



INCOME PARTNERS

中期报告 2023

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 2023 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
致弘收高收益波幅管理债券基金的份额持有人	2
市场概述与展望	3
投资组合概况（截至 2023 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
损益和其他全面收益表（未经审计）	7
归属于份额持有人的资产净额变动表（未经审计）	8
财务报表（未经审计）附注	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

罗兵咸永道会计师事务所
香港
中环
太子大厦 22 楼

瑞士代表性代理人

Acolin Fund Services AG, Geneva Branch
6, Cours de Rive
CH-1204 Geneva
Switzerland

基金管理人董事

魏志华
Dasher Karl Franklin (于 2023 年 6 月 21 日任命)
Doggett John Blackman (于 2023 年 6 月 21 日任命)
Haenni Gregoire Marie (于 2023 年 6 月 21 日任命)

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)

的近律师行
香港
中环
遮打道 18 号
历山大厦 5 楼

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

2023 年业绩概览

弘收高收益波幅管理债券基金（本“基金”）于 2023 年前六个月实现的总回报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	2023 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	-13.51%	-
1A 类分派（美元）份额	HK0000421328	IPRHY1A HK	2013 年 5 月 7 日 (于 2021 年 8 月 3 日 重新激活)	⁻²	-
1B 类累积（人民币）份额	HK0000421351	IRHY1BA HK	2019 年 6 月 26 日	⁻²	-
1E 类分派（美元对冲）份额	HK0000490067	IPRHY1E HK	2019 年 3 月 25 日	-8.14%	7.7%
2A 类累积（美元）份额	HK0000421419	IRHY2AA HK	2011 年 7 月 27 日	-13.73%	-
2A 类分派（美元）份额	HK0000421401	IPRHY2A HK	2011 年 8 月 3 日	-13.73%	7.9%
2B 类累积（人民币）份额	HK0000421435	IRHY2BA HK	2011 年 7 月 27 日	-9.44%	-
2B 类分派（人民币）份额	HK0000421427	IPRHY2B HK	2011 年 7 月 27 日	-9.43%	7.8%
2C 类分派（美元）份额	HK0000421443	IPRHY2C HK	2011 年 8 月 10 日	-13.73%	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	-13.26%	-
2D 类分派（港元）份额	HK0000421450	IPRHY2D HK	2018 年 2 月 9 日	-13.24%	8.0%
2E 类累积（澳元）份额	HK0000421484	IRHY2EA HK	2018 年 3 月 7 日	-11.54%	-
2E 类分派（澳元）份额	HK0000421476	IPRHY2E HK	2018 年 5 月 4 日	-11.53%	6.5%
2F 类累积（澳元对冲）份额	HK0000421500	IRHY2FA HK	2015 年 10 月 13 日	-9.16%	-
2F 类分派（澳元对冲）份额	HK0000421492	IPRHY2F HK	2019 年 5 月 2 日	-9.16%	6.6%
2G 类累积（美元对冲）份额	HK0000421526	IRHY2GA HK	2015 年 10 月 13 日	-8.36%	-
2G 类分派（美元对冲）份额	HK0000421518	IPRHY2G HK	2015 年 10 月 19 日	-8.35%	7.6%
2I 类累积（新加坡元对冲）份额	HK0000421567	IRHY2IA HK	2019 年 4 月 30 日	-8.94%	-
2I 类分派（新加坡元对冲）份额	HK0000421559	IPRHY2I HK	2019 年 4 月 24 日	-8.89%	6.4%
2J 类分派（欧元）份额	HK0000490000	IPRHY2J HK	2019 年 7 月 16 日	⁻²	-
2K 类累积（欧元对冲）份额	HK0000490034	IRHY2KA HK	2019 年 5 月 8 日	⁻²	-
2K 类分派（欧元对冲）份额	HK0000490026	IPRHY2K HK	2019 年 5 月 7 日	-9.48%	5.3%
2L 类累积（港元对冲）份额	HK0000490059	IRHY2LA HK	2019 年 5 月 7 日	-9.24%	-
2L 类分派（港元对冲）份额	HK0000490042	IPRHY2L HK	2019 年 4 月 17 日	-9.23%	7.7%
2XB 类累积（人民币）份额	HK0000706074	-	2021 年 12 月 22 日	-9.44%	-
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在 2023 年上半年持续承压，因中国的经济复苏势头于 2023 年第二季度开始停滞，同时市场对陷入四面楚歌的中国房地产行业的看跌情绪日益浓厚。

2023 年第一季度期间，在前置性政府投资、重新开放后被压抑的住房需求以及强于预期的出口的推动下，中国经济表现超出市场预期，同比增长 4.5%。然而，第二季度的经济增长势头明显回落，4 月、5 月和 6 月的制造业采购经理指数意外跌破 50。私人投资和住房销售增速进一步下滑，转为负增长，而由于消费者和私营企业主信心疲软，内需依旧乏力。为提振需求，中国人民银行于 6 月中旬下调基准利率 10 个基点。

由于经济增长疲软、国内消费乏力并且越来越多的开发商面临困境，中国房地产市场预计将进入双底阶段。市场情绪已显脆弱，而价格大幅波动的情况也变得越来越常见，即使远洋、大连万达和碧桂园等大型私营开发商的债券也是如此。

展望未来，我们预计政府不会推出大规模的刺激举措，原因是政府将 2023 年的 GDP 增长率目标维持在 5% 的适度水平。包括发行专项政府债券和减税在内的更多财政刺激举措有可能在 7 月举行完政治局会议之后推出。

在当前环境下，我们认为审慎挑选债券最为重要。基金管理人今后将继续密切关注违约风险以及中国对于房地产市场的政策立场，同时积极管理风险。

投资组合概况 (截至 2023 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-	8.6%	11.6%

前十大持仓	27.7%
永利澳门有限公司	3.8%
金沙中国有限公司	3.8%
Smc Global Power Holdings	3.4%
东亚银行有限公司	2.9%
巴基斯坦政府债券	2.8%
碧桂园控股有限公司	2.7%
斯里兰卡政府债券	2.3%
Vedanta Resources Plc	2.1%
Greenko Energy Holdings	2.0%
Melco Resorts Finance	1.9%

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)、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)。

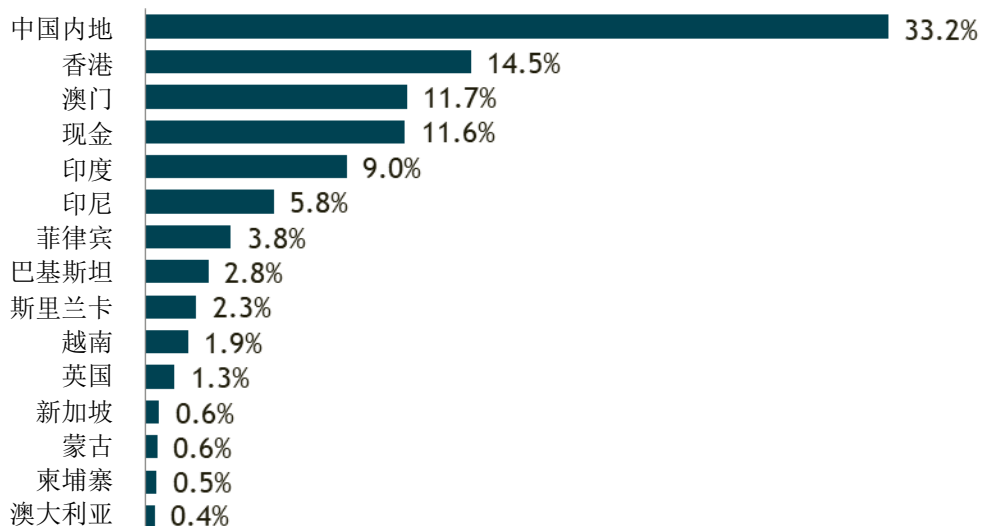
弘收高收益波幅管理债券基金

(弘收策略基金的子基金)

