

香港創富債券指數基金

2022 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

	2022年1月31日 港元	2021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	2,261,645,496	2,331,015,762
應收利息	13,507	11,717,349
應收經紀款項	195,813,180	—
現金和現金等價物	7,419,951	11,448,255
總資產	2,478,385,692	2,354,181,366
負債		
應付經紀款項	188,676,127	—
應付收益分派	11,650,951	10,273,501
其他應付賬款	614,431	676,472
總負債	200,941,509	10,949,973
單位持有人應佔資產淨值(買入價)	2,277,444,183	2,343,231,393
即：		
權益	2,277,444,183	2,343,231,393
已發行單位總數	22,845,001	22,830,001
以買入價計算的每單位資產淨值	99.69	102.64

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2022年1月31日止期間

ABF香港創富債券指數基金

	2021年8月1日至 2022年1月31日 港元	2020年8月1日至 2021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資產之虧損淨額	(52,851,778)	(16,510,023)
外匯虧損淨額	(213)	(25)
雜項收入	13,503	4,501
利息收入	521	13
虧損總額	(52,837,967)	(16,505,534)
管理費 ^{附註2}	1,646,773	1,653,036
交易費用 ^{附註1}	10,697	12,253
受託人費用 ^{附註1}	587,320	591,756
註冊登記費用 ^{附註1}	10,901	10,852
銀行收費 ^{附註1}	400	-
法律和專業費用	328,666	199,314
核數師酬金	77,202	75,951
雜項開支 ^{附註1}	265,371	329,519
經營開支總額	2,927,330	2,872,681
單位持有人應佔資產淨值減少及期內綜合收益總額	(55,765,297)	(19,378,215)

附註1 於截至2022年及2021年1月31日止期間，除交易費用、受託人費用及註冊登記費用外，其他應付受託人/受託人的關連人士的相關費用如下：

	2021年8月1日至 2022年1月31日 港元	2020年8月1日至 2021年1月31日 港元
銀行收費	400	-
雜項開支	47,946	44,575

附註2 於截至2022年及2021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2022年1月31日止期間

ABF 香港創富債券指數基金

	2021年8月1日至 2022年1月31日 港元	2020年8月1日至 2021年1月31日 港元
期初結餘	2,343,231,393	2,401,860,727
單位持有人應佔資產淨值減少及期內綜合收益總額	(55,765,297)	(19,378,215)
認購單位(均衡調整除外)	15,314,190	-
贖回單位(均衡調整除外)	(13,673,897)	(22,276,318)
認購及贖回的均衡調整	(11,255)	(99,295)
期內向單位持有人作出的收益分派	(11,650,951)	(6,620,700)
	(10,021,913)	(28,996,313)
期末結餘	2,277,444,183	2,353,486,199
已發行單位數目	單位	單位
承前的已發行單位數目	22,830,001	23,046,001
期內已發行單位	150,000	-
期內已贖回單位	(135,000)	(216,000)
結轉的已發行單位數目	22,845,001	22,830,001

現金流量表

截至2022年1月31日止期間

ABF 香港創富債券指數基金

	2021年8月1日至 2022年1月31日 港元	2020年8月1日至 2021年1月31日 港元
經營活動		
已收利息	521	13
已付管理費	(1,643,553)	(1,674,458)
已付受託人費用	(586,513)	(599,658)
已付交易費用	(10,308)	(9,919)
購買投資付款	(289,937,066)	(374,697,541)
出售投資所得款項(包括從投資獲得的票面利息)	297,528,785	413,345,106
已付其他經營開支	(749,210)	(666,574)
已收雜項收入	13,503	4,501
經營活動產生的現金淨額	4,616,159	35,701,470
融資活動		
發行單位所得款項(包括均衡調整)	15,341,775	-
贖回單位付款(包括均衡調整)	(13,712,737)	(22,375,613)
已付收益分派	(10,273,501)	(10,601,160)
融資活動所用的現金淨額	(8,644,463)	(32,976,773)
現金和現金等價物(減少)/增加淨額	(4,028,304)	2,724,697
期初現金和現金等價物	11,448,255	5,608,613
期末現金和現金等價物	7,419,951	8,333,310

