



INCOME PARTNERS

中期报告 2024

弘收高收益波幅管理债券基金

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

半年度财务报表 (未经审计)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

目录

基金管理与行政管理	1
基金管理人报告	2
2024 年业绩概览	2
市场概述与展望	3
投资组合概况 (截至 2024 年 6 月 30 日)	4
财务报表 (未经审计)	5
财务状况表 (未经审计)	5
损益和其他全面收益表 (未经审计)	6
份额持有人应占资产净值变动表 (未经审计)	7
财务报表 (未经审计) 附注	8
投资组合 (未经审计)	25
投资组合持仓变动表 (未经审计)	30
抵押品持仓 (未经审计)	34

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

基金管理与行政管理

基金管理人

弘收投资管理(香港)有限公司
香港
英皇道 979 号
太古坊
康桥大厦
3503-4 室

受托人和主要办事处

花旗信托有限公司
香港
中环花园道三号
冠君大厦 50 楼

基金登记机构兼处理代理人

Citicorp Financial Services Limited
香港九龙
观塘
海滨道 83 号
One Bay East 花旗大楼

保管人

花旗银行香港分行
香港
中环花园道三号
冠君大厦 50 楼

审计师

罗兵咸永道会计师事务所
香港
中环
太子大厦 22 楼

瑞士代表性代理人

Acolin Fund Services AG, Geneva Branch
6, Cours de Rive
CH-1204 Geneva
Switzerland

基金管理人董事

魏志华
Gregoire Marie Haenni
Karl Franklin Dasher
John Blackman Doggett

行政管理人

花旗银行香港分行
香港
中环花园道三号
冠君大厦 50 楼

基金管理人的律师 (香港法律方面)

的近律师行
香港
中环
遮打道 18 号
历山大厦 5 楼

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

基金管理人报告

致弘收高收益波幅管理债券基金的份额持有人

2024 年业绩概览

弘收高收益波幅管理债券基金（本“基金”）于 2024 年前六个月实现的总回报¹如下表所示：

份额类别	ISIN 编码	彭博代码	基金类别成立日期	2024 年 迄今回报率	年化红利收益率*
1A 类累积 (美元) 份额	HK0000421336	IRHY1AA HK	2018 年 1 月 8 日	6.97%	-
1A 类分派 (美元) 份额	HK0000421328	IPRHY1A HK	2013 年 5 月 7 日 (于 2021 年 8 月 3 日重新激活)	- ²	-
1B 类累积 (人民币) 份额	HK0000421351	IRHY1BA HK	2019 年 6 月 26 日	- ²	-
1E 类分派 (美元对冲) 份额	HK0000490067	IPRHY1E HK	2019 年 3 月 25 日	10.77%	7.9%
2A 类累积 (美元) 份额	HK0000421419	IRHY2AA HK	2011 年 7 月 27 日	6.72%	-
2A 类分派 (美元) 份额	HK0000421401	IPRHY2A HK	2011 年 8 月 3 日	6.71%	8.8%
2B 类累积 (人民币) 份额	HK0000421435	IRHY2BA HK	2011 年 7 月 27 日	9.27%	-
2B 类分派 (人民币) 份额	HK0000421427	IPRHY2B HK	2011 年 7 月 27 日	9.27%	8.2%
2C 类分派 (美元) 份额	HK0000421443	IPRHY2C HK	2011 年 8 月 10 日	6.72%	7.0% (按 7% 的固定 百分比支付)
2D 类累积 (港元) 份额	HK0000421468	IRHY2DA HK	2018 年 2 月 21 日	6.68%	-
2D 类分派 (港元) 份额	HK0000421450	IPRHY2D HK	2018 年 2 月 9 日	6.71%	8.6%
2E 类累积 (澳元) 份额	HK0000421484	IRHY2EA HK	2018 年 3 月 7 日	-	-
2E 类分派 (澳元) 份额	HK0000421476	IPRHY2E HK	2018 年 5 月 4 日	9.02%	7.0%
2F 类累积 (澳元对冲) 份额	HK0000421500	IRHY2FA HK	2015 年 10 月 13 日	9.79%	-
2F 类分派 (澳元对冲) 份额	HK0000421492	IPRHY2F HK	2019 年 5 月 2 日	9.85%	6.8%
2G 类累积 (美元对冲) 份额	HK0000421526	IRHY2GA HK	2015 年 10 月 13 日	10.38%	-
2G 类分派 (美元对冲) 份额	HK0000421518	IPRHY2G HK	2015 年 10 月 19 日	10.35%	8.1%
2I 类累积 (新加坡元对冲) 份额	HK0000421567	IRHY2IA HK	2019 年 4 月 30 日	9.44%	-
2I 类分派 (新加坡元对冲) 份额	HK0000421559	IPRHY2I HK	2019 年 4 月 24 日	9.48%	6.8%
2J 类分派 (欧元) 份额	HK0000490000	IPRHY2J HK	2019 年 7 月 16 日	- ²	-
2K 类累积 (欧元对冲) 份额	HK0000490034	IRHY2KA HK	2019 年 5 月 8 日	- ²	-
2K 类分派 (欧元对冲) 份额	HK0000490026	IPRHY2K HK	2019 年 5 月 7 日	9.78%	5.3%
2L 类累积 (港元对冲) 份额	HK0000490059	IRHY2LA HK	2019 年 5 月 7 日	-	-
2L 类分派 (港元对冲) 份额	HK0000490042	IPRHY2L HK	2019 年 4 月 17 日	9.78%	8.3%
2XB 类累积 (人民币) 份额	HK0000706074	-	2021 年 12 月 22 日	-	-
2XG 类累积 (美元对冲) 份额	HK0000706090	-	2021 年 7 月 14 日	- ²	-

* 年化红利收益率: $[(1 + \text{每份额收益分配} / \text{除息后资产净值})^{\text{收益分配频率}} - 1]$ 。收益率数据为估计值, 依据最近的红利分配及上个月的除息后资产净值。收益率数据仅供参考。红利收益率为正并不意味着回报率为正。不保证分红率, 可能会用资本支付收益分配。

¹ 经每月红利分配调整

² 根据香港证监会适用于集合投资计划的广告宣传指引, 份额类别的投资往绩记录超过6个月之后, 可呈列业绩表现信息。

弘收高收益波幅管理债券基金 (弘收策略基金的子基金)

市场概述与展望

2024 年上半年，亚洲高收益债券市场延续自 2023 年 11 月以来的上涨势头，以美元计，实现两位数的回报率。

根据下方按地区划分的表现细分表所示，中国内地对本基金今年迄今的回报率作出显著贡献，贡献度为 3.5%。单就本基金于中国内地的投资而言，实现高达 16.8% 的总回报率，超过总体市场的水平，原因在于我们战略性地超配房地产板块以及低配金融和准主权板块。在中央政府出台的一系列扶持政策的推动下，中国内地房地产板块稳健复苏。虽然我们承认，由于购房者需求减弱以及求稳心态作祟，房地产市场持续承压，但部分优质房地产开发商的债券价格依然蕴含着诱人的投资机会。

