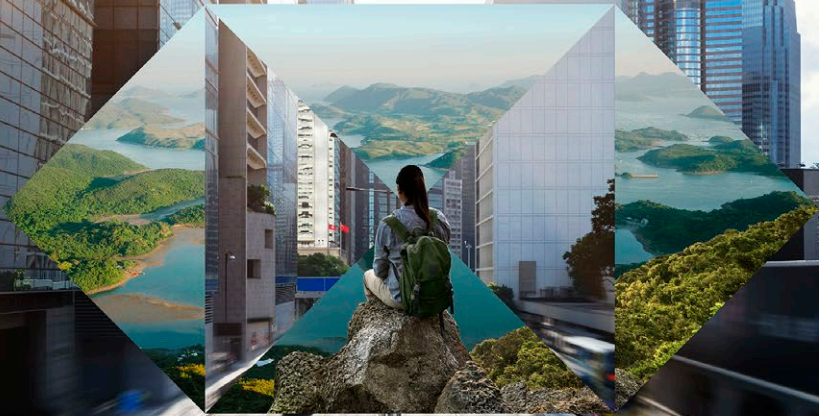


香港創富債券指數基金

2023 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

	2023年1月31日 港元	2022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	2,045,692,988	2,180,803,437
應收利息	12,262,186	11,437,835
應收經紀款項	9,800,072	4,964,965
現金和現金等價物	5,259,644	856,892
總資產	2,073,014,890	2,198,063,129
負債		
應付經紀款項	10,270,493	-
應付收益分派	1,089,750	228,950
其他應付賬款	606,403	655,358
總負債	11,966,646	884,308
單位持有人應佔資產淨值(買入價)	2,061,048,244	2,197,178,821
即：		
權益	2,061,048,244	2,197,178,821
已發行單位總數	21,795,001	22,895,001
以買入價計算的每單位資產淨值	94.57	95.97

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2023年1月31日止期間

ABF香港創富債券指數基金

	2022年8月1日至 2023年1月31日 港元	2021年8月1日至 2022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	(31,469,681)	(52,851,778)
外匯虧損淨額	(142)	(213)
雜項收入	4,501	13,503
利息收入	12,190	521
虧損總額	(31,453,132)	(52,837,967)
管理費 ^{附註2}	1,514,620	1,646,773
交易費用 ^{附註1}	9,920	10,697
受託人費用 ^{附註1}	531,722	587,320
註冊登記費用 ^{附註1}	10,963	10,901
銀行收費 ^{附註1}	–	400
法律和專業費用	83,270	328,666
核數師酬金	77,620	77,202
雜項開支 ^{附註1}	335,470	265,371
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	(34,016,717)	(55,765,297)

附註1 於截至2023年及2022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：

	2022年8月1日至 2023年1月31日 港元	2021年8月1日至 2022年1月31日 港元
銀行收費	–	400
雜項開支	70,650	47,946

附註2 於截至2023年及2022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2023年1月31日止期間

ABF 香港創富債券指數基金

	2022年8月1日至 2023年1月31日 港元	2021年8月1日至 2022年1月31日 港元
期初結餘	2,197,178,821	2,343,231,393
單位持有人應佔資產淨值減少及期內綜合收益總額	(34,016,717)	(55,765,297)
認購單位(均衡調整除外)	-	15,314,190
贖回單位(均衡調整除外)	(100,490,060)	(13,673,897)
認購及贖回的均衡調整	(534,050)	(11,255)
期內向單位持有人作出的收益分派	(1,089,750)	(11,650,951)
	(102,113,860)	(10,021,913)
期末結餘	2,061,048,244	2,277,444,183
已發行單位數目	單位	單位
承前的已發行單位數目	22,895,001	22,830,001
期內已發行單位	-	150,000
期內已贖回單位	(1,100,000)	(135,000)
結轉的已發行單位數目	21,795,001	22,845,001

