

# 沛富基金

## 二零二三年中期業績報告

二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日

## 目錄

	頁次
經理投資報告	2
簡明資產淨值報表(未經審核)	5
簡明綜合收入報表(未經審核)	6
基金單位持有人應佔資產淨值變動之簡明報表(未經審核)	7
簡明現金流量表(未經審核)	8
簡明財務報表附註(未經審核)	10
投資組合(未經審核)	22
組合持股量變動報表(未經審核)	42
相關指數成份股披露	42
證券借貸安排及持有的抵押品詳情(未經審核)	43
行政及管理層	66

## 經理投資報告

### 有關沛富基金

沛富基金(「基金」)為亞洲債券基金2(ABF2)的其中一隻基金，乃EMEAP(東亞及太平洋地區中央銀行行長會議)組織推動亞洲債券市場進一步發展的第二階段計劃。

基金為追蹤Markit iBoxx ABF泛亞洲指數(「相關指數」)的表現而設，主要投資於八個EMEAP市場中由官方、半官方機構及跨國金融機構所發行或保證的以當地貨幣結算的債券及其他債券；包括：中國、香港、印尼、馬來西亞、菲律賓、新加坡、南韓和泰國。

### 有關MARKIT IBOXX ABF泛亞洲指數

基金以Markit iBoxx ABF泛亞洲指數為投資基準。Markit iBoxx ABF泛亞洲指數由Markit Indices GmbH編製及公佈。Markit iBoxx ABF泛亞洲指數為中國、香港、印尼、馬來西亞、菲律賓、新加坡、南韓和泰國的官方、半官方機構及跨國金融機構所發行或保證的亞洲貨幣結算債券及其他債券的投資回報指標。

IHS Markit在二零二三年度全年亞洲指數回顧(2023 Asian Annual Index Review)中計算二零二三年iBoxx ABF指數中八個市場的比重，新比重於二零二三年十月三十一日起生效。相關指數過往及現有之市場比重為：

市場	現有比重* (%)	過往比重 (%)
中國	25.00	25.00
香港	8.26	8.07
印尼	8.47	8.37
馬來西亞	11.31	11.45
菲律賓	6.21	6.58
新加坡	16.16	16.07
南韓	15.32	15.01
泰國	9.27	9.45

\* 資料來源：Markit、道富環球投資管理(截至二零二三年十二月三十一日)。

上表所示現有比重為截至二零二三年十二月三十一日的數字。詳情請瀏覽[www.ihsmarkit.com](http://www.ihsmarkit.com)。

# 沛富基金

二零二三年中期業績報告

## 經理投資報告 (續)

### 表現報告

截至31.12.2023止期間	三個月	六個月	一年	三年	五年	十年	自成立後 年度化 <sup>(a)</sup>
沛富基金 <sup>(b)</sup>	6.88%	4.73%	5.37%	-2.11%	1.96%	1.87%	3.58%
Markit iBoxx ABF 泛亞洲指數 <sup>(c)</sup>	7.01%	4.95%	5.70%	-1.80%	2.41%	2.33%	4.14%

附註：

- (a) 表現開始日期為二零零五年六月二十九日，即基金單位首次發行當日。
- (b) 基金回報以美元按資產淨值計算（包括股息）。為期不足一年之表現回報未經年度化處理。
- (c) 基準回報率按總回報基準列示。基準回報率與基金不同，並不包括稅項的影響、本基金開支或本基金的交易成本。

### 投資組合及市場回顧

自成立以來，與4.14%之指數回報比較，基金年度化之總回報（包括股息）為3.58%（經扣除費用）。差額為-0.56%（約整後），其中-0.50%之金額主要是因為要達至指數基金之基準，無可避免地受到若干相關因素影響（相關因素指信託契約中允許之費用及開支及稅項）；其餘-0.06%是由於交易成本及管理基金所使用之抽樣方法所產生之追蹤差額。

按未對沖基準計算，Markit iBoxx ABF泛亞洲指數自成立以來之年度化表現為4.14%。有關表現乃受債券市場反彈（佔回報之3.44%）及亞洲貨幣之變動（佔回報之0.70%）所帶動。

### 投資組合策略

基金之投資目標為提供緊貼相關指數總回報之投資回報（扣除費用及開支前）。基金為達到此目標而採用被動式管理。

經理人採用代表性抽樣方式，透過一個能代表相關指數的多元化證券組合投資，配合指數的特徵及回報。要建立一個完全反映亞洲固定收入市場的廣泛市場指數並不可能，亦不符合成本效益，原因為許多債券的交易成本高昂，加上部分債券已因被其他長期投資者持有而難以買入。

## 經理投資報告 (續)

### 基金增長

於二零二三年七月至十二月期間，基金之總資產淨值上漲至35.07億美元，漲幅為4.6%。以發行在外之基金單位計算，基金於六個月期間上漲1.46%，年末時仍然發行在外之基金單位數目為31,800,594個基金單位。於截至二零二三年十二月三十一日止期間內，基金單位認購扣除贖回後之基金單位數目合共為458,240個基金單位。

### 金融衍生工具的風險

截至二零二三年十二月三十一日止期間，基金並無面臨任何金融衍生工具風險。

### 金融衍生工具的環球風險

金融衍生工具的環球風險乃採取承諾方法計量，為以下各項的總和：

- (a) 概無淨額結算或對沖安排的獨立金融衍生工具各自的風險絕對值；
- (b) 經作出淨額結算或對沖安排後的獨立金融衍生工具各自的淨風險絕對值；及
- (c) 根據以下所獲得並再作投資的現金抵押總和：
  - i) 場外金融衍生工具對手方風險的減少；及
  - ii) 有關證券借貸及購回交易的有效投資組合管理技巧。

### 其他資料

於截至二零二三年十二月三十一日止期間內，基金並無參與任何其他單位信託基金、互惠基金及集體投資計劃的買賣。於截至二零二三年十二月三十一日止期間內，基金亦無進行借貸。概無任何其他重大資料可對基金估值造成不利影響。

# 沛富基金

二零二三年中期業績報告

## 簡明資產淨值報表

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

		於 31.12.2023	於 30.06.2023	於 31.12.2022	於 30.06.2022
	附註	美元	美元	美元	美元
<b>資產</b>					
投資	6(f)	3,508,108,208	3,351,791,410	3,328,514,610	3,275,984,221
應收經紀賬款		32,749,071	43,527,156	12,591,953	40,663,577
應收利息	6(e)	3,022	3,204	888	20
其他應收款項		621,846	227,898	1,051,478	239,933
銀行現金	6(e)	12,436,907	16,369,085	25,189,311	11,886,219
<b>總資產</b>		<u>3,553,919,054</u>	<u>3,411,918,753</u>	<u>3,367,348,240</u>	<u>3,328,773,970</u>
<b>負債</b>					
應付經紀賬款		39,351,305	52,237,240	30,345,244	47,254,388
應付審計費用		118,600	82,546	19,059	65,154
應付信託人費用	6(d)	146,339	139,070	140,440	135,703
應付管理費	6(c)	631,427	651,960	602,701	629,478
應付指數特許權費		352,876	264,658	87,260	86,301
其他應付款項		6,087,031	5,924,619	6,130,614	6,313,848
<b>負債 (基金單位持有人應佔資產淨值除外)</b>		<u>46,687,578</u>	<u>59,300,093</u>	<u>37,325,318</u>	<u>54,484,872</u>
<b>基金單位持有人應佔資產淨值</b>	3	<u>3,507,231,476</u>	<u>3,352,618,660</u>	<u>3,330,022,922</u>	<u>3,274,289,098</u>
已發行基金單位數目	3	<u>31,800,594</u>	<u>31,342,354</u>	<u>30,870,064</u>	<u>30,447,894</u>
基金單位持有人每單位應佔資產淨值	3	<u>110.29</u>	<u>106.97</u>	<u>107.87</u>	<u>107.54</u>

第10至21頁的附註構成本財務報表一部分。

## 簡明綜合收入報表

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

	附註	01.07.2023 至31.12.2023 美元	01.07.2022 至31.12.2022 美元
<b>收入</b>			
銀行存款利息收入	6(e)	38,008	17,144
投資淨收益	4	164,285,354	67,977,529
外匯收益／(虧損)淨額		70,515	(268,534)
證券借貸收入		151,772	186,831
其他收入		769	913
<b>總投資收入</b>		<b>164,546,418</b>	<b>67,913,883</b>
<b>開支</b>			
管理費	6(c)	(1,897,304)	(1,803,983)
信託人費用	6(d)	(845,567)	(810,316)
指數特許權費		(176,438)	(176,438)
出版及印刷開支	6(i)	(8,932)	(15,513)
審計費		(36,054)	(36,450)
處理代理人費用		(7,860)	(8,105)
資產託管費及銀行手續費	6(i)	(2,228)	(2,208)
交易手續費	6(i)	(12,750)	(16,545)
法律及專業費用	6(i)	(116,045)	(77,394)
其他經營開支	6(i)	(6,233)	(6,301)
<b>總經營開支</b>		<b>(3,109,411)</b>	<b>(2,953,253)</b>
<b>經營溢利</b>		<b>161,437,007</b>	<b>64,960,630</b>
<b>融資成本</b>			
分派予基金單位持有人	8	(53,595,425)	(50,831,283)
利息開支	6(e)	(19,810)	(8,815)
		<b>(53,615,235)</b>	<b>(50,840,098)</b>
<b>分派後及除稅前溢利</b>		<b>107,821,772</b>	<b>14,120,532</b>
稅項	5	(2,432,353)	(2,982,029)
<b>分派及除稅後溢利／基金單位持有人 應佔來自營運的資產淨值增加</b>		<b>105,389,419</b>	<b>11,138,503</b>

第10至21頁的附註構成本財務報表一部分。

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 基金單位持有人應佔資產淨值變動之簡明報表

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

	01.07.2023 至31.12.2023 美元	01.07.2022 至31.12.2022 美元
期初結餘	3,352,618,660	3,274,289,098
發行基金單位	56,661,510	49,838,286
贖回基金單位	(7,438,113)	(5,242,965)
發行基金單位淨額	49,223,397	44,595,321
基金單位持有人應佔的資產淨值增加	105,389,419	11,138,503
期終結餘	<u>3,507,231,476</u>	<u>3,330,022,922</u>
<b>已發行基金單位數目</b>		
	01.07.2023 至31.12.2023 基金單位	01.07.2022 至31.12.2022 基金單位
期初已發行的基金單位	31,342,354	30,447,894
發行基金單位	528,240	472,170
贖回基金單位	(70,000)	(50,000)
期終已發行的基金單位	<u>31,800,594</u>	<u>30,870,064</u>

第10至21頁的附註構成本財務報表一部分。



## 簡明現金流量表

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

	01.07.2023 至31.12.2023 美元	01.07.2022 至31.12.2022 美元
<b>營運活動的現金流</b>		
基金單位持有人應佔的資產淨值增加 經調整：	105,389,419	11,138,503
銀行存款利息收入	(38,008)	(17,144)
利息開支	19,810	8,815
分派予基金單位持有人	53,595,425	50,831,283
稅項	2,432,353	2,982,029
外匯重估(收益)/虧損	(69,274)	700
	<hr/>	<hr/>
<b>營運資金變動前的經營溢利</b>	161,329,725	64,944,186
投資的淨增加額	(156,316,798)	(52,530,389)
應收經紀賬款的淨減少額	10,778,085	28,071,624
其他應收款項淨增加額	(393,948)	(811,545)
應付經紀賬款的淨減少額	(12,885,935)	(16,909,144)
應付賬款及應計開支的淨增加/(減少)額	133,564	(76,532)
	<hr/>	<hr/>
<b>營運所產生現金</b>	2,644,693	22,688,200
已收銀行存款利息收入	38,190	16,276
已付稅項	(2,292,497)	(3,155,907)
	<hr/>	<hr/>
<b>營運活動所產生淨現金</b>	390,386	19,548,569
	<hr style="border-top: 1px dashed black;"/>	<hr style="border-top: 1px dashed black;"/>
<b>融資活動的現金流</b>		
分派予基金單位持有人	(53,595,425)	(50,831,283)
已付利息開支	(19,810)	(8,815)
發行基金單位	56,661,510	49,838,286
贖回基金單位	(7,438,113)	(5,242,965)
	<hr/>	<hr/>
<b>融資活動所用的淨現金</b>	(4,391,838)	(6,244,777)
	<hr style="border-top: 1px dashed black;"/>	<hr style="border-top: 1px dashed black;"/>
現金及現金等價物的淨(減少)/增加額	(4,001,452)	13,303,792
貨幣匯兌的影響	69,274	(700)
期初現金及現金等價物	16,369,085	11,886,219
	<hr/>	<hr/>
<b>期終現金及現金等價物</b>	12,436,907	25,189,311
	<hr style="border-top: 3px double black;"/>	<hr style="border-top: 3px double black;"/>
<b>現金及現金等價物的結餘分析：</b>		
銀行現金	12,436,907	25,189,311
	<hr style="border-top: 3px double black;"/>	<hr style="border-top: 3px double black;"/>

第10至21頁的附註構成本財務報表一部分。

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 簡明現金流量表(續)

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

融資活動所產生負債之對賬

	01.07.2023 至31.12.2023 美元	01.07.2022 至31.12.2022 美元
於七月一日	-	-
融資現金流的變動		
已付贖回基金	(7,438,113)	(5,242,965)
其他變動		
贖回基金單位	<u>7,438,113</u>	<u>5,242,965</u>
於十二月三十一日	<u>-</u>	<u>-</u>

第10至21頁的附註構成本財務報表一部分。

## 簡明財務報表附註

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

### 1. 一般資料

沛富基金(「**基金**」)乃根據新加坡二零零一年《證券及期貨法》第286條以及香港法例第571章《證券及期貨條例》第104條獲認可的新加坡單位信託。基金按照道富環球投資管理新加坡有限公司與滙豐機構信託服務(新加坡)有限公司於二零零五年六月二十一日訂立的信託契約(「**信託契約**」)而成立。信託契約根據於二零零六年六月二十八日訂立的修訂及重列契約、於二零零七年六月二十八日訂立的第二修訂及重列契約、於二零零八年六月二十七日訂立的補充契約、於二零一一年六月二十四日訂立的第三修訂及重列契約、於二零一八年七月十日訂立的第四修訂及重列契約、於二零一九年十二月二十七日訂立的第五修訂及重列契約及於二零二零年八月十七日訂立的第六修訂及重列契約而作出修訂及重列。信託契約及所有補充契約受新加坡法律管轄。基金同時於香港聯合交易所有限公司及東京證券交易所上市。基金於二零零五年六月二十九日開始運作。

基金的投資目標旨在於扣除費用及開支前，提供緊貼Markit iBoxx ABF泛亞洲指數(「**相關指數**」)總回報的投資回報。相關指數由Markit Indices GmbH(「**指數提供者**」)釐定及編製。相關指數為官方、半官方機構或跨國金融機構所發行或保證，以人民幣、港元、印尼盾、韓圓、馬幣、菲律賓披索、新加坡元或泰銖(各為「**亞洲貨幣**」)結算的債券的投資回報指標。每一亞洲貨幣結算債券均由指數提供者指定，並為相關指數當時的成份證券。

### 2. 編製基準及會計政策

本未經審核簡明中期財務報表(「**中期財務報表**」)已根據國際會計準則(「**國際會計準則**」)第34號「中期財務報告」編製。本中期財務報表已按歷史成本慣例法編製，並已就投資重估作出修訂。編製本中期財務報表所用之會計政策及計算方法與截至二零二三年六月三十日止年度之年報財務報表所用者一致。

#### 列報及比較資料的變動

當簡明財務報表內的列報及分類項目修訂時，比較數額已作更新，以符合本年度的列報或分類方式。

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 簡明財務報表附註(續)

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

#### 3. 基金單位持有人應佔資產淨值及已發行基金單位數目

##### 已發行基金單位數目

	01.07.2023至 31.12.2023 基金單位	01.01.2023至 30.06.2023 基金單位	01.07.2022至 31.12.2022 基金單位
期初已發行的基金單位	31,342,354	30,870,064	30,447,894
發行基金單位	528,240	482,290	472,170
贖回基金單位	<u>(70,000)</u>	<u>(10,000)</u>	<u>(50,000)</u>
期終已發行的基金單位	<u>31,800,594</u>	<u>31,342,354</u>	<u>30,870,064</u>
	美元	美元	美元
基金單位持有人應佔資產淨值	<u>3,507,231,476</u>	<u>3,352,618,660</u>	<u>3,330,022,922</u>
基金單位持有人應佔資產淨值 (每單位)	<u>110.29</u>	<u>106.97</u>	<u>107.87</u>
各新增基金單位的資產淨值 (1個新增基金單位相等於 10,000個單位)	<u>1,102,882</u>	<u>1,069,677</u>	<u>1,078,722</u>