香港成为本基金表现的第二大贡献者，对本基金今年迄今的回报率的贡献度为 2.7%，单就香港而言，实现 12.4% 的总回报率。另外，印尼对本基金今年迄今表现的贡献度为 1.4%，排名第三，而未加权回报率达到惊人的 17.3%。针对于香港和印尼的投资，我们精挑细选债券，所取得的表现显著优于总体市场。相比之下，本基金依旧低配印度和澳门，看好这些地区的优质资产，从而导致印度和澳门对于本基金表现的贡献度相对较低。

各地表现						对今年迄今回报率的贡献度					
地区	中国内地	香港	印度	印尼	澳门	地区	中国内地	香港	印度	印尼	澳门
本基金	16.8%	12.4%	6.9%	17.3%	4.2%	本基金	3.5%	2.7%	0.8%	1.4%	0.3%
总体市场	13.4%	7.8%	8.1%	5.5%	4.9%	总体市场	3.3%	1.4%	1.4%	0.3%	0.5%

展望未来，过去几个月的一波持续上涨行情过后，要留意将在下半年面临的不确定因素。诸多因素都会令格局变得复杂，例如潜伏的美国经济衰退风险、美联储的潜在降息、美国大选的结果以及不断升级的地缘政治紧张局势等。

为应对这些动态，我们准备对目前持有的头寸逐步进行获利了结并转向波动性较低的投资。同时，我们有意评估延长投资组合久期的最佳时机，从而进行战略性头寸配置，以期在美元见顶造成货币波动性不断加剧之际，把握随之而来的机会。

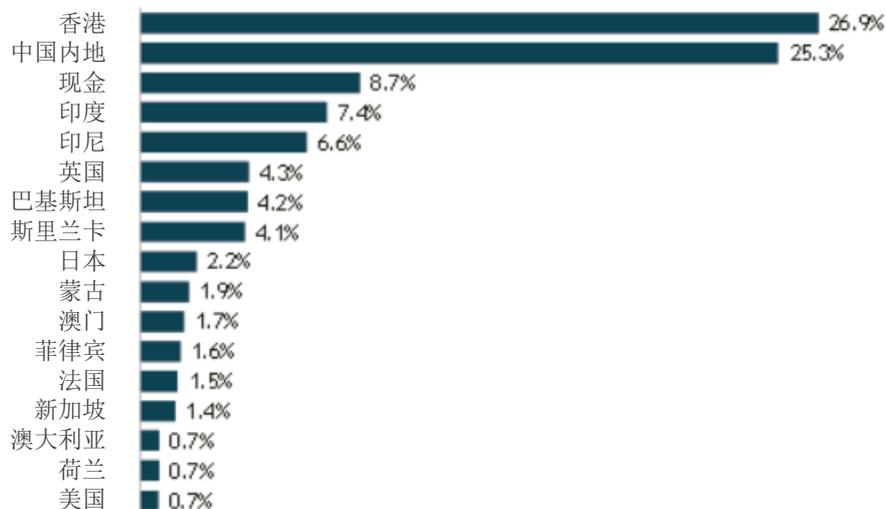
弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

投资组合概况 (截至 2024 年 6 月 30 日)

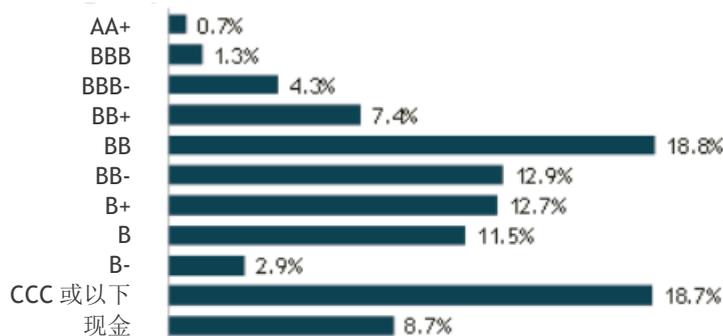
修正久期:	平均信用评级:	到期收益率 (以人民币计) ³ :	到期收益率 (以美元计) ⁴ :
2.6 年	B+	7.7%	10.6%

前十大持仓	38.1%
巴基斯坦政府债券	4.2%
Fortune Star BVI Ltd	4.2%
NWD Finance BVI Ltd	4.2%
利丰有限公司	4.1%
斯里兰卡政府债券	4.1%
LS Finance 2017 Ltd	3.8%
渣打集团有限公司	3.5%
仁恒地产(香港)有限公司	3.3%
Sun Hung Kai & Co BVI	3.3%
一嗨汽车租赁有限公司	3.1%

地域敞口



信用评级敞口



³ 以人民币计的到期收益率适用于以美元计价 (1A 类)、美元计价 (2A 类)、人民币计价 (2B 类)、美元计价 (2C 类)、港元计价 (2D 类)、澳元计价 (2E 类)、新加坡元计价 (2H 类)、欧元计价 (2J 类)、美元计价 (2XA 类) 和人民币计价 (2XB 类) 的所有未对冲份额类别, 因投资者面临人民币风险。在适用情况下, 偿债日期用于计算可赎回债券的到期收益率 (源自彭博)。

⁴ 以美元计的到期收益率适用于以美元对冲计价 (1E 类)、澳元对冲计价 (2F 类)、美元对冲计价 (2G 类)、新加坡元对冲计价 (2I 类)、欧元对冲计价 (2K 类)、港元对冲计价 (2L 类)、人民币计价 (美元敞口) (2X 类)、美元计价 (2XG 类) 的所有已对冲份额类别, 因投资者不面临人民币风险。在适用情况下, 偿债日期用于计算可赎回债券的到期收益率 (源自彭博)。

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表 (未经审计)

财务状况表 (未经审计)

截至 2024 年 6 月 30 日

	附注	截至 2024 年 6 月 30 日 (未经审计) 人民币	截至 2023 年 12 月 31 日 (经审计) 人民币
资产 - 流动资产			
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		186,090,868	195,112,570
衍生金融工具		277,562	770,171
应收利息		3,305,011	3,322,682
预付款		937,101	822,528
其他应收款项		-	222,507
经纪机构应付款项		11,183,864	1,582,977
保证金存款		11,642,878	18,454,683
银行结余		4,484,221	4,118,767
资产总计		217,921,505	224,406,885
负债 - 流动负债			
衍生金融工具		1,663,453	141,095
应付经纪机构款项		5,589,781	931,593
其他负债和应计支出	2(a) 2(b)	1,169,982	1,309,587
应付赎回款项	2(g)	1,990,915	56,444
负债总计 (不含份额持有人应占资产净值)		10,414,131	2,438,719
份额持有人应占资产净值		207,507,374	221,968,166
由以下项目代表:		217,921,505	221,968,166
份额持有人应占资产净值 (根据本基金的招募说明书)		207,507,374	221,968,166

