



高腾亚洲收益基金

（高腾微基金的子基金）

半年度报告（未经审计）

截至 2024 年 6 月 30 日

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

目录

	页码
管理和行政	1
财务状况表 (未经审计)	2
损益表及其他综合收益表 (未经审计)	3
基金份额持有人应占净资产净值变动表 (未经审计)	4 - 7
财务报表附注 (未经审计)	8 - 14
投资组合明细表 (未经审计)	15 - 18
投资组合所持投资项目变动表 (未经审计)	19

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

管理和行政

管理人
高腾国际资产管理有限公司
万宜大厦 21 楼 2105-07 室
德辅道中 68 号
香港中环

基金管理人董事
毕万英
李宇

基金管理人律师
的近律师行
历山大厦 5 楼
遮打道 18 号
香港中环

受托人、基金登记机构和转让代理人
中国工商银行(亚洲)信托有限公司
中国工商银行大厦 33 楼
花园道 3 号
香港中环

保管人
中国工商银行(亚洲)有限公司
中国工商银行大厦 33 楼
花园道 3 号
香港中环

审计师
安永会计师事务所
太古坊一号 27 楼
英皇道 979 号
香港鲗鱼涌

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

财务状况表 (未经审计)

截至 2024 年 6 月 30 日

	2024 年 6 月 30 日 美元	2023 年 12 月 31 日 美元
资产		
预付款项	283	7,515
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		
- 债务证券	35,711,366	33,186,778
- 货币远期合约	25,609	13,401
- 集体投资计划	1,787,968	5,198,142
应收利息		
- 债务证券	392,621	509,361
应收认购款	6,610,879	25,903
应收经纪款项	25,019,702	1,028,156
现金和现金等价物	4,231,416	276,304
其他应收款	17,900	37,356
资产合计	<u>73,797,744</u>	<u>40,282,917</u>
负债		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		
- 货币远期合约	1,782	22,223
- 商品期货	-	14,219
应付赎回款项	20,661	54,283
应付管理费	62,176	23,248
应付受托人费用	5,192	6,091
应付交易手续费	19,845	15,555
应付经纪款项	31,044,787	590,303
其他应付款	35,500	50,731
负债总额 (不包括基金份额持有人应占资产净值)	<u>31,189,943</u>	<u>776,653</u>
基金份额持有人应占资产净值	<u>42,607,801</u>	<u>39,506,264</u>
负债合计	<u>73,797,744</u>	<u>40,282,917</u>

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

损益表及其他综合收益表 (未经审计)

截至 2024 年 6 月 30 日

	截至 2024 年 6 月 30 日 美元	截至 2023 年 6 月 30 日 美元
收益		
债务证券利息收入	1,031,964	1,309,938
银行利息收入	1,275	4,896
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净收益	186,754	1,164,742
外币净收益	862	277,108
其他收益	23,855	56,868
总收益	1,244,710	2,813,552
支出		
管理费#	(125,541)	(195,312)
受托人费用*	(16,025)	(26,458)
行政费*	(37,409)	(38,609)
审计师报酬	(13,575)	(13,015)
法律和专业费用	(1,353)	(5,406)
保管人费用*	(4,467)	(7,493)
交易成本	(18)	(385)
交易手续费*	(55,450)	(51,855)
其他费用	(24,122)	(753,633)
费用报销^	21,735	23,906
总费用	(256,225)	(1,068,260)
税前利润	988,485	1,745,292
预缴税金	-	-
本报告期间基金份额持有人应占净资产增加额	988,485	1,745,292

已支付/应付给基金管理人的费用。

* 已支付/应付给受托人、保管人或其关联人士的费用。

^ 由管理人自愿承担的费用。

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

基金份额持有人应占净资产净值变动表 (未经审计)