投資報表

ABF 香港創富債券指數基金

於 2022 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 (%)
債務證券							
上市投資							
中國							
國家開發銀行(香港)0.55%，2023年1月12日	82,500,000	82,234,457	3.61	中華人民共和國香港特別行政區政府0.8%，2027年8月27日	10,000,000	9,651,224	0.42
				中華人民共和國香港特別行政區政府1.09%，2023年6月5日	11,500,000	11,589,920	0.51
				中華人民共和國香港特別行政區政府1.25%，2027年6月29日	99,300,000	98,821,185	4.34
				中華人民共和國香港特別行政區政府1.49%，2028年2月22日	9,000,000	8,993,859	0.40
				中華人民共和國香港特別行政區政府1.59%，2036年3月4日	60,000,000	58,015,548	2.55
				中華人民共和國香港特別行政區政府1.68%，2026年1月21日	220,200,000	223,934,218	9.83
				中華人民共和國香港特別行政區政府1.84%，2024年12月9日	13,000,000	13,280,063	0.58
				中華人民共和國香港特別行政區政府1.89%，2032年3月2日	76,500,000	77,770,351	3.42
				中華人民共和國香港特別行政區政府1.94%，2023年12月4日	6,500,000	6,640,217	0.29
				中華人民共和國香港特別行政區政府1.97%，2029年1月17日	116,000,000	119,879,133	5.26
				中華人民共和國香港特別行政區政府2.02%，2034年3月7日	59,200,000	60,710,192	2.67
				中華人民共和國香港特別行政區政府2.07%，2026年8月26日	29,000,000	29,938,994	1.31
				中華人民共和國香港特別行政區政府2.13%，2030年7月16日	90,100,000	93,821,743	4.12
				中華人民共和國香港特別行政區政府2.22%，2024年8月7日	217,400,000	223,841,714	9.83
				中華人民共和國香港特別行政區政府2.24%，2029年8月27日	52,000,000	54,296,544	2.38
				中華人民共和國香港特別行政區政府2.71%，2023年2月20日	3,000,000	3,072,688	0.14
				中華人民共和國香港特別行政區政府2.95%，2025年2月24日	30,000,000	31,640,340	1.39
				中華人民共和國香港特別行政區政府3.27%，2023年8月28日	17,150,000	17,852,747	0.78
				中華人民共和國香港特別行政區政府3.32%，2026年2月25日	4,000,000	4,324,844	0.19
				中華人民共和國香港特別行政區政府4.65%，2022年8月29日	15,000,000	15,356,400	0.67
						<u>1,686,616,823</u>	<u>74.06</u>

投資報表

ABF 香港創富債券指數基金

於 2022 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 (%)
南韓				馬來西亞			
韓國道路公社 3.02%，2023 年 3 月 5 日	30,000,000	30,629,757	1.34	馬來西亞進出口銀行 2.95%，2023 年 3 月 12 日	61,000,000	62,110,121	2.73
		30,629,757	1.34			62,110,121	2.73
總上市投資		1,799,481,037	79.01				
非上市但有報價的投資				南韓			
開曼群島				韓國進出口銀行 0.9%，2026 年 8 月 13 日			
MTR CORPORATION CI LTD 2.25%，2024 年 12 月 28 日	22,000,000	22,365,821	0.98		25,000,000	23,937,250	1.05
MTR CORPORATION CI LTD 2.46%，2032 年 9 月 20 日	60,000,000	59,491,170	2.62			23,937,250	1.05
		81,856,991	3.60	非上市但有報價的總投資			
						462,164,459	20.30
中國				總投資			
中國進出口銀行 3.13%，2023 年 3 月 22 日	15,000,000	15,357,871	0.67			2,261,645,496	99.31
		15,357,871	0.67	其他資產淨值			
						15,798,687	0.69
香港				資產淨值總額			
香港機場管理局 1.55%，2027 年 10 月 30 日	45,000,000	43,368,261	1.90			2,277,444,183	100.00
香港機場管理局 1.95%，2027 年 6 月 16 日	20,000,000	19,774,222	0.87	總投資成本			
香港機場管理局 2.3%，2030 年 4 月 24 日	47,000,000	46,696,596	2.05			2,294,453,255	
香港按揭證券有限公司 0.65%，2023 年 10 月 25 日	30,000,000	29,706,600	1.31				
香港按揭證券有限公司 0.8%，2024 年 4 月 15 日	75,000,000	73,860,750	3.24				
香港按揭證券有限公司 1.92%，2022 年 5 月 10 日	5,000,000	5,018,564	0.22				
香港按揭證券有限公司 3.15%，2049 年 3 月 19 日	30,000,000	30,073,322	1.32				
市區重建局 2.15%，2023 年 5 月 10 日	30,000,000	30,403,911	1.34				
		278,902,226	12.25				

投資組合變動表

ABF 香港創富債券指數基金

於2022年1月31日

	佔總資產淨值 百分比(%) 2022年1月31日	佔總資產淨值 百分比(%) 2021年7月31日
債務證券		
上市投資	79.01	79.42
非上市但有報價的投資	20.30	20.06
債務證券(總計)	99.31	99.48
總投資	99.31	99.48
其他資產淨值	0.69	0.52
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	
2021年8月1日至2022年1月31日	99.60	102.83	
2021	101.31	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	
	2022年1月31日 港元	2021年7月31日 港元	2020年7月31日 港元
資產淨值總額	2,277,444,183	2,343,231,393	2,401,860,727
每單位資產淨值	99.69	102.64	104.22

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2022年 1月31日止6個月	截至2021年 7月31日止12個月
ABF 香港創富債券指數基金	(2.37)% ^(a)	(0.81)% ^(a)
Markit iBoxx ABF Hong Kong Index	(2.24)% ^(b)	(0.18)% ^(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) 指標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
2022 年度中期收益分派	2022 年 1 月 27 日	2022 年 2 月 10 日	0.51	11,650,951
2021 年度末期收益分派	2021 年 7 月 29 日	2021 年 8 月 12 日	0.45	10,273,501
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

相關指數成分股披露

於**2022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。概無佔指數比重逾10%的指數成分證券。

於2021年8月1日至2022年1月31日期間，Markit iBoxx ABF Hong Kong Index 下跌2.24%，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2.37%。

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

陳寶枝
劉嘉燕
葉士奇
何慧芬(於2021年11月19日獲委任)
譚振邦(於2021年11月19日獲委任)

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