随附的附注为该等财务报表的一部分。

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

损益和其他全面收益表 (未经审计)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

	附注	截至 2024 年 6 月 30 日止六个月 (未经审计) 人民币	截至 2023 年 6 月 30 日止六个月 (未经审计) 人民币
收入			
债务利息收入		5,926,629	8,203,369
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和 负债的收益/(亏损)净额		22,233,458	(51,172,655)
汇兑(亏损)/收益净额		(4,933,096)	18,603,609
银行利息收入		382,716	775,795
其他应收款项减值损失拨回		1,112,537	-
其他收入		2,296	196,729
投资收入/(亏损)总计		24,724,540	(23,393,153)
支出			
管理费	2(a)	(1,551,670)	(2,708,624)
受托人费用	2(b)	(36,093)	(34,831)
保管人、行政管理、合规监测、财务报表编制费用和 基金登记机构兼处理代理人费用	2(g)	(437,209)	(430,670)
审计师酬金		(240,760)	(238,676)
其他营业支出		(260,541)	(293,737)
法律及专业费		(87,214)	(109,848)
营业支出总计		(2,613,487)	(3,816,386)
营业收入/(亏损)		22,111,053	(27,209,539)
财务费用			
向可赎回份额持有人的收益分配		(6,550,172)	(8,985,223)
利息支出		-	(1,278)
收益分配后的收入/(亏损)		15,560,881	(36,196,040)
经营活动产生的份额持有人应占资产净值增加/(减少)		15,560,881	(36,196,040)

随附的附注为该等财务报表的一部分。

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

份额持有人应占资产净值变动表 (未经审计)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

	截至 2024 年 6 月 30 日止六个月 (未经审计) 人民币	截至 2023 年 6 月 30 日止六个月 (未经审计) 人民币
期初份额持有人应占资产净值	221,968,166	418,113,303
发行可赎回份额	1,955,926	29,460,967
赎回可赎回份额	(31,977,599)	(71,264,903)
经营活动产生的份额持有人应占资产净值增加/(减少)	<u>15,560,881</u>	<u>(36,196,040)</u>
期末可赎回份额持有人应占资产净值	<u>207,507,374</u>	<u>340,113,327</u>
	截至 2024 年 6 月 30 日止六个月 (未经审计) 份	截至 2023 年 6 月 30 日止六个月 (未经审计) 份
期初发行在外的份额	2,055,068	2,675,602
发行的份额	25,215	115,509
赎回的份额	<u>(232,238)</u>	<u>(322,190)</u>
期末发行在外的份额	<u>1,848,045</u>	<u>2,468,921</u>

随附的附注为该等财务报表的一部分。

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表(未经审计)附注

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

1 主要会计政策

该等未经审计的中期财务报表根据《国际财务报告准则》(“国际财务报告准则”)编制。财务报表根据历史成本法编制,并经重估以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债(包括衍生工具)作出修订。

所采用的会计政策与截至 2024 年 6 月 30 日止期间的年度财务报表的会计政策保持一致,在该等年度财务报表的财务报表附注中进行了说明。

2 与基金管理人和关联人士的交易

受托人和基金管理人的关联方和关联人士为香港证监会颁布的《单位信托及互惠基金守则》中定义的关联方和关联人士。与关联方和关联人士的所有交易均在正常业务过程中按正常商业条款订立。本子基金由弘收投资管理(香港)有限公司管理。与受托人、基金管理人和各自关联方及关联人士的交易如下:

(a) 管理费

本子基金当前的管理费按下表中载明的费率收取:

类别	管理费 (占相关类别资产净值的比例/年)
1A 类美元(累积)份额	1.00%
1A 类美元(分派)份额	1.00%
1E 类美元(分派)份额	1.00%
2A 类美元(累积)份额	1.50%
2A 类美元(分派)份额	1.50%
2B 类人民币(累积)份额	1.50%
2B 类人民币(分派)份额	1.50%
2C 类美元(分派)份额	1.50%
2D 类港元(累积)份额	1.50%
2D 类港元(分派)份额	1.50%
2E 类澳元(累积)份额	1.50%
2E 类澳元(分派)份额	1.50%
2F 类澳元对冲(累积)份额	1.50%
2F 类澳元对冲(分派)份额	1.50%
2G 类美元对冲(累积)份额	1.50%
2G 类美元对冲(分派)份额	1.50%
2I 类新加坡元对冲(累积)份额	1.50%
2I 类新加坡元对冲(分派)份额	1.50%
2J 类欧元对冲(分派)份额	1.50%
2K 类欧元对冲(累积)份额	1.50%
2K 类欧元对冲(分派)份额	1.50%
2L 类港元对冲(累积)份额	1.50%
2L 类港元对冲(分派)份额	1.50%

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表 (未经审计) 附注 (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

2 与基金管理人和关联人士的交易 (续)

(a) 管理费 (续)

类别	管理费 (占相关类别资产净值的比例/年)
2XB 类人民币 (累积) 份额	1.50%
2XG 类美元对冲 (累积) 份额	1.50%
4C 类美元对冲 (累积) 份额	0.00%

管理费每日应计并应于每月月末支付。

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月的管理费总额为 1,551,670 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日止六个月: 2,708,624 人民币), 截至 2024 年 6 月 30 日未偿付的数额为 251,054 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日: 395,398 人民币)。

如果管理费从当前水平上调至不超过每年本子基金资产净值的 2% 的最高水平, 则基金管理人会提前一个月通知份额持有人。

截至 2024 年 6 月 30 日止期间, 并无来自本子基金的基金管理人弘收投资管理(香港)有限公司的管理费退费 (截至 2023 年 6 月 30 日止期间: 零人民币)。管理费退费与本子基金持有的由基金管理人管理的投资基金有关。

(b) 受托人费用

因本子基金的资产而应计的付给受托人的受托人费用以每年本子基金资产净值的 0.0075% (截至 2023 年 6 月 30 日止六个月: 0.0075%) 为基准, 每年至少为 10,000 美元 (截至 2023 年 6 月 30 日止六个月: 10,000 美元)。当前因本子基金的资产而应向受托人支付的费用每年不到本子基金资产净值的 1%。如果受托人费用从当前水平上调至不超过每年本子基金资产净值的 1% 的最高水平, 则受托人会提前一个月通知份额持有人。

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月的受托人费用总额为 36,093 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日止六个月: 34,831 人民币), 截至 2024 年 6 月 30 日未偿付的数额为 5,963 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日: 5,893 人民币)。