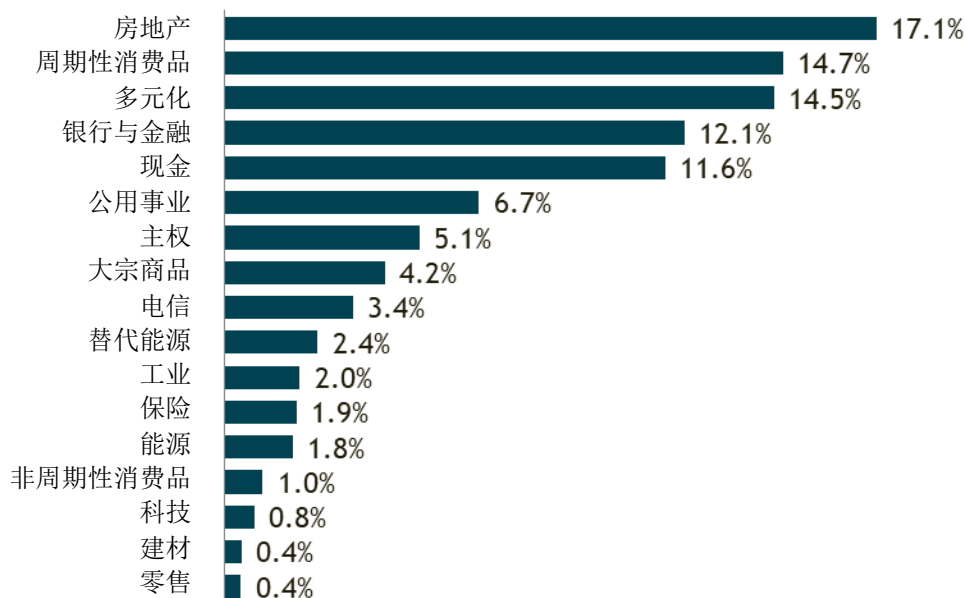
(根据香港法律成立的开放式伞形单位信托)

投资组合概况 (截至 2023 年 6 月 30 日) (续)

地域敞口



行业敞口



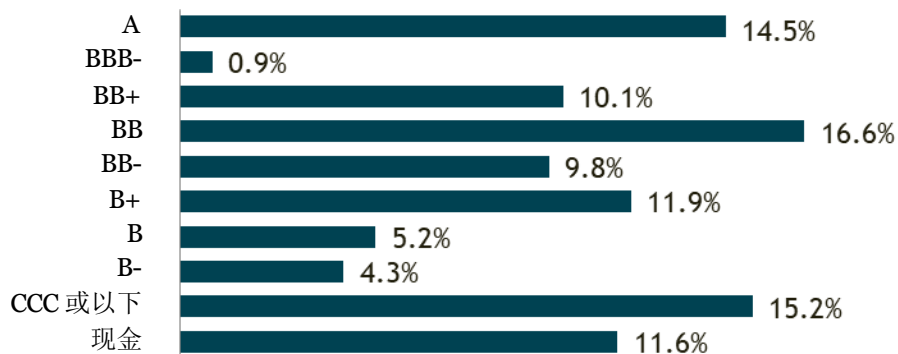
弘收高收益波幅管理债券基金

(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 2023 年 6 月 30 日) (续)

信用评级敞口



#由于四舍五入，敞口总和可能并不相同。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 2023 年 6 月 30 日

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 2023 年 6 月 30 日

	截至 2023 年 6 月 30 日 (未经审计) 人民币	截至 2022 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	295,081,227	371,825,676
衍生金融工具	2,683,388	2,711,553
应收利息	5,307,039	8,568,804
预付款和其他应收款项	1,049,773	952,132
经纪机构应付款项	8,946,359	2,893,957
应收认购款项	14,413	-
保证金存款	32,556,229	15,990,154
银行结余	9,096,650	21,123,888
	<u>354,735,078</u>	<u>424,066,164</u>
资产总计		
	<u>354,735,078</u>	<u>424,066,164</u>
负债 — 流动负债		
衍生金融工具	3,482,330	838,014
应付经纪机构款项	6,417,442	1,550,221
	2(a)	
其他负债和应计支出	2(b)	
应付赎回款项	2(g)	
	1,063,237	1,204,987
	3,658,742	2,359,639
	<u>14,621,751</u>	<u>5,952,861</u>
负债 (不含归属于份额持有人的资产净额)		
	<u>14,621,751</u>	<u>5,952,861</u>
归属于份额持有人的资产净额		
	<u>340,113,327</u>	<u>418,113,303</u>
	<u>354,735,078</u>	<u>418,113,303</u>
由以下项目代表:		
归属于份额持有人的资产净额 (根据本基金的招募说明书)	340,113,327	418,113,303

随附的附注为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)

损益和其他全面收益表 (未经审计)

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

	附注	截至 2023 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2022 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币
收入			
债务利息收入		8,203,369	14,258,592
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		(51,172,655)	(151,655,398)
汇兑收益净额		18,603,609	33,684,209
银行利息收入		775,795	50,269
退费		-	-
其他收入		196,729	79,013
投资亏损总计		(23,393,153)	(103,583,315)
支出			
管理费	2(a)	(2,708,624)	(4,191,498)
受托人费用	2(b)	(34,831)	(33,523)
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)	(430,670)	(489,982)
审计师酬金		(238,676)	(193,417)
其他营业支出		(293,737)	(210,967)
法律及专业费		(109,848)	(162,130)
营业支出总计		(3,816,386)	(5,281,517)
营业亏损		(27,209,539)	(108,864,832)
财务费用			
向可赎回份额持有人的收益分配		(8,985,223)	(15,789,305)
利息支出		(1,278)	-
收益分配后的亏损		(36,196,040)	(124,654,137)
经香港证监会认可费用调整		-	(113,712)
经营活动产生的归属于份额持有人的 资产净额减少		(36,196,040)	(124,767,849)

随附的附注为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)

归属于份额持有人的资产净额变动表 (未经审计)

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

	截至 2023 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2022 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币
期初归属于份额持有人的资产净额	418,113,303	694,992,168
发行可赎回份额	29,460,967	32,257,219
赎回可赎回份额	(71,264,903)	(102,199,933)
经营活动产生的归属于份额持有人的资产净额减少	(36,196,040)	(124,767,849)
期末归属于可赎回份额持有人的资产净额	<u>340,113,327</u>	<u>500,281,605</u>
	截至 2023 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 份	截至 2022 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 份
期初发行在外的份额	2,675,602	4,214,950
发行的份额	115,509	103,429
赎回的份额	(322,190)	(616,584)
期末发行在外的份额	<u>2,468,921</u>	<u>3,701,795</u>

随附的附注为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 (未经审计) 附注

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

1 主要会计政策概要

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

所采用的会计政策与截至 2023 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正常商业条款订立。本子基金由弘收投资管理(香港)有限公司管理。与受托人、基金管理人和各自关联方及关联人士的交易如下:

(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 (未经审计) 附注 (续)

截至 2023 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 2023 年 6 月 30 日止六个月的管理费总额为 2,708,624 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日止六个月: 4,191,498 人民币), 截至 2023 年 6 月 30 日未偿付的数额为 395,398 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日: 612,638 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 2023 年 6 月 30 日止期间, 并无来自本子基金的基金管理人弘收投资管理(香港)有限公司的管理费退费 (截至 2022 年 6 月 30 日止期间: 零)。管理费退费与本子基金持有的由基金管理人管理的投资基金有关。

(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 2022 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 2022 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 2023 年 6 月 30 日止六个月的受托人费用总额为 34,831 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日止六个月: 33,523 人民币), 截至 2023 年 6 月 30 日未偿付的数额为 5,893 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日: 5,503 人民币)。

(c) 交叉交易

截至 2023 年 6 月 30 日和 2022 年 6 月 30 日止期间, 概无将投资持仓卖给也由本子基金的基金管理人管理的其他基金的交易或向其购买投资持仓的交易。

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) 附注 (续)

截至 2023 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 2023 年 6 月 30 日, 本子基金投资弘收人民币债券基金(“IPRMBBF”), 其由本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 2023 年 6 月 30 日

	持仓量	份额 价格 人民币	公允价值 人民币
IPRMBBF	<u>63,800</u>	<u>770.71</u>	<u>49,171,173</u>

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>

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) 附注 (续)