截至2024年6月30日

	A类港元对冲 (累积) 美元	A类港元对冲 (派息) 美元	A类美元 (累积) 美元	A类美元 (派息) 美元	B类美元 (累积) 美元	I类离岸人民币对冲 (累积) 美元	I类美元 (累积) 美元
于2024年1月1日	5,667,004	5,713,038	5,346,454	6,915,681	5,109,460	272,809	9,237,766
认购份额 [^]	80,653	173,643	522,268	116,259	-	-	-
赎回份额	(1,135,474)	(775,462)	(1,302,252)	(2,726,738)	-	-	(2,346,023)
股利	-	(141,770)	-	(146,601)	-	-	-
	4,612,183	4,969,449	4,566,470	4,158,601	5,109,460	272,809	6,891,743
基金份额持有人应占 净资产增加/减少额	131,379	124,616	149,017	163,034	172,628	(1,618)	228,785
于2024年6月30日	4,743,562	5,094,065	4,715,487	4,321,635	5,282,088	271,191	7,120,528
	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额
于2024年1月1日	4,725,037.92	5,619,433.03	509,056.49	926,663.85	510,655.32	196,276.22	878,529.62
认购份额 [^]	66,422.28	171,757.68	49,239.85	15,689.15	-	-	-
赎回份额	(930,719.31)	(769,328.27)	(122,261.01)	(364,611.65)	-	-	(222,506.74)
于2024年6月30日	3,860,740.89	5,021,862.44	436,035.33	577,741.35	510,655.32	196,276.22	656,022.88

[^]包括股息再投资

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

基金份额持有人应占净资产净值变动表 (未经审计) (续)

截至2024年6月30日

	M类人民币 (累积) 美元	M类人民币对冲 (累积) 美元	总计 美元
于2024年1月1日	1,244,052	-	39,506,264
认购份额 [^]	9,087,379	707,184	10,687,386
赎回份额	(14)	-	(8,285,963)
股利	-	-	(288,371)
	<u>10,331,417</u>	<u>707,184</u>	<u>41,619,316</u>
基金份额持有人应占 净资产增加/减少额	20,634	10	988,485
于2024年6月30日	<u>10,352,051</u>	<u>707,194</u>	<u>42,607,801</u>
	基金份额	基金份额	
于2024年1月1日	998,851.17	-	
认购份额 [^]	7,086,935.22	577,524.57	
赎回份额	(10.82)	-	
于2024年6月30日	<u>8,085,775.57</u>	<u>577,524.57</u>	

[^]包括股息再投资

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

基金份额持有人应占净资产净值变动表 (未经审计) (续)

截至2023年6月30日

	A类港元对冲 (累积) 美元	A类港元对冲 (派息) 美元	A类美元 (累积) 美元	A类美元 (派息) 美元	B类美元 (累积) 美元	I类离岸人民币对冲 (累积) 美元	I类美元 (累积) 美元
于2023年1月1日	6,173,679	7,187,352	6,870,179	8,698,394	21,037,159	280,196	23,841,886
认购份额 [^]	190,542	306,628	358,236	72,786	-	-	464,339
赎回份额	(393,251)	(493,073)	(1,346,830)	(686,643)	(21,908,380)	-	(296,667)
股利	-	(195,580)	-	(232,941)	-	-	-
	5,970,970	6,805,327	5,881,585	7,851,596	(871,221)	280,196	24,009,558
基金份额持有人应占 净资产增加/减少额	39,093	59,685	151,329	172,017	871,221	(12,802)	498,407
于2023年6月30日	6,010,063	6,865,012	6,032,914	8,023,613	-	267,394	24,507,965
	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额	基金份额
于2023年1月1日	5,217,851.04	6,802,905.42	671,197.08	1,133,368.98	2,220,074.72	196,276.22	2,339,689.85
认购份额 [^]	155,311.25	282,000.85	33,564.18	9,221.39	-	-	32,198.71
赎回份额	(323,513.54)	(461,322.34)	(126,092.88)	(88,238.37)	(2,220,074.72)	-	(16,992.35)
于2023年6月30日	5,049,648.75	6,623,583.93	578,668.38	1,054,352.00	-	196,276.22	2,354,896.21

[^] 包括股息再投资

高腾亚洲收益基金
 (高腾微基金的子基金)