(c) 交叉交易

截至 2024 年 6 月 30 日和 2023 年 6 月 30 日止期间, 概无将投资持仓卖给也由本子基金的基金管理人管理的其他基金的交易或向其购买投资持仓的交易。

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表 (未经审计) 附注 (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

2 与基金管理人和关联人士的交易 (续)

(d) 于基金管理人所管理基金的投资

截至 2024 年 6 月 30 日, 本子基金投资弘收人民币债券基金 (“IPRMBBF”), 其由本子基金的同一个基金管理人管理。

IPRMBBF 按照日期为 2014 年 6 月 23 日的信托契约根据香港法律于香港注册成立。IPRMBBF 的主要投资目标是通过投资人民币计价的固定收益类证券, 寻求长期利息收入和资本升值。

下表概述由本子基金的同一个基金管理人所管理的投资基金的所有权情况:

截至 2024 年 6 月 30 日

	持仓量	份额价格 人民币	公允价值 人民币
IPRMBBF	-	-	-

截至 2023 年 6 月 30 日

	持仓量	份额价格 人民币	公允价值 人民币
IPRMBBF	63,800	770.71	49,171,173

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表 (未经审计) 附注 (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

2 与基金管理人和关联人士的交易 (续)

(e) 本子基金份额持仓

基金管理人及其关联人士截至 2024 年 6 月 30 日和 2023 年 12 月 31 日于本基金的份额持仓如下。

基金管理人管理委员会成员持有的份额:

	于 2024 年 1 月 1 日发行在外的 份额	期 年内 认购的份额	期 年内 赎回的份额	于 2024 年 6 月 30 日发行在 外的份额
<u>2024 年</u>				
4C 类美元对冲 (累积) 份额	6,270	-	(5,296)	974
	于 2023 年 1 月 1 日发行在外的 份额	年 年内 认购的份额	年 年内 赎回的份额	于 2023 年 12 月 31 日发行在 外的份额
<u>2023 年</u>				
4C 类美元对冲 (累积) 份额	6,270	-	-	6,270

(f) 银行结余

截至 2024 年 6 月 30 日, 本子基金存在花旗银行香港分行的银行存款数额为 4,484,221 人民币 (截至 2023 年 12 月 31 日: 4,118,767 人民币), 花旗银行香港分行是受托人兼基金登记机构的关联公司。本子基金在截至 2024 年 6 月 30 日止期间赚得的银行利息收入为 382,716 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日止期间: 775,795 人民币)。

财务报表 (未经审计) 附注 (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

2 与基金管理人和关联人士的交易 (续)

(g) 保管人、行政管理、合规监测、财务报表编制费用和基金登记机构兼处理代理人费用

根据基金管理人和花旗银行香港分行之间的服务协议，花旗银行香港分行担任基金行政管理人，已同意向本子基金提供财务服务、会计服务、行政管理服务等服务。

Citicorp Financial Services Limited 为本子基金的基金登记机构。

受托人已委任花旗银行香港分行担任本子基金资产的保管人。

保管人、子行政管理人和基金登记机构也有权收取用本子基金的资产支付的应付费用，该等费用的费率在基金管理人、受托人和保管人、子行政管理人或基金登记机构 (视情况而定) 之间不时商定。行政管理人、保管人、子行政管理人和基金登记机构的费用应按月支付。

保管人、行政管理和基金登记机构费用总额包含合规监测费和财务报表编制费用，截至 2024 年 6 月 30 日止六个月为 437,209 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日止六个月: 430,670 人民币)，截至 2024 年 6 月 30 日未偿付的数额为 123,574 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日: 105,719 人民币)。

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月的保管人费用总额为 108,280 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日止六个月: 104,494 人民币)，截至 2024 年 6 月 30 日未偿付的数额为 17,889 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日: 17,678 人民币)。

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月的行政管理费用总额为 259,872 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日止六个月: 250,785 人民币)，截至 2024 年 6 月 30 日未偿付的数额为 46,977 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日: 46,470 人民币)。

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月的基金登记机构费用总额为 21,655 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日止六个月: 21,116 人民币)，截至 2024 年 6 月 30 日未偿付的数额为 3,577 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日: 3,536 人民币)。

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月的合规监测费用总额为 10,553 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日止六个月: 19,030 人民币)，截至 2024 年 6 月 30 日未偿付的数额为 1,701 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日: 2,832 人民币)。

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月的财务报表编制费用总额为 36,849 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日止六个月: 35,245 人民币)，截至 2024 年 6 月 30 日未偿付的数额为 53,430 人民币 (截至 2023 年 6 月 30 日: 35,203 人民币)。

3 软佣金安排

基金管理人确认，截至 2024 年 6 月 30 日止期间，不存在与通过经纪机构或交易商指导本子基金的交易有关的软佣金安排。

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表 (未经审计) 附注 (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

4 可赎回份额

六个月内已发行可赎回份额的变动如下:

	于 2023 年 12 月 31 日 发行在外的份额	期内发行的份额	期内赎回的份额	于 2024 年 6 月 30 日 发行在外的份额
截至 2024 年 6 月 30 日				
<u>可赎回份额</u>				
1A 类美元 (累积) 份额	10,783	-	-	10,783
1E 类美元 (分派) 份额	11,146	-	(5,149)	5,997
2A 类美元 (累积) 份额	12,483	-	(1,096)	11,387
2A 类美元 (分派) 份额	122,810	34	(21,008)	101,836
2B 类人民币 (累积) 份额	131,540	-	(9,534)	122,006
2B 类人民币 (分派) 份额	702,660	20,788	(45,169)	678,279
2C 类美元 (分派) 份额	32,329	110	(8,495)	23,944
2D 类港元 (累积) 份额	54,526	1,756	(3,844)	52,438
2D 类港元 (分派) 份额	716,885	-	(101,815)	615,069
2E 类澳元 (分派) 份额	468	-	-	468
2F 类澳元对冲 (累积) 份额	9,364	-	-	9,364
2F 类澳元对冲 (分派) 份额	11,092	-	-	11,092
2G 类美元对冲 (累积) 份额	17,158	204	(4,703)	12,659
2G 类美元对冲 (分派) 份额	161,519	2,323	(13,905)	149,937
2I 类新加坡元对冲 (累积) 份额	8,722	-	(5,189)	3,533
2I 类新加坡元对冲 (分派) 份额	19,887	-	-	19,887

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表 (未经审计) 附注 (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

4 可赎回份额 (续)

六个月内已发行可赎回份额的变动如下:

	于 2023 年 12 月 31 日 发行在外的份额	期内发行的份额	期内赎回的份额	于 2024 年 6 月 30 日 发行在外的份额
截至 2024 年 6 月 30 日				
<u>可赎回份额</u>				
2K 类欧元对冲 (分派) 份额	2,004	-	-	2,004
2L 类港元对冲 (累积) 份额	1,976	-	(1,976)	-
2L 类港元对冲 (分派) 份额	16,388	-	-	16,388
2XB 类人民币 (累积) 份额	5,058	-	(5,058)	-
4C 类美元对冲 (累积) 份额	6,270	-	(5,297)	974
	<u>2,055,068</u>	<u>25,215</u>	<u>(232,238)</u>	<u>1,848,045</u>
份额总数				

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表 (未经审计) 附注 (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

4 可赎回份额 (续)

年内已发行可赎回份额的变动如下:

	于 2022 年 12 月 31 日 发行在外的份额	期内发行的份额	期内赎回的份额	于 2023 年 6 月 30 日 发行在外的份额
截至 2023 年 6 月 30 日				
<u>可赎回份额</u>				
1A 类美元 (累积) 份额	104,703	35,307	(34,168)	105,842
1A 类美元 (分派) 份额	20,000	-	(20,000)	-
1E 类美元 (分派) 份额	14,475	-	-	14,475
2A 类美元 (累积) 份额	25,581	472	(7,893)	18,160
2A 类美元 (分派) 份额	147,252	338	(16,679)	130,911
2B 类人民币 (累积) 份额	139,223	-	(605)	138,618
2B 类人民币 (分派) 份额	797,072	29,379	(40,943)	785,508
2C 类美元 (分派) 份额	36,729	104	(700)	36,133
2D 类港元 (累积) 份额	55,929	5,059	(5,849)	55,139
2D 类港元 (分派) 份额	862,614	1,390	(65,853)	798,151
2E 类澳元 (累积) 份额	114	-	-	114
2E 类澳元 (分派) 份额	468	-	-	468
2F 类澳元对冲 (累积) 份额	9,364	-	-	9,364
2F 类澳元对冲 (分派) 份额	18,813	-	(201)	18,612
2G 类美元对冲 (累积) 份额	18,986	332	(1,617)	17,701
2G 类美元对冲 (分派) 份额	228,879	129	(16,885)	212,123
2I 类新加坡元对冲 (累积) 份额	11,711	-	(2,989)	8,722
2I 类新加坡元对冲 (分派) 份额	32,888	-	(10,508)	22,380

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表(未经审计)附注(续)

截至2024年6月30日止六个月

4 可赎回份额(续)

年内已发行可赎回份额的变动如下:

	于2022年12月31日 发行在外的份额	期内发行的份额	期内赎回的份额	于2023年6月30日 发行在外的份额
截至2023年6月30日				
<u>可赎回份额</u>				
2K类欧元对冲(累积)份额	884	-	(884)	-
2K类欧元对冲(分派)份额	12,079	-	1	12,080
2L类港元对冲(累积)份额	3,938	-	(1,962)	1,976
2L类港元对冲(分派)份额	55,205	-	(35,350)	19,855
2XB类人民币(累积)份额	72,425	42,999	(59,106)	56,318
4C类美元对冲(累积)份额	6,270	-	1	6,271
	<u>2,675,602</u>	<u>115,509</u>	<u>(322,190)</u>	<u>2,468,921</u>
份额总数				

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表 (未经审计) 附注 (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

5 份额持有人应占资产净值

	截至 2024 年 6 月 30 日 (未经审计) 人民币	截至 2023 年 12 月 31 日 (经审计) 人民币
份额持有人应占份额净值 (根据本基金的招募说明书)		
1A 类美元 (累积) 份额	546.48	498.79
1E 类美元 (分派) 份额	377.12	345.57
2A 类美元 (累积) 份额	851.48	779.10
2A 类美元 (分派) 份额	313.51	299.39
2B 类人民币 (累积) 份额	132.27	121.03
2B 类人民币 (分派) 份额	47.86	45.58
2C 类美元 (分派) 份额	336.97	319.75
2D 类港元 (累积) 份额	66.19	60.56
2D 类港元 (分派) 份额	39.52	37.71
2E 类澳元 (分派) 份额	260.00	246.15
2F 类澳元对冲 (累积) 份额	409.69	372.18
2F 类澳元对冲 (分派) 份额	243.50	228.68
2G 类美元对冲 (累积) 份额	650.95	575.84
2G 类美元对冲 (分派) 份额	330.26	304.13
2I 类新加坡元对冲 (累积) 份额	386.92	354.44
2I 类新加坡元对冲 (分派) 份额	268.18	254.04
2K 类欧元对冲 (分派) 份额	408.88	385.74
2L 类港元对冲 (累积) 份额	-	60.51
2L 类港元对冲 (分派) 份额	45.97	42.57
2XB 类人民币 (累积) 份额	-	96.91
4C 类美元对冲 (累积) 份额	612.53	537.95

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表 (未经审计) 附注 (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

5 份额持有人应占资产净值 (续)

	截至 2024 年 6 月 30 日 (未经审计) 类别货币	截至 2023 年 12 月 31 日 (经审计) 类别货币
份额持有人应占份额净值 (根据本基金的招募说明书)		
1A 类美元 (累积) 份额	74.94	70.04
1E 类美元 (分派) 份额	51.72	48.53
2A 类美元 (累积) 份额	116.77	109.40
2A 类美元 (分派) 份额	42.99	42.04
2B 类人民币 (累积) 份额	132.27	121.03
2B 类人民币 (分派) 份额	47.86	45.58
2C 类美元 (分派) 份额	46.21	44.90
2D 类港元 (累积) 份额	70.88	66.43
2D 类港元 (分派) 份额	42.32	41.36
2E 类澳元 (分派) 份额	53.54	50.81
2F 类澳元对冲 (累积) 份额	84.36	76.82
2F 类澳元对冲 (分派) 份额	50.14	47.20
2G 类美元对冲 (累积) 份额	89.27	80.86
2G 类美元对冲 (分派) 份额	45.29	42.71
2I 类新加坡元对冲 (累积) 份额	71.91	65.70
2I 类新加坡元对冲 (分派) 份额	49.84	47.09
2K 类欧元对冲 (分派) 份额	52.36	48.95
2L 类港元对冲 (累积) 份额	-	66.37
2L 类港元对冲 (分派) 份额	49.23	46.69
2XB 类人民币 (累积) 份额	-	96.91
4C 类美元对冲 (累积) 份额	84.00	75.54

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表 (未经审计) 附注 (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