截至 2023 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 2023 年 6 月 30 日和 2022 年 12 月 31 日于本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 2023 年 1 月 1 日 发行在外的 份额	期内 认购的 份额	期内 赎回的 份额	于 2023 年 6 月 30 日 发行在外的 份额
2023 年				
2B 类人民币 (分派) 份额	-	-	-	-
	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>
	于 2022 年 1 月 1 日 发行在外的 份额	年内 认购的 份额	年内 赎回的 份额	于 2022 年 12 月 31 日 发行在外的 份额
2022 年				
2B 类人民币 (分派) 份额	56,097	-	(56,097)	-
	<u>56,097</u>	<u>-</u>	<u>(56,097)</u>	<u>-</u>
基金管理人管理委员会成员持有的份额:				
	于 2023 年 1 月 1 日 发行在外的 份额	期内 认购的 份额	期内 赎回的 份额	于 2023 年 6 月 30 日 发行在外的 份额
2023 年				
4C 类美元对冲 (累积) 份额	6,270	-	-	6,270
	<u>6,270</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>6,270</u>
	于 2022 年 1 月 1 日 发行在外的 份额	年内 认购的 份额	年内 赎回的 份额	于 2022 年 12 月 31 日 发行在外的 份额
2022 年				
4C 类美元对冲 (累积) 份额	-	6,270	-	6,270
	<u>-</u>	<u>6,270</u>	<u>-</u>	<u>6,270</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 (未经审计) 附注 (续)

截至 2023 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 2023 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 9,096,650 人民币 (截至 2022 年 12 月 31 日: 21,123,888 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 2023 年 6 月 30 日止期间赚得的银行利息收入为 775,795 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日止期间: 50,269 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、行政管理服务等服务。

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

受托人已委任花旗银行香港分行担任本子基金资产的保管人。

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

保管人、行政管理和基金登记机构费用总额包含合规监测费和财务报表编制费用, 截至 2023 年 6 月 30 日止六个月为 430,670 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日止六个月: 489,982 人民币), 截至 2023 年 6 月 30 日未偿付的数额为 105,719 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日: 88,522 人民币)。

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月的保管人费用总额为 104,494 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日止六个月: 98,176 人民币), 截至 2023 年 6 月 30 日未偿付的数额为 17,678 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日: 16,508 人民币)。

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月的行政管理费用总额为 250,785 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日止六个月: 305,173 人民币), 截至 2023 年 6 月 30 日未偿付的数额为 46,470 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日: 47,475 人民币)。

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月的基金登记机构费用总额为 21,116 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日止六个月: 21,589 人民币), 截至 2023 年 6 月 30 日未偿付的数额为 3,536 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日: 3,302 人民币)。

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月的合规监测费用总额为 19,030 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日止六个月: 30,518 人民币), 截至 2023 年 6 月 30 日未偿付的数额为 2,832 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日: 4,343 人民币)。

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月的财务报表编制费用总额为 35,245 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日止六个月: 34,526 人民币), 截至 2023 年 6 月 30 日未偿付的数额为 35,203 人民币 (截至 2022 年 6 月 30 日: 16,894 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 (未经审计) 附注 (续)

截至 2023 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 2023 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。

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) 附注 (续)

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

5 可赎回份额

六个月内已发行可赎回份额的变动如下:

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

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) 附注 (续)

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

5 可赎回份额 (续)

六个月内已发行可赎回份额的变动如下:

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

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

5 可赎回份额 (续)

年内已发行可赎回份额的变动如下:

	于 2021 年 12 月 31 日 发行在外的份额	期内发行的 份额	期内赎回的 份额	于 2022 年 6 月 30 日 发行在外的份额
截至 2022 年 6 月 30 日				
可赎回份额				
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 (未经审计) 附注 (续)

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

5 可赎回份额 (续)

年内已发行可赎回份额的变动如下:

	于 2021 年 12 月 31 日 发行在外的 份额	期内发行的 份额	期内赎回的 份额	于 2022 年 6 月 30 日 发行在外的 份额
截至 2022 年 6 月 30 日				
<u>可赎回份额</u>				
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)

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) 附注 (续)

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

6 归属于份额持有人的资产净额

	截至 2023 年 6 月 30 日 (未经审计) 人民币	截至 2022 年 12 月 31 日 (经审计) 人民币
每份额归属于份额持有人的资产净额 (根据本基金的招募说明书)		
1A 类美元 (累积) 份额	523.58	577.40
1A 类美元 (分派) 份额	-	451.88
1E 类美元 (分派) 份额	380.74	409.16
2A 类美元 (累积) 份额	819.88	906.40
2A 类美元 (分派) 份额	328.67	376.28
2B 类人民币 (累积) 份额	127.36	140.80
2B 类人民币 (分派) 份额	49.94	57.28
2C 类美元 (分派) 份额	352.08	404.36
2D 类港元 (累积) 份额	63.73	70.46
2D 类港元 (分派) 份额	41.38	47.37
2E 类澳元 (累积) 份额	389.14	430.19
2E 类澳元 (分派) 份额	268.00	305.03
2F 类澳元对冲 (累积) 份额	387.92	417.68
2F 类澳元对冲 (分派) 份额	246.60	273.38
2G 类美元对冲 (累积) 份额	611.59	636.61
2G 类美元对冲 (分派) 份额	335.90	361.77
2I 类新加坡元对冲 (累积) 份额	369.66	391.47
2I 类新加坡元对冲 (分派) 份额	273.89	298.75
2K 类欧元对冲 (累积) 份额	-	526.95
2K 类欧元对冲 (分派) 份额	409.65	434.15
2L 类港元对冲 (累积) 份额	63.92	67.53
2L 类港元对冲 (分派) 份额	46.78	51.15
2XB 类人民币 (累积) 份额	102.00	112.76
4C 类美元对冲 (累积) 份额	567.18	585.98

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) 附注 (续)

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

6 归属于份额持有人的资产净额 (续)

	截至 2023 年 6 月 30 日 (未经审计) 类别货币	截至 2022 年 12 月 31 日 (经审计) 类别货币
每份额归属于份额持有人的资产净额 (根据本基金的招募说明书)		
1A 类美元 (累积) 份额	72.07	83.43
1A 类美元 (分派) 份额	-	65.29
1E 类美元 (分派) 份额	52.41	59.12
2A 类美元 (累积) 份额	112.86	130.96
2A 类美元 (分派) 份额	45.24	54.37
2B 类人民币 (累积) 份额	127.36	140.80
2B 类人民币 (分派) 份额	49.94	57.28
2C 类美元 (分派) 份额	48.46	58.43
2D 类港元 (累积) 份额	68.76	79.37
2D 类港元 (分派) 份额	44.65	53.36
2E 类澳元 (累积) 份额	80.83	91.48
2E 类澳元 (分派) 份额	55.67	64.86
2F 类澳元对冲 (累积) 份额	80.58	88.81
2F 类澳元对冲 (分派) 份额	51.22	58.13
2G 类美元对冲 (累积) 份额	84.19	91.98
2G 类美元对冲 (分派) 份额	46.24	52.27
2I 类新加坡元对冲 (累积) 份额	68.97	75.83
2I 类新加坡元对冲 (分派) 份额	51.10	57.87
2K 类欧元对冲 (累积) 份额	-	71.36
2K 类欧元对冲 (分派) 份额	51.87	58.79
2L 类港元对冲 (累积) 份额	68.97	76.07
2L 类港元对冲 (分派) 份额	50.47	57.63
2XB 类人民币 (累积) 份额	102.00	112.76
4C 类美元对冲 (累积) 份额	78.07	84.67

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) 附注 (续)

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

7 向可赎回份额持有人的收益分配

	截至 2023 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2022 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	418,113,303	694,992,168
期间归属于份额持有人的资产净额减少	(36,196,040)	(124,767,849)
向份额持有人的收益分配	8,985,223	15,789,305
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	22,923,949	151,757,484
分配前的未分配收益	413,826,435	737,771,108
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 (未经审计) 附注 (续)