基金份额持有人应占净资产净值变动表 (未经审计) (续)

截至2023年6月30日

	M类人民币 (累积) 美元	M类人民币对冲 (累积) 美元	总计 美元
于2023年1月1日	1,212,424	1,780,044	77,081,313
认购份额 [^]	-	-	1,392,531
赎回份额	-	(873,585)	(25,998,429)
股利	-	-	(428,521)
	<u>1,212,424</u>	<u>906,459</u>	<u>52,046,894</u>
基金份额持有人应占 净资产增加/减少额	22,462	(56,120)	1,745,292
于2023年6月30日	<u>1,234,886</u>	<u>850,339</u>	<u>53,792,186</u>
	基金份额	基金份额	
于2023年1月1日	998,851.17	1,496,410.24	
认购份额 [^]	-	-	
赎回份额	-	(747,700.00)	
于2023年6月30日	<u>998,851.17</u>	<u>748,710.24</u>	

[^] 包括股息再投资

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

财务报表附注(未经审计)

1. 重要会计政策摘要

高腾亚洲受益基金(以下简称“子基金”)的中期财务报表采用与子基金年度财务报表相同的会计政策及计算方法。

2. 向基金份额持有人分配收益

基金管理人可在考虑子基金的净收益及资本资产后酌情按其认为适当的情况每月向基金份额持有人分配收益。

截至 2024 年 6 月 30 日

	美元
截至 2024 年 1 月 1 日的未分配收益	-
本报告期间基金份额持有人应占净资产增加额	988,485
减: 外币净收益	(862)
减: 金融资产以公允价值计入当期损益的未变现盈利净额	<u>(1,547,450)</u>
本报告期间收益分配前的未分配损失	(559,827)
本报告期间向基金份额持有人分配收益	<u>(288,371)</u>
于 2024 年 6 月 30 日	<u>(848,198)</u>

截至 2023 年 6 月 30 日

	美元
截至 2023 年 1 月 1 日的未分配收益	64,433
本报告期间基金份额持有人应占净资产增加额	1,745,292
减: 外币净收益	(277,108)
减: 金融资产以公允价值计入当期损益的未变现盈利净额	<u>(2,846,334)</u>
本报告期间收益分配前的未分配损失	(1,313,717)
本报告期间向基金份额持有人分配收益	<u>(428,521)</u>
于 2023 年 6 月 30 日	<u>(1,742,238)</u>

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

财务报表附注(未经审计)(续)

2. 向基金份额持有人分配收益(续)

	2024 美元
A类港元对冲(派息)	
2024年1月12日按每基金份额0.0352港元支付	25,414
2024年2月14日按每基金份额0.0352港元支付	24,101
2024年3月13日按每基金份额0.0352港元支付	23,504
2024年4月15日按每基金份额0.0352港元支付	23,414
2024年5月14日按每基金份额0.0352港元支付	22,727
2024年6月13日按每基金份额0.0352港元支付	22,610
	<hr/> 141,770
A类美元(派息)	
2024年1月12日按每基金份额0.0333港元支付	30,858
2024年2月14日按每基金份额0.0333港元支付	31,035
2024年3月13日按每基金份额0.0334港元支付	21,628
2024年4月15日按每基金份额0.0335港元支付	21,163
2024年5月14日按每基金份额0.0335港元支付	21,005
2024年6月13日按每基金份额0.0335港元支付	20,912
	<hr/> 146,601
总计	<hr/> <hr/> 288,371

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

财务报表附注(未经审计)(续)

2. 向基金份额持有人分配收益(续)