6 向可赎回份额持有人的收益分配

	截至 2024 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2023 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币
于 1 月 1 日的未分配收益	221,968,166	418,113,303
期内份额持有人应占资产净值减少	15,560,880	(36,196,040)
向份额持有人的收益分配	6,550,172	8,985,223
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的未变现亏损	<u>(50,433,719)</u>	<u>22,923,949</u>
分配前的未分配收益	193,645,499	413,826,435
就 1A 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.49 美元的月度收益分配	-	(67,816)
就 1E 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.40 美元的月度收益分配	-	(40,066)
就 2A 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.41 美元的月度收益分配	-	(417,782)
就 2B 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.52 离岸人民币的月度收益分配	-	(414,478)
就 2C 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.47 美元的月度收益分配	-	(119,456)
就 2D 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.40 港元的月度收益分配	-	(305,553)
就 2E 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.41 澳元的月度收益分配	-	(889)
就 2F 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.37 澳元的月度收益分配	-	(32,292)
就 2G 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.36 美元的月度收益分配	-	(570,180)
就 2I 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.40 新加坡元的月度收益分配	-	(67,612)
就 2K 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.31 欧元的月度收益分配	-	(27,290)
就 2L 类份额于 2023 年 1 月 3 日宣派每份额 0.40 港元的月度收益分配	-	(19,555)
就 1A 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.35 美元的月度收益分配	-	(47,208)
就 1E 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.32 美元的月度收益分配	-	(31,238)
就 2A 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.29 美元的月度收益分配	-	(288,524)
就 2B 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.31 离岸人民币的月度收益分配	-	(254,636)
就 2C 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.34 美元的月度收益分配	-	(84,265)
就 2D 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.28 港元的月度收益分配	-	(206,085)

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表 (未经审计) 附注 (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

6 向可赎回份额持有人的收益分配 (续)

	截至 2024 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2023 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币
就 2E 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.29 澳元的月度收益分配	-	(647)
就 2F 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.26 澳元的月度收益分配	-	(23,345)
就 2G 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.28 美元的月度收益分配	-	(432,440)
就 2I 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.26 新加坡元的月度收益分配	-	(43,930)
就 2K 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.22 欧元的月度收益分配	-	(19,522)
就 2L 类份额于 2023 年 2 月 1 日宣派每份额 0.31 港元的月度收益分配	-	(14,717)
就 1A 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.35 美元的月度收益分配	-	(48,133)
就 1E 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.32 美元的月度收益分配	-	(31,850)
就 2A 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.29 美元的月度收益分配	-	(273,217)
就 2B 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.31 离岸人民币的月度收益分配	-	(249,343)
就 2C 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.34 美元的月度收益分配	-	(85,950)
就 2D 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.28 港元的月度收益分配	-	(209,420)
就 2E 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.29 澳元的月度收益分配	-	(631)
就 2F 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.26 澳元的月度收益分配	-	(22,763)
就 2G 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.28 美元的月度收益分配	-	(425,100)
就 2I 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.26 新加坡元的月度收益分配	-	(29,853)
就 2K 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.22 欧元的月度收益分配	-	(19,495)
就 2L 类份额于 2023 年 3 月 1 日宣派每份额 0.31 港元的月度收益分配	-	(8,580)
就 1E 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.32 美元的月度收益分配	-	(31,924)
就 2A 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.29 美元的月度收益分配	-	(272,250)
就 2B 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.31 离岸人民币的月度收益分配	-	(247,092)
就 2C 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.34 美元的月度收益分配	-	(86,186)

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表 (未经审计) 附注 (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

6 向可赎回份额持有人的收益分配 (续)

	截至 2024 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2023 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币
就 2D 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.29 港元的月度收益分配	-	(211,144)
就 2E 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.29 澳元的月度收益分配	-	(629)
就 2F 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.26 澳元的月度收益分配	-	(22,675)
就 2G 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.28 美元的月度收益分配	-	(419,057)
就 2I 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.26 新加坡元的月度收益分配	-	(30,136)
就 2K 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.22 欧元的月度收益分配	-	(19,912)
就 2L 类份额于 2023 年 4 月 3 日宣派每份额 0.31 港元的月度收益分配	-	(5,404)
就 1E 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.32 美元的月度收益分配	-	(32,047)
就 2A 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.29 美元的月度收益分配	-	(273,305)
就 2B 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.31 离岸人民币的月度收益分配	-	(243,892)
就 2C 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.34 美元的月度收益分配	-	(86,557)
就 2D 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.29 港元的月度收益分配	-	(206,638)
就 2E 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.29 澳元的月度收益分配	-	(626)
就 2F 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.26 澳元的月度收益分配	-	(22,583)
就 2G 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.28 美元的月度收益分配	-	(420,669)
就 2I 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.26 新加坡元的月度收益分配	-	(30,329)
就 2K 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.22 欧元的月度收益分配	-	(20,338)
就 2L 类份额于 2023 年 5 月 4 日宣派每份额 0.31 港元的月度收益分配	-	(5,426)
就 1E 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.32 美元的月度收益分配	-	(32,985)
就 2A 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.29 美元的月度收益分配	-	(274,432)
就 2B 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.31 离岸人民币的月度收益分配	-	(243,543)
就 2C 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.34 美元的月度收益分配	-	(87,440)
就 2D 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.29 港元的月度收益分配	-	(211,513)

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表 (未经审计) 附注 (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

6 向可赎回份额持有人的收益分配 (续)

	截至 2024 年 6 月 30 日止六个月 (未经审计) 人民币	截至 2023 年 6 月 30 日止六个月 (未经审计) 人民币
就 2E 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.30 澳元的月度收益分配	-	(652)
就 2F 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.26 澳元的月度收益分配	-	(22,472)
就 2G 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.28 美元的月度收益分配	-	(432,987)
就 2I 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.26 新加坡元的月度收益分配	-	(30,656)
就 2K 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.22 欧元的月度收益分配	-	(20,267)
就 2L 类份额于 2023 年 6 月 1 日宣派每份额 0.31 港元的月度收益分配	-	(5,596)
就 1E 类份额于 2024 年 1 月 2 日宣派每份额 0.32 美元的月度收益分配	(25,472)	-
就 2A 类份额于 2024 年 1 月 2 日宣派每份额 0.30 美元的月度收益分配	(263,103)	-
就 2B 类份额于 2024 年 1 月 2 日宣派每份额 0.31 离岸人民币的月度收益分配	(217,825)	-
就 2C 类份额于 2024 年 1 月 2 日宣派每份额 0.34 美元的月度收益分配	(78,494)	-
就 2D 类份额于 2024 年 1 月 2 日宣派每份额 0.29 港元的月度收益分配	(189,450)	-
就 2E 类份额于 2024 年 1 月 2 日宣派每份额 0.30 澳元的月度收益分配	(683)	-
就 2F 类份额于 2024 年 1 月 2 日宣派每份额 0.27 澳元的月度收益分配	(14,579)	-
就 2G 类份额于 2024 年 1 月 2 日宣派每份额 0.29 美元的月度收益分配	(334,498)	-
就 2I 类份额于 2024 年 1 月 2 日宣派每份额 0.27 新加坡元的月度收益分配	(28,978)	-
就 2K 类份额于 2024 年 1 月 2 日宣派每份额 0.22 欧元的月度收益分配	(3,466)	-
就 2L 类份额于 2024 年 1 月 2 日宣派每份额 0.32 港元的月度收益分配	(4,792)	-
就 1E 类份额于 2024 年 2 月 1 日宣派每份额 0.32 美元的月度收益分配	(13,810)	-
就 2A 类份额于 2024 年 2 月 1 日宣派每份额 0.30 美元的月度收益分配	(256,790)	-
就 2B 类份额于 2024 年 2 月 1 日宣派每份额 0.31 离岸人民币的月度收益分配	(209,092)	-
就 2C 类份额于 2024 年 2 月 1 日宣派每份额 0.26 美元的月度收益分配	(60,531)	-
就 2D 类份额于 2024 年 2 月 1 日宣派每份额 0.29 港元的月度收益分配	(185,456)	-
就 2E 类份额于 2024 年 2 月 1 日宣派每份额 0.30 澳元的月度收益分配	(657)	-
就 2F 类份额于 2024 年 2 月 1 日宣派每份额 0.27 澳元的月度收益分配	(14,034)	-
就 2G 类份额于 2024 年 2 月 1 日宣派每份额 0.29 美元的月度收益分配	(336,789)	-
就 2I 类份额于 2024 年 2 月 1 日宣派每份额 0.27 新加坡元的月度收益分配	(28,808)	-
就 2K 类份额于 2024 年 2 月 1 日宣派每份额 0.22 欧元的月度收益分配	(3,425)	-