#### 4. 投資淨收益

	01.07.2023至 31.12.2023 美元	01.07.2022至 31.12.2022 美元
投資未變現價值收益變動	137,052,975	75,529,664
出售投資時實現的收益/(虧損)	<u>27,232,379</u>	<u>(7,552,135)</u>
	<u>164,285,354</u>	<u>67,977,529</u>

## 簡明財務報表附註(續)

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

### 5. 稅項

基金於截至二零二三年十二月三十一日止期間產生的稅項為2,432,353美元(截至二零二二年十二月三十一日止六個月:2,982,029美元)。該金額包括來自中國、菲律賓及印尼的預扣稅合共2,424,189美元,以及有關繳付新加坡企業所得稅及其他稅項的餘下部分8,164美元。

於二零一八年十一月七日,中國財政部(「**財政部**」)及中國國家稅務總局(「**國稅局**」)聯合發佈財稅[2018]108號文(「**108號文**」),該108號文規定境外機構投資者暫時獲豁免就二零一八年十一月七日至二零二一年十一月六日期間收到的中國非官方債券利息收入繳付中國預扣稅及增值稅(「**增值稅**」)。此外,財政部及國稅局於二零二一年十一月二十二日聯合發佈公告[2021]34號(「**34號文**」),規定108號文批准的暫時稅務豁免現已延長至二零二五年十二月三十一日。

根據日期為二零二零年二月二十八日的致基金單位持有人函件,經理人及信託人已決定更改基金的稅項撥備政策,並停止就二零一八年十一月七日至二零二一年十一月六日期間從中國非官方債券所收取的利息收入作出中國預扣稅及增值稅撥備。在發佈34號文後,有關豁免將延長至二零二五年十二月三十一日。經理人將保留就二零一八年十一月七日前所收取的中國非官方債券利息收入作出的中國預扣稅撥備,直至知悉相關條例的最近發展及詮釋為止。

於二零二三年十二月三十一日,基金就截至二零一八年十一月六日中國非官方債券利息收入作出10%的預扣所得稅撥備3,758,259美元(相等於人民幣27,285,160元)(於二零二三年六月三十日:3,676,262美元,相等於人民幣27,285,160元)。撥備變動是由於換算產生的匯兌差額所致。該金額於資產淨值報表入賬為「其他應付款項」。此外,根據第36號通知,來自政府債券及地方政府債券的所收利息獲豁免繳納增值稅。根據108號文,境外機構投資者暫時獲豁免就二零一八年十一月七日至二零二一年十一月六日期間收取的中國非官方債券利息收入繳付增值稅,而根據34號文,上述暫時豁免已延長至二零二五年十二月三十一日。然而,現行增值稅規例並無指定豁免境外機構投資者於二零一六年五月一日至二零一八年十一月六日期間的所收利息的增值稅。因此,於二零一六年五月一日至二零一八年十一月六日期間從非官方債券(包括企業債券)賺取的利息收入仍應繳納6%增值稅。

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 簡明財務報表附註(續)

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

#### 5. 稅項(續)

就增值稅相關稅項(包括城市建設維護稅、教育附加稅及地方教育附加稅)而言，根據《城市建設維護稅法》及財政部和國稅局聯合發佈的公告[2021]28號，自二零二一年九月一日起不再就境外公司在中國向中國企業提供服務及銷售無形資產所繳付的增值稅徵收城市建設維護稅、教育附加稅及地方教育附加稅。根據我們對現行做法的理解，上海稅務機關目前不強制從外國投資者賺取的利息收入所繳付的增值稅中徵收此等稅項。有鑑於此，經理人已評估中國稅務機關就增值稅相關稅項提出質疑的風險並不高，因此已於二零二二年一月二十四日決定撤銷就二零一六年五月一日至二零一八年十一月六日期間產生的利息收入所作出的0.72%增值稅相關稅項撥備。

根據日期為二零二零年二月二十八日的致基金單位持有人函件，經理人已考慮到信託的現行中國稅務撥備政策，並已向獨立及專業稅務顧問諮詢。於二零二三年十二月三十一日，就二零一六年五月一日至二零一八年十一月六日期間基金於中國非官方債券的投資所收取的債券利息收入作出的增值稅撥備為1,012,250美元(相等於人民幣7,348,992元)(於二零二三年六月三十日：990,165美元，相等於人民幣7,348,992元)。撥備變動是由於換算產生的匯兌差額所致。該金額計入資產淨值報表內的「其他應付款項」。



## 簡明財務報表附註(續)

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

### 6. 與關連方(包括經理人、信託人及其關連人士)進行的交易及結餘

經理人或信託人的關連人士指按香港證券及期貨事務監察委員會制定的單位信託及互惠基金守則(「證監會守則」)所界定的關連人士。基金的經理人及信託人分別為道富環球投資管理新加坡有限公司及滙豐機構信託服務(新加坡)有限公司。道富環球投資管理新加坡有限公司為美國道富公司的附屬公司。滙豐機構信託服務(新加坡)有限公司為HSBC Holdings Plc旗下附屬公司。基金與關連方(包括經理人、信託人及其關連人士)於期內訂立的所有交易，均於日常業務過程中按一般商業條款進行。據經理人及信託人所知，除下文披露者外，基金概無與經理人或信託人的關連人士進行其他交易。

#### (a) 與經理人及信託人的關連人士進行的外匯交易

於截至二零二三年十二月三十一日止期間內，經理人透過其聯屬人士State Street Global Markets, LLC及透過信託人的聯屬人士香港上海滙豐銀行有限公司及香港上海滙豐銀行有限公司悉尼分行作基金投資結算，於外匯交易中進行的交易總值為261,157,205美元(二零二二年十二月三十一日止六個月：394,256,542美元)，佔截至二零二三年十二月三十一日止期間內基金外匯交易價值的100%(二零二二年十二月三十一日止六個月：100%)。

公司名稱	外匯交易總值 美元	佔外匯交易 總值百分比 %
截至31.12.2023止期間		
State Street Global Markets, LLC	22,806,133	8.74
香港上海滙豐銀行有限公司	49,683,471	19.02
香港上海滙豐銀行有限公司悉尼分行	188,667,601	72.24
截至31.12.2022止期間		
State Street Global Markets, LLC	27,750,000	7.04
香港上海滙豐銀行有限公司	70,650,000	17.92
香港上海滙豐銀行有限公司悉尼分行	295,856,542	75.04

## 簡明財務報表附註(續)

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

### 6. 與關連方(包括經理人、信託人及其關連人士)進行的交易及結餘(續)

#### (a) 與經理人及信託人的關連人士進行的外匯交易(續)

於截至二零二三年及二零二二年十二月三十一日止期間內，上述所列經理人及信託人的關連人士已按正常商業條款在日常業務過程中與基金訂立外匯交易正常買賣差價。於截至二零二三年及二零二二年十二月三十一日止期間內，並無向經理人或信託人的關連人士支付任何直接佣金。

#### (b) 持有單位

於二零二三年十二月三十一日，經理人的董事及高級職員並無持有基金的任何基金單位(二零二二年：無)。香港上海滙豐銀行有限公司(信託人的關連方)作為代表其客戶的代名人持有30,440,713個基金單位(二零二三年六月三十日：29,984,000個基金單位)，佔基金資產淨值的95.72%(二零二二年：95.66%)。

#### (c) 管理費

基金向經理人支付一筆管理費\*，管理費按日累計，並於每月月底支付，以基金的每日平均資產淨值而釐定，有關計算年率如下：

首10億美元	0.13%
接續的2億5千萬美元	0.12%
接續的2億5千萬美元	0.11%
其後	0.10%

\* 此項費用可透過向單位持有人發出三個月的書面通知而增加至最高每年0.25%。

#### (d) 信託人費用

基金向信託人支付信託人費用\*，信託人費用按日累計，並於每月月底支付，以基金每日平均資產淨值計算，每年為0.05%。

\* 此項費用可透過向單位持有人發出三個月的書面通知而增加至最高每年0.15%。



簡明財務報表附註(續)

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

6. 與關連方(包括經理人、信託人及其關連人士)進行的交易及結餘(續)

(e) 銀行結餘及應收利息

信託人的關連方(即香港上海滙豐銀行有限公司)持有基金的銀行結餘及應收利息。該等交易詳情如下：

	於 31.12.2023 美元	於 30.06.2023 美元
銀行結餘	12,436,907	16,369,085
應收利息	3,022	-

於截至二零二三年及二零二二年十二月三十一日止期間內，以下於綜合收入報表呈列有關基金銀行結餘的收入及開支乃自信託人的關連方(即香港上海滙豐銀行有限公司)賺取／收取／向其支付。

	截至31.12.2023 止期間 美元	截至31.12.2022 止期間 美元
利息收入	38,008	17,144
利息開支	19,810	8,815

(f) 投資

於截至二零二三年十二月三十一日及二零二三年六月三十日止期間／年度內，基金的投資在信託人的關連方(即滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司)。該等投資詳情如下：

	於31.12.2023 美元	於30.06.2023 美元
投資	3,508,108,208	3,351,791,410

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 簡明財務報表附註(續)

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

#### 6. 與關連方(包括經理人、信託人及其關連人士)進行的交易及結餘(續)

##### (g) 證券借貸安排

截至二零二三年及二零二二年十二月三十一日止期間，基金與信託人的關連方(即英國滙豐銀行有限公司)(作為證券借貸代理)訂立證券借貸安排。該等交易詳情載列如下：

	截至31.12.2023 止期間 美元	截至31.12.2022 止期間 美元
通過英國滙豐銀行有限公司的總證券借貸交易	305,916,730	218,936,019

於期末／年末持有的抵押品詳情載列如下：

	於 31.12.2023 美元	於 30.06.2023 美元
英國滙豐銀行有限公司在獨立賬戶持有的抵押品	108,797,707	353,097,547

簡明財務報表附註(續)

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

6. 與關連方(包括經理人、信託人及其關連人士)進行的交易及結餘(續)

(h) 與經理人及信託人的關連人士進行的債券交易

- (i) 於截至二零二三年及二零二二年十二月三十一日止期間，基金透過信託人的聯屬人士(作為買方或賣方)進行的債券交易如下：

公司名稱	購買交易總值 美元	出售交易總值 美元
截至31.12.2023止期間		
滙豐銀行(中國)有限公司	12,222,330	1,364,699
香港上海滙豐銀行有限公司	633,596	-
截至31.12.2022止期間		
滙豐銀行(中國)有限公司	17,613,781	2,917,324
香港上海滙豐銀行有限公司	2,178,832	-

簡明財務報表附註(續)

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

6. 與關連方(包括經理人、信託人及其關連人士)進行的交易及結餘(續)

(h) 與經理人及信託人的關連人士進行的債券交易(續)

(ii) 於截至二零二三年及二零二二年十二月三十一日止期間，基金透過信託人的聯屬人士(作為交付或接收代理)進行的債券交易如下：

公司名稱	交易總值	交易總值
	31.12.2023 美元	31.12.2022 美元
滙豐銀行(中國)有限公司	13,587,029	20,531,105
HSBC Bank Malaysia Berhad	1,888,510	11,159,264
PT Bank HSBC Indonesia	12,991,685	16,827,480
香港上海滙豐銀行有限公司	43,935,324	102,402,845
香港上海滙豐銀行有限公司曼谷分行	29,524,699	22,520,385
香港上海滙豐銀行有限公司首爾分行	24,941,116	33,889,760
滙豐銀行(新加坡)有限公司	33,850,779	35,206,961
香港上海滙豐銀行有限公司菲律賓分行	3,102,292	5,811,782

## 簡明財務報表附註(續)

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

### 6. 與關連方(包括經理人、信託人及其關連人士)進行的交易及結餘(續)

#### (i) 向信託人或經理人及其關連人士支付的其他相關款項

- (i) 於截至二零二三年及二零二二年十二月三十一日止期間，除向信託人或其關連人士支付的信託人費用外，向信託人或其關連人士支付的其他相關款項如下：

	01.07.2023 至31.12.2023	01.07.2022 至31.12.2022
	美元	美元
出版及印刷開支	-	108
資產託管費及銀行手續費	614	559
交易手續費*	12,750	16,545
法律及專業費用	1,013	3,988
其他經營開支	6,233	6,301

\* 交易手續費於購買或出售投資時收取。

- (ii) 於截至二零二三年及二零二二年十二月三十一日止期間，除向經理人支付的管理費外，概無向經理人或其關連人士支付其他相關款項。

### 7. 非金錢利益安排

經理人可經由或透過其他人士之代理人就基金戶口進行交易，惟任何有關交易均須符合「最佳執行」之標準，而其他人士之代理人與經理人或其任何關連人士作出安排，將根據該安排不時向經理人或其任何關連人士提供商品、服務或其他利益或促使經理人或其任何關連人士取得商品、服務或其他利益(例如研究及諮詢服務、電腦硬件連帶特設軟件或研究服務及表現量度服務)，其提供之性質旨在合理預期可使基金整體獲益，並可為改善基金之表現作出貢獻。為釋疑問，該等商品及服務可能並不包括旅遊、住宿、娛樂、一般行政商品或服務、一般辦公室設備或寫字樓、會籍費用、僱員薪金或直接金錢款項。

於截至二零二三年十二月三十一日及二零二二年十二月三十一日止期間，經理人並無就基金戶口的有關交易收取任何非金錢利益。

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 簡明財務報表附註(續)

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

#### 8. 分派

	01.07.2023 至31.12.2023 美元	01.07.2022 至31.12.2022 美元
期終分派		
— 於二零二三年八月三日已就31,342,354個 基金單位支付每基金單位1.71美元	53,595,425	—
— 於二零二二年八月三日已就30,437,894個 基金單位支付每基金單位1.67美元	—	50,831,283

#### 9. 補充比率

	01.01.2023至 31.12.2023止期間	01.01.2022至 31.12.2022止期間
支出比率 <sup>(1)</sup>	0.18%	0.18%
營業額比率 <sup>(2)</sup>	9.76%	15.45%

附註：

- 1 支出比率是按新加坡投資管理協會(「新加坡投資管理協會」)釐定的指引計算。期末的支出比率基於二零二三年一月一日至二零二三年十二月三十一日止期間的經營開支總額6,238,354美元(二零二二年一月一日至二零二二年十二月三十一日止期間：6,051,402美元)除以二零二三年一月一日至二零二三年十二月三十一日止期間的平均資產淨值3,378,516,994美元(二零二二年一月一日至二零二二年十二月三十一日止期間：3,352,498,559美元)計算。經營開支總額不包括(如適用)經紀佣金及其他交易成本、業績表現費、利息支出、向單位持有人作出之分派、外匯收益／虧損、購買或銷售其他基金所產生的首次認購費及贖回費、於源頭已扣除的稅項或因所得收入而產生的稅項。基金並無支付任何業績表現費。平均資產淨值乃根據每日結餘而得出。
- 2 組合營業額比率乃根據集體投資計劃守則所載列的公式計算。組合營業額比率按購買或銷售總額較低者，即相關投資的銷售額327,192,629美元(二零二二年：銷售額496,519,190美元)除以每日平均資產淨值3,353,658,223美元(二零二二年：3,213,305,116美元)計算。為符合新加坡註冊會計師協會頒佈的建議會計實務準則第七號「單位信託基金的匯報框架」(「建議會計實務準則第七號」)的建議，本期間的購買或銷售總額並不包括經紀佣金及其他交易成本。

#### 10. 資產淨值報表日期後續事項

本期間結束後，於二零二四年一月十二日，基金宣佈每個基金單位派息1.71美元。有關股息已於二零二四年二月一日派付。於二零二三年十二月三十一日，基金單位持有人應佔資產淨值並無計入上述應付股息。