	2023 美元
A类港元对冲(派息)	
2023年1月12日按每基金份额0.0367港元支付	31,938
2023年2月15日按每基金份额0.0392港元支付	34,491
2023年3月15日按每基金份额0.0377港元支付	32,890
2023年4月13日按每基金份额0.0377港元支付	32,939
2023年5月17日按每基金份额0.0369港元支付	31,781
2023年6月14日按每基金份额0.0368港元支付	31,541
	<u>195,580</u>
A类美元(派息)	
2023年1月12日按每基金份额0.0344港元支付	38,990
2023年2月15日按每基金份额0.0364港元支付	41,175
2023年3月15日按每基金份额0.0356港元支付	40,498
2023年4月13日按每基金份额0.0350港元支付	39,612
2023年5月17日按每基金份额0.0347港元支付	36,628
2023年6月14日按每基金份额0.0342港元支付	36,038
	<u>232,941</u>
总计	<u><u>428,521</u></u>

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

财务报表附注(未经审计)(续)

3. 基金份额持有人应占资产净值

对于分别发行或回购的基金份额,收到或支付的对价基于子基金在交易日的基金份额资产净值。根据信托契约的规定,基于最终交易的市场价格或收盘价,对子基金投资头寸进行估值以确定认购和赎回的每一基金份额交易资产净值。子基金的基金份额资产净值的计算方法是将子基金的净资产除以未偿基金份额总数。

可赎回基金份额可在每个估值日(即历年来的每个工作日)发行和赎回。可赎回份额持有人可在工作日下午 4 时之前(香港时间)认购或赎回可赎回份额。认购及赎回价格均参照估值日有关类别的每一基金份额资产净值计算。

为保护所有份额持有人的利益,基金管理人可将任一赎回日赎回的任何子基金份额数量限制在相关已发行子基金份额总数的 10%。在此情况下,有关限额将按比例适用,以便所有在赎回当日提出有效赎回要求的有关子基金份额持有人可赎回相同比例的基金份额。

每一基金份额资产净值计算如下:

	2024年6月30日	2023年12月31日
基金份额持有人应占资产净值(美元)		
A类港元对冲(累积)	4,743,562	5,667,004
A类港元对冲(派息)	5,094,065	5,713,038
A类美元(累积)	4,715,487	5,346,454
A类美元(派息)	4,321,635	6,915,681
B类美元(累积)	5,282,088	5,109,460
I类离岸人民币对冲(累积)	271,191	272,809
I类美元(累积)	7,120,528	9,237,766
M类人民币(累积)	10,352,051	1,244,052
M类人民币对冲(累积)	707,194	-
发行的基金份额数量(基金份额)		
A类港元对冲(累积)	3,860,740.89	4,725,037.92
A类港元对冲(派息)	5,021,862.44	5,619,433.03
A类美元(累积)	436,035.33	509,056.49
A类美元(派息)	577,741.35	926,663.85
B类美元(累积)	510,655.32	510,655.32
I类离岸人民币对冲(累积)	196,276.22	196,276.22
I类美元(累积)	656,022.88	878,529.62
M类人民币(累积)	8,085,775.57	998,851.17
M类人民币对冲(累积)	577,524.57	-

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

财务报表附注(未经审计)(续)

3. 基金份额持有人应占资产净值(续)

	2024年6月30日	2023年12月31日
每一基金份额资产净值		
A类港元对冲(累积)	港元 9.59	9.36 港元
A类港元对冲(派息)	7.91 港元	7.93 港元
A类美元(累积)	10.81 美元	10.50 美元
A类美元(派息)	7.48 美元	7.46 美元
B类美元(累积)	10.34 美元	10.00 美元
I类离岸人民币对冲(累积)	离岸人民币 10.08 元	离岸人民币 9.89 元
I类美元(累积)	10.85 美元	10.51 美元
M类人民币(累积)	离岸人民币 9.34 元	离岸人民币 8.86 元
M类人民币对冲(累积)	离岸人民币 8.94 元	-

财务状况表中列报的归属于基金份额持有人的净资产与为处理基金份额认购和赎回而确定的归属于基金份额持有人的净资产的对账如下:

	2024年6月30日 美元	2023年12月31日 美元
基金份额持有人应占资产净值 (按照子基金的信托契约计算)	42,607,801	39,506,264
设立费用调整数(附注(a))	-	-
基金份额持有人应占资产净值 (按香港财务报告准则计算)	42,607,801	39,506,264