現金流量表

截至2023年1月31日止期間

ABF 香港創富債券指數基金

	2022年8月1日至 2023年1月31日 港元	2021年8月1日至 2022年1月31日 港元
經營活動		
已收利息	12,190	521
已付管理費	(1,503,340)	(1,643,553)
已付受託人費用	(528,625)	(586,513)
已付交易費用	(11,476)	(10,308)
購買投資付款	(159,997,976)	(289,937,066)
出售投資所得款項(包括從投資獲得的票面利息)	268,249,780	297,528,785
已付其他經營開支	(569,242)	(749,210)
已收雜項收入	4,501	13,503
經營活動產生的現金淨額	105,655,812	4,616,159
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)	(101,024,110)	(13,712,737)
已付收益分派	(228,950)	(10,273,501)
融資活動所用的現金淨額	(101,253,060)	(8,644,463)
現金和現金等價物增加/(減少)淨額	4,402,752	(4,028,304)
期初現金和現金等價物	856,892	11,448,255
期末現金和現金等價物	5,259,644	7,419,951

投資報表

ABF 香港創富債券指數基金

於 2023 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)1.6%，2025年 2月16日	31,000,000	29,252,840	1.42	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	9,018,492	0.44
國家開發銀行(香港)2.85%，2024年 7月19日	85,000,000	82,956,600	4.02	中華人民共和國香港特別行政區政府 0.94%，2024年2月21日	25,000,000	24,313,048	1.18
		<u>112,209,440</u>	<u>5.44</u>	中華人民共和國香港特別行政區政府 1.25%，2027年6月29日	107,300,000	99,120,231	4.81
				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	8,343,101	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	65,000,000	53,018,381	2.57
				中華人民共和國香港特別行政區政府 1.68%，2026年1月21日	181,200,000	172,878,843	8.39
香港				中華人民共和國香港特別行政區政府 1.79%，2025年4月14日	49,000,000	47,207,595	2.29
香港金融管理局1.51%外匯基金票據， 2027年2月24日	25,800,000	24,154,682	1.17	中華人民共和國香港特別行政區政府 1.84%，2024年12月22日	13,000,000	12,581,212	0.61
香港金融管理局1.73%外匯基金票據， 2024年2月20日	10,100,000	9,904,274	0.48	中華人民共和國香港特別行政區政府 1.89%，2032年3月2日	80,500,000	72,943,207	3.54
香港金融管理局1.96%外匯基金票據， 2024年6月3日	6,850,000	6,701,108	0.33	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	6,411,470	0.31
香港金融管理局2.39%外匯基金票據， 2025年8月20日	30,000,000	29,204,685	1.42	中華人民共和國香港特別行政區政府 1.97%，2029年1月17日	80,000,000	75,259,528	3.65
香港金融管理局2.48%外匯基金票據， 2029年2月28日	12,500,000	12,089,004	0.59	中華人民共和國香港特別行政區政府 2.02%，2034年3月7日	52,200,000	46,338,457	2.25
香港金融管理局2.49%外匯基金票據， 2028年8月22日	5,000,000	4,853,316	0.24	中華人民共和國香港特別行政區政府 2.07%，2026年8月26日	50,500,000	48,485,171	2.35
香港金融管理局2.6%外匯基金票據， 2024年8月20日	14,000,000	13,780,901	0.67	中華人民共和國香港特別行政區政府 2.13%，2030年7月16日	93,100,000	87,282,377	4.24
香港按揭證券有限公司5%， 2024年10月25日	62,500,000	63,129,375	3.06	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	212,973,801	10.33
中華人民共和國香港特別行政區政府 0.31%，2023年11月22日	3,000,000	2,922,690	0.14	中華人民共和國香港特別行政區政府 2.24%，2029年8月27日	33,000,000	31,340,278	1.52
中華人民共和國香港特別行政區政府 0.36%，2024年4月15日	149,500,000	143,805,276	6.98	中華人民共和國香港特別行政區政府 2.95%，2025年2月24日	15,000,000	14,795,124	0.72
中華人民共和國香港特別行政區政府 0.51%，2023年10月23日	34,000,000	33,253,360	1.61	中華人民共和國香港特別行政區政府 3.3%，2042年5月26日	16,000,000	15,573,206	0.76
				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	3,998,674	0.19
				中華人民共和國香港特別行政區政府 3.74%，2038年1月12日	10,000,000	10,193,100	0.49
						<u>1,395,873,967</u>	<u>67.73</u>
				總上市投資		<u>1,508,083,407</u>	<u>73.17</u>