## 投資組合

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

### 基本 – 按地理位置劃分

上市債券	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>中國(25.50%)</b>			
AGRICUL 4.39% 08SEP2027 (INTERBANK)	70,000,000	10,675,030	0.30
AGRICUL DEV 2.27% 08JUN2025 (INTERBANK)	30,000,000	4,283,176	0.12
AGRICUL DEV 2.57% 13SEP2028 (INTERBANK)	25,000,000	3,557,196	0.10
AGRICUL DEV 3.06% 06JUN2032 (INTERBANK)	90,000,000	13,202,419	0.38
AGRICUL DEV BANK CHINA 2.46% 27JUL2025 (INTERBANK)	10,000,000	1,428,605	0.04
AGRICUL DEV BANK CHINA 2.5% 24AUG2027 (INTERBANK)	20,000,000	2,850,963	0.08
AGRICUL DEV BANK CHINA 2.5% 24MAR2025 (INTERBANK)	10,000,000	1,440,819	0.04
AGRICUL DEV BANK CHINA 2.58% 23MAR2025 (INTERBANK)	20,000,000	2,886,261	0.08
AGRICUL DEV BANK CHINA 2.6% 01DEC2025 (INTERBANK)	20,000,000	2,842,267	0.08
AGRICUL DEV BANK CHINA 2.61% 09MAR2025 (INTERBANK)	30,000,000	4,335,596	0.12
AGRICUL DEV BANK CHINA 2.74% 23FEB2027 (INTERBANK)	60,000,000	8,742,562	0.25
AGRICUL DEV BANK CHINA 2.91% 21FEB2029 (INTERBANK)	30,000,000	4,402,485	0.13
AGRICUL DEV BANK CHINA 2.99% 11AUG2026 (INTERBANK)	10,000,000	1,448,744	0.04
AGRICUL DEV BANK CHINA 3.1% 27FEB2033 (INTERBANK)	5,000,000	742,527	0.02
AGRICUL DEV BANK CHINA 3.3% 05NOV2031 (INTERBANK)	30,000,000	4,418,090	0.13
AGRICUL DEV BANK CHINA 3.75% 25JAN2029 (INTERBANK)	140,000,000	21,520,226	0.61
CENTRAL HUIJIN INVESTMENT 3.71% 18SEP2027 (INTERBANK)	30,000,000	4,415,763	0.13
CENTRAL HUIJIN INVESTMENT 4.05% 30AUG2030 (INTERBANK)	10,000,000	1,521,081	0.04
CHINA (GOVT OF) 1.99% 09APR2025 (INTERBANK)	25,000,000	3,576,794	0.10
CHINA (GOVT OF) 2% 15JUN2025 (INTERBANK)	35,000,000	4,990,089	0.14
CHINA (GOVT OF) 2.18% 15AUG2026 (INTERBANK)	40,000,000	5,701,655	0.16
CHINA (GOVT OF) 2.18% 25AUG2025 (INTERBANK)	55,000,000	7,837,959	0.22
CHINA (GOVT OF) 2.22% 25SEP2025 (INTERBANK)	30,000,000	4,271,123	0.12
CHINA (GOVT OF) 2.24% 25MAY2025 (INTERBANK)	30,000,000	4,302,095	0.12
CHINA (GOVT OF) 2.28% 25NOV2025 (INTERBANK)	80,000,000	11,363,689	0.32
CHINA (GOVT OF) 2.3% 15MAY2026 (INTERBANK)	40,000,000	5,754,914	0.16
CHINA (GOVT OF) 2.33% 15DEC2025 (INTERBANK)	25,000,000	3,535,552	0.10
CHINA (GOVT OF) 2.35% 15MAR2025 (INTERBANK)	45,000,000	6,492,003	0.19
CHINA (GOVT OF) 2.37% 20JAN2027 (INTERBANK)	50,000,000	7,260,015	0.21
CHINA (GOVT OF) 2.39% 15NOV2026 (INTERBANK)	20,000,000	2,851,091	0.08
CHINA (GOVT OF) 2.4% 15JUL2028 (INTERBANK)	40,000,000	5,735,297	0.16
CHINA (GOVT OF) 2.44% 15OCT2027 (INTERBANK)	40,000,000	5,722,320	0.16
CHINA (GOVT OF) 2.46% 15FEB2026 (INTERBANK)	35,000,000	5,085,960	0.15
CHINA (GOVT OF) 2.48% 15APR2027 (INTERBANK)	60,000,000	8,634,886	0.25
CHINA (GOVT OF) 2.48% 25SEP2028 (INTERBANK)	20,000,000	2,862,184	0.08



## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

#### 基本 – 按地理位置劃分 (續)

上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>中國(25.50%) (續)</b>			
CHINA (GOVT OF) 2.5% 25JUL2027 (INTERBANK)	55,000,000	7,873,558	0.22
CHINA (GOVT OF) 2.52% 25AUG2033 (INTERBANK)	50,000,000	7,081,347	0.20
CHINA (GOVT OF) 2.54% 25DEC2030 (INTERBANK)	25,000,000	3,524,188	0.10
CHINA (GOVT OF) 2.55% 15OCT2028 (INTERBANK)	20,000,000	2,853,968	0.08
CHINA (GOVT OF) 2.6% 01SEP2032 (INTERBANK)	40,000,000	5,706,554	0.16
CHINA (GOVT OF) 2.6% 15SEP2030 (INTERBANK)	20,000,000	2,861,822	0.08
CHINA (GOVT OF) 2.62% 15APR2028 (INTERBANK)	25,000,000	3,645,907	0.10
CHINA (GOVT OF) 2.62% 25JUN2030 (INTERBANK)	30,000,000	4,324,773	0.12
CHINA (GOVT OF) 2.62% 25SEP2029 (INTERBANK)	50,000,000	7,176,273	0.21
CHINA (GOVT OF) 2.64% 15JAN2033 (INTERBANK)	30,000,000	4,408,553	0.13
CHINA (GOVT OF) 2.67% 25MAY2033 (INTERBANK)	60,000,000	8,553,794	0.24
CHINA (GOVT OF) 2.67% 25NOV2033 (INTERBANK)	55,000,000	7,846,729	0.22
CHINA (GOVT OF) 2.68% 21MAY2030 (INTERBANK)	50,000,000	7,131,414	0.20
CHINA (GOVT OF) 2.69% 12AUG2026 (INTERBANK)	60,000,000	8,679,229	0.25
CHINA (GOVT OF) 2.69% 15AUG2032 (INTERBANK)	50,000,000	7,192,495	0.21
CHINA (GOVT OF) 2.75% 15JUN2029 (INTERBANK)	50,000,000	7,287,242	0.21
CHINA (GOVT OF) 2.76% 15MAY2032 (INTERBANK)	50,000,000	7,183,187	0.21
CHINA (GOVT OF) 2.77% 24JUN2030 (INTERBANK)	80,000,000	11,437,233	0.33
CHINA (GOVT OF) 2.79% 15DEC2029 (SHANGHAI)	20,000,000	2,871,137	0.08
CHINA (GOVT OF) 2.8% 15NOV2032 (INTERBANK)	40,000,000	5,765,710	0.16
CHINA (GOVT OF) 2.8% 24MAR2029 (INTERBANK)	35,000,000	5,148,738	0.15
CHINA (GOVT OF) 2.8% 25MAR2030 (INTERBANK)	30,000,000	4,403,880	0.13
CHINA (GOVT OF) 2.86% 16JUL2030 (INTERBANK)	20,000,000	2,922,542	0.08
CHINA (GOVT OF) 2.88% 25FEB2033 (INTERBANK)	50,000,000	7,300,132	0.21
CHINA (GOVT OF) 2.89% 18NOV2031 (INTERBANK)	45,000,000	6,523,299	0.19
CHINA (GOVT OF) 3% 15OCT2053 (INTERBANK)	20,000,000	2,929,882	0.08
CHINA (GOVT OF) 3.02% 27MAY2031 (INTERBANK)	55,000,000	8,038,773	0.23
CHINA (GOVT OF) 3.03% 11MAR2026 (INTERBANK)	60,000,000	8,846,817	0.25
CHINA (GOVT OF) 3.12% 05DEC2026 (INTERBANK)	55,000,000	7,993,300	0.23
CHINA (GOVT OF) 3.12% 25OCT2052 (INTERBANK)	19,000,000	2,819,901	0.08
CHINA (GOVT OF) 3.13% 21NOV2029 (INTERBANK)	55,000,000	8,058,504	0.23
CHINA (GOVT OF) 3.19% 15APR2053 (INTERBANK)	25,000,000	3,770,512	0.11
CHINA (GOVT OF) 3.25% 06JUN2026 (INTERBANK)	50,000,000	7,378,155	0.21
CHINA (GOVT OF) 3.27% 19NOV2030 (INTERBANK)	70,000,000	10,391,245	0.30
CHINA (GOVT OF) 3.28% 03DEC2027 (INTERBANK)	36,000,000	5,294,971	0.15
CHINA (GOVT OF) 3.29% 23MAY2029 (INTERBANK)	60,000,000	8,880,209	0.25



投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>中國(25.50%) (續)</b>			
CHINA (GOVT OF) 3.32% 15APR2052 (INTERBANK)	30,000,000	4,610,051	0.13
CHINA (GOVT OF) 3.39% 16MAR2050 (INTERBANK)	50,000,000	7,747,268	0.22
CHINA (GOVT OF) 3.51% 16JUL2025 (INTERBANK)	20,000,000	2,930,309	0.08
CHINA (GOVT OF) 3.52% 25APR2046 (INTERBANK)	20,000,000	3,126,911	0.09
CHINA (GOVT OF) 3.53% 18OCT2051 (INTERBANK)	15,000,000	2,383,879	0.07
CHINA (GOVT OF) 3.54% 16AUG2028 (INTERBANK)	25,000,000	3,766,038	0.11
CHINA (GOVT OF) 3.64% 09APR25 (INTERBANK)	50,000,000	7,255,209	0.21
CHINA (GOVT OF) 3.7% 23MAY2066 (INTERBANK)	20,000,000	3,363,313	0.10
CHINA (GOVT OF) 3.72% 12APR2051 (INTERBANK)	54,000,000	8,843,782	0.25
CHINA (GOVT OF) 3.77% 20FEB2047 (INTERBANK)	15,000,000	2,453,894	0.07
CHINA (GOVT OF) 3.82% 02SEP2030	20,000,000	3,086,565	0.09
CHINA (GOVT OF) 3.86% 22JUL2049 (INTERBANK)	70,000,000	11,734,394	0.34
CHINA (GOVT OF) 3.91% 23OCT2038	20,000,000	3,277,513	0.09
CHINA (GOVT OF) 3.96% 29JUL2040	30,000,000	5,035,427	0.14
CHINA (GOVT OF) 4% 24JUN2069 (INTERBANK)	90,000,000	16,103,006	0.46
CHINA (GOVT OF) 4% 27AUG2029	30,000,000	4,643,140	0.13
CHINA (GOVT OF) 4.08% 01MAR2040	15,000,000	2,538,171	0.07
CHINA (GOVT OF) 4.23% 09DEC2040	20,000,000	3,427,357	0.10
CHINA (GOVT OF) 4.31% 24FEB2041	20,000,000	3,498,621	0.10
CHINA (GOVT OF) 4.35% 15NOV2062	40,000,000	7,548,319	0.22
CHINA (GOVT OF) 4.5% 08MAY2038	20,000,000	3,464,143	0.10
CHINA (GOVT OF) 4.5% 23JUN2041 (INTERBANK)	20,000,000	3,541,523	0.10
CHINA (GOVT) 3.81% 14SEP2050 (INTERBANK)	50,000,000	8,312,918	0.24
CHINA (PEOPLE'S REPUBLIC OF) 2.75% 17FEB2032 (INTERBANK)	55,000,000	7,947,268	0.23
CHINA (REP OF) 2.9% 5MAY2026 (INTERBANK)	70,000,000	10,107,148	0.29
CHINA DEVELOPMENT BANK 1.6% 16FEB2025	14,000,000	1,746,144	0.05
CHINA DEVELOPMENT BANK 2.28% 26SEP2026 (INTERBANK)	10,000,000	1,412,717	0.04
CHINA DEVELOPMENT BANK 2.5% 01APR2025 (INTERBANK)	40,000,000	5,764,734	0.16
CHINA DEVELOPMENT BANK 2.59% 17MAR2025 (INTERBANK)	20,000,000	2,890,041	0.08
CHINA DEVELOPMENT BANK 2.65% 03MAR2026 (INTERBANK)	10,000,000	1,450,470	0.04
CHINA DEVELOPMENT BANK 2.85% 19JUL2024	110,000,000	14,110,991	0.40
CHINA DEVELOPMENT BANK 3.12% 13SEP2031 (INTERBANK)	50,000,000	7,308,608	0.21
CHINA DEVELOPMENT BANK 3.18% 05APR2026	80,000,000	11,763,447	0.34
CHINA DEVELOPMENT BANK 3.48% 08JAN2029 (INTERBANK)	75,000,000	11,392,389	0.33

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

#### 基本 – 按地理位置劃分 (續)

上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>中國(25.50%) (續)</b>			
CHINA DEVELOPMENT BANK 3.65% 21MAY2029 (INTERBANK)	60,000,000	9,098,508	0.26
CHINA DEVELOPMENT BANK 3.66% 01MAR2031	70,000,000	10,783,025	0.31
CHINA DEVELOPMENT BANK 3.74% 10SEP2025	80,000,000	11,684,976	0.33
CHINA DEVELOPMENT BANK 3.8% 30OCT2036	10,000,000	1,578,171	0.05
CHINA DEVELOPMENT BANK 4.04% 06JUL2028 (INTERBANK)	70,000,000	10,706,563	0.31
CHINA DEVELOPMENT BANK 4.04% 10APR2027 (INTERBANK)	30,000,000	4,573,032	0.13
CHINA DEVELOPMENT BANK 4.1% 30AUG2025	28,000,000	4,120,009	0.12
CHINA DEVELOPMENT BANK 4.3% 17MAR2030	30,000,000	4,674,896	0.13
CHINA DEVELOPMENT BANK 4.47% 14JAN2026	19,000,000	2,473,456	0.07
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85% 28JAN2026	70,000,000	10,156,366	0.29
CHINA GOVERNMENT BOND 2.9% 24MAY2032	20,000,000	2,901,448	0.08
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02% 22OCT2025 (INTERBANK)	95,000,000	13,713,277	0.39
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25% 22NOV2028 (INTERBANK)	50,000,000	7,378,932	0.21
CHINA GOVERNMENT BOND 3.7% 26JUN2026	10,000,000	1,466,570	0.04
CHINA GOVERNMENT BOND 3.86% 19FEB2029	20,000,000	3,065,570	0.09
CHINA GOVERNMENT BOND 3.96% 15APR2030	20,000,000	3,088,636	0.09
CHINA GOVERNMENT BOND 4.03% 21JUN2040	20,000,000	3,337,161	0.10
CHINA GOVERNMENT BOND 4.12% 02AUG2042	20,000,000	3,460,626	0.10
CHINA GOVERNMENT BOND 4.22% 19MAR2048	30,000,000	5,246,790	0.15
CHINA GOVERNMENT BOND 4.25% 17MAY2062	20,000,000	3,704,225	0.11
CHINA GOVERNMENT BOND 4.27% 17MAY2037	10,000,000	1,678,335	0.05
CHINA GOVERNMENT BOND 4.3% 30NOV2059	20,000,000	3,711,515	0.11
CHINA GOVT 2.85% 04JUN2027 (INTERBANK)	50,000,000	7,326,785	0.21
CHINA GOVT 2.99% 15OCT2025 (INTERBANK)	100,000,000	14,434,124	0.41
CHINA GOVT 3.27% 22AUG2046 (INTERBANK)	20,000,000	3,027,570	0.09
CHINA GOVT BOND 2.74% 04AUG2026 (INTERBANK)	50,000,000	7,247,256	0.21
CHINA GOVT BOND 4.05% 24JUL2047 (INTERBANK)	20,000,000	3,421,533	0.10
CHINA RAILWAY GROUP 3.07% 05JUN2025 (INTERBANK)	20,000,000	2,896,512	0.08
CHINA RAILWAY GROUP 3.34% 08AUG2024 (INTERBANK)	20,000,000	2,870,313	0.08
CHINA RAILWAY GROUP 3.47% 24SEP2025 (INTERBANK)	20,000,000	2,896,636	0.08
CHINA RAILWAY GROUP 3.57% 30JUL2030 (INTERBANK)	10,000,000	1,490,879	0.04
CHINA RAILWAY GROUP 3.74% 15OCT2041 (INTERBANK)	20,000,000	3,104,110	0.09
CHINA RAILWAY GROUP 4.53% 23AUG2028 (INTERBANK)	10,000,000	1,543,048	0.04
CHINA STATE RAILWAY 2.7% 25AUG2027 (INTERBANK)	50,000,000	7,138,650	0.20
CHINA STATE RAILWAY 3.25% 11APR2032 (INTERBANK)	30,000,000	4,436,795	0.13