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

7 向可赎回份额持有人的收益分配 (续)

	截至 2023 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2022 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 (未经审计) 附注 (续)

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

7 向可赎回份额持有人的收益分配 (续)

	截至 2023 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2022 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 (未经审计) 附注 (续)

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

7 向可赎回份额持有人的收益分配 (续)

	截至 2023 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2022 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)
就 1A 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.49 美元的月度收益分配	(67,816)	-
就 1E 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.40 美元的月度收益分配	(40,066)	-
就 2A 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.41 美元的月度收益分配	(417,782)	-
就 2B 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.52 离岸人民币的月度收益分配	(414,478)	-
就 2C 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.47 美元的月度收益分配	(119,456)	-
就 2D 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.40 港元的月度收益分配	(305,553)	-
就 2E 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.41 澳元的月度收益分配	(889)	-
就 2F 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.37 澳元的月度收益分配	(32,292)	-
就 2G 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.36 美元的月度收益分配	(570,180)	-
就 2I 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.40 新加坡元的月度收益分配	(67,612)	-
就 2K 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.31 欧元的月度收益分配	(27,290)	-
就 2L 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.40 港元的月度收益分配	(19,555)	-
就 1A 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.35 美元的月度收益分配	(47,208)	-
就 1E 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.32 美元的月度收益分配	(31,238)	-
就 2A 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.29 美元的月度收益分配	(288,524)	-
就 2B 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.31 离岸人民币的月度收益分配	(254,636)	-
就 2C 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.34 美元的月度收益分配	(84,265)	-
就 2D 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.28 港元的月度收益分配	(206,085)	-

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) 附注 (续)

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

7 向可赎回份额持有人的收益分配 (续)

	截至 2023 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2022 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币
就 2E 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.29 澳元的月度收益分配	(647)	-
就 2F 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.26 澳元的月度收益分配	(23,345)	-
就 2G 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.28 美元的月度收益分配	(432,440)	-
就 2I 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.26 新加坡元的月度收益分配	(43,930)	-
就 2K 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.22 欧元的月度收益分配	(19,522)	-
就 2L 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.31 港元的月度收益分配	(14,717)	-
就 1A 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.35 美元的月度收益分配	(48,133)	-
就 1E 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.32 美元的月度收益分配	(31,850)	-
就 2A 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.29 美元的月度收益分配	(273,217)	-
就 2B 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.31 离岸人民币的月度收益分配	(249,343)	-
就 2C 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.34 美元的月度收益分配	(85,950)	-
就 2D 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.28 港元的月度收益分配	(209,420)	-
就 2E 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.29 澳元的月度收益分配	(631)	-
就 2F 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.26 澳元的月度收益分配	(22,763)	-
就 2G 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.28 美元的月度收益分配	(425,100)	-
就 2I 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.26 新加坡元的月度收益分配	(29,853)	-
就 2K 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.22 欧元的月度收益分配	(19,495)	-
就 2L 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.31 港元的月度收益分配	(8,580)	-
就 1E 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.32 美元的月度收益分配	(31,924)	-
就 2A 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.29 美元的月度收益分配	(272,250)	-
就 2B 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.31 离岸人民币的月度收益分配	(247,092)	-
就 2C 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.34 美元的月度收益分配	(86,186)	-
就 2D 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.29 港元的月度收益分配	(211,144)	-
就 2E 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.29 澳元的月度收益分配	(629)	-
就 2F 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.26 澳元的月度收益分配	(22,675)	-

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) 附注 (续)

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

7 向可赎回份额持有人的收益分配 (续)

	截至 2023 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2022 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币
就 2G 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.28 美元的 月度收益分配	(419,057)	-
就 2I 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.26 新加坡元的 月度收益分配	(30,136)	-
就 2K 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.22 欧元的 月度收益分配	(19,912)	-
就 2L 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.31 港元的 月度收益分配	(5,404)	-
就 1E 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.32 美元的 月度收益分配	(32,047)	-
就 2A 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.29 美元的 月度收益分配	(273,305)	-
就 2B 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.31 离岸人民币 的月度收益分配	(243,892)	-
就 2C 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.34 美元的 月度收益分配	(86,557)	-
就 2D 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.29 港元的 月度收益分配	(206,638)	-
就 2E 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.29 澳元的 月度收益分配	(626)	-
就 2F 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.26 澳元的 月度收益分配	(22,583)	-
就 2G 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.28 美元的 月度收益分配	(420,669)	-
就 2I 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.26 新加坡元的 月度收益分配	(30,329)	-
就 2K 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.22 欧元的 月度收益分配	(20,338)	-
就 2L 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.31 港元的 月度收益分配	(5,426)	-
就 1E 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.32 美元的 月度收益分配	(32,985)	-
就 2A 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.29 美元的 月度收益分配	(274,432)	-
就 2B 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.31 离岸人民币 的月度收益分配	(243,543)	-
就 2C 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.34 美元的 月度收益分配	(87,440)	-
就 2D 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.29 港元的 月度收益分配	(211,513)	-
就 2E 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.30 澳元的 月度收益分配	(652)	-
就 2F 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.26 澳元的 月度收益分配	(22,472)	-
就 2G 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.28 美元的 月度收益分配	(432,987)	-

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) 附注 (续)

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

7 向可赎回份额持有人的收益分配 (续)

	截至 2023 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2022 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币
就 2I 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.26 新加坡元的 月度收益分配	(30,656)	-
就 2K 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.22 欧元的 月度收益分配	(20,267)	-
就 2L 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.31 港元的 月度收益分配	(5,596)	-
于 6 月 30 日的未分配收益	<u>404,841,212</u>	<u>721,981,803</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 2023 年 6 月 30 日

	持仓量	公允价值 人民币	占资产净额 百分比(%)
有报价投资			
公司债券(67.21%)			
澳大利亚 (0.42%)			
PERENTI FINANCE ASLAU 6 1/2 10/07/25	200,000	1,427,077	0.42
百慕大 (0.36%)			
CHINA OIL CHIOIL 4.7 06/30/26	200,000	1,232,906	0.36
香港 (10.42%)			
BANK OF EAST ASIA LTD FRN 31DEC2049	500,000	3,187,495	0.94
BK OF EAST ASIA BNKEA 5 7/8 PERP	1,000,000	6,681,923	1.96
CAS CAPITAL NO1 CASHLD 4 PERP	1,050,000	6,313,486	1.85
CELESTIAL DYNASTY LTD 4.25% 27JUN2029	255,000	1,561,304	0.46
CHINA SOUTH CITY CSCHCN 7 1/4 11/20/22	200,000	877,796	0.26
CHINA WATER AFF CWAHK 4.85 05/18/26	200,000	1,262,299	0.37
FEC FINANCE LTD FAEACO 7 3/8 PERP	200,000	1,359,791	0.40
FWD LTD FWDINS 5 1/2 PERP	950,000	6,245,823	1.84
NANYANG COMMERC NANYAN 6 1/2 PERP	750,000	5,313,835	1.56
RH INTL FINANCE LTD 6.5% 31DEC2049	600,000	2,612,370	0.77
YANGO JUSTICE 0.00% 15APR2023	250,000	29,622	0.01
印度 (2.18%)			
ADANI GREEN ENE ADANIG 4 3/8 09/08/24	300,000	2,024,823	0.60
HDFC BANK LTD HDFCB 3.7 PERP	400,000	2,530,265	0.74
JSW STEEL LTD JSTLIN 5.95 04/18/24	200,000	1,444,585	0.42
RENEW POWER PVT LTD 5.875% 05MAR2027	208,000	1,418,202	0.42
印尼 (3.54%)			
BUKIT MAKMUR MAN DOIDIJ 7 3/4 02/10/26	600,000	3,713,015	1.09
DELTA MERLIN DUN DUNIAT 0 06/26/32	1,675,000	692,258	0.20
INDIKA ENERGY IV INDYIJ 8 1/4 10/22/25	300,000	2,169,297	0.64
MINEJESA CAPITAL BV 4.625% 10AUG2030	200,000	1,305,451	0.39
PAKUWON JATI PWONIJ 4 7/8 04/29/28	400,000	2,618,168	0.77
THETA CAPITAL PTE LTD 8.125% 22JAN2025	250,000	1,524,133	0.45
毛里求斯 (2.65%)			
CA MAGNUM HLDING HEXWIN 5 3/8 10/31/26	400,000	2,615,785	0.77
DIAMOND II LTD RNW 7.95 07/28/26	200,000	1,431,828	0.42
NETWORK I2I LTD FRN 31DEC2049	700,000	4,950,934	1.46
蒙古 (0.54%)			
MONGO MIN/ENG RE MONMIN 9 1/4 04/15/24	300,000	1,849,839	0.54
荷兰 (2.98%)			
GREENKO DUTCH BV GRNKEN 3.85 03/29/26	1,100,000	6,763,907	1.99
JABABEKA INTL BV KIJAIJ 7 12/15/27	700,000	3,374,800	0.99

