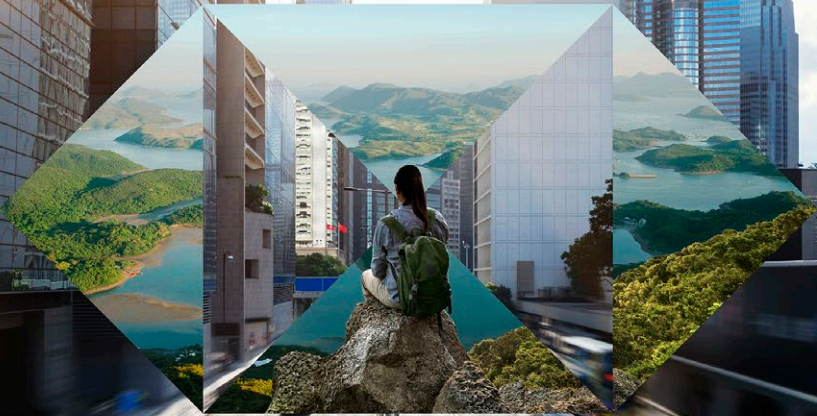


香港創富債券指數基金

2021 中期報告



HSBC Global Asset Management
滙豐 環球投資管理

目錄

	頁
財務狀況表	1
綜合收益表	2
權益變動表	3
現金流量表	4
投資報表	5
投資組合變動表	7
表現紀錄	8
派息披露	9
相關指數成分股披露	10
行政	11

財務狀況表

ABF 香港創富債券指數基金

	2021年1月31日 港元	2020年7月31日 港元
資產		
以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產	2,338,835,631	2,386,555,172
應收利息	13,779,158	15,563,142
應收經紀款項	41,563,989	5,404,222
現金和現金等價物	8,333,310	5,608,613
總資產	2,402,512,088	2,413,131,149
負債		
應付經紀款項	41,813,830	-
應付收益分派	6,620,700	10,601,160
其他應付賬款	591,359	669,262
總負債	49,025,889	11,270,422
單位持有人應佔資產淨值(買入價)	2,353,486,199	2,401,860,727
即：		
權益	2,353,486,199	2,401,860,727
已發行單位總數	22,830,001	23,046,001
以買入價計算的每單位資產淨值	103.09	104.22

附註：本基金中期報告已應用與年報相同的會計政策及計算方法。

綜合收益表

截至2021年1月31日止期間

ABF香港創富債券指數基金

	2020年8月1日至 2021年1月31日 港元	2019年8月1日至 2020年1月31日 港元
以公允價值計量且其變動計入損益的金融工具之(虧損)/收益淨額	(16,510,023)	36,658,780
外匯虧損淨額	(25)	(57)
來自經理人的退款	-	2,710,174
雜項收入	4,501	76,564
利息收入	13	1,600
	<hr/>	<hr/>
(虧損)/收入總額	(16,505,534)	39,447,061
	<hr/>	<hr/>
管理費 ^{附註2}	1,653,036	1,743,496
交易費用 ^{附註1}	12,253	16,534
受託人費用 ^{附註1}	591,756	628,200
註冊登記費用 ^{附註1}	10,852	10,151
法律和專業費用	199,314	31,867
核數師酬金	75,951	76,785
雜項開支 ^{附註1}	329,519	281,265
	<hr/>	<hr/>
經營開支總額	2,872,681	2,788,298
	<hr/>	<hr/>
單位持有人應佔資產淨值(減少)/增加及期內綜合收益總額	(19,378,215)	36,658,763

附註1 於截至2021年及2020年1月31日止期間，除受託人費用、註冊登記費用及交易費用外，其他應付受託人/受託人的關連人士的相關費用如下：

	2020年8月1日至 2021年1月31日 港元	2019年8月1日至 2020年1月31日 港元
雜項開支	44,575	3,913

附註2 於截至2021年及2020年1月31日止期間，除支付予經理人的管理費外，並無其他支付予經理人/經理人的關連人士的費用。

權益變動表

截至2021年1月31日止期間

ABF 香港創富債券指數基金

	2020年8月1日至 2021年1月31日 港元	2019年8月1日至 2020年1月31日 港元
期初結餘	2,401,860,727	2,618,526,872
單位持有人應佔資產淨值(減少)/增加及期內綜合收益總額	(19,378,215)	36,658,763
認購單位(均衡調整除外)	-	97,866,400
贖回單位(均衡調整除外)	(22,276,318)	(307,865,685)
認購及贖回的均衡調整	(99,295)	(530,670)
期內向單位持有人作出的收益分派	(6,620,700)	(16,793,281)
	(28,996,313)	(227,323,236)
期末結餘	2,353,486,199	2,427,862,399
已發行單位數目	單位	單位
承前的已發行單位數目	23,046,001	26,546,001
期內已發行單位	-	1,000,000
期內已贖回單位	(216,000)	(3,100,000)
結轉的已發行單位數目	22,830,001	24,446,001