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表 (未经审计) 附注 (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

6 向可赎回份额持有人的收益分配 (续)

	截至 2024 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2023 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币
就 2L 类份额于 2024 年 2 月 1 日宣派每份额 0.32 港元的月度收益分配	(4,826)	-
就 1E 类份额于 2024 年 3 月 1 日宣派每份额 0.32 美元的月度收益分配	(13,842)	-
就 2A 类份额于 2024 年 3 月 1 日宣派每份额 0.30 美元的月度收益分配	(257,396)	-
就 2B 类份额于 2024 年 3 月 1 日宣派每份额 0.31 离岸人民币的月度收益分配	(208,829)	-
就 2C 类份额于 2024 年 3 月 1 日宣派每份额 0.26 美元的月度收益分配	(48,070)	-
就 2D 类份额于 2024 年 3 月 1 日宣派每份额 0.29 港元的月度收益分配	(182,755)	-
就 2E 类份额于 2024 年 3 月 1 日宣派每份额 0.30 澳元的月度收益分配	(658)	-
就 2F 类份额于 2024 年 3 月 1 日宣派每份额 0.27 澳元的月度收益分配	(14,052)	-
就 2G 类份额于 2024 年 3 月 1 日宣派每份额 0.29 美元的月度收益分配	(337,569)	-
就 2I 类份额于 2024 年 3 月 1 日宣派每份额 0.27 新加坡元的月度收益分配	(28,765)	-
就 2K 类份额于 2024 年 3 月 1 日宣派每份额 0.22 欧元的月度收益分配	(3,439)	-
就 2L 类份额于 2024 年 3 月 1 日宣派每份额 0.32 港元的月度收益分配	(4,832)	-
就 1E 类份额于 2024 年 4 月 2 日宣派每份额 0.32 美元的月度收益分配	(13,938)	-
就 2A 类份额于 2024 年 4 月 2 日宣派每份额 0.30 美元的月度收益分配	(244,673)	-
就 2B 类份额于 2024 年 4 月 2 日宣派每份额 0.31 离岸人民币的月度收益分配	(207,475)	-
就 2C 类份额于 2024 年 4 月 2 日宣派每份额 0.26 美元的月度收益分配	(48,435)	-
就 2D 类份额于 2024 年 4 月 2 日宣派每份额 0.29 港元的月度收益分配	(180,948)	-
就 2E 类份额于 2024 年 4 月 2 日宣派每份额 0.30 澳元的月度收益分配	(663)	-
就 2F 类份额于 2024 年 4 月 2 日宣派每份额 0.27 澳元的月度收益分配	(14,147)	-
就 2G 类份额于 2024 年 4 月 2 日宣派每份额 0.29 美元的月度收益分配	(332,875)	-
就 2I 类份额于 2024 年 4 月 2 日宣派每份额 0.27 新加坡元的月度收益分配	(28,831)	-
就 2K 类份额于 2024 年 4 月 2 日宣派每份额 0.22 欧元的月度收益分配	(3,441)	-
就 2L 类份额于 2024 年 4 月 2 日宣派每份额 0.32 港元的月度收益分配	(4,865)	-
就 1E 类份额于 2024 年 5 月 2 日宣派每份额 0.32 美元的月度收益分配	(13,879)	-

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

财务报表 (未经审计) 附注 (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

6 向可赎回份额持有人的收益分配 (续)

	截至 2024 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币	截至 2023 年 6 月 30 日止 六个月 (未经审计) 人民币
就 2A 类份额于 2024 年 5 月 2 日宣派每份额 0.30 美元的月度收益分配	(228,451)	-
就 2B 类份额于 2024 年 5 月 2 日宣派每份额 0.31 离岸人民币的月度收益分配	(211,910)	-
就 2C 类份额于 2024 年 5 月 2 日宣派每份额 0.26 美元的月度收益分配	(48,263)	-
就 2D 类份额于 2024 年 5 月 2 日宣派每份额 0.29 港元的月度收益分配	(177,928)	-
就 2E 类份额于 2024 年 5 月 2 日宣派每份额 0.30 澳元的月度收益分配	(662)	-
就 2F 类份额于 2024 年 5 月 2 日宣派每份额 0.27 澳元的月度收益分配	(14,130)	-
就 2G 类份额于 2024 年 5 月 2 日宣派每份额 0.29 美元的月度收益分配	(318,439)	-
就 2I 类份额于 2024 年 5 月 2 日宣派每份额 0.27 新加坡元的月度收益分配	(28,566)	-
就 2K 类份额于 2024 年 5 月 2 日宣派每份额 0.22 欧元的月度收益分配	(3,414)	-
就 2L 类份额于 2024 年 5 月 2 日宣派每份额 0.32 港元的月度收益分配	(4,851)	-
就 1E 类份额于 2024 年 6 月 3 日宣派每份额 0.32 美元的月度收益分配	(13,930)	-
就 2A 类份额于 2024 年 6 月 3 日宣派每份额 0.30 美元的月度收益分配	(229,222)	-
就 2B 类份额于 2024 年 6 月 3 日宣派每份额 0.31 离岸人民币的月度收益分配	(211,918)	-
就 2C 类份额于 2024 年 6 月 3 日宣派每份额 0.26 美元的月度收益分配	(45,158)	-
就 2D 类份额于 2024 年 6 月 3 日宣派每份额 0.29 港元的月度收益分配	(172,454)	-
就 2E 类份额于 2024 年 6 月 3 日宣派每份额 0.30 澳元的月度收益分配	(677)	-
就 2F 类份额于 2024 年 6 月 3 日宣派每份额 0.27 澳元的月度收益分配	(14,448)	-
就 2G 类份额于 2024 年 6 月 3 日宣派每份额 0.29 美元的月度收益分配	(318,618)	-
就 2I 类份额于 2024 年 6 月 3 日宣派每份额 0.27 新加坡元的月度收益分配	(28,861)	-
就 2K 类份额于 2024 年 6 月 3 日宣派每份额 0.22 欧元的月度收益分配	(3,469)	-
就 2L 类份额于 2024 年 6 月 3 日宣派每份额 0.32 港元的月度收益分配	(4,868)	-
于 6 月 30 日的未分配收益	<u>187,095,327</u>	<u>404,841,212</u>