投資報表

ABF 香港創富債券指數基金

於 2023 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				香港鐵路有限公司 4.2% , 2024 年 9 月 30 日			
					13,000,000	12,993,595	0.63
開曼群島				市區重建局 2.15% , 2023 年 5 月 10 日			
MTR CORPORATION CI LTD 2.25% , 2024 年 12 月 28 日	22,000,000	21,222,859	1.03		30,000,000	29,876,402	1.45
MTR CORPORATION CI LTD 2.46% , 2032 年 9 月 20 日	60,000,000	51,426,042	2.49			405,854,782	19.69
		72,648,901	3.52	馬來西亞			
				馬來西亞進出口銀行 2.95% , 2023 年 3 月 12 日			
					15,000,000	14,993,752	0.73
						14,993,752	0.73
中國				南韓			
國家開發銀行 4.47% , 2026 年 1 月 14 日	2,000,000	2,010,646	0.10	韓國進出口銀行 0.9% , 2026 年 8 月 13 日			
		2,010,646	0.10		25,000,000	22,101,500	1.07
				韓國產業銀行 4.6% , 2024 年 1 月 18 日			
					20,000,000	20,000,000	0.97
香港						42,101,500	2.04
香港機場管理局 1.55% , 2027 年 10 月 30 日	45,000,000	40,183,034	1.95	非上市但有報價的總投資			
香港機場管理局 1.95% , 2027 年 6 月 16 日	20,000,000	18,344,458	0.89			537,609,581	26.08
香港機場管理局 2.3% , 2030 年 4 月 24 日	47,000,000	41,523,945	2.01	總投資			
香港機場管理局 2.8% , 2024 年 5 月 26 日	20,000,000	19,574,000	0.95			2,045,692,988	99.25
香港機場管理局 2.8% , 2024 年 6 月 6 日	20,000,000	19,601,216	0.95	其他資產淨值			
香港機場管理局 3.2% , 2027 年 8 月 16 日	20,000,000	19,304,496	0.94			15,355,256	0.75
香港按揭證券有限公司 0.65% , 2023 年 10 月 25 日	27,000,000	26,307,180	1.28	資產淨值總額			
香港按揭證券有限公司 0.8% , 2024 年 4 月 15 日	75,000,000	71,803,500	3.48			2,061,048,244	100.00
香港按揭證券有限公司 1.65% , 2025 年 2 月 17 日	15,000,000	14,233,500	0.69	總投資成本			
香港按揭證券有限公司 2.87% , 2024 年 5 月 28 日	30,000,000	29,383,800	1.42			2,198,026,888	
香港按揭證券有限公司 3.15% , 2049 年 3 月 19 日	30,000,000	23,005,334	1.12				
香港按揭證券有限公司 5% , 2023 年 11 月 16 日	18,000,000	18,062,820	0.88				
香港鐵路有限公司 3.25% , 2024 年 8 月 15 日	22,000,000	21,657,502	1.05				

投資組合變動表

ABF 香港創富債券指數基金

於 2023 年 1 月 31 日

	佔總資產淨值 百分比 (%) 2023 年 1 月 31 日	佔總資產淨值 百分比 (%) 2022 年 7 月 31 日
債務證券		
上市投資	73.17	76.43
非上市但有報價的投資	26.08	22.82
債務證券 (總計)	99.25	99.25
總投資	99.25	99.25
其他資產淨值	0.75	0.75
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	
2022年8月1日至2023年1月31日	96.31	90.13	
2022	93.03	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	
	2023年1月31日	2022年7月31日	2021年7月31日
	港元	港元	港元
資產淨值總額	2,061,048,244	2,197,178,821	2,343,231,393
每單位資產淨值	94.57	95.97	102.64

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2023年 1月31日止6個月	截至2022年 7月31日止12個月
ABF 香港創富債券指數基金	(1.40)% ^(a)	(6.02)% ^(a)
MarkitiBoxxABFHongKongIndex	(1.31)% ^(b)	(5.86)% ^(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
2023 年度中期收益分派	2023 年 1 月 30 日	2023 年 2 月 13 日	0.05	1,089,750
2022 年度末期收益分派	2022 年 7 月 28 日	2022 年 8 月 11 日	0.01	228,950
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

相關指數成分股披露

於**2023年1月31日**

本基金是一項旨在達致與Markiti Boxx 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2022年8月1日至2023年1月31日期間，Markiti Boxx ABF Hong Kong Index下跌1.31%，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1.40%。

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(於2022年10月10日辭任)
何慧芬
譚振邦

監察委員會委員

陳少平
陳家樂教授
林張灼華教授
馮殷諾

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