現金流量表

截至2021年1月31日止期間

ABF 香港創富債券指數基金

	2020年8月1日至 2021年1月31日 港元	2019年8月1日至 2020年1月31日 港元
經營活動		
已收利息	13	1,600
已付管理費	(1,674,458)	(1,782,768)
已付受託人費用	(599,658)	(643,449)
已付交易費用	(9,919)	(18,868)
購買投資付款	(374,697,541)	(315,985,085)
出售投資所得款項(包括從投資獲得的票面利息)	413,345,106	524,220,654
已付其他經營開支	(666,574)	(566,753)
來自經理人的退款	-	2,710,174
已收雜項收入	4,501	76,564
	<hr/>	<hr/>
經營活動產生的現金淨額	35,701,470	208,012,069
融資活動		
發行單位所得款項(包括均衡調整)	-	98,701,000
贖回單位付款(包括均衡調整)	(22,375,613)	(284,424,355)
已付收益分派	(10,601,160)	(22,829,561)
	<hr/>	<hr/>
融資活動所用的現金淨額	(32,976,773)	(208,552,916)
現金和現金等價物增加/(減少)淨額	2,724,697	(540,847)
期初現金和現金等價物	5,608,613	867,789
	<hr/>	<hr/>
期末現金和現金等價物	8,333,310	326,942
	<hr/>	<hr/>

投資報表

ABF 香港創富債券指數基金

於 2021 年 1 月 31 日

	持有量	市場價值 港元	佔總資 產淨值 百分比 (%)		持有量	市場價值 港元	佔總資 產淨值 百分比 (%)
非上市但有報價的投資				南韓			
開曼群島				韓國產業銀行 3.2% · 2021 年 10 月 3 日			
MTR CORPORATION CI LTD 2.25% 2024 年 12 月 28 日	22,000,000	23,304,600	0.99	11,000,000	11,201,300	0.47	
MTR CORPORATION CI LTD 2.46% 2032 年 9 月 20 日	60,000,000	63,462,762	2.70	韓國土地和住宅公營公司 4.2% · 2022 年 1 月 18 日	20,000,000	20,672,834	0.88
		<u>86,767,362</u>	<u>3.69</u>			<u>31,874,134</u>	<u>1.35</u>
中國				委內瑞拉			
中國進出口銀行 3.13% 2023 年 3 月 22 日	15,000,000	15,686,241	0.67	安第斯發展公司 1.81% · 2021 年 8 月 2 日	114,000,000	114,478,800	4.86
		<u>15,686,241</u>	<u>0.67</u>			<u>114,478,800</u>	<u>4.86</u>
香港				非上市但有報價的總投資			
香港機場管理局 1.55% · 2027 年 10 月 30 日	45,000,000	44,756,550	1.90			<u>544,912,169</u>	<u>23.15</u>
香港機場管理局 1.95% · 2027 年 6 月 16 日	20,000,000	20,560,000	0.87	總投資			
香港機場管理局 2.3% · 2030 年 4 月 24 日	47,000,000	48,804,574	2.07			2,338,835,631	99.38
香港按揭證券有限公司 1.92% · 2022 年 5 月 10 日	5,000,000	5,089,750	0.22	其他資產淨值			
香港按揭證券有限公司 2.31% · 2021 年 4 月 12 日	47,000,000	47,172,020	2.01			<u>14,650,568</u>	<u>0.62</u>
香港按揭證券有限公司 3.15% · 2049 年 3 月 19 日	30,000,000	35,115,420	1.49	資產淨值總額			
市區重建局 2.15% · 2023 年 5 月 10 日	30,000,000	31,119,000	1.32			<u>2,353,486,199</u>	<u>100.00</u>
		<u>232,617,314</u>	<u>9.88</u>	總投資成本			
						<u>2,272,143,247</u>	
馬來西亞							
馬來西亞進出口銀行 2.95% 2023 年 3 月 12 日	61,000,000	63,488,318	2.70				
		<u>63,488,318</u>	<u>2.70</u>				

