	2,800,000
RONSHINE CHINA RONXIN 7.1 01/25/25	250,000	-	-	250,000
RONSHINE CHINA RONXIN 7.35 12/15/23	500,000	-	-	500,000
RONSHINE CHINA RONXIN 8.95 01/22/23	750,000	-	-	750,000
SANDS CHINA LTD SANLTD 4 3/8 06/18/30	-	1,000,000	-	1,000,000
SHIMAO PROPERTY SHIMAO 6 1/8 02/21/24	-	1,500,000	-	1,500,000
SHUI ON DEVELOP SHUION 5 1/2 03/03/25	-	800,000	-	800,000
SINO OCEAN LAND SINOCE 4 3/4 08/05/29	1,600,000	-	-	1,600,000
STUDIO CITY FIN STCITY 6 07/15/25	500,000	-	-	500,000
SUN HUNG KAI BVI SUNHKC 5 09/07/26	1,000,000	-	-	1,000,000
SUNAC CHINA HLDG SUNAC 6 1/2 07/09/23	250,000	-	-	250,000
SUNAC CHINA HLDG SUNAC 6.8 10/20/24	2,500,000	2,500,000	(2,500,000)	2,500,000
SUNAC CHINA HLDG SUNAC 7.95 08/08/22	500,000	-	-	500,000
SUNAC CHINA HLDG SUNAC 8.35 04/19/23	250,000	250,000	(250,000)	250,000
TIMES CHINA HLDG LTD 6.75% 08JUL2025	250,000	500,000	-	750,000
TIMES CN HLDG TPHL 6.2 03/22/26	500,000	-	-	500,000
WANDA PROPERTIES DALWAN 6 7/8 07/23/23	1,000,000	-	(200,000)	800,000
WEALTH DRIVEN LT FOSUNI 5 1/2 08/17/23	-	1,500,000	(1,500,000)	-
WENS FOODSTUFF GWFOOD 3.258 10/29/30	250,000	-	-	250,000
WEST CHINA CEM WESCHI 4.95 07/08/26	450,000	250,000	-	700,000
WYNN MACAU LTD WYNNMAC 5 1/2 01/15/26	1,500,000	-	-	1,500,000

弘收高收益波幅管理债券基金
 (弘收策略基金的子基金)
 (根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

投资组合持仓变动表 (未经审计) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月

	截至 2022 年 1 月 1 日	增添	出售	截至 2022 年 6 月 30 日
公司债券 (续)				
中国内地 (续)				
YANGO CAYMAN YANGOG 11 3/4 09/08/22	500,000	500,000	(500,000)	500,000
YANGO JUSTICE INTL 8.25% 25NOV2023	750,000	1,750,000	(750,000)	1,750,000
YUZHOU GROUP YUZHOU 6.35 01/13/27	1,000,000	-	-	1,000,000
YUZHOU PROPRTIE YUZHOU 6 10/25/23	-	2,000,000	(1,000,000)	1,000,000
YUZHOU PROPRTIE YUZHOU 7 3/8 01/13/26	1,000,000	-	-	1,000,000
YUZHOU PROPRTIE YUZHOU 8 1/2 02/04/23	250,000	250,000	(250,000)	250,000
YUZHOU PROPRTIE YUZHOU 8 3/8 10/30/24	250,000	250,000	(250,000)	250,000
ZHENRO PROPRTIE ZHPRHK 8.3 09/15/23	500,000	500,000	(500,000)	500,000
ZHONGAN ONLINE ZHONAN 3 1/2 03/08/26	1,000,000	-	-	1,000,000
菲律宾				
JOLLIBEE WORLDWIDE PTE L FRN 31DEC2049	500,000	-	-	500,000
SMC GLOBAL POWER SMCGL 5.95 PERP	2,000,000	-	-	2,000,000
新加坡				
LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.25% 19JUN2024	450,000	-	-	450,000
MEDCO PLATINUM R MEDCIJ 6 3/4 01/30/25	500,000	-	-	500,000
泰国				
BANGKOK BANK/HK BBLTB 4.3 06/15/27	-	600,000	(600,000)	-
越南				
MONG DUONG FIN MONDFI 5 1/8 05/07/29	1,000,000	-	-	1,000,000
政府债券				
蒙古				
MONGOLIA MONGOL 5 1/8 12/05/22	500,000	-	-	500,000
MONGOLIA MONGOL 5 5/8 05/01/23	1,000,000	-	-	1,000,000
巴基斯坦				
REP OF PAKISTAN PKSTAN 6 7/8 12/05/27	1,500,000	750,000	-	2,250,000
中国内地				
CHINA GOVT BOND CGB 1.94 04/25/23	-	50,000,000	(50,000,000)	-
CHINA GOVT BOND CGB 2.26 02/24/25	-	30,000,000	(30,000,000)	-
CHINA GOVT BOND CGB 2.47 09/02/24	-	50,000,000	(50,000,000)	-
CHINA GOVT BOND CGB 3.53 10/18/51	-	80,000,000	(80,000,000)	-
CHINA GOVT BOND CGB 3.72 04/12/51	10,000,000	-	(10,000,000)	-
CHINA GOVT BOND CGB 3.81 09/14/50	50,000,000	-	(50,000,000)	-
斯里兰卡				
REP OF SRI LANKA SRILAN 6.2 05/11/27	2,000,000	4,000,000	(3,000,000)	3,000,000

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)
(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

投资组合持仓变动表 (未经审计) (续)

截至 2022 年 6 月 30 日止六个月

	截至 2022 年 1 月 1 日	增添	出售	截至 2022 年 6 月 30 日
投资基金				
香港				
INCOME PART RMB BOND-4A USDA	-	53,140	-	53,140

弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

抵押品持仓 (未经审计)

截至 2022 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	2.46%	12,360,993
瑞银	现金	N/A	N/A	N/A	美元	1.99%	9,987,989
花旗银行香港分行	现金	N/A	N/A	N/A	美元	1.22%	6,121,337
凯基证券(新加坡)私人有限公司	现金	N/A	N/A	N/A	美元	0.30%	1,529,794

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	-	-