备注:

- (a) 解释性备忘录规定于子基金运作的首 5 年摊销成立成本,而非按香港财务报告准则规定于本报告期间发生的金额作为费用。

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

财务报表附注(未经审计)(续)

3. 基金份额持有人应占资产净值(续)

	2024年6月30日 基金份额价格 (在财务报表中列报)	2024年6月28日 公布基金份额价格:
A类港元对冲(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	9.59 港元*	港元 9.59
A类港元对冲(派息)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	7.91 港元*	7.91 港元
A类美元(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	10.81 美元*	10.81 美元
A类美元(派息)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	7.48 美元*	7.47 美元
B类美元(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	10.34 美元*	10.34 美元
I类离岸人民币对冲(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	离岸人民币 10.08 元*	离岸人民币 10.08 元
I类美元(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	10.85 美元*	10.85 美元
M类人民币(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	离岸人民币 9.34 元*	离岸人民币 9.34 元
M类人民币对冲(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	离岸人民币 8.94 元*	离岸人民币 8.94 元

* 基金份额价格设立成本调整的影响小于小数点后两位。

** 公布资产净值当年的最后一个估值日。

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

财务报表附注(未经审计)(续)

3. 基金份额持有人应占资产净值(续)

	2023年12月31日 基金份额价格 (在财务报表中列报)	2023年12月29日 公布基金份额价格:
A类港元对冲(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	9.36 港元*	9.36 港元
A类港元对冲(派息)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	7.93 港元*	7.93 港元
A类美元(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	10.50 美元*	10.50 美元
A类美元(派息)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	7.46 美元*	7.46 美元
B类美元(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	10.00 美元*	10.00 美元
I类离岸人民币对冲(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	离岸人民币 9.89 元*	离岸人民币 9.89 元
I类美元(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	10.51 美元*	10.51 美元
M类人民币(累积)		
每一基金份额归属于基金份额持有人的净资产	离岸人民币 8.86 元*	离岸人民币 8.86 元

* 基金份额价格设立成本调整的影响小于小数点后两位。

** 公布资产净值当年的最后一个估值日。

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

投资组合明细表 (未经审计)

截至 2024 年 6 月 30 日

债务证券 (报价)	持有量/ 面值	公允价值 美元	应计利息 美元	占净资产 百分比
澳大利亚				
澳大利亚和新西兰银行集团有限公司 5.731% 18092034	300,000	297,846	4,919	0.70%
CIMIC Finance USA Pty Ltd 7% 25032034	400,000	404,448	7,467	0.95%
麦格理银行有限公司 3.052% 03032036	200,000	165,966	2,001	0.39%
NBN Co Ltd 1.625% 08012027	300,000	275,211	2,343	0.65%
NBN Co Ltd 6% 06102033	300,000	315,519	4,250	0.74%
Perenti Finance Pty Ltd 7.5% 26042029	200,000	204,240	2,708	0.48%
Scentre Group Trust 2 5.125% 24092080	200,000	185,434	2,762	0.44%
Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 4.125% 30042036	500,000	538,928	3,745	1.27%
法国				
法国电力集团 9.125% PERP	300,000	327,585	1,217	0.77%
法国兴业银行 8% PERP	300,000	299,742	6,133	0.70%
香港				
友邦保险控股有限公司 5.375% 05042034	300,000	292,320	3,852	0.69%
东亚银行有限公司 6.625% 13032027	400,000	402,000	7,950	0.94%
中信银行(国际)有限公司 6% 05122033	500,000	512,650	2,167	1.20%
大新银行有限公司 7.375% 15112033	250,000	261,092	2,356	0.61%
富卫集团有限公司 7.635% 02072031	700,000	710,416	-	1.67%
富卫集团有限公司 8.045% PERP	200,000	195,992	715	0.46%
新濠博亚金融有限公司 5.75% 21072028	200,000	187,844	5,111	0.44%
新濠博亚金融有限公司 7.625% 17042032	200,000	198,830	3,135	0.47%
NWD Finance BVI Ltd 4.125% PERP	200,000	121,558	-	0.29%
Swire Pacific Mtn Financing HK Ltd 5.125% 05072029	800,000	794,248	-	1.86%
印度				
阿达尼港口和经济特区有限公司 3.1% 02022031	300,000	238,578	3,849	0.56%
巴帝电信有限公司 3.25% 03062031	200,000	175,630	506	0.41%
Continuum Green Energy India Pvt / Co-Issuers 7.5% 26062033	200,000	198,594	208	0.47%
印度进出口银行 5.5% 18012033	300,000	301,053	7,471	0.71%
Network i2i Ltd 5.65% PERP	350,000	347,154	4,175	0.82%
印度电力金融股份有限公司 3.35% 16052031	250,000	217,500	1,047	0.51%
信实工业有限公司 2.875% 12012032	250,000	211,493	3,374	0.50%
信实工业有限公司 4.875% 10022045	250,000	223,325	4,773	0.52%
印度尼西亚				
Adaro Indonesia PT 4.25% 31102024	300,000	297,375	2,160	0.70%
印尼自由港有限公司 5.315% 14042032	200,000	193,182	2,274	0.45%
JGC Ventures Pte Ltd 0% 30062025*	22,665	11,030	-	0.03%
Medco Laurel Tree Pte Ltd 6.95% 12112028	250,000	244,955	2,365	0.58%
Modernland Overseas Pte Ltd 3% 30042027*	89,102	30,814	-	0.07%
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 5.2% 02072034	200,000	197,974	-	0.46%