投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>中國(25.50%) (續)</b>			
CHINA STATE RAILWAY 3.5% 15DEC2032 (INTERBANK)	30,000,000	4,406,946	0.13
CHINA STATE RAILWAY 3.75% 19NOV2051 (INTERBANK)	20,000,000	3,147,669	0.09
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 2.37% 03APR2025 (INTERBANK)	10,000,000	1,435,848	0.04
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 2.48% 28DEC2026 (INTERBANK)	10,000,000	1,413,113	0.04
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 2.5% 13JAN2025 (INTERBANK)	10,000,000	1,446,751	0.04
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 2.57% 10JUN2025 (INTERBANK)	40,000,000	5,740,904	0.16
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 2.61% 27JAN2027 (INTERBANK)	60,000,000	8,712,157	0.25
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 2.64% 14APR2026 (INTERBANK)	30,000,000	4,336,624	0.12
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 2.85% 07JUL2033 (INTERBANK)	30,000,000	4,320,289	0.12
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 2.87% 06FEB2028 (INTERBANK)	20,000,000	2,933,092	0.08
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 2.9% 19AUG2032 (INTERBANK)	30,000,000	4,324,159	0.12
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 3.1% 13FEB2033 (INTERBANK)	15,000,000	2,231,062	0.06
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 3.18% 11MAR2032 (INTERBANK)	30,000,000	4,473,502	0.13
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 3.22% 14MAY2026 (INTERBANK)	10,000,000	1,466,296	0.04
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 3.33% 22FEB2026 (INTERBANK)	20,000,000	2,958,128	0.08
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 3.38% 16JUL2031 (INTERBANK)	60,000,000	8,966,631	0.26
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 3.86% 20MAY2029 (INTERBANK)	100,000,000	15,335,852	0.44
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 3.87% 14SEP2025	20,000,000	2,924,259	0.08
EXPORT-IMPORT BANK CHINA 4.89% 26MAR2028 (INTERBANK)	100,000,000	15,961,049	0.46
		894,353,746	25.50

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

#### 基本 – 按地理位置劃分 (續)

上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>香港(6.10%)</b>			
CORP ANDINA DE 3.265% 24MAR2027	10,000,000	1,265,291	0.04
HK GOVERNMENT BOND 2.39% 20AUG2025	55,000,000	6,974,579	0.20
HK SCIENCE & TECH PARKS 3.2% 11JUL2024	21,000,000	2,707,660	0.08
HONG KONG (GOVT OF) 0.8% 27AUG2027	39,000,000	4,627,265	0.13
HONG KONG (GOVT OF) 1.25% 29JUN2027	93,100,000	11,216,388	0.32
HONG KONG (GOVT OF) 1.49% 22FEB2028	7,000,000	849,595	0.02
HONG KONG (GOVT OF) 1.51% 24FEB2027	55,000,000	6,755,094	0.19
HONG KONG (GOVT OF) 1.59% 04MAR2036	78,000,000	8,206,197	0.23
HONG KONG (GOVT OF) 1.68% 21JAN2026	175,000,000	21,833,819	0.62
HONG KONG (GOVT OF) 1.79% 14APR2025	112,000,000	14,045,485	0.40
HONG KONG (GOVT OF) 1.84% 09DEC2024	47,000,000	5,908,147	0.17
HONG KONG (GOVT OF) 1.89% 02MAR2032	90,000,000	10,699,821	0.31
HONG KONG (GOVT OF) 1.97% 17JAN2029	148,000,000	18,284,462	0.52
HONG KONG (GOVT OF) 2.02% 07MAR2034	65,000,000	7,521,039	0.22
HONG KONG (GOVT OF) 2.07% 26AUG2026	10,000,000	1,254,253	0.04
HONG KONG (GOVT OF) 2.13% 16JUL2030	97,000,000	11,961,049	0.34
HONG KONG (GOVT OF) 2.24% 27AUG2029	15,000,000	1,869,121	0.05
HONG KONG (GOVT OF) 2.48% 28FEB2029	15,000,000	1,898,305	0.05
HONG KONG (GOVT OF) 2.95% 24FEB2025	55,000,000	7,045,083	0.20
HONG KONG (GOVT OF) 3.3% 26MAY2042	45,000,000	5,431,608	0.16
HONG KONG (GOVT OF) 3.31% 26MAY2025	25,000,000	3,194,992	0.09
HONG KONG (GOVT OF) 3.32% 25FEB2026	40,000,000	5,184,742	0.15
HONG KONG (GOVT OF) 3.74% 12JAN2038	70,000,000	9,188,055	0.26
HONG KONG (GOVT OF) 3.75% 24FEB2025	25,000,000	3,240,327	0.09
HONG KONG (GOVT OF) 3.98% 25AUG2025	50,000,000	6,536,879	0.19
HONG KONG (GOVT OF) 4.08% 24NOV2025	20,000,000	2,604,022	0.07
HONG KONG (GOVT OF) 4.55% 25NOV2024	30,000,000	3,875,061	0.11
HONG KONG (GOVT OF) 4.6% 10MAR2025	45,000,000	5,982,607	0.17
HONG KONG (GOVT OF) 4.68% 12SEP2025	75,000,000	9,813,636	0.28
HONG KONG MORTGAGE CORP 3.15% 26FEB2049	35,000,000	3,655,904	0.10
HONG KONG MORTGAGE CORP 5% 25OCT2024	80,000,000	10,340,290	0.30
		213,970,776	6.10

投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比
	美元	美元	(%)
<b>印尼(8.42%)</b>			
INDONESIA (GOVT OF) 8.75% 15MAY2031	73,000,000,000	5,348,139	0.15
INDONESIA (REP OF) 10% 15FEB2028 FR47	50,000,000,000	3,756,712	0.11
INDONESIA (REP OF) 10.5% 15AUG2030 FR52	60,000,000,000	4,856,294	0.14
INDONESIA (REP OF) 10.5% 15JUL2038 FR50	32,000,000,000	2,836,112	0.08
INDONESIA (REP OF) 11% 15SEP2025 FR40	36,000,000,000	2,578,652	0.07
INDONESIA (REP OF) 12% 15SEP2026 FR37	14,000,000,000	1,059,679	0.03
INDONESIA (REP OF) 5.125% 15APR2027 FR90	110,000,000,000	6,918,947	0.20
INDONESIA (REP OF) 5.375% 15AUG2025	70,000,000,000	4,558,747	0.13
INDONESIA (REP OF) 5.5% 15APR2026	120,000,000,000	7,714,346	0.22
INDONESIA (REP OF) 6.25% 15JUN2036 FR88	30,000,000,000	1,903,023	0.05
INDONESIA (REP OF) 6.375% 15APR2032 FR91	176,370,000,000	11,409,995	0.33
INDONESIA (REP OF) 6.375% 15APR2042	37,000,000,000	2,327,877	0.07
INDONESIA (REP OF) 6.375% 15AUG2028	66,000,000,000	4,369,496	0.12
INDONESIA (REP OF) 6.375% 15JUL2037	40,000,000,000	2,620,380	0.08
INDONESIA (REP OF) 6.375% 15MAR2034	89,050,000,000	5,721,128	0.16
INDONESIA (REP OF) 6.5% 15FEB2031	202,000,000,000	13,396,955	0.38
INDONESIA (REP OF) 6.5% 15JUN2025	140,000,000,000	9,122,820	0.26
INDONESIA (REP OF) 6.5% 15JUN2039	55,000,000,000	3,462,234	0.10
INDONESIA (REP OF) 6.625% 15FEB2034	30,000,000,000	2,006,143	0.06
INDONESIA (REP OF) 6.625% 15MAY2033	118,000,000,000	7,714,270	0.22
INDONESIA (REP OF) 6.625% 15SEP2029	50,000,000,000	3,287,785	0.09
INDONESIA (REP OF) 6.75% 15JUN2047	84,885,000,000	5,465,414	0.16
INDONESIA (REP OF) 6.875% 15AUG2051 FR89	75,000,000,000	4,960,495	0.14
INDONESIA (REP OF) 7% 15FEB2033	80,000,000,000	5,505,515	0.16
INDONESIA (REP OF) 7% 15MAY2027 FR59	163,000,000,000	10,839,341	0.31
INDONESIA (REP OF) 7% 15SEP2030	177,000,000,000	11,977,605	0.34
INDONESIA (REP OF) 7.125% 15JUN2038	85,000,000,000	5,791,657	0.17
INDONESIA (REP OF) 7.125% 15JUN2042 FR92	100,000,000,000	6,750,075	0.19
INDONESIA (REP OF) 7.125% 15JUN2043	65,000,000,000	4,377,490	0.12
INDONESIA (REP OF) 7.375% 15MAY2048	90,000,000,000	6,188,902	0.18
INDONESIA (REP OF) 7.375% 15OCT2030	10,000,000,000	688,231	0.02
INDONESIA (REP OF) 7.5% 15APR2040 FR83	90,000,000,000	6,380,441	0.18
INDONESIA (REP OF) 7.5% 15JUN2035	130,000,000,000	8,959,246	0.26
INDONESIA (REP OF) 7.5% 15MAY2038	94,500,000,000	6,611,635	0.19
INDONESIA (REP OF) 8.25% 15JUN2032 FR58	80,000,000,000	5,717,938	0.16
INDONESIA (REP OF) 8.25% 15MAY2036	117,000,000,000	8,611,311	0.25



## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

#### 基本 – 按地理位置劃分 (續)

上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>印尼(8.42%) (續)</b>			
INDONESIA (REP OF) 8.375% 15MAR2034	175,000,000,000	13,040,303	0.37
INDONESIA (REP OF) 8.375% 15SEP2026 FR56	150,000,000,000	10,423,966	0.30
INDONESIA (REP OF) 9% 15MAR2029	116,500,000,000	8,519,889	0.24
INDONESIA (REP OF) 9.5% 15JUL2031 FR54	29,000,000,000	2,285,132	0.07
INDONESIA (REP OF) 9.5% 15MAY2041 FR57	36,000,000,000	2,914,527	0.08
INDONESIA (REP OF) 9.75% 15MAY2037 FR45	20,000,000,000	1,639,735	0.05
INDONESIA EXIMBANK 8.75% 05SEP2025	10,000,000,000	670,427	0.02
INDONESIA GOVERNMENT 6.125% 15MAY2028	125,000,000,000	8,064,913	0.23
INDONESIA GOVERNMENT 7.5% 15AUG2032	40,000,000,000	2,830,194	0.08
INDONESIA GOVERNMENT 8.25% 15MAY2029	120,000,000,000	8,472,294	0.24
INDONESIA GOVERNMENT 8.375% 15APR2039	85,000,000,000	6,420,937	0.18
INDONESIA GOVERNMENT 8.75% 15FEB2044	25,000,000,000	1,979,542	0.06
INDONESIA GOVT 10.25% 15JUL2027 SER FR42	44,000,000,000	3,306,306	0.09
PERUSAHAAN PENERBIT 4.875% 15JUL2026	40,000,000,000	2,551,043	0.07
PERUSAHAAN PENERBIT SBS 8.875% 15NOV2031	30,000,000,000	2,220,126	0.06
PERUSAHAAN PENERBIT SBSN 6% 15JAN2027	60,000,000,000	3,934,119	0.11
PERUSAHAAN PENERBIT SBSN SER PBS 6.125% 15OCT2025	15,000,000,000	979,983	0.03
PERUSAHAAN PENERBIT SURAT BERHARGA SYARIAH 7.75% 15OCT2046	49,800,000,000	3,620,466	0.10
PERUSAHAAN PENERBIT SURAT BERHARGA SYARIAH NEGARA INDONESIA 5.875% 15JUL2028	5,845,000,000	377,199	0.01
PERUSAHAAN PENERBIT SURAT BERHARGA SYARIAH NEGARA INDONESIA 6.875% 15MAR2036	80,000,000,000	5,330,900	0.15
		<u>295,377,031</u>	<u>8.42</u>
<b>菲律賓(6.12%)</b>			
PHILIPPINE GOVERNMENT 3.625% 09SEP2025	630,000,000	11,168,697	0.32
PHILIPPINE GOVERNMENT 4.625% 09SEP2040	660,000,000	10,540,638	0.30
PHILIPPINE GOVERNMENT 4.75% 04MAY2027	416,360,000	7,354,935	0.20
PHILIPPINE GOVERNMENT 5.25% 18MAY2037	225,000,000	3,842,707	0.11
PHILIPPINE GOVERNMENT 5.75% 12APR2025	210,000,000	3,833,610	0.11
PHILIPPINE GOVERNMENT 6.25% 22MAR2028	400,000,000	7,411,513	0.21
PHILIPPINE GOVERNMENT 6.75% 24JAN2039	110,000,000	2,164,713	0.06
PHILIPPINE GOVERNMENT 6.875% 10JAN2029	1,055,000,000	20,290,242	0.58

投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>菲律賓(6.12%) (續)</b>			
PHILIPPINES (REP OF) 10.25% 19JAN2026	77,000,000	1,547,251	0.04
PHILIPPINES (REP OF) 18.25% 29NOV2025	50,000,000	1,078,182	0.03
PHILIPPINES (REP OF) 2.875% 09JUL2030	100,000,000	1,582,752	0.05
PHILIPPINES (REP OF) 3.375% 08APR2026	505,000,000	8,792,163	0.25
PHILIPPINES (REP OF) 3.625% 21MAR2033	300,000,000	4,716,657	0.13
PHILIPPINES (REP OF) 3.625% 22APR2028	405,000,000	6,838,655	0.20
PHILIPPINES (REP OF) 3.75% 12AUG2028	305,000,000	5,188,751	0.15
PHILIPPINES (REP OF) 4% 22JUL2031	420,000,000	6,965,883	0.20
PHILIPPINES (REP OF) 4.25% 07APR2025	150,000,000	2,691,566	0.08
PHILIPPINES (REP OF) 4.875% 20JAN2032	503,100,000	8,752,557	0.25
PHILIPPINES (REP OF) 5.125% 15JUL2041	175,000,000	2,956,749	0.07
PHILIPPINES (REP OF) 5.75% 16AUG2037	50,000,000	902,638	0.03
PHILIPPINES (REP OF) 6.25% 14FEB2026	340,000,000	6,316,156	0.18
PHILIPPINES (REP OF) 6.375% 27JUL2030	260,000,000	4,908,551	0.14
PHILIPPINES (REP OF) 6.5% 19MAY2029	60,000,000	1,113,579	0.03
PHILIPPINES (REP OF) 6.625% 17AUG2033	30,000,000	576,192	0.02
PHILIPPINES (REP OF) 7% 13OCT2029	170,000,000	3,243,582	0.09
PHILIPPINES (REP OF) 7.25% 23JUN2032	250,000,000	4,838,372	0.14
PHILIPPINES (REP OF) 7.5% 20OCT2032	30,000,000	596,540	0.02
PHILIPPINES (REP OF) 8% 19JUL2031	1,326,174,950	27,245,215	0.78
PHILIPPINES (REP OF) 8% 30SEP2035	410,000,000	8,603,101	0.25
PHILIPPINES (REP OF) 8.125% 16DEC2035	886,712,627	18,509,188	0.53
PHILIPPINES (REP OF) 8.125% 24NOV2042	100,000,000	2,183,850	0.06
PHILIPPINES (REP OF) 8.5% 29NOV2032	100,000,000	2,080,788	0.06
PHILIPPINES (REP OF) 8.625% 06SEP2027	249,000,000	4,941,360	0.14
PHILIPPINES (REP OF) 8.75% 27MAY2030	180,000,000	3,672,584	0.10
PHILIPPINES (REP OF) 9.25% 05NOV2034	223,000,000	4,962,041	0.14
PHILIPPINES (REP OF) 9.375% 05OCT2031	50,000,000	1,080,708	0.03
PHILIPPINES (REP OF) 9.5% 04DEC2028	66,000,000	1,346,929	0.04
		214,839,595	6.12