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 2023 年 6 月 30 日

	持仓量	公允价值 人民币	占资产净额 百分比(%)
公司债券(67.21%) (续)			
中国内地 (33.42%)			
AGILE GROUP AGILE 5 1/2 04/21/25	500,000	951,094	0.28
AGILE GROUP HOLDINGS LTD 6.05% 13OCT2025	300,000	533,345	0.16
AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN 31DEC2049	1,000,000	920,098	0.27
AOYUAN PROPERTY CAPG 5 3/8 09/13/22	2,000,000	813,065	0.24
CENTRAL CHINA CENCHI 7 1/2 07/14/25	300,000	166,018	0.05
CENTRAL CHINA CENCHI 7 1/4 07/16/24	300,000	201,256	0.06
CFLD CAYMAN INV CHFOTN 9 07/31/21	1,000,000	889,925	0.26
CHAMPION PATH SOCJOG 4 1/2 01/27/26	500,000	3,200,934	0.94
CHINA AOYUAN GROUP LTD 0.00% 01MAR2027	750,000	288,751	0.08
CHINA AOYUAN GROUP LTD 0.00% 19FEB2023	500,000	197,091	0.06
CHINA EVERGRANDE 0% 22JAN2023	2,995,000	1,342,454	0.39
CHINA SCE GRP CHINSC 5.95 09/29/24	250,000	317,830	0.09
CHINA SCE GRP CHINSC 6 02/04/26	250,000	227,004	0.07
CHINA SCE GRP CHINSC 7 05/02/25	250,000	263,345	0.08
CIFI HOLDINGS CIFIHG 4.45 08/17/26	1,400,000	1,149,987	0.34
CIFI HOLDINGS CIFIHG 5 1/4 05/13/26	1,400,000	1,145,614	0.34
CMNWLTH BK OF AUST-0 NCD 21/03/22	500,000	3,385,458	1.00
COUNTRY GARDEN COGARD 7 1/4 04/08/26	3,400,000	8,723,288	2.56
DEXIN CHINA HLDN DEXICN 9.95 12/03/22	500,000	1,292,789	0.38
EASY TACTIC LTD GZRFP 6 1/2 07/11/27	1,582,068	993,706	0.29
EHI CAR SERVICES EHICAR 7 09/21/26	400,000	1,748,322	0.51
FANTASIA HOLDING 0.00% 01JUN2023	2,000,000	986,110	0.29
FORTUNE STAR FOSUNI 5 05/18/26	200,000	1,073,025	0.32
FORTUNE STAR FOSUNI 5.05 01/27/27	550,000	2,730,621	0.80
HUARONG FINANCE HRAM 4 1/4 11/07/27	1,000,000	6,066,748	1.78
KAISA GROUP 0% 30JUN2023	550,000	268,823	0.08
KAISA GROUP KAISAG 9 3/4 09/28/23	2,500,000	1,214,778	0.36
KWG GROUP KWGPRO 5.95 08/10/25	250,000	193,553	0.06
KWG PROPERTY KWGPRO 5 7/8 11/10/24	500,000	380,096	0.11
LOGAN GROUP CO LTD 0.00% 06JUL2026	1,000,000	726,397	0.21
LOGAN GROUP CO LTD 0.00% 12JUL2025	750,000	558,474	0.16
LS FINANCE 2017 LIHKK 4.8 06/18/26	200,000	1,168,192	0.34
MELCO RESORTS MPEL 5 3/4 07/21/28	1,000,000	6,381,019	1.88
MGM CHINA HOLDIN MGMCHI 5 1/4 06/18/25	200,000	1,396,187	0.41
MGM CHINA HOLDIN MGMCHI 5 7/8 05/15/26	500,000	3,474,414	1.02
NAGACORP LTD 7.95% 06JUL2024	250,000	1,711,326	0.50
NEW METRO GLOBAL FTLNHD 4 1/2 05/02/26	300,000	882,464	0.26
NEW METRO GLOBAL FTLNHD 4 5/8 10/15/25	300,000	1,097,616	0.32
POWERLONG PWRLNG 4.9 05/13/26	250,000	190,680	0.06
POWERLONG PWRLNG 5.95 04/30/25	750,000	563,922	0.17
POWERLONG REAL ESTATE 6.25% 10AUG2024	400,000	290,588	0.09
RED SUN PROPRTI 0.00% 03 OCT 2099	250,000	154,066	0.05
RED SUN PROPERTIES GRP 0.00% 13JAN2025	500,000	319,647	0.09
RED SUN PROPERTIES GRP 0.00% 16APR2025	250,000	155,119	0.05
RKPF 2019 E LTD ROADKG 7 3/4 PERP	1,550,000	3,644,952	1.07

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 2023 年 6 月 30 日

	持仓量	公允价值 人民币	占资产净额 百分比(%)
公司债券(67.21%) (续)			
中国内地 (33.42%) (续)			
RONGCHANGDA DEV RISSUN 9 1/2 09/17/24	1,000,000	708,308	0.21
RONSHINE CHINA 0.00% 15DEC2023	500,000	170,227	0.05
RONSHINE CHINA 0.00% 22JAN2023	750,000	286,966	0.08
RONSHINE CHINA 0.00% 25JAN2025	250,000	109,614	0.03
SANDS CHINA LTD SANLTD 4 3/8 06/18/30	2,000,000	12,898,759	3.79
SHIMAO GROUP HOLDINGS LT 0.00% 11JAN2031	1,000,000	707,872	0.21
SHIMAO GRP HLDGS 0.00% 13JUL2030	1,000,000	727,487	0.21
SHIMAO PROPERTY 0.00% 21FEB2024	1,000,000	563,894	0.17
SINO OCEAN LAND SINOCE 4 3/4 08/05/29	1,600,000	2,498,126	0.73
STUDIO CITY FIN STCITY 6 07/15/25	800,000	5,416,558	1.59
SUN HUNG KAI BVI SUNHKC 5 09/07/26	1,000,000	6,445,893	1.90
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 0.00% 20OCT2024	2,500,000	2,791,763	0.82
TIMES CHINA HLDG LTD 6.75% 08JUL2025	750,000	414,047	0.12
TIMES CN HLDG 0.00% 22MAR2026	500,000	277,212	0.08
TIMES PROPERTY 0.00% 02MAR2023	1,000,000	558,800	0.16
WYNN MACAU LTD WYNMAC 5 1/2 01/15/26	1,500,000	10,134,579	2.98
WYNN MACAU LTD WYNMAC 5 1/2 10/01/27	400,000	2,592,828	0.76
YANGO CAYMAN 0.00% 08SEP2022	500,000	29,676	0.01
YANGO JUSTICE INTL 0% 25NOV2023	1,750,000	255,027	0.08
YUZHOU PROPRTIE 0.00% 04FEB2023	250,000	84,785	0.03
YUZHOU PROPRTIE 0.00% 13JAN2026	1,000,000	339,141	0.10
YUZHOU PROPRTIE 0.00% 13JAN2027	1,000,000	357,303	0.11
YUZHOU PROPRTIE 0.00% 25OCT2023	1,000,000	339,141	0.10
YUZHOU PROPRTIE 0.00% 30OCT2024	250,000	84,785	0.02
ZHENRO PROPERTIES 0.00% 15SEP2023	500,000	99,890	0.03
ZHENRO PROPERTIES GROUP 0.00% 10SEP2024	2,000,000	399,558	0.12
菲律宾 (3.79%)			
JOLLIBEE WORLDWIDE PTE L FRN 31DEC2049	200,000	1,389,301	0.41
SMC GLOBAL POWER SMCGL 5.95 PERP	2,000,000	11,499,288	3.38
新加坡 (1.74%)			
LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.25% 19JUN2024	450,000	2,129,795	0.63
MEDCO BELL MEDCIJ 6 3/8 01/30/27	550,000	3,769,313	1.11
英国 (3.29%)			
STANDARD CHART STANLN 7 3/4 PERP	600,000	4,299,233	1.26
VEDANTA RESOURCE	1,250,000	6,904,277	2.03
越南 (1.88%)			
MONG DUONG FIN MONDFI 5 1/8 05/07/29	1,000,000	6,406,808	1.88
公司债券总计		228,603,462	67.21