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

投资组合明细表 (未经审计) (续)

截至 2024 年 6 月 30 日

债务证券 (续) (报价)	持有量/ 面值	公允价值 美元	应计利息 美元	占净资产 百分比
日本				
三菱日联金融集团 8.2% PERP	500,000	537,850	18,906	1.26%
朝日生命保险相互会社 Co 6.9% PERP	1,000,000	1,028,050	29,708	2.41%
日本生命保险相互会社 5.95% 16042054	250,000	247,560	3,099	0.58%
野村控股 5.783% 03072034	600,000	597,864	-	1.40%
野村控股 F% 02072027	500,000	502,810	-	1.18%
乐天集团株式会社 11.25% 15022027	200,000	214,294	9,062	0.50%
乐天集团株式会社 9.75% 15042029	300,000	310,158	6,581	0.73%
软银集团株式会社 5.125% 19092027	250,000	240,487	3,630	0.56%
软银集团株式会社 5.25% 06072031	-	-	7,656	-
软银集团株式会社 7% 08072031	300,000	299,487	-	0.70%
武田药品工业株式会社 5.3% 05072034	1,000,000	993,160	-	2.33%
武田药品工业株式会社 5.65% 05072044	500,000	491,845	-	1.15%
卢森堡				
Prologis International Funding II SA 4.625% 21022035	400,000	441,209	7,097	1.04%
澳门				
Champion Path Holdings Ltd 4.5% 27012026	500,000	480,155	9,625	1.13%
Champion Path Holdings Ltd 4.85% 27012028	200,000	182,728	4,149	0.43%
美高梅中国控股有限公司 7.125% 26062031	700,000	705,019	693	1.66%
Studio City Finance Ltd 5% 15012029	200,000	176,322	4,611	0.41%
Studio City Finance Ltd 6.5% 15012028	200,000	190,708	5,994	0.45%
永利澳门有限公司 5.5% 15012026	500,000	490,410	12,681	1.15%
马来西亚				
Genm Capital Labuan Ltd 3.882% 19042031	300,000	263,625	2,329	0.62%
中华人民共和国				
阿里巴巴集团控股有限公司 4.5% 28112034	300,000	276,375	1,237	0.65%
建业地产股份有限公司 7.25% 13082024*	300,000	8,625	-	0.02%
中国信达 2020 I 管理有限公司 5.75% 28052029	700,000	699,888	3,690	1.64%
China Great Wall International Holdings VI Ltd 7.15% PERP	400,000	401,952	-	0.94%
创兴银行有限公司 5.7% PERP	250,000	249,653	6,571	0.59%
招银国际租赁管理有限公司 2.875% 04022031	1,150,000	998,752	13,501	2.34%
Coastal Emerald Ltd 6.5% PERP	500,000	508,625	2,799	1.19%
大发地产集团有限公司 12.5% 30062022*	1,336,000	-	-	-
怡略有限公司 6.5% 11072025*	386,023	-	-	-
怡略有限公司 6.5% 11072027*	51	-	-	-
远东宏信有限公司 6.625% 16042027	1,000,000	1,002,720	13,802	2.35%
吉利汽车控股有限公司 4% PERP	250,000	246,928	611	0.58%
Huarong Finance 2019 Co Ltd 4.5% 29052029	700,000	634,634	2,800	1.49%
佳源国际控股有限公司 11.375% 02052022*	700,000	-	-	-