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

#### 基本 – 按地理位置劃分 (續)

上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>新加坡(16.14%)</b>			
HOUSING & DEVELOPMENT 1.265% 24JUN2030	750,000	506,853	0.01
HOUSING & DEVELOPMENT 1.73% 19MAY2031	10,000,000	6,883,474	0.20
HOUSING & DEVELOPMENT 1.845% 15MAR2027	13,000,000	9,515,255	0.27
HOUSING & DEVELOPMENT 1.971% 25JAN2029	12,000,000	8,695,716	0.25
HOUSING & DEVELOPMENT 2.315% 18SEP2034	750,000	522,132	0.01
HOUSING & DEVELOPMENT 2.35% 25MAY2027	750,000	555,258	0.02
HOUSING & DEVELOPMENT 2.627% 09JUN2025	3,500,000	2,621,318	0.06
HOUSING & DEVELOPMENT BRD 1.54% 12OCT2028	3,000,000	2,124,921	0.06
HOUSING & DEVELOPMENT BRD 1.645% 23NOV2026	2,500,000	1,818,038	0.05
HOUSING & DEVELOPMENT BRD 1.865% 21JUL2033	15,500,000	10,506,585	0.30
HOUSING & DEVELOPMENT BRD 2.545% 04JUL2031	2,500,000	1,840,421	0.05
HOUSING & DEVELOPMENT 2.94% 13JUL2027	5,000,000	3,816,224	0.11
HOUSING & DEVELOPMENT 3.104% 24NOV2028	5,000,000	3,802,356	0.11
HOUSING & DEVELOPMENT 3.995% 06DEC2029	5,000,000	3,982,236	0.11
HOUSING & DEVELOPMENT 4.09% 26OCT2027	2,000,000	1,579,252	0.05
LAND TRANSPORT 3.275% 29OCT2025	7,500,000	5,717,103	0.16
LAND TRANSPORT 3.35% 19MAR2048	13,750,000	10,055,974	0.29
LAND TRANSPORT 3.45% 30JUL2058	7,750,000	5,596,404	0.16
LAND TRANSPORT 3.51% 18SEP2030	3,000,000	2,335,534	0.07
LAND TRANSPORT AUTHORITY 3.09% 31AUG2027	500,000	383,718	0.01
LAND TRANSPORT AUTHORITY 3.3% 03JUN2054	1,250,000	876,295	0.03
LAND TRANSPORT AUTHORITY 3.38% 30JAN2059	3,250,000	2,309,347	0.07
LAND TRANSPORT AUTHORITY 3.43% 30OCT2053	2,750,000	1,987,535	0.06
SINGAPORE (GOVT OF) 2.125% 01JUN2026	50,000,000	37,139,347	1.06
SINGAPORE (GOVT OF) 2.375% 01JUN2025	35,000,000	26,218,617	0.75
SINGAPORE (GOVT OF) 2.75% 01APR2042	29,500,000	22,472,384	0.64
SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030	32,500,000	25,085,488	0.72
SINGAPORE (GOVT OF) 3.375% 01SEP2033	32,000,000	25,908,086	0.74
SINGAPORE (GOVT OF) 3.5% 1MAR2027	40,000,000	31,265,458	0.89
SINGAPORE GOVERNMENT 0.5% 01NOV2025	40,000,000	28,876,591	0.82
SINGAPORE GOVERNMENT 1.25% 01NOV2026	32,000,000	23,200,293	0.66
SINGAPORE GOVERNMENT 1.625% 01JUL2031	35,000,000	24,780,329	0.71
SINGAPORE GOVERNMENT 1.875% 01MAR2050	31,000,000	19,810,170	0.56
SINGAPORE GOVERNMENT 1.875% 01OCT2051	31,000,000	19,860,503	0.57
SINGAPORE GOVERNMENT 2.25% 01AUG2036	35,500,000	25,775,071	0.73
SINGAPORE GOVERNMENT 2.375% 01JUL2039	20,000,000	14,589,083	0.42



投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>新加坡(16.14%) (續)</b>			
SINGAPORE GOVERNMENT 2.625% 01AUG2032	35,000,000	26,636,122	0.76
SINGAPORE GOVERNMENT 2.625% 01MAY2028	30,000,000	22,809,299	0.65
SINGAPORE GOVERNMENT 2.75% 01MAR2046	33,000,000	25,138,603	0.72
SINGAPORE GOVERNMENT 2.875% 01AUG2028	10,000,000	7,738,332	0.22
SINGAPORE GOVERNMENT 2.875% 01JUL2029	35,000,000	27,197,079	0.78
SINGAPORE GOVERNMENT 2.875% 01SEP2027	21,000,000	16,151,401	0.46
SINGAPORE GOVERNMENT 3% 01AUG2072	16,300,000	13,388,144	0.38
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.8% 17AUG2071	6,500,000	3,830,830	0.11
TEMASEK FINANCIAL I LTD 3.785% 05MAR2025	2,000,000	1,536,942	0.04
TEMASEK FINANCIAL I LTD 4.0475% 05MAR2035	1,500,000	1,182,678	0.03
TEMASEK FINANCIAL I LTD 4.2% 02AUG2050	5,750,000	4,837,223	0.14
TEMASEK FINANCIAL LTD 1.8% 24NOV2026	3,500,000	2,547,263	0.07
		566,007,285	16.14
<b>南韓(15.27%)</b>			
(D) KOREA (REP OF) 1% 28FEB2025	5,000,000,000	3,919,593	0.11
(D) KOREA (REP OF) 1% 28FEB2027	10,000,000,000	7,348,752	0.21
(D) KOREA (REP OF) 1% 30APR2027	10,000,000,000	7,307,561	0.21
(D) KOREA (REP OF) 1% 30JUN2025	5,000,000,000	3,876,709	0.11
(D) KOREA (REP OF) 1% 30JUN2027	10,000,000,000	7,267,045	0.21
(D) KOREA (REP OF) 1% 30SEP2025	5,000,000,000	3,847,963	0.11
(D) KOREA (REP OF) 1% 31MAR2027	5,000,000,000	3,663,939	0.10
(D) KOREA (REP OF) 1.125% 10SEP2025	8,000,000,000	6,013,583	0.17
(D) KOREA (REP OF) 1.125% 10SEP2039	5,000,000,000	2,930,874	0.08
(D) KOREA (REP OF) 1.25% 10MAR2026	12,000,000,000	8,965,424	0.26
(D) KOREA (REP OF) 1.375% 10DEC2029	10,000,000,000	7,013,556	0.20
(D) KOREA (REP OF) 1.375% 10JUN2030	10,000,000,000	6,949,455	0.20
(D) KOREA (REP OF) 1.5% 10MAR2025	5,000,000,000	3,814,961	0.11
(D) KOREA (REP OF) 1.5% 10MAR2050	25,000,000,000	14,083,106	0.40
(D) KOREA (REP OF) 1.5% 10SEP2040	6,000,000,000	3,722,505	0.11
(D) KOREA (REP OF) 1.625% 10SEP2070	2,000,000,000	1,010,145	0.03
(D) KOREA (REP OF) 1.75% 10SEP2026	7,000,000,000	5,262,400	0.15
(D) KOREA (REP OF) 1.875% 10JUN2029	7,000,000,000	5,087,193	0.15
(D) KOREA (REP OF) 1.875% 10MAR2051	29,500,000,000	18,002,104	0.51

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

#### 基本 – 按地理位置劃分 (續)

上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>南韓(15.27%) (續)</b>			
(D) KOREA (REP OF) 1.875% 10SEP2041	3,000,000,000	1,937,647	0.06
(D) KOREA (REP OF) 2% 10JUN2031	10,000,000,000	7,154,386	0.20
(D) KOREA (REP OF) 2% 10MAR2049	20,000,000,000	12,704,710	0.36
(D) KOREA (REP OF) 2.375% 10DEC2031	10,000,000,000	7,320,355	0.21
(D) KOREA (REP OF) 2.375% 10MAR2027	5,000,000,000	3,814,681	0.11
(D) KOREA (REP OF) 2.5% 10MAR2052	20,000,000,000	13,906,109	0.40
(D) KOREA (REP OF) 3.125% 10JUN2025	10,000,000,000	7,754,103	0.22
(D) KOREA (REP OF) 3.125% 10JUN2026	10,000,000,000	7,767,621	0.22
(D) KOREA (REP OF) 3.125% 10SEP2027	6,000,000,000	4,690,575	0.13
(D) KOREA (REP OF) 3.125% 10SEP2052	15,000,000,000	11,795,301	0.34
(D) KOREA (REP OF) 3.25% 10JUN2033	9,000,000,000	7,027,184	0.20
(D) KOREA (REP OF) 3.25% 10MAR2028	15,000,000,000	11,784,082	0.34
(D) KOREA (REP OF) 3.25% 10MAR2053	17,000,000,000	13,691,176	0.39
(D) KOREA (REP OF) 3.25% 10SEP2042	2,500,000,000	1,992,097	0.06
(D) KOREA (REP OF) 3.375% 10JUN2032	5,000,000,000	3,934,605	0.11
(D) KOREA (REP OF) 3.375% 10MAR2025	6,000,000,000	4,703,694	0.13
(D) KOREA (REP OF) 3.5% 10SEP2028	10,000,000,000	7,963,537	0.23
(D) KOREA (REP OF) 3.5% 10SEP2072	3,400,000,000	2,966,086	0.08
(D) KOREA (REP OF) 3.625% 10SEP2025	7,000,000,000	5,528,978	0.16
(D) KOREA (REP OF) 3.625% 10SEP2053	10,000,000,000	8,669,987	0.25
(D) KOREA (REP OF) 3.875% 10DEC2026	5,000,000,000	3,969,795	0.11
(D) KOREA (REP OF) 4.25% 10DEC2025	10,000,000,000	7,930,089	0.23
(D) KOREA (REP OF) 4.25% 10DEC2032	8,000,000,000	6,725,302	0.19
(D) KOREA (REPUBLIC OF) 2.375% 10SEP2038	5,000,000,000	3,559,773	0.10
(D) KOREA DEVELOPMENT BANK 2.24% 10MAR2024	10,000,000,000	7,754,251	0.22
(D) KOREA DEVELOPMENT BANK 3.25% 30MAY2025	10,000,000,000	7,746,216	0.22
(D) KOREA DEVELOPMENT BANK 3.7% 15JUL2027	10,000,000,000	7,884,623	0.23
(D) KOREA DEVELOPMENT BANK 4.75% 26SEP2024	10,000,000,000	7,833,760	0.22
(D) KOREA HOUSING FINANCE CO 3.734% 11AUG2027	10,000,000,000	7,866,028	0.22
(D) KOREA LAND & HOUSING COR 1.597% 28SEP2036	10,000,000,000	6,281,238	0.18
(D) KOREA LAND & HOUSING COR 3.43% 10AUG2032	10,000,000,000	7,787,608	0.22
(D) KOREA MONETARY STAB BOND 2.32% 03MAR2025	23,000,000,000	17,676,696	0.50
(D) KOREA RAIL NETWORK AUTH 3.451% 07JUL2042	10,000,000,000	7,906,357	0.23
(D) KOREA RAILROAD CORP 5.074% 29SEP2025	10,000,000,000	8,052,477	0.23
(D) KOREA TREASURY 3.75% 10DEC2033	11,200,000,000	9,105,266	0.26
(D) KOREA TREASURY BOND 1.5% 10DEC2026	6,000,000,000	4,439,600	0.13

投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>南韓(15.27%) (續)</b>			
(D) KOREA TREASURY BOND 1.5% 10DEC2030	10,000,000,000	6,950,148	0.20
(D) KOREA TREASURY BOND 1.5% 10SEP2036	4,000,000,000	2,576,691	0.07
(D) KOREA TREASURY BOND 1.875% 10JUN2026	10,000,000,000	7,529,843	0.21
(D) KOREA TREASURY BOND 2% 10MAR2046	10,000,000,000	6,447,694	0.18
(D) KOREA TREASURY BOND 2.125% 10JUN2027	5,000,000,000	3,750,600	0.11
(D) KOREA TREASURY BOND 2.125% 10MAR2047	15,000,000,000	9,869,477	0.28
(D) KOREA TREASURY BOND 2.25% 10DEC2025	13,000,000,000	9,915,200	0.28
(D) KOREA TREASURY BOND 2.25% 10JUN2025	6,000,000,000	4,591,847	0.13
(D) KOREA TREASURY BOND 2.375% 10DEC2027	5,000,000,000	3,769,573	0.11
(D) KOREA TREASURY BOND 2.375% 10DEC2028	7,500,000,000	5,616,400	0.16
(D) KOREA TREASURY BOND 2.625% 10JUN2028	3,000,000,000	2,277,930	0.06
(D) KOREA TREASURY BOND 2.625% 10MAR2048	15,000,000,000	10,837,079	0.31
(D) KOREA TREASURY BOND 2.625% 10SEP2035	9,000,000,000	6,659,789	0.19
(D) KOREA TREASURY BOND 2.75% 10DEC2044	10,000,000,000	7,346,188	0.21
(D) KOREA TREASURY BOND 3% 10DEC2042	10,000,000,000	7,613,698	0.22
(D) KOREA TREASURY BOND 4% 10DEC2031	8,000,000,000	6,563,868	0.19
(D) KOREA TREASURY BOND 4.75% 10DEC2030	9,000,000,000	7,670,071	0.22
(D) KOREA TREASURY BOND 5.25% 10MAR2027	6,000,000,000	5,021,394	0.14
(D) KOREA TREASURY BOND 5.5% 10DEC2029	7,000,000,000	6,124,281	0.17
(D) KOREA TREASURY BOND 5.5% 10MAR2028	9,000,000,000	7,721,169	0.22
(D) KOREA TREASURY BOND 5.75% 10MAR2026	11,000,000,000	9,142,265	0.26
(D) KR SMES & STARTUPS AGEN 5.094% 18NOV2025	10,000,000,000	8,027,926	0.23
		535,735,992	15.27
<b>非上市債券</b>			
<b>香港(1.52%)</b>			
AIRPORT AUTHORITY 1.55% 30OCT2027	16,000,000	1,887,036	0.05
AIRPORT AUTHORITY 1.9% 19NOV2030	15,000,000	1,690,207	0.05
AIRPORT AUTHORITY 1.95% 20NOV2030	63,000,000	7,118,997	0.20
AIRPORT AUTHORITY 2.3% 24APR2030	55,000,000	6,443,870	0.18
AIRPORT AUTHORITY 2.33% 29APR2030	30,000,000	3,519,204	0.10
AIRPORT AUTHORITY 2.8% 06JUN2024	5,000,000	635,101	0.02
AIRPORT AUTHORITY 3.3% 08AUG2027	55,000,000	6,941,226	0.20

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

#### 基本 – 按地理位置劃分 (續)

非上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>香港(1.52%) (續)</b>			
AIRPORT AUTHORITY HK 1.95% 11MAY2027	20,000,000	2,414,946	0.07
MTR CORP CI LTD 2.95% 26APR2047	4,000,000	418,599	0.01
MTR CORP LTD 3.25% 15AUG2024	10,000,000	1,273,785	0.04
MTR CORP LTD 3.95% 29MAY2025	20,000,000	2,557,750	0.08
MTR CORP LTD 4.5% 22FEB2025	50,000,000	6,437,111	0.18
MTR CORP LTD 4.85% 29SEP2025	45,000,000	5,895,322	0.17
NEW DEVELOPM BANK BRICS 4.1% 22MAY2026	41,000,000	5,341,627	0.15
URBAN RENEWAL AUTHORITY 3.85% 27JAN2026	5,000,000	642,976	0.02
		53,217,757	1.52
<b>馬來西亞(11.33%)</b>			
BANK PEMBANGUNAN MALAY 4.75% 12SEP2029	10,000,000	2,315,386	0.07
CAGAMAS BERHAD 3.31% 31JAN2025	5,000,000	1,100,857	0.03
DANAINFRA NASIONAL 2.84% 24FEB2028	5,000,000	1,063,679	0.03
DANAINFRA NASIONAL 2.86% 23SEP2030	5,000,000	1,034,538	0.03
DANAINFRA NASIONAL 3.7% 27OCT2028	10,000,000	2,195,446	0.06
DANAINFRA NASIONAL 3.91% 06JUN2031	5,000,000	1,095,374	0.03
DANAINFRA NASIONAL 4.44% 19OCT2029	10,000,000	2,267,661	0.07
DANAINFRA NASIONAL 4.82% 01APR2048	5,000,000	1,183,243	0.03
DANAINFRA NASIONAL 4.95% 06APR2040	10,000,000	2,411,333	0.07
DANAINFRA NASIONAL 5.03% 20APR2029	5,000,000	1,160,521	0.03
DANAINFRA NASIONAL 5.04% 12NOV2040	10,000,000	2,424,021	0.07
DANAINFRA NASIONAL 5.06% 12FEB2049	10,000,000	2,460,197	0.07
DANAINFRA NASIONAL 5.11% 19FEB2038	10,000,000	2,459,384	0.07
DANAINFRA NASIONAL 5.36% 21FEB2048	10,000,000	2,558,306	0.07
DANGA CAPITAL BHD 4.94% 26JAN2033	5,000,000	1,190,049	0.03
DANUM CAPITAL 3.14% 13MAY2027	5,000,000	1,070,051	0.03
DANUM CAPITAL 3.29% 13MAY2030	5,000,000	1,054,756	0.03
DANUM CAPITAL BHD 4.3% 13FEB2026	5,000,000	1,118,521	0.03
GOVCO HOLDINGS BHD 4.29% 22FEB2024	5,000,000	1,107,643	0.03
GOVCO HOLDINGS BHD 4.55% 22FEB2027	10,000,000	2,270,526	0.07
GOVCO HOLDINGS BHD 4.95% 20FEB2032	10,000,000	2,368,268	0.07
JAMBATAN KEDUA SDN BHD 4.3% 28MAY2025	5,000,000	1,106,152	0.03
LEMBAGA PEMBIAYAAN PERUM 2.66% 05NOV2027	5,000,000	1,054,580	0.03