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 2023 年 6 月 30 日

	持仓量	公允价值 人民币	占资产净额 百分比(%)
政府债券 (5.09%)			
巴基斯坦 (2.80%) REP OF PAKISTAN PKSTAN 6 7/8 12/05/27	2,750,000	9,529,066	2.80
斯里兰卡 (2.29%) REP OF SRI LANKA 0.00% 11MAY2027	2,400,000	7,777,526	2.29
政府债券总计		<u>17,306,592</u>	<u>5.09</u>
投资基金 (14.46%)			
香港 (14.46%) INCOME PART RMB BOND-4A USDA	63,800	49,171,173	14.46
投资基金总计		<u>49,171,173</u>	<u>14.46</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 2023 年 6 月 30 日

衍生金融工具 (-0.23%)

基础资产	对手方	未偿付合约名义值	公允价值 人民币	占资产净额 百分比(%)
外汇远期合约				
买入人民币/卖出美元	巴克莱银行	42,000,000 人民币	(748,376)	(0.22)
买入港元/卖出人民币	花旗银行	1,006,617 港元	17,892	0.01
买入新加坡元/卖出人民币	花旗银行	602,522 新加坡元	21,806	0.01
买入欧元/卖出人民币	花旗银行	627,850 欧元	64,620	0.02
买入美元/卖出人民币	花旗银行	761,168 美元	115,321	0.03
买入美元/卖出人民币	花旗银行	489,373 美元	74,143	0.02
买入港元/卖出人民币	花旗银行	271,956 港元	4,834	0.00
买入新加坡元/卖出人民币	花旗银行	1,145,530 新加坡元	41,459	0.01
买入美元/卖出人民币	花旗银行	10,049,386 美元	1,522,533	0.45
买入美元/卖出人民币	花旗银行	1,490,807 美元	225,865	0.07
买入澳元/卖出人民币	花旗银行	954,839 澳元	(80,036)	(0.02)
买入欧元/卖出人民币	花旗银行	57,141 欧元	5,881	0.00
买入澳元/卖出人民币	花旗银行	755,736 澳元	(63,347)	(0.02)
买入人民币/卖出港元	花旗银行	124,059 人民币	(2,435)	(0.00)
买入新加坡元/卖出人民币	花旗银行	6,419 新加坡元	117	0.00
买入澳元/卖出人民币	花旗银行	10,004 澳元	(928)	(0.00)
买入美元/卖出人民币	花旗银行	5,593 美元	572	0.00
买入港元/卖出人民币	花旗银行	2,950 港元	31	0.00
买入欧元/卖出人民币	花旗银行	6,481 欧元	510	0.00
买入美元/卖出人民币	花旗银行	16,540 美元	1,692	0.00
买入澳元/卖出人民币	花旗银行	7,929 澳元	(736)	(0.00)
买入新加坡元/卖出人民币	花旗银行	12,202 新加坡元	222	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 2023 年 6 月 30 日****衍生金融工具 (-0.23%) (续)**

基础资产	对手方	未偿付合约名义值	公允价值 人民币	占资产净额 百分比(%)
外汇远期合约 (续)				
买入欧元/卖出人民币	花旗银行	590 欧元	46	0.00
买入人民币/卖出美元	巴克莱银行	60,000,000 人民币	(683,863)	(0.20)
买入人民币/卖出美元	巴克莱银行	64,000,000 人民币	(741,495)	(0.22)
买入人民币/卖出港元	花旗银行	1,292 人民币	(11)	(0.00)
买入人民币/卖出欧元	花旗银行	451,862 人民币	(738)	(0.00)
买入人民币/卖出美元	瑞银	65,000,000 人民币	(273,043)	(0.08)
买入人民币/卖出美元	瑞银	65,000,000 人民币	(242,949)	(0.07)
买入人民币/卖出欧元	花旗银行	3,014 人民币	1	0.00
买入人民币/卖出港元	花旗银行	1,298 人民币	(5)	(0.00)
买入澳元/卖出人民币	花旗银行	10,004 澳元	(341)	(0.00)
买入澳元/卖出人民币	花旗银行	7,929 澳元	(270)	(0.00)
买入澳元/卖出人民币	花旗银行	954,839 澳元	(32,528)	(0.01)
买入澳元/卖出人民币	花旗银行	755,736 澳元	(25,746)	(0.01)
买入欧元/卖出人民币	花旗银行	6,481 欧元	20	0.00
买入欧元/卖出人民币	花旗银行	627,850 欧元	1,971	0.00
买入港元/卖出人民币	花旗银行	2,950 港元	11	0.00
买入港元/卖出人民币	花旗银行	1,006,617 港元	3,867	0.00
买入人民币/卖出港元	花旗银行	125,966 人民币	(526)	(0.00)
买入港元/卖出人民币	花旗银行	271,956 港元	1,045	0.00
买入新加坡元/卖出人民币	花旗银行	6,419 新加坡元	87	0.00
买入新加坡元/卖出人民币	花旗银行	12,202 新加坡元	165	0.00
买入新加坡元/卖出人民币	花旗银行	602,522 新加坡元	8,161	0.00
买入新加坡元/卖出人民币	花旗银行	1,145,530 新加坡元	15,515	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 2023 年 6 月 30 日****衍生金融工具 (-0.23%) (续)**

基础资产	对手方	未偿付合约名义值	公允价值 人民币	占资产净额 百分比(%)
外汇远期合约 (续)				
买入美元/卖出人民币	花旗银行	5,593 美元	218	0.00
买入美元/卖出人民币	花旗银行	16,540 美元	645	0.00
买入美元/卖出人民币	花旗银行	761,168 美元	29,700	0.01
买入美元/卖出人民币	花旗银行	489,373 美元	19,095	0.01
买入美元/卖出人民币	花旗银行	10,049,386 美元	392,118	0.12
买入美元/卖出人民币	花旗银行	1,490,807 美元	58,170	0.02
买入人民币/卖出美元	花旗银行	3,568,665 人民币	(20,971)	(0.01)
买入人民币/卖出新加坡元	花旗银行	6,178,916 人民币	(19,592)	(0.01)
买入人民币/卖出港元	花旗银行	927,052 人民币	(4,722)	(0.00)
买入人民币/卖出美元	花旗银行	72,455,211 人民币	(425,782)	(0.13)
买入人民币/卖出新加坡元	花旗银行	3,249,971 人民币	(10,305)	(0.00)
买入人民币/卖出欧元	花旗银行	5,000,987 人民币	(5,143)	(0.00)
买入人民币/卖出港元	花旗银行	126,030 人民币	(642)	(0.00)
买入人民币/卖出美元	花旗银行	10,867,845 人民币	(63,865)	(0.02)
买入人民币/卖出澳元	花旗银行	4,670,331 人民币	30,590	0.01
买入人民币/卖出美元	花旗银行	5,487,953 人民币	(32,250)	(0.01)
买入人民币/卖出澳元	花旗银行	3,696,529 人民币	24,212	0.01
买入人民币/卖出澳元	花旗银行	43,687 人民币	(29)	(0.00)
买入人民币/卖出澳元	花旗银行	55,195 人民币	(37)	(0.00)
买入人民币/卖出美元	花旗银行	124,961 人民币	(364)	(0.00)
买入人民币/卖出新加坡元	花旗银行	39,390 人民币	(10)	(0.00)
买入人民币/卖出新加坡元	花旗银行	74,896 人民币	(19)	(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 2023 年 6 月 30 日