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

投资组合明细表 (未经审计) (续)

截至 2024 年 6 月 30 日

债务证券 (续) (报价)	持有量/ 面值	公允价值 美元	应计利息 美元	占净资产 百分比
中华人民共和国 (续)				
佳源国际控股有限公司 12% 30102022*	1,000,000	-	-	-
联想集团有限公司 6.536% 27072032	500,000	523,285	13,980	1.23%
美团点评 3.05% 28102030	1,200,000	1,032,120	6,405	2.42%
当代置业中国有限公司 8% 30122024*	571,830	-	-	-
当代置业中国有限公司 9% 28122024*	218,018	-	-	-
当代置业中国有限公司 9% 30122025*	666,101	-	-	-
当代置业中国有限公司 9% 30122026*	888,138	-	-	-
力高地产集团有限公司 10.5% 06012023*	17,000,000	-	-	-
力高地产集团有限公司 11% 06082023*	611,366	-	-	-
弘阳地产集团有限公司 10.5% 03102022*	840,000	-	-	-
弘阳地产集团有限公司 7.3% 21052024*	700,000	-	-	-
祥生控股集团有限公司 10.5% 07062022*	1,300,000	-	-	-
Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd 4.875% 17052042	400,000	382,756	2,383	0.90%
融创中国控股有限公司 6.75% 30092028*	215,187	22,074	-	0.05%
腾讯控股有限公司 2.88% 22042031	500,000	433,240	6,072	1.02%
微博股份有限公司 3.375% 08072030	200,000	174,554	3,244	0.41%
Xiaomi Best Time International Ltd 2.875% 14072031	350,000	291,498	4,668	0.68%
阳光城嘉世国际有限公司 10.25% 15092022*	500,000	-	-	-
阳光城嘉世国际有限公司 9.25% 15042023*	800,000	-	-	-
正荣地产集团有限公司 7.1% 10092024*	500,000	-	-	-
正荣地产集团有限公司 9.15% 06052023*	600,000	-	-	-
众安在线财产保险股份有限公司 3.5% 08032026	200,000	190,708	2,197	0.45%
中原忠诚有限公司 5.9% 20062027	200,000	200,634	361	0.47%
菲律宾				
菲律宾中华银行 5.5% 18012029	200,000	200,438	5,011	0.47%
菲律宾中华银行 6.5% PERP	500,000	495,210	11,194	1.16%
新加坡				
新加坡航空有限公司 5.25% 21032034	250,000	255,237	3,646	0.60%
韩国				
韩华生命保险 3.379% 04022032	500,000	468,695	6,899	1.10%
现代资本美国 5.3% 24062029	500,000	496,430	515	1.17%
现代资本美国 F% 24062027	1,000,000	1,001,490	1,238	2.35%
Hyundai Card Co Ltd 5.75% 24042029	500,000	502,195	5,351	1.18%
韩国国家石油公司 F% 03042027	200,000	201,056	3,040	0.47%
LG Energy Solution Ltd 5.375% 02072027	1,000,000	994,340	-	2.33%
LG Energy Solution Ltd 5.5% 02072034	1,000,000	975,850	-	2.29%
Mirae Asset Securities Co Ltd 6% 26012029	200,000	202,090	5,167	0.47%
SK 海力士 5.5% 16012027	300,000	299,244	7,562	0.70%
西班牙				
西班牙桑坦德银行有限公司 7% PERP	400,000	430,816	3,444	1.01%