投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

非上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量 美元	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>馬來西亞(11.33%) (續)</b>			
LEMBAGA PEMBIAYAAN PERUM 4.21% 06JUL2038	5,000,000	1,129,740	0.03
LEMBAGA PEMBIAYAAN PERUM 4.79% 24MAR2045	10,000,000	2,365,038	0.07
LEMBAGA PEMBIAYAAN PERUM 4.9% 05APR2033	10,000,000	2,371,144	0.07
LEMBAGA PEMBIAYAAN PERUM 4.91% 24MAR2051	15,000,000	3,560,734	0.10
LEMBAGA PEMBIAYAAN PERUM 4.94% 16APR2032	5,000,000	1,180,280	0.03
MALAYSIA (GOVT OF) 3.892% 15MAR2027	30,000,000	6,687,699	0.19
MALAYSIA (GOVT OF) 3.99% 15OCT2025	43,000,000	9,541,684	0.27
MALAYSIA (GOVT OF) 4.498% 15APR2030	43,000,000	9,859,382	0.28
MALAYSIA (GOVT OF) 4.709% 15SEP2026	1,000,000	227,887	0.01
MALAYSIA (GOVT OF) 4.736% 15MAR2046	25,000,000	5,916,668	0.17
MALAYSIA (GOVT OF) 4.786% 31OCT2035	30,000,000	7,099,606	0.20
MALAYSIA (GOVT OF) 2.632% 15APR2031	15,000,000	3,052,509	0.09
MALAYSIA GOVERNMENT 3.519% 20APR2028	15,000,000	3,282,767	0.09
MALAYSIA GOVERNMENT 3.582% 15JUL2032	20,500,000	4,475,018	0.13
MALAYSIA GOVERNMENT 3.757% 22MAY2040	35,000,000	7,331,749	0.21
MALAYSIA GOVERNMENT 3.828% 05JUL2034	50,000,000	11,055,976	0.32
MALAYSIA GOVERNMENT 3.882% 14MAR2025	10,000,000	2,269,970	0.07
MALAYSIA GOVERNMENT 3.885% 15AUG2029	30,000,000	6,697,441	0.19
MALAYSIA GOVERNMENT 3.9% 30NOV2026	8,000,000	1,769,031	0.05
MALAYSIA GOVERNMENT 3.906% 15JUL2026	20,000,000	4,484,909	0.13
MALAYSIA GOVERNMENT 4.065% 15JUN2050	40,000,000	8,494,398	0.24
MALAYSIA GOVERNMENT 4.254% 31MAY2035	17,000,000	3,830,663	0.11
MALAYSIA GOVERNMENT 4.457% 31MAR2053	19,000,000	4,322,645	0.12
MALAYSIA GOVERNMENT 4.504% 30APR2029	8,000,000	1,827,076	0.05
MALAYSIA GOVERNMENT 4.696% 15OCT2042	34,500,000	8,166,074	0.23
MALAYSIA GOVERNMENT 4.893% 08JUN2038	50,000,000	11,986,676	0.34
MALAYSIA GOVERNMENT 4.921% 06JUL2048	21,500,000	5,296,148	0.15
MALAYSIA INVESTMENT 4.193% 07OCT2032	36,000,000	8,132,864	0.23
MALAYSIA INVESTMENT 4.724% 15JUN2033	30,000,000	7,025,011	0.20
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 3.447% 15JUL2036	35,000,000	7,357,711	0.21
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 3.465% 15OCT2030	55,000,000	11,830,928	0.34
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 3.599% 31JUL2028	5,000,000	1,103,114	0.03
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 3.726% 31MAR2026	35,000,000	7,739,483	0.22
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 3.871% 08AUG2028	10,000,000	2,232,164	0.06
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 3.899% 15JUN2027	10,000,000	2,206,276	0.06
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.07% 30SEP2026	70,000,000	15,622,944	0.45



## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

#### 基本 – 按地理位置劃分 (續)

非上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>馬來西亞(11.33%) (續)</b>			
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.119% 30NOV2034	20,000,000	4,459,507	0.13
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.128% 15AUG2025	25,000,000	5,590,983	0.16
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.13% 09JUL2029	5,000,000	1,133,330	0.03
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.245% 30SEP2030	10,000,000	2,259,203	0.06
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.291% 14AUG2043	20,000,000	4,533,273	0.13
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.369% 31OCT2028	65,000,000	14,701,247	0.42
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.417% 30SEP2041	24,000,000	5,472,447	0.16
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.467% 15SEP2039	5,000,000	1,156,377	0.03
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.638% 15NOV2049	18,000,000	4,160,819	0.12
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.662% 31MAR2038	20,000,000	4,734,701	0.14
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.755% 04AUG2037	55,000,000	13,169,726	0.38
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.895% 08MAY2047	10,000,000	2,386,952	0.07
MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 5.357% 15MAY2052	30,000,000	7,684,236	0.22
MALYSIAN (GOVT OF) 3.502% 31MAY2027	16,300,000	3,560,280	0.10
MALYSIAN (GOVT OF) 3.899% 16NOV2027	31,000,000	6,871,227	0.20
MALYSIAN (GOVT OF) 3.955% 15SEP2025	42,000,000	9,349,857	0.27
MALYSIAN (GOVT OF) 4.127% 15APR2032	17,000,000	3,827,275	0.11
MALYSIAN (GOVT OF) 4.232% 30JUN2031	20,200,000	4,529,060	0.13
MALYSIAN (GOVT OF) 4.392% 15APR2026	29,000,000	6,512,532	0.19
MALYSIAN (GOVT OF) 4.762% 07APR2037	23,000,000	5,459,007	0.16
MALYSIAN GOVERNMENT 3.733% 15JUN2028	50,000,000	10,963,867	0.31
MALYSIAN GOVERNMENT 3.844% 15APR2033	32,000,000	7,053,097	0.20
MALYSIAN GOVERNMENT 4.837% 15JUL2025	7,670,000	1,746,012	0.05
MALYSIAN GOVERNMENT 4.935% 30SEP2043	20,000,000	4,844,275	0.14
MALYSIAN GOVERNMENT 5.248% 15SEP2028	8,000,000	1,892,731	0.05
PENGURUSAN AIR SPV BHD 4.56% 31JAN2030	10,000,000	2,290,071	0.07
PERBADANAN TABUNG PENDID 4.85% 26JUL2041	10,000,000	2,403,627	0.07
PERBADANAN TABUNG PENDID 4.86% 12MAR2032	20,000,000	4,712,046	0.13
PRASARANA MALAYSIA BHD 3.37% 03AUG2029	20,000,000	4,325,621	0.12
PRASARANA MALAYSIA BHD 5.07% 26FEB2041	10,000,000	2,452,861	0.07
SYARIKAT PRASARANA NEGAR 4.35% 04AUG2026	5,000,000	1,129,357	0.03
SYARIKAT PRASARANA NEGAR 4.85% 27SEP2024	5,000,000	1,113,988	0.03
SYARIKAT PRASARANA NEGAR 5.07% 28SEP2029	5,000,000	1,174,235	0.03
		397,257,726	11.33

投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

非上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>南韓(0.28%)</b>			
(D) KOREA EXPRESSWAY CORP 2.549% 27FEB2030	10,000,000,000	7,450,600	0.21
KOREA EXPRESSWAY CORP 5.28% 07NOV2024	15,000,000	1,937,713	0.06
KOREA MINE REHABILITATION AND RESOURCES CORPORATION 2.09% 09MAR2025	3,000,000	379,066	0.01
		9,767,379	0.28
<b>泰國(9.34%)</b>			
BANK AGRICULTURE & AGRICULTURE COOP 2.62% 27JUL2031	40,000,000	1,168,113	0.03
BANK OF THAILAND BOND 1.63% 17MAY2024	100,000,000	2,933,684	0.08
ELEC GENERAT AUTH THAI 3.19% 01MAR2034	30,000,000	872,329	0.02
ELEC GENERAT AUTH THAI 3.72% 01MAR2042	30,000,000	826,902	0.02
GOVERNMENT HOUSING BANK 2.7% 13MAY2031	50,000,000	1,427,685	0.04
GOVERNMENT HOUSING BANK 2.97% 14DEC2027	100,000,000	2,928,995	0.08
GOVERNMENT HOUSING BANK 3.47% 27APR2032	50,000,000	1,482,486	0.04
THAILAND (GOVT OF) 2.25% 17MAR2027	220,000,000	6,464,007	0.18
THAILAND (GOVT OF) 2.4% 17MAR2029	220,000,000	6,473,424	0.18
THAILAND (GOVT OF) 1% 17JUN2027	495,000,000	13,850,213	0.40
THAILAND (GOVT OF) 1.585% 17DEC2035	400,000,000	10,392,031	0.30
THAILAND (GOVT OF) 1.6% 17DEC2029	370,000,000	10,320,769	0.29
THAILAND (GOVT OF) 1.6% 17JUN2035	150,000,000	3,915,947	0.11
THAILAND (GOVT OF) 1.875% 17JUN2049	140,000,000	3,015,769	0.09
THAILAND (GOVT OF) 2% 17DEC2031	550,000,000	15,412,131	0.44
THAILAND (GOVT OF) 2.35% 17JUN2026	385,000,000	11,290,110	0.32
THAILAND (GOVT OF) 2.5% 17JUN2071	30,000,000	610,070	0.02
THAILAND (GOVT OF) 2.65% 17JUN2028	350,000,000	10,362,208	0.30
THAILAND (GOVT OF) 2.75% 17JUN2052	115,000,000	2,923,070	0.08
THAILAND (GOVT OF) 3.14% 17JUN2047	10,000,000	282,434	0.01
THAILAND (GOVT OF) 3.35% 17JUN2033	450,000,000	13,947,334	0.40
THAILAND (GOVT OF) 3.39% 17JUN2037	250,000,000	7,775,249	0.22
THAILAND (GOVT OF) 3.4% 17JUN2036	346,000,000	10,698,278	0.31
THAILAND (GOVT OF) 3.45% 17JUN2043	230,000,000	7,067,157	0.20
THAILAND (GOVT OF) 3.58% 17DEC2027	168,000,000	5,144,699	0.15
THAILAND (GOVT OF) 3.65% 20JUN2031	348,000,000	10,908,176	0.31

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

#### 基本 – 按地理位置劃分 (續)

非上市債券 (續)	於31.12.2023 的持有量	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>泰國(9.34%) (續)</b>			
THAILAND (GOVT OF) 3.775% 25JUN2032	423,150,000	13,420,536	0.38
THAILAND (GOVT OF) 3.8% 14JUN2041	109,000,000	3,527,614	0.10
THAILAND (GOVT OF) 3.85% 12DEC2025	520,000,000	15,702,335	0.45
THAILAND (GOVT OF) 4% 17JUN2072	60,000,000	1,838,225	0.05
THAILAND (GOVT OF) 4.675% 29JUN2044	543,000,000	19,437,189	0.55
THAILAND (GOVT OF) 4.75% 20DEC2024	90,000,000	2,700,830	0.08
THAILAND (GOVT OF) 4.85% 17JUN2061	281,000,000	9,968,047	0.28
THAILAND (GOVT OF) 4.875% 22JUN2029	399,000,000	13,118,614	0.37
THAILAND (GOVT OF) 5.67% 13MAR2028	164,000,000	5,508,515	0.17
THAILAND (GOVT OF) 6.15% 07JUL2026	150,000,000	4,933,690	0.14
THAILAND GOVERNMENT BOND 0.95% 17JUN2025	420,000,000	12,065,562	0.35
THAILAND GOVERNMENT BOND 2% 17JUN2042	295,000,000	7,356,857	0.21
THAILAND GOVERNMENT BOND 2.125% 17DEC2026	310,000,000	9,031,623	0.26
THAILAND GOVERNMENT BOND 2.875% 17JUN2046	100,100,000	2,695,348	0.08
THAILAND GOVERNMENT BOND 3.3% 17JUN2038	382,150,000	11,709,814	0.33
THAILAND GOVERNMENT BOND 3.6% 17JUN2067	305,000,000	8,493,479	0.24
THAILAND GOVERNMENT BOND 4% 17JUN2066	380,000,000	11,609,839	0.34
THAILAND GOVT BOND 2.875% 17DEC2028	400,000,000	11,969,534	0.34
		<u>327,580,921</u>	<u>9.34</u>
報價債券總額		<u>3,508,108,208</u>	<u>100.02</u>
總債券		<u>3,508,108,208</u>	<u>100.02</u>
總債券，以成本計算		<u>3,661,238,660</u>	



投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>投資分佈</b>		
<b>(a) 下表概列於二零二三年十二月三十一日S&amp;P's或iBoxx對 基金債券作出的信貸評級</b>		
<b>按信貸評級</b>		
AAA	530,367,282	15.12
AA+	259,866,689	7.41
AA	536,561,811	15.30
A+	844,189,380	24.07
A	345,187,756	9.84
A-	311,230,100	8.87
BBB	332,007,692	9.47
BBB+	188,975,472	5.39
無評級	159,722,026	4.55
	<u>3,508,108,208</u>	<u>100.02</u>
<b>投資組合</b>		
<b>(b) 按資產類別</b>		
債券	<u>3,508,108,208</u>	<u>100.02</u>
	<u>3,508,108,208</u>	<u>100.02</u>
<b>(c) 按行業</b>		
基本物料	379,066	0.01
非週期性消費品	9,388,313	0.27
金融	357,835,302	10.20
政府部門	3,066,647,409	87.44
工業	69,868,816	1.99
公用事業	3,989,302	0.11
	<u>3,508,108,208</u>	<u>100.02</u>

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 投資組合 (續)

於二零二三年十二月三十一日 (未經審核)

#### 十大持股量

	於31.12.2023 的公平值 美元	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
SINGAPORE (GOVT OF) 2.125% 01JUN2026	37,139,347	1.06
SINGAPORE (GOVT OF) 3.5% 1MAR2027	31,265,458	0.89
SINGAPORE GOVERNMENT 0.5% 01NOV2025	28,876,591	0.82
PHILIPPINES (REP OF) 8% 19JUL2031	27,245,215	0.78
SINGAPORE GOVERNMENT 2.875% 01JUL2029	27,197,079	0.78
SINGAPORE GOVERNMENT 2.625% 01AUG2032	26,636,122	0.76
SINGAPORE (GOVT OF) 2.375% 01JUN2025	26,218,617	0.75
SINGAPORE (GOVT OF) 3.375% 01SEP2033	25,908,086	0.74
SINGAPORE GOVERNMENT 2.25% 01AUG2036	25,775,071	0.73
SINGAPORE GOVERNMENT 2.75% 01MAR2046	25,138,603	0.72
	<u>281,400,189</u>	<u>8.03</u>
	於30.06.2023 的公平值 美元	於30.06.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
HONG KONG MORTGAGE CORP 5% 25OCT2024	39,671,744	1.18
SINGAPORE (GOVT OF) 2.125% 01JUN2026	37,738,537	1.13
SINGAPORE (GOVT OF) 3% 01SEP2024	34,453,006	1.03
SINGAPORE GOVERNMENT 2.875% 01JUL2029	30,271,685	0.90
SINGAPORE (GOVT OF) 3.5% 01MAR2027	30,068,825	0.90
PHILIPPINES (REP OF) 8% 19JUL2031	27,146,452	0.81
SINGAPORE (GOVT OF) 2.375% 01JUN2025	26,875,633	0.80
SINGAPORE GOVERNMENT 2.75% 01MAR2046	25,488,885	0.76
SINGAPORE (GOVT OF) 3.375% 01SEP2033	24,469,783	0.73
SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030	23,850,021	0.71
	<u>300,034,571</u>	<u>8.95</u>

## 組合持股量變動報表

自二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間(未經審核)

	於31.12.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)	於30.06.2023 佔總資產淨值 的百分比 (%)
<b>報價投資</b>		
<b>債券</b>		
中國	25.50	25.71
香港	7.62	7.30
印尼	8.42	8.43
馬來西亞	11.33	11.39
菲律賓	6.12	6.59
新加坡	16.14	16.03
南韓	15.55	15.08
泰國	9.34	9.45
	<hr/>	<hr/>
<b>報價投資總額</b>	<b>100.02</b>	<b>99.98</b>
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>