衍生金融工具 (-0.23%) (续)

基础资产	对手方	未偿付合约名义值	公允价值 人民币	占资产净额 百分比(%)
外汇远期合约 (续)				
买入人民币/卖出欧元	花旗银行	61,381 人民币	252	0.00
买入人民币/卖出美元	花旗银行	39,452 人民币	(115)	(0.00)
买入人民币/卖出美元	花旗银行	1,492,797 人民币	(1,110)	(0.00)
衍生金融工具总计			(798,942)	(0.23)
资产净额总计				
投资总计, 按公允价值			295,081,227	86.76
衍生金融工具			(798,942)	(0.23)
银行结余			9,096,650	2.67
其他资产净额			36,734,392	10.80
资产净额总计			340,113,327	100.00
投资总计, 按成本			436,864,070	

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)

投资组合持仓变动表 (未经审计)

截至 2023 年 6 月 30 日止六个月

	截至 2023 年 1 月 1 日	增添	出售	截至 2023 年 6 月 30 日
有报价投资				
公司债券				
澳大利亚				
PERENTI FINANCE ASLAU 6 1/2 10/07/25	200,000	-	-	200,000
百慕大				
CHINA OIL CHIOIL 4.7 06/30/26	500,000	-	(300,000)	200,000
HOPSON DEVELOP HPDLF 7 05/18/24	-	300,000	(300,000)	-
香港				
BANK OF EAST ASIA LTD FRN 31DEC2049	500,000	-	-	500,000
BK OF EAST ASIA BNKEA 5 7/8 PERP	-	1,000,000	-	1,000,000
CAS CAPITAL NO1 CASHLD 4 PERP	1,050,000	-	-	1,050,000
CELESTIAL DYNASTY LTD 4.25% 27JUN2029	255,000	-	-	255,000
CHINA SOUTH CITY CSCHCN 7 1/4 11/20/22	200,000	-	-	200,000
CHINA WATER AFF CWAHK 4.85 05/18/26	500,000	-	(300,000)	200,000
FEC FINANCE LTD FAEACO 7 3/8 PERP	200,000	-	-	200,000
FWD LTD FWDINS 5 1/2 PERP	950,000	-	-	950,000
GEMDALE EVER GEMDAL 4.95 08/12/24	300,000	-	(300,000)	-
NANYANG COMMERC NANYAN 6 1/2 PERP	750,000	-	-	750,000
NWD MTN LTD NWDEVL 4 1/8 07/18/29	1,700,000	-	(1,700,000)	-
RH INTL FINANCE LTD 6.5% 31DEC2049	600,000	-	-	600,000
YANGO JUSTICE 0.00% 15APR2023	250,000	-	-	250,000
YANLORD LAND HK YLLGSP 5 1/8 05/20/26	200,000	-	(200,000)	-
印度				
ADANI GREEN ENE ADANIG 4 3/8 09/08/24	300,000	-	-	300,000
ADANI TRANSMISSI ADTIN 4 1/4 05/21/36	350,000	-	(350,000)	-
GREENKO INVESTMENT CO 4 7/8 08/16/23	659,000	-	(659,000)	-
HDFC BANK LTD HDFCB 3.7 PERP	400,000	-	-	400,000
JSW STEEL LTD JSTLIN 5.95 04/18/24	1,000,000	-	(800,000)	200,000
RENEW POWER PVT LTD 5.875% 05MAR2027	400,000	400,000	(592,000)	208,000
印尼				
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
INDIKA ENERGY IV INDYIJ 8 1/4 10/22/25	600,000	-	(300,000)	300,000
MINEJESA CAPITAL BV 4.625% 10AUG2030	200,000	-	-	200,000
PAKUWON JATI PWONIJ 4 7/8 04/29/28	200,000	200,000	-	400,000
THETA CAPITAL PTE LTD 8.125% 22JAN2025	250,000	-	-	250,000
日本				
ASAHI MUTUAL LIF ASAMLI 6.9 PERP	-	250,000	(250,000)	-
SUMITOMO MITSUI SUMIFL 5.353 04/25/28	-	500,000	(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 2023 年 6 月 30 日止六个月

	截至 2023 年 1 月 1 日	增添	出售	截至 2023 年 6 月 30 日
公司债券 (续)				
毛里求斯				
AZURE POWER AZUPOE 3.575 08/19/26	400,000	-	(400,000)	-
CA MAGNUM HLDING HEXWIN 5 3/8 10/31/26	400,000	-	-	400,000
DIAMOND II LTD RNW 7.95 07/28/26	-	200,000	-	200,000
NETWORK I2I LTD FRN 31DEC2049	700,000	-	-	700,000
蒙古				
MONGO MIN/ENG RE MONMIN 9 1/4 04/15/24	450,000	300,000	(450,000)	300,000
荷兰				
GREENKO DUTCH BV GRNKEN 3.85 03/29/26	1,100,000	-	-	1,100,000
JABABEKA INTL BV KIJAIJ 7 12/15/27	700,000	-	-	700,000
中国内地				
AAC TECHNOLOGIES AACTEC 3 3/4 06/02/31	400,000	-	(400,000)	-
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	(1,000,000)	1,000,000
AOYUAN PROPERTY CAPG 5 3/8 09/13/22	2,000,000	-	-	2,000,000
BANK OF COMMUNICATIONS FRN 31DEC2020	-	1,100,000	(1,100,000)	-
CENTRAL CHINA CENCHI 7 1/2 07/14/25	300,000	-	-	300,000
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	300,000	200,000	-	500,000
CHINA AOYUAN GROUP LTD 0.00% 01MAR2027	750,000	-	-	750,000
CHINA AOYUAN GROUP LTD 0.00% 19FEB2023	500,000	-	-	500,000
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	-	(500,000)	250,000
CHINA SCE GRP CHINSC 7 05/02/25	250,000	-	-	250,000
CIFI HOLDINGS CIFIHG 4.45 08/17/26	1,400,000	-	-	1,400,000
CIFI HOLDINGS CIFIHG 5 1/4 05/13/26	1,400,000	-	-	1,400,000
CMNWLTB BK OF AUST-0 NCD 21/03/22	-	1,100,000	(600,000)	500,000
COUNTRY GARDEN COGARD 3 1/8 10/22/25	1,500,000	-	(1,500,000)	-
COUNTRY GARDEN COGARD 4.8 08/06/30	1,000,000	-	(1,000,000)	-
COUNTRY GARDEN COGARD 7 1/4 04/08/26	1,500,000	1,900,000	-	3,400,000
COUNTRY GARDEN COGARD 8 01/27/24	500,000	-	(500,000)	-
DEXIN CHINA HLDN DEXICN 9.95 12/03/22	500,000	-	-	500,000
EASY TACTIC LTD GZRFP 6 1/2 07/11/27	1,524,885	57,183	-	1,582,068
EHI CAR SERVICES EHICAR 7 09/21/26	400,000	-	-	400,000
FANTASIA HOLDING 0.00% 01JUN2023	2,000,000	-	-	2,000,000
FORTUNE STAR FOSUNI 5 05/18/26	700,000	-	(500,000)	200,000
FORTUNE STAR FOSUNI 5.05 01/27/27	1,050,000	-	(500,000)	550,000
FRANSHION BRILLA CHJMAO 4 1/4 07/23/29	336,000	-	(336,000)	-