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

投资组合明细表 (未经审计) (续)

截至 2024 年 6 月 30 日

债务证券 (续) (报价)	持有量/ 面值	公允价值 美元	应计利息 美元	占净资产 百分比
斯里兰卡				
Sri Lanka Government International Bond 6.2% 11052027*	500,000	293,750	-	0.69%
瑞士				
瑞银集团 9.25% PERP	400,000	430,344	4,933	1.01%
泰国				
Kasikornbank PCL/Hong Kong 5.275% PERP	500,000	487,315	5,641	1.14%
英国				
巴克莱集团 4.973% 31052036	300,000	323,006	1,354	0.76%
巴克莱集团 9.625% PERP	200,000	216,692	856	0.51%
汇丰控股有限公司 6.211% 21032034	250,000	167,486	2,891	0.39%
汇丰控股有限公司 8% PERP	200,000	209,832	5,067	0.49%
国民西敏集团 8.125% PERP	200,000	202,656	45	0.48%
渣打集团有限公司 7.75% PERP	300,000	302,772	8,783	0.71%
美利坚合众国				
拉斯维加斯金沙集团 6.2% 15082034	300,000	301,134	2,325	0.71%
		35,711,366	390,137	83.81%
集体投资计划				
高腾人民币债券基金- B 类 (离岸人民 币) - ACC	600,000	839,629	-	1.97%
高腾人民币债券基金- B 类 (美元对 冲) - ACC	90,000	948,339	-	2.23%
		1,787,968	-	4.20%
外币远期合约				
买入离岸人民币/美元 - 高盛	离岸人民币 1,989,985 元	(1,782)	-	-
买入港元/美元 - 高盛	84,035,000 港元	1,839	-	-
卖出澳元/美元 - 高盛	250,000 澳元	761	-	-
卖出离岸人民币/美元 - 高盛	离岸人民币 6,036,600 元	11,882	-	0.03%
卖出欧元/美元 - 高盛	1,600,000 欧元	10,457	-	0.02%
卖出港元/美元 - 高盛	5,500,000 港元	670	-	-
		23,827	-	0.05%
总投资		37,523,161	390,137	88.06%
其他净资产		5,084,640		11.94%
基金份额持有人应占资产净值		42,607,801		100.00%
按成本计算投资总额		49,225,500		

* 违约债券

高腾亚洲收益基金
(高腾微基金的子基金)

投资组合所持投资项目变动表 (未经审计)

截至 2024 年 6 月 30 日

	截至 2024 年 6 月 30 日的净资产百分比	截至 2023 年 12 月 31 日 的净资产百分比
债务证券 (按风险国家分列)		
澳大利亚	5.62%	4.37%
法国	1.47%	4.78%
香港	8.63%	5.34%
印度	4.50%	5.32%
印度尼西亚	2.29%	7.51%
爱尔兰	-	1.27%
日本	12.80%	8.52%
卢森堡	1.04%	-
澳门	5.23%	7.44%
马来西亚	0.62%	3.08%
蒙古国	-	0.78%
荷兰	-	0.63%
中国	19.42%	18.51%
菲律宾	1.63%	1.85%
沙特阿拉伯	-	0.92%
新加坡	0.60%	-
韩国	12.06%	4.20%
西班牙	1.01%	0.56%
斯里兰卡	0.69%	1.04%
瑞士	1.01%	1.62%
泰国	1.14%	1.98%
英国	3.34%	2.97%
美利坚合众国	0.71%	1.31%
期货合约	-	(0.04)%
外币远期合约	0.05%	(0.02)%
集体投资计划	4.20%	13.16%
总投资	88.06%	97.10%
其他资产	11.94%	2.90%
	100.00%	100.00%