## 相關指數成份股披露

於二零二三年十二月三十一日

基金的相關指數為Markit iBoxx ABF泛亞洲指數，其於二零二三年十二月三十一日並無任何佔指數10%以上的成份股。

於二零二三年七月一日至二零二三年十二月三十一日止期間內，Markit iBoxx ABF泛亞洲指數增長4.95%，而基金每單位資產淨值增長4.73%。

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）

下節乃根據新加坡金融管理局所頒佈之集體投資計劃守則及香港證券及期貨事務監察委員會所頒佈之單位信託及互惠基金守則之規定而披露。

#### (A) 持有的抵押品

於31.12.2023

抵押品提供者	抵押品提供者 的信貨評級 <sup>1</sup>	抵押品性質	非現金抵押品 的市值（如適用） 美元	抵押品公平值 美元
Nomura International PLC	A1	固定收入證券	108,797,707	<u>108,797,707</u>
				<u><u>108,797,707</u></u>

於30.06.2023

抵押品提供者	抵押品提供者 的信貨評級 <sup>1</sup>	抵押品性質	非現金抵押品 的市值（如適用） 美元	抵押品公平值 美元
Credit Suisse AG Singapore Branch	A1	固定收入證券	198,302,119	198,302,119
Nomura International PLC	Baa1	固定收入證券	353,097,547	<u>353,097,547</u>
				<u><u>551,399,666</u></u>

<sup>1</sup> 穆迪評級服務作出的信貨評級

證券借貸安排及持有的抵押品詳情(未經審核)(續)

(B) 固定收入抵押品的信貸評級

於31.12.2023

抵押品提供者	資產類別	評級機構	抵押品信貸	抵押品公平值 美元
			評級	
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	穆迪評級	A1	42,666,142
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	穆迪評級	A1	64,817,974
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	穆迪評級	A1	1,313,591
				<u>108,797,707</u>

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 證券借貸安排及持有的抵押品詳情(未經審核)(續)

#### (B) 固定收入抵押品的信貸評級(續)

於30.06.2023

抵押品提供者	資產類別	評級機構	抵押品信貸 評級	抵押品公平值 美元
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	穆迪評級	Aa2	32
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	穆迪評級	A1	122,279,614
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	穆迪評級	A1	7,843,377
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	穆迪評級	A1	5,708,595
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	穆迪評級	A1	8,586,269
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	穆迪評級	A1	5,725,926
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	穆迪評級	A1	6,083,936
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	穆迪評級	A1	11,293,127
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	穆迪評級	Aaa	30,781,243
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	穆迪評級	A1	73,203,313
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	穆迪評級	A1	31,140,374
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	穆迪評級	A1	3,372,510
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	穆迪評級	A1	5,555,247
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	穆迪評級	A1	7,995,223
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	穆迪評級	A1	32,363,264
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	穆迪評級	A1	39,606,629
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	穆迪評級	A1	72,837,412
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	穆迪評級	A1	15,469,202
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	穆迪評級	A1	71,554,373
				551,399,666



證券借貸安排及持有的抵押品詳情 (未經審核) (續)

(C) 證券借貸及購回交易分析

證券借貸交易

截至31.12.2023止期間

對手方	抵押品類別	貨幣	到期日期 <sup>2</sup>	抵押品提供者 的地理位置	結算 / 清算	已借出的證券 公平值 美元
Nomura International PLC	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	雙方抵押品	71,484,329
Nomura International PLC	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	雙方抵押品	210,399,619
Nomura International PLC	政府債券	泰銖	無固定期限	倫敦	雙方抵押品	24,032,782
						<u>305,916,730</u>

證券借貸安排及持有的抵押品詳情 (未經審核) (續)

(C) 證券借貸及購回交易分析 (續)

證券借貸交易 (續)

截至31.12.2022止期間

對手方	抵押品類別	貨幣	到期日期 <sup>2</sup>	抵押品提供者 的地理位置	結算 / 清算	已借出的證券 公平值 美元
Credit Suisse AG Singapore Branch	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	三方抵押品	11,730,284
Credit Suisse AG Singapore Branch	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	三方抵押品	7,001,941
Nomura International PLC	公司債券	港元	無固定期限	倫敦	雙方抵押品	19,480,993
Nomura International PLC	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	雙方抵押品	42,892,854
Nomura International PLC	公司債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	雙方抵押品	20,232,970
Nomura International PLC	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	雙方抵押品	53,127,771
Nomura International PLC	政府債券	泰銖	無固定期限	倫敦	雙方抵押品	64,469,206
						218,936,019

<sup>2</sup> 於期內 / 年內借出且未於截至二零二三年十二月三十一日及二零二三年六月三十日止期間 / 年度獲歸還的證券披露於下表。

證券借貸安排及持有的抵押品詳情(未經審核)(續)

(C) 證券借貸及購回交易分析(續)

證券借貸交易(續)

於31.12.2023

貸款抵押	抵押品		到期日期	代理人 地理位置	現金與 非現金		結算/ 清算	資產淨值 百分比	已借出的 證券 公平值 <sup>2</sup> 美元
	類別	貨幣			抵押品 的比例	抵押品 到期日期			
HONG KONG (GOVT OF) 2.95% 24FEB2025	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.10%	3,522,542
HONG KONG (GOVT OF) 0.8% 27AUG2027	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.02%	533,915
HONG KONG (GOVT OF) 1.49% 22FEB2028	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.01%	424,798
HONG KONG (GOVT OF) 2.48% 28FEB2029	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.04%	1,499,661
HONG KONG (GOVT OF) 2.24% 27AUG2029	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.04%	1,476,606
HONG KONG (GOVT OF) 1.68% 21JAN2026	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.18%	6,331,808
HONG KONG (GOVT OF) 1.68% 21JAN2026	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	參考下表	雙方抵押品	0.15%	5,352,405
HONG KONG (GOVT OF) 1.68% 21JAN2026	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.02%	542,726
HONG KONG (GOVT OF) 1.25% 29JUN2027	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.02%	602,384
HONG KONG (GOVT OF) 1.25% 29JUN2027	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.03%	1,090,315
HONG KONG (GOVT OF) 2.02% 07MAR2034	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.06%	2,169,530
HONG KONG (GOVT OF) 2.02% 07MAR2034	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.10%	3,644,811
HONG KONG (GOVT OF) 1.59% 04MAR2036	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.10%	3,314,041

證券借貸安排及持有的抵押品詳情 (未經審核) (續)

(C) 證券借貸及購回交易分析 (續)

證券借貸交易 (續)

於31.12.2023 (續)

貸款抵押	抵押品		到期日期	代理人 地理位置	現金與 非現金		結算/ 清算	資產淨值 百分比	已借出的 證券 公平值 <sup>2</sup> 美元
	類別	貨幣			抵押品	抵押品的 比例			
HONG KONG (GOVT OF) 1.59% 04MAR2036	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.03%	867,963	
HONG KONG (GOVT OF) 3.74% 12JAN2038	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.05%	1,863,863	
HONG KONG (GOVT OF) 3.74% 12JAN2038	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.04%	1,417,586	
HONG KONG (GOVT OF) 3.75% 24FEB2025	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.04%	1,535,915	
SINGAPORE (GOVT OF) 2.375% 01JUN2025	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.27%	9,593,767	
SINGAPORE GOVERNMENT 2.625% 01MAY2028	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.17%	6,006,449	
SINGAPORE (GOVT OF) 2.75% 01APR2042	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.13%	4,570,654	
SINGAPORE (GOVT OF) 3.375% 01SEP2033	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.17%	5,772,645	
SINGAPORE GOVERNMENT 1.25% 01NOV2026	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.16%	5,466,569	
SINGAPORE GOVERNMENT 2.875% 01SEP2027	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.28%	9,696,994	
SINGAPORE GOVERNMENT 2.625% 01AUG2032	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.54%	18,926,867	
SINGAPORE GOVERNMENT 2.875% 01AUG2028	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.17%	6,113,282	
							2.92%	102,338,096	

參考下表

證券借貸安排及持有的抵押品詳情(未經審核)(續)

(C) 證券借貸及購回交易分析(續)

證券借貸交易(續)

於30.06.2023

貸款抵押	抵押品		到期日期	代理人 地理位置	現金與 非現金		結算/ 清算	資產淨值 百分比	已借出的 證券 公平值 <sup>2</sup> 美元
	類別	貨幣			抵押品 的比例	非現金 抵押品的 到期日期			
HK GOVERNMENT BOND 2.39% 20AUG2025	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.10%	3,428,927
HONG KONG (GOVT OF) 0.8% 27AUG2027	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.04%	1,256,389
HONG KONG (GOVT OF) 0.8% 27AUG2027	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.07%	2,227,236
HONG KONG (GOVT OF) 1.25% 29JUN2027	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.02%	582,998
HONG KONG (GOVT OF) 1.25% 29JUN2027	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.03%	1,055,227
HONG KONG (GOVT OF) 1.49% 22FEB2028	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.01%	409,785
HONG KONG (GOVT OF) 1.51% 24FEB2027	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.10%	3,271,537
HONG KONG (GOVT OF) 1.51% 24FEB2027	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.05%	1,784,474
HONG KONG (GOVT OF) 1.59% 04MAR2036	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	參考下表	雙方抵押品	0.09%	3,131,711
HONG KONG (GOVT OF) 1.59% 04MAR2036	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.05%	1,789,549
HONG KONG (GOVT OF) 1.68% 21JAN2026	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.21%	7,172,403
HONG KONG (GOVT OF) 1.68% 21JAN2026	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.02%	610,417
HONG KONG (GOVT OF) 1.68% 21JAN2026	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.16%	5,237,380
HONG KONG (GOVT OF) 1.79% 14APR2025	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.09%	3,085,929
HONG KONG (GOVT OF) 1.79% 14APR2025	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.09%	3,085,929
HONG KONG (GOVT OF) 1.84% 09DEC2024	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.09%	2,910,104

證券借貸安排及持有的抵押品詳情(未經審核)(續)

(C) 證券借貸及購回交易分析(續)

證券借貸交易(續)

於30.06.2023(續)

貸款抵押	抵押品		到期日期	代理人 地理位置	現金與 非現金		結算/ 清算	資產淨值 百分比	已借出的 證券 公平值 <sup>2</sup> 美元
	類別	貨幣			抵押品 的比例	非現金 抵押品 的日期			
HONG KONG (GOVT OF) 1.84% 09DEC2024	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.04%	1,486,011	
HONG KONG (GOVT OF) 1.89% 02MAR2032	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.08%	2,539,304	
HONG KONG (GOVT OF) 1.89% 02MAR2032	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.15%	5,078,608	
HONG KONG (GOVT OF) 1.96% 03JUN2024	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.05%	1,597,481	
HONG KONG (GOVT OF) 1.96% 03JUN2024	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.04%	1,252,926	
HONG KONG (GOVT OF) 1.97% 17JAN2029	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.13%	4,414,283	
HONG KONG (GOVT OF) 1.97% 17JAN2029	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.07%	2,266,794	
HONG KONG (GOVT OF) 1.97% 17JAN2029	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.20%	6,561,772	
HONG KONG (GOVT OF) 2.02% 07MAR2034	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	參考下表 雙方抵押品	0.06%	2,066,290	
HONG KONG (GOVT OF) 2.02% 07MAR2034	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.10%	3,471,368	
HONG KONG (GOVT OF) 2.13% 16JUL2030	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.08%	2,618,972	
HONG KONG (GOVT OF) 2.13% 16JUL2030	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.14%	4,767,117	
HONG KONG (GOVT OF) 2.13% 16JUL2030	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.04%	1,177,066	
HONG KONG (GOVT OF) 2.22% 07AUG2024	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.05%	1,640,297	
HONG KONG (GOVT OF) 2.22% 07AUG2024	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.10%	3,469,859	
HONG KONG (GOVT OF) 2.6% 20AUG2024	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.10%	3,483,093	



證券借貸安排及持有的抵押品詳情(未經審核)(續)

(C) 證券借貸及購回交易分析(續)

證券借貸交易(續)

於30.06.2023(續)

貸款抵押	抵押品		到期日期	地理位置	現金與		結算/ 清算	資產淨值 百分比	已借出的 證券 公平值 <sup>2</sup> 美元
	類別	貨幣			證券借貸 代理人的 抵押品	非現金 抵押品的 到期日期			
HONG KONG (GOVT OF) 2.84% 22AUG2024	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.09%	2,859,211	
HONG KONG (GOVT OF) 2.95% 24FEB2025	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.02%	633,644	
HONG KONG (GOVT OF) 2.95% 24FEB2025	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.10%	3,485,045	
HONG KONG (GOVT OF) 2.95% 24FEB2025	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.04%	1,387,681	
HONG KONG (GOVT OF) 3.3% 26MAY2042	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.03%	856,701	
HONG KONG (GOVT OF) 3.32% 25FEB2026	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.08%	2,549,266	
HONG KONG (GOVT OF) 3.32% 25FEB2026	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.03%	841,258	
HONG KONG (GOVT OF) 3.32% 25FEB2026	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.02%	637,316	
HONG KONG (GOVT OF) 3.74% 12JAN2038	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.09%	3,164,544	
HONG KONG (GOVT OF) 4.55% 25NOV2024	政府債券	港元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.06%	1,935,298	
SINGAPORE (GOVT OF) 2.125% 01JUN2026	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	三方抵押品	0.32%	10,680,718	
SINGAPORE (GOVT OF) 2.125% 01JUN2026	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	三方抵押品	0.33%	10,979,778	
SINGAPORE (GOVT OF) 2.125% 01JUN2026	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	三方抵押品	0.24%	8,152,948	
SINGAPORE (GOVT OF) 2.375% 01JUN2025	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.05%	1,806,158	
SINGAPORE (GOVT OF) 2.375% 01JUN2025	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.09%	2,889,853	
SINGAPORE (GOVT OF) 2.375% 01JUN2025	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.04%	1,444,927	

參考下表

證券借貸安排及持有的抵押品詳情(未經審核)(續)

(C) 證券借貸及購回交易分析(續)

證券借貸交易(續)

於30.06.2023(續)

貸款抵押	抵押品		現金與				結算/ 清算	資產淨值 百分比	已借出的 證券 公平值 <sup>2</sup> 美元
	類別	貨幣	到期日期	代理人 地理位置	非現金 抵押品 的比例	非現金 抵押品 的日期			
SINGAPORE (GOVT OF) 2.375% 01JUN2025	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.07%	2,456,375
SINGAPORE (GOVT OF) 2.375% 01JUN2025	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.12%	4,045,794
SINGAPORE (GOVT OF) 2.375% 01JUN2025	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.20%	6,863,401
SINGAPORE (GOVT OF) 2.75% 01APR2042	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.16%	5,311,430
SINGAPORE (GOVT OF) 2.75% 01APR2042	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.25%	8,382,458
SINGAPORE (GOVT OF) 2.75% 01APR2042	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.04%	1,371,675
SINGAPORE (GOVT OF) 2.75% 01APR2042	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.08%	2,667,146
SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.21%	6,898,160
SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	參考下表	雙方抵押品	0.02%	550,385
SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.04%	1,174,155
SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.02%	807,231
SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.03%	880,616
SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.04%	1,467,694
SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.21%	7,044,929
SINGAPORE (GOVT OF) 3% 01SEP2024	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.61%	20,288,173
SINGAPORE (GOVT OF) 3% 01SEP2024	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.12%	3,939,594

證券借貸安排及持有的抵押品詳情(未經審核)(續)

(C) 證券借貸及購回交易分析(續)

證券借貸交易(續)

於30.06.2023(續)

貸款抵押	抵押品		到期日期	代理人 地理位置	現金與 非現金		結算/ 清算	資產淨值 百分比	已借出的 證券 公平值 <sup>1</sup> 美元
	類別	貨幣			抵押品 的比例	抵押品的 到期日期			
SINGAPORE (GOVT OF) 3% 01SEP2024	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.09%	2,951,007	
SINGAPORE (GOVT OF) 3.375% 01SEP2033	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.22%	7,516,811	
SINGAPORE (GOVT OF) 3.375% 01SEP2033	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.05%	1,529,361	
SINGAPORE (GOVT OF) 3.375% 01SEP2033	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.31%	10,284,956	
SINGAPORE (GOVT OF) 3.5% 01MAR2027	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	三方抵押品	0.45%	15,034,413	
SINGAPORE (GOVT OF) 3.5% 01MAR2027	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	三方抵押品	0.26%	8,719,959	
SINGAPORE GOVERNMENT 0.5% 01NOV2025	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.19%	6,522,480	
SINGAPORE GOVERNMENT 0.5% 01NOV2025	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.12%	3,960,323	
SINGAPORE GOVERNMENT 0.5% 01NOV2025	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.12%	4,132,511	
SINGAPORE GOVERNMENT 0.5% 01NOV2025	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.05%	1,763,205	
SINGAPORE GOVERNMENT 0.5% 01NOV2025	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.01%	344,376	
SINGAPORE GOVERNMENT 0.5% 01NOV2025	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.02%	688,752	
SINGAPORE GOVERNMENT 1.25% 01NOV2026	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.16%	5,206,960	
SINGAPORE GOVERNMENT 1.25% 01NOV2026	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.27%	8,977,518	
SINGAPORE GOVERNMENT 1.625% 01JUL2031	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.27%	8,913,427	
SINGAPORE GOVERNMENT 1.625% 01JUL2031	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	雙方抵押品	0.04%	1,335,845	