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 2023 年 6 月 30 日止六个月

	截至 2023 年 1 月 1 日	增添	出售	截至 2023 年 6 月 30 日
公司债券 (续)				
中国内地 (续)				
GRNLGR 5.875% 03JUL2024	1,250,000	-	(1,250,000)	-
HUARONG FINANCE HRAM 4 1/4 11/07/27	-	1,000,000	-	1,000,000
KAISA GROUP 0% 30JUN2023	550,000	-	-	550,000
KAISA GROUP KAISAG 9 3/4 09/28/23	2,500,000	-	-	2,500,000
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	(500,000)	500,000
LOGAN GROUP CO LTD 0.00% 06JUL2026	1,000,000	-	-	1,000,000
LOGAN GROUP CO LTD 0.00% 12JUL2025	750,000	-	-	750,000
LS FINANCE 2017 LIHKK 4.8 06/18/26	500,000	-	(300,000)	200,000
MELCO RESORTS MPEL 5 3/4 07/21/28	1,500,000	-	(500,000)	1,000,000
MGM CHINA HOLDIN MGMCHI 5 1/4 06/18/25	500,000	-	(300,000)	200,000
MGM CHINA HOLDIN MGMCHI 5 7/8 05/15/26	-	500,000	-	500,000
NAGACORP LTD 7.95% 06JUL2024	-	250,000	-	250,000
NEW METRO GLOBAL FTLNHD 4 1/2 05/02/26	700,000	-	(400,000)	300,000
NEW METRO GLOBAL FTLNHD 4 5/8 10/15/25	500,000	-	(200,000)	300,000
POWERLONG PWRLNG 4.9 05/13/26	250,000	-	-	250,000
POWERLONG PWRLNG 5.95 04/30/25	750,000	-	-	750,000
POWERLONG REAL ESTATE 6.25% 10AUG2024	400,000	-	-	400,000
RED SUN PROPRTI 0.00% 03 OCT 2099	250,000	-	-	250,000
RED SUN PROPERTIES GRP 0.00% 13JAN2025	500,000	-	-	500,000
RED SUN PROPERTIES GRP 0.00% 16APR2025	250,000	-	-	250,000
RKPF 2019 E LTD ROADKG 7 3/4 PERP	1,550,000	-	-	1,550,000
RONGCHANGDA DEV RISSUN 9 1/2 09/17/24	1,000,000	-	-	1,000,000
RONSHINE CHINA 0.00% 15DEC2023	500,000	-	-	500,000
RONSHINE CHINA 0.00% 22JAN2023	750,000	-	-	750,000
RONSHINE CHINA 0.00% 25JAN2025	250,000	-	-	250,000
SANDS CHINA LTD SANLTD 4 3/8 06/18/30	2,000,000	500,000	(500,000)	2,000,000
SANDS CHINA LTD SANLTD 5.4 08/08/28	-	300,000	(300,000)	-
SHIMAO GROUP HOLDINGS LT 0.00% 11JAN2031	1,000,000	-	-	1,000,000
SHIMAO GRP HLDGS 0.00% 13JUL2030	1,000,000	-	-	1,000,000
SHIMAO PROPERTY 0.00% 21FEB2024	1,000,000	-	-	1,000,000
SHUI ON DEVELOP SHUION 5 1/2 03/03/25	800,000	-	(800,000)	-
SINO OCEAN LAND SINOCE 2.7 01/13/25	500,000	-	(500,000)	-
SINO OCEAN LAND SINOCE 4 3/4 08/05/29	1,600,000	-	-	1,600,000
STUDIO CITY FIN STCITY 5 01/15/29	-	500,000	(500,000)	-
STUDIO CITY FIN STCITY 6 07/15/25	800,000	-	-	800,000
SUN HUNG KAI BVI SUNHKC 5 09/07/26	1,000,000	-	-	1,000,000
SUNAC CHINA HLDG 0.00% 09JUL2023	250,000	-	(250,000)	-
SUNAC CHINA HLDG 0.00% 19APR2023	250,000	-	(250,000)	-
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 0.00% 20OCT2024	2,500,000	-	-	2,500,000
TIMES CHINA HLDG LTD 6.75% 08JUL2025	750,000	750,000	(750,000)	750,000
TIMES CN HLDG 0.00% 22MAR2026	500,000	500,000	(500,000)	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 2023 年 6 月 30 日止六个月

	截至 2023 年 1 月 1 日	增添	出售	截至 2023 年 6 月 30 日
公司债券 (续)				
中国内地 (续)				
TIMES PROPERTY 0.00% 02MAR2023	1,000,000	1,000,000	(1,000,000)	1,000,000
WANDA PROP GLOBA DALWAN 11 02/13/26	-	750,000	(750,000)	-
WENS FOODSTUFF GWFOOD 3.258 10/29/30	250,000	-	(250,000)	-
WEST CHINA CEM WESCHI 4.95 07/08/26	700,000	-	(700,000)	-
WYNN MACAU LTD WYNMAC 5 1/2 01/15/26	1,500,000	-	-	1,500,000
WYNN MACAU LTD WYNMAC 5 1/2 10/01/27	-	400,000	-	400,000
YANGO CAYMAN 0.00% 08SEP2022	500,000	-	-	500,000
YANGO JUSTICE INTL 0% 25NOV2023	1,750,000	-	-	1,750,000
YUZHOU PROPERTIE 0.00% 04FEB2023	250,000	-	-	250,000
YUZHOU PROPERTIE 0.00% 13JAN2026	1,000,000	-	-	1,000,000
YUZHOU PROPERTIE 0.00% 13JAN2027	1,000,000	-	-	1,000,000
YUZHOU PROPERTIE 0.00% 25OCT2023	1,000,000	-	-	1,000,000
YUZHOU PROPERTIE 0.00% 30OCT2024	250,000	-	-	250,000
ZHENRO PROPERTIES 0.00% 15SEP2023	500,000	-	-	500,000
ZHENRO PROPERTIES GROUP 0.00% 10SEP2024	2,000,000	-	-	2,000,000
ZHONGAN ONLINE ZHONAN 3 1/2 03/08/26	500,000	-	(500,000)	-
菲律宾				
JOLLIBEE WORLDWIDE PTE L FRN 31DEC2049	200,000	-	-	200,000
SMC GLOBAL POWER SMCGL 5.95 PERP	2,000,000	-	-	2,000,000
新加坡				
ABJA INVESTMENT TATAIN 5.95 07/31/24	400,000	-	(400,000)	-
LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.25% 19JUN2024	450,000	-	-	450,000
MEDCO BELL MEDCIJ 6 3/8 01/30/27	-	550,000	-	550,000
韩国				
POSCO POHANG 5 7/8 01/17/33	-	300,000	(300,000)	-
SK HYNIX INC HYUELE 6 1/2 01/17/33	-	500,000	(500,000)	-
英国				
JAGUAR LAND ROVER AUTOMO 7.75% 15OCT2025	600,000	-	(600,000)	-
STANDARD CHART STANLN 7 3/4 PERP	-	600,000	-	600,000
VEDANTA RESOURCE	1,800,000	-	(550,000)	1,250,000
美国				
BOC AVIATION USA BOCAVI 4 7/8 05/03/33	-	200,000	(200,000)	-
越南				
MONG DUONG FIN MONDFI 5 1/8 05/07/29	1,000,000	-	-	1,000,000

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 2023 年 6 月 30 日止六个月

	截至 2023 年 1 月 1 日	增添	出售	截至 2023 年 6 月 30 日
政府债券				
香港				
HONG KONG HKINTL 4 5/8 01/11/33	-	350,000	(350,000)	-
蒙古				
MONGOLIA MONGOL 5 5/8 05/01/23	800,000	-	(800,000)	-
巴基斯坦				
REP OF PAKISTAN PKSTAN 6 7/8 12/05/27	2,250,000	500,000	-	2,750,000
菲律宾				
PHILIPPINES(REP) PHILIP 5 07/17/33	-	450,000	(450,000)	-
斯里兰卡				
REP OF SRI LANKA 0.00% 11MAY2027	3,700,000	-	(1,300,000)	2,400,000
投资基金				
香港				
INCOME PART RMB BOND-4A USDA	63,800	-	-	63,800

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 2023 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 花旗银行	现金	N/A	N/A	N/A	美元	4.41%	14,990,914
香港分行	现金	N/A	N/A	N/A	美元	2.31%	7,850,509
瑞银	现金	N/A	N/A	N/A	美元	2.37%	8,057,771
"KGI Securities (Singapore) Pte.Ltd."	现金	N/A	N/A	N/A	美元	0.49%	1,657,035

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	-	-