投資組合變動表

ABF 香港創富債券指數基金

於 2021 年 1 月 31 日

	佔總資產淨值 百分比 (%) 2021 年 1 月 31 日	佔總資產淨值 百分比 (%) 2020 年 7 月 31 日
債務證券		
上市投資	76.23	75.09
非上市但有報價的投資	23.15	24.27
債務證券 (總計)	99.38	99.36
總投資	99.38	99.36
其他資產淨值	0.62	0.64
資產淨值總額	100.00	100.00

表現紀錄

ABF 香港創富債券指數基金

	每單位資產淨值		
	最低 港元	最高 港元	
2020年8月1日至2021年1月31日	103.08	104.24	
2020	98.42	104.63	
2019	95.25	99.98	
2018	95.89	100.02	
2017	97.28	101.52	
2016	98.44	102.30	
2015	98.64	101.48	
2014	98.08	100.42	
2013	98.92	104.92	
2012	102.13	105.54	
2011	99.53	103.72	
	2021年1月31日 港元	2020年7月31日 港元	2019年7月31日 港元
資產淨值總額	2,353,486,199	2,401,860,727	2,618,526,872
每單位資產淨值	103.09	104.22	98.64

根據《單位信託及互惠基金守則》第8.6(l)章，受託人需比較本基金及實際指數在有關期間的表現。

	截至2021年 1月31日止6個月	截至2020年 7月31日止12個月
ABF 香港創富債券指數基金	(0.82)% ^(a)	6.85% ^(a)
Markit iBoxx ABF Hong Kong Index	(0.45)% ^(b)	6.80% ^(b)

(a) 表現是按基礎貨幣、單位價格對單位價格及股息（如有）再投資計算。

(b) 指針回報以總回報基準顯示。有別於本基金，指標回報並不包括基金開支或基金交易成本。

投資者應注意投資涉及風險，過往業績並非未來表現的指引。在作任何投資決定之前，投資者應參考本基金認購章程。

派息披露

ABF 香港創富債券指數基金

	除息日期	分派日期	每單位收益分派 港元	收益分派總額 港元
2021 年度中期收益分派	2021 年 1 月 28 日	2021 年 2 月 8 日	0.29	6,620,700
2020 年度末期收益分派	2020 年 7 月 30 日	2020 年 8 月 13 日	0.46	10,601,160
2020 年度中期收益分派	2020 年 1 月 30 日	2020 年 2 月 13 日	0.68	16,793,281

相關指數成分股披露

於**2021年1月31日**

本基金是一項旨在達致與Markit iBoxx ABF Hong Kong Index (「指數」) 總回報相若的指數基金。以下是佔指數比重逾10%的指數成分證券列表。

加權值

於**2021年1月31日**

中華人民共和國香港特別行政區政府 1.1%，2023年1月17日

14.25%

於2020年8月1日至2021年1月31日期間，Markit iBoxx ABF Hong Kong Index 下跌0.45%，而ABF香港創富債券指數基金(股息再投資)的每單位資產淨值則下跌0.82%。

行政

經理人及上市代理人

滙豐投資基金(香港)有限公司
香港中環
皇后大道中1號
滙豐總行大廈

經理人的董事

鮑國賢(於2020年8月28日辭任)
巴培卓
馬浩德
譚振邦
劉嘉燕

監察委員會委員

張仁良
熊天慧
麥毅進
袁鯤濤

投資顧問

滙豐環球投資管理(香港)有限公司
香港中環
皇后大道中1號
滙豐總行大廈

受託人、託管人、行政管理人、收款代理人及過戶代理處

滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司
香港中環
皇后大道中1號
滙豐總行大廈

處理代理人

香港證券兌換代理服務有限公司
香港中環
德輔道中199號
維德廣場2樓

法律顧問

高偉紳律師行
香港中環
康樂廣場1號
怡和大廈27樓

核數師

畢馬威會計師事務所
於《財務彙報局條例》下的註冊公眾利益實體核數師
香港中環
遮打道10號
太子大廈8樓

由滙豐環球投資管理（香港）有限公司刊發