參考下表

# 沛富基金

二零二三年中期業績報告

## 證券借貸安排及持有的抵押品詳情(未經審核)(續)

### (C) 證券借貸及購回交易分析(續)

#### 證券借貸交易(續)

於30.06.2023(續)

貸款抵押	抵押品		現金與					已借出的 證券 公平值 <sup>2</sup> 美元	
	類別	貨幣	到期日期	證券借貸 代理人的 地理位置	非現金 抵押品 的比例	非現金 抵押品的 到期日期	結算/ 資產淨值 百分比		
SINGAPORE GOVERNMENT 1.625% 01JUL2031	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.12%	4,174,516
SINGAPORE GOVERNMENT 1.625% 01JUL2031	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.05%	1,669,807
SINGAPORE GOVERNMENT 1.875% 01MAR2050	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.25%	8,375,542
SINGAPORE GOVERNMENT 1.875% 01MAR2050	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.24%	8,192,040
SINGAPORE GOVERNMENT 1.875% 01OCT2051	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.20%	6,631,962
SINGAPORE GOVERNMENT 1.875% 01OCT2051	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.08%	2,818,584
SINGAPORE GOVERNMENT 1.875% 01OCT2051	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.03%	911,895
SINGAPORE GOVERNMENT 2.25% 01AUG2036	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%	參考下表	雙方抵押品	0.16%	5,516,365
SINGAPORE GOVERNMENT 2.25% 01AUG2036	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.03%	1,034,318
SINGAPORE GOVERNMENT 2.25% 01AUG2036	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.28%	9,481,252
SINGAPORE GOVERNMENT 2.375% 01JUL2039	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.09%	2,876,438
SINGAPORE GOVERNMENT 2.375% 01JUL2039	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.07%	2,479,688
SINGAPORE GOVERNMENT 2.375% 01JUL2039	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.07%	2,479,688
SINGAPORE GOVERNMENT 2.625% 01AUG2032	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.53%	17,898,187
SINGAPORE GOVERNMENT 2.625% 01MAY2028	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.17%	5,723,209
SINGAPORE GOVERNMENT 2.625% 01MAY2028	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.34%	11,446,418

證券借貸安排及持有的抵押品詳情(未經審核)(續)

(C) 證券借貸及購回交易分析(續)

證券借貸交易(續)

於30.06.2023(續)

貸款抵押	抵押品		到期日期	代理人 地理位置	現金與 非現金		結算/ 清算	資產淨值 百分比	已借出的 證券 公平值 <sup>2</sup> 美元
	類別	貨幣			抵押品 的比例	抵押品 到期日期			
SINGAPORE GOVERNMENT 2.75% 01MAR2046	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.53%	17,764,980
SINGAPORE GOVERNMENT 2.875% 01JUL2029	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.53%	17,860,294
SINGAPORE GOVERNMENT 2.875% 01JUL2029	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.18%	6,054,337
SINGAPORE GOVERNMENT 2.875% 01SEP2027	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.34%	11,494,148
SINGAPORE GOVERNMENT 3% 01AUG2072	政府債券	新加坡元	無固定期限	倫敦	0%		三方抵押品	0.12%	3,930,947
THAILAND (GOVT OF) 1% 17JUN2027	政府債券	泰銖	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.07%	2,332,716
THAILAND (GOVT OF) 1% 17JUN2027	政府債券	泰銖	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.13%	4,303,459
THAILAND (GOVT OF) 1.585% 17DEC2035	政府債券	泰銖	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.12%	3,961,212
THAILAND (GOVT OF) 2% 17DEC2031	政府債券	泰銖	無固定期限	倫敦	0%	參考下表	雙方抵押品	0.16%	5,229,971
THAILAND (GOVT OF) 2.65% 17JUN2028	政府債券	泰銖	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.11%	3,576,170
THAILAND (GOVT OF) 3.4% 17JUN2036	政府債券	泰銖	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.15%	5,189,878
THAILAND (GOVT OF) 3.58% 17DEC2027	政府債券	泰銖	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.07%	2,495,258
THAILAND (GOVT OF) 3.65% 20JUN2031	政府債券	泰銖	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.16%	5,320,763
THAILAND (GOVT OF) 5.67% 13MAR2028	政府債券	泰銖	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.08%	2,691,159
THAILAND (GOVT OF) 6.15% 07JUL2026	政府債券	泰銖	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.02%	805,151
THAILAND GOVERNMENT BOND 2.125% 17DEC2026	政府債券	泰銖	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.09%	2,946,652

證券借貸安排及持有的抵押品詳情 (未經審核) (續)

(C) 證券借貸及購回交易分析 (續)

證券借貸交易 (續)

於30.06.2023 (續)

貸款抵押	抵押品		到期日期	現金與 證券借貸 代理人的 地理位置	非現金 抵押品的 比例	非現金 抵押品的 到期日期	結算/ 清算	資產淨值 百分比	已借出的 證券 公平值 <sup>3</sup> 美元
	類別	貨幣							
THAILAND GOVERNMENT BOND 0.95% 17JUN2025	政府債券	泰銖	無固定期限	倫敦	0%		雙方抵押品	0.17%	5,773,500
THAILAND GOVERNMENT BOND 3.3% 17JUN2038	政府債券	泰銖	無固定期限	倫敦	0%	參考下表	雙方抵押品	0.17%	5,660,654
								15.04%	504,367,860

<sup>3</sup> 已借出的證券的資料乃根據基金會計記錄作出。外幣交易按換算日期通行的匯率換算為功能貨幣。而資產及負債按期終當日通行的匯率換算為功能貨幣。



證券借貸安排及持有的抵押品詳情(未經審核)(續)

(C) 證券借貸及購回交易分析(續)

證券借貸交易的抵押品

於31.12.2023

抵押品提供者	抵押品類別	貨幣	到期日期	抵押品提供者的地理位置	現金與非現金抵押品的比例	非現金抵押品的到期日期	結算/清算	抵押品所覆蓋之資產淨值百分比	抵押品公平值 美元
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零二四年一月十日	雙方抵押品	1.22%	42,666,142
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零二四年二月十三日	雙方抵押品	1.85%	64,817,974
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零二四年一月二十二日	雙方抵押品	0.04%	1,313,591
								<u>3.11%</u>	<u>108,797,707</u>

於30.06.2023

抵押品提供者	抵押品類別	貨幣	到期日期	抵押品提供者的地理位置	現金與非現金抵押品的比例	非現金抵押品的到期日期	結算/清算	抵押品所覆蓋之資產淨值百分比	抵押品公平值 美元
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	歐元	無固定期限	倫敦	0%	二零三一年五月二十五日	三方抵押品	0.00%	32
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零二七年九月二十日	三方抵押品	0.23%	7,843,377
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零二七年六月二十日	三方抵押品	0.17%	5,708,595
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零三五年六月二十日	三方抵押品	0.26%	8,586,269
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零三八年三月二十日	三方抵押品	0.17%	5,725,926
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零四八年三月二十日	三方抵押品	0.18%	6,083,936
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零四九年九月二十日	三方抵押品	0.34%	11,293,127

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 證券借貸安排及持有的抵押品詳情(未經審核)(續)

#### (C) 證券借貸及購回交易分析(續)

##### 證券借貸交易的抵押品(續)

於30.06.2023(續)

抵押品提供者	抵押品類別	貨幣	到期日期	抵押品提供者的地理位置	現金與非現金抵押品的比例	非現金抵押品的到期日期	結算/清算	抵押品所覆蓋之資產淨值百分比	抵押品公平值 美元
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零二七年九月二十日	三方抵押品	3.65%	122,279,614
CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH	政府債券	美元	無固定期限	倫敦	0%	二零二四年一月十五日	三方抵押品	0.92%	30,781,243
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零二八年三月二十日	雙方抵押品	2.18%	73,203,313
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零二四年九月二十日	雙方抵押品	0.93%	31,140,374
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零二三年三月二十日	雙方抵押品	0.10%	3,372,510
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零二九年三月十日	雙方抵押品	0.17%	5,555,247
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零二三年三月二十日	雙方抵押品	0.24%	7,995,223
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零四零年三月二十日	雙方抵押品	0.97%	32,363,264
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零二三年八月十日	雙方抵押品	1.18%	39,606,629
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零二三年八月二十八日	雙方抵押品	2.17%	72,837,412
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零二三年九月四日	雙方抵押品	0.46%	15,469,202
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府債券	日元	無固定期限	倫敦	0%	二零二三年九月十一日	雙方抵押品	2.13%	71,554,373
								<u>16.45%</u>	<u>551,399,666</u>

#### 購回交易

不適用。

證券借貸安排及持有的抵押品詳情 (未經審核) (續)

(D) 已借出的可轉讓證券

於31.12.2023

已借出的可轉讓 證券總值 <sup>3</sup> 美元	借出證券數額 佔可借出資產總值 的比例 <sup>3</sup> %	借出證券數額 佔基金管理資產 的比例 <sup>3</sup> %	購回交易的 絕對金額 美元
102,338,096	9.1499	2.9179	不適用

於30.06.2023

已借出的可轉讓 證券總值 <sup>3</sup> 美元	借出證券數額 佔可借出資產總值 的比例 <sup>3</sup> %	借出證券數額 佔基金管理資產 的比例 <sup>3</sup> %	購回交易的 絕對金額 美元
504,367,860	47.7579	15.044	不適用

<sup>3</sup> 已借出的證券的資料乃根據基金會計記錄作出。外幣交易按換算日期通行的匯率換算為功能貨幣。而資產及負債按期終當日通行的匯率換算為功能貨幣。

(E) 以現金抵押品作出的投資

不適用。於二零二三年十二月三十一日及二零二三年六月三十日，基金並無收取任何現金抵押品。

(F) 與最高授權金額 (若有) 相比，被重新使用或重新抵押的已收抵押品所佔的份額，以及有關證券類別的任何限制資料 (若適用)

於截至二零二三年及二零二二年十二月三十一日止期間內，概無所佔已收抵押品已就貸款抵押被重新使用或重新抵押。

證券借貸安排及持有的抵押品詳情(未經審核)(續)

(G) 十大抵押品發行人

	抵押品公平值 美元	佔總資產淨值 的百分比 %
於31.12.2023		
Nomura International PLC	<u>108,797,707</u>	<u>3.1021%</u>
	<u><u>108,797,707</u></u>	<u><u>3.1021%</u></u>
於30.06.2023		
Credit Suisse AG Singapore Branch	198,302,119	5.9148%
Nomura International PLC	<u>353,097,547</u>	<u>10.5320%</u>
	<u><u>551,399,666</u></u>	<u><u>16.4468%</u></u>

證券借貸安排及持有的抵押品詳情 (未經審核) (續)

(H) 基金收取的十大抵押證券

	公平值 美元	佔總資產淨值的 百分比 %
於31.12.2023		
JAPAN JPGV 0.600 03/20/23	64,817,974	1.8481%
JAPAN JPGV 02/27/23	42,666,142	1.2165%
JAPAN JPGV 0.005 03/10/31	1,313,591	0.0375%
	<u>108,797,707</u>	<u>3.1021%</u>
於30.06.2023		
JAPAN JPGV 0.100 09/20/27	130,122,991	3.8812%
JAPAN JPGV 0.100 03/20/28	73,203,313	2.1835%
JAPAN JPGV 08/28/23	72,837,412	2.1726%
JAPAN JPGV 09/11/23	71,554,373	2.1343%
JAPAN JPGV 08/10/23	39,606,629	1.1814%
JAPAN JPGV 0.400 03/20/40	32,363,264	0.9653%
JAPAN JPGV 0.500 09/20/24	31,140,374	0.9288%
US TREASURY UST 0.625 01/15/24	30,781,243	0.9181%
JAPAN JPGV 09/04/23	15,469,202	0.4614%
JAPAN JPGV 0.400 09/20/49	11,293,127	0.3368%
	<u>508,371,928</u>	<u>15.1634%</u>

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 證券借貸安排及持有的抵押品詳情 (未經審核) (續)

#### (i) 證券借貸及購回交易的十大交易對手

	借出證券之公平值 <sup>3</sup> 美元	佔總資產淨值 的百分比 <sup>3</sup> %
於31.12.2023		
Nomura International PLC	102,338,096	2.9179%
	<u>102,338,096</u>	<u>2.9179%</u>
於30.06.2023		
Credit Suisse AG Singapore Branch	57,498,763	1.7150%
Nomura International PLC	446,869,097	13.3290%
	<u>504,367,860</u>	<u>15.0440%</u>

<sup>3</sup> 已借出的證券的資料乃根據基金會計記錄作出。外幣交易按換算日期通行的匯率換算為功能貨幣。而資產及負債按期終當日通行的匯率換算為功能貨幣。



證券借貸安排及持有的抵押品詳情 (未經審核) (續)

(J) 託管人及每位託管人持有的資產數額

	於31.12.2023 的公平值 美元	於30.06.2023 的公平值 美元
抵押證券的託管人		
英國滙豐銀行有限公司 <sup>4</sup>	108,797,707	353,097,547
JP Morgan Bank Luxembourg S.A. <sup>6</sup>	—	198,302,119
	<u>108,797,707</u>	<u>551,399,666</u>
向借款方提供的證券借貸的託管人 <sup>3, 5</sup>		
英國滙豐銀行有限公司	<u>102,338,096</u>	<u>504,367,860</u>

<sup>3</sup> 已借出的證券的資料乃根據基金會計記錄作出。外幣交易按換算日期通行的匯率換算為功能貨幣。而資產及負債按期終當日通行的匯率換算為功能貨幣。

<sup>4</sup> 抵押品由英國滙豐銀行有限公司根據雙方抵押品託管安排以獨立賬戶持有。

<sup>5</sup> 向借方提供的所有證券借貸均以獨立賬戶持有。英國滙豐銀行有限公司作為證券借貸代理以安排貸款交易並管理抵押品。

<sup>6</sup> JP Morgan Bank Luxembourg S.A. 為一間三方抵押品經理人，證券借貸代理英國滙豐銀行有限公司向其轉授若干抵押品管理、保證金融資及託管職能。

## 沛富基金

二零二三年中期業績報告

### 證券借貸安排及持有的抵押品詳情(未經審核)(續)

#### (K) 基金證券借貸所賺取的收入

	截至31.12.2023 止期間 美元	截至31.12.2022 止期間 美元
基金所賺取的收入	151,772	186,831
經理人所賺取的收入	—	—
	<u>151,772</u>	<u>186,831</u>

#### (L) 在證券借貸及購回交易的回報與現金抵押品再投資的回報之間進行分配

	截至31.12.2023 止期間 美元	截至31.12.2022 止期間 美元
證券借貸及購回交易的回報	151,772	186,831
現金抵押品再投資的回報	—	—

## 行政及管理層

### 經理人的董事

Kheng Siang Ng先生  
Kevin David Anderson先生  
Louis Anthony Boscia先生

### 監察委員會成員

Michele Bullock女士  
Tokiko Shimizu女士  
Mathee Supapongse先生  
(於二零二三年九月退任)  
Alisara Mahasandana女士  
Darryl Chan先生  
Xuan Changneng博士  
Christian Hawkesby先生  
Lorelei Fernandez女士  
Maria Ramona Gertrudes T. Santiago夫人  
(於二零二三年十一月辭任)  
Aida S Budiman女士  
Abdul Rasheed Ghaffour先生  
(於二零二三年八月辭任)  
Marzunisham Omar先生  
(於二零二三年八月獲委任)  
Leong Sing Chiong先生  
Woong Kim先生

### 信託人

滙豐機構信託服務(新加坡)有限公司  
10 Marina Boulevard  
Marina Bay Financial Centre  
Tower 2, #48-01  
Singapore 018983

### 託管人、行政管理人、過戶登記處 及收款代理人

滙豐機構信託服務(亞洲)有限公司  
香港  
皇后大道中1號  
滙豐總行大廈

### 經理人

道富環球投資管理新加坡有限公司

新加坡辦事處：  
168 Robinson Road  
#33-01 Capital Tower  
Singapore 068912

香港分行辦事處：  
香港  
中環  
金融街8號  
國際金融中心二期68樓

### 服務代理人

HK Conversion Agency Services Limited  
香港  
中環  
港景街1號  
國際金融中心一期10樓

### 核數師

PricewaterhouseCoopers LLP  
7 Straits View  
Marina One, East Tower  
Level 12  
Singapore 018936