可用于收益分配的金额为本子基金就相关期间应收的总净额 (“总收益”) 与针对收益应支付的支出之差, 有可能会根据信托契约做出调整。总收益将包括以利息 (例如银行存款和债务证券所实现的利息) 或基金管理人确定符合收益性质的其他收入的形式应收的款项。未变现资本收益或亏损不构成总收益的一部分, 因此不会对可用于收益分配的金额产生影响。

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

投资组合 (未经审计)

截至 2024 年 6 月 30 日

	持仓量	公允价值 人民币	占资产净额 百分比(%)
有报价投资			
公司债券(80.66%)			
澳大利亚 (0.72%)			
MINERAL RESOURCE MINAU 8 11/01/27	200,000	1,489,569	0.72
百慕大 (2.91%)			
CHINA OIL CHIOIL 4.7 06/30/26	700,000	4,700,288	2.26
CHINA WATER AFF CWAHK 4.85 05/18/26	200,000	1,345,710	0.65
法国 (1.44%)			
BNP PARIBAS BNP 8 PERP	200,000	1,465,286	0.71
SOCIETE GENERALE SOCGEN 10 PERP	200,000	1,514,887	0.73
香港 (14.62%)			
EHI CAR SERVICES EHICAR 12 09/26/27	568,000	3,806,824	1.83
FWD LTD FWDINS 5 1/2 PERP	400,000	2,610,508	1.26
GLP CHINA GLPCHI 2.95 03/29/26	200,000	1,258,293	0.61
JSW STEEL LTD JSTLIN 5.05 04/05/32	500,000	3,226,091	1.55
LAI SUN MTN LTD LASUDE 5 07/28/26	1,250,000	6,105,571	2.94
RH INTL FINANCE LTD 6.5% 31DEC2049	900,000	3,200,649	1.54
VEDANTA RESOURCE	550,000	3,249,649	1.58
YANLORD LAND HK YLLGSP 5 1/8 05/20/26	1,100,000	6,873,687	3.31
印度 (2.53%)			
ADANI RENEW ENER ARENRJ 4 5/8 10/15/39	200,000	1,016,182	0.49
JABABEKA INTL BV KIJAIJ 7 12/15/27	600,000	4,232,224	2.04
印尼 (3.41%)			
INDIKA INTI ENEG INDYIJ 8 3/4 05/07/29	350,000	2,556,032	1.23
LONGFOR HOLDINGS LNGFOR 3.95 09/16/29	850,000	4,531,371	2.18
日本 (2.18%)			
RAKUTEN GROUP RAKUTN 9 3/4 04/15/29	600,000	4,519,809	2.18
泽西岛 (1.15%)			
WEST CHINA CEM WESCHI 4.95 07/08/26	400,000	2,389,354	1.15
毛里求斯 (0.71%)			
DIAMOND II LTD RNW 7.95 07/28/26	200,000	1,480,104	0.71
蒙古 (1.66%)			
MODERNLAND OVERS MDLNIJ 6.95 04/13/24	1,350,000	3,444,132	1.66
荷兰 (0.64%)			
MINEJESA CAPITAL MINCAP 5 5/8 08/10/37	200,000	1,323,922	0.64

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

投资组合 (未经审计) (续)

截至 2024 年 6 月 30 日

	持仓量	公允价值 人民币	占资产净额 百分比(%)
公司债券(80.66%) (续)			
中国内地 (44.38%)			
AGILE GROUP AGILE 5 1/2 04/21/25	500,000	254,494	0.12
BANK OF EAST ASIA LTD FRN 31DEC2049	500,000	3,573,924	1.72
CA MAGNUM HLDING HEXWIN 5 3/8 10/31/26	200,000	1,396,245	0.67
CAS CAPITAL NO1 CASHLD 4 PERP	550,000	3,748,791	1.81
CIFI HOLDINGS GROUP	700,000	563,379	0.27
EHI CAR SERVICES EHCAR 7 09/21/26	400,000	2,522,507	1.22
ESTATE SKY LTD CSIPRO 5.45 07/21/25	200,000	1,306,712	0.63
FORTUNE STAR FOSUNI 5 05/18/26	200,000	1,361,024	0.66
FORTUNE STAR FOSUNI 5.05 01/27/27	1,100,000	7,255,580	3.50
GREENKO DUTCH BV GRNKEN 3.85 03/29/26	500,000	3,133,257	1.51
GREENTOWN CHINA GRNCH 5.65 07/13/25	400,000	2,776,797	1.34
ING GROEP NV INTNED 8 PERP	200,000	1,488,839	0.72
LI & FUNG LTD LIFUNG 5 1/4 12/29/49	2,450,000	8,453,469	4.07
LS FINANCE 2017 LIHKK 4.8 06/18/26	1,200,000	7,967,331	3.84
MELCO RESORTS MPEL 5 3/4 07/21/28	200,000	1,365,632	0.66
MONGO MIN/ENG RE MONMIN 12 1/2 09/13/26	500,000	3,887,629	1.87
NEW METRO GLOBAL FTLNHD 4 1/2 05/02/26	500,000	2,224,049	1.07
NWD FINANCE (BVI) LTD FRN 31DEC2049	1,000,000	5,953,987	2.88
NWD FINANCE(BVI) NWDEVL 4.8 PERP	850,000	2,641,951	1.27
RKPF OVRS 2020 A ROADKG 5 1/8 07/26/26	200,000	470,733	0.23
SHUI ON DEVELOP SHUION 5 1/2 03/03/25	650,000	3,910,380	1.88
SHUI ON DEVELOP SHUION 5 1/2 06/29/26	400,000	2,098,749	1.01
SMC GLOBAL POWER SMCGL 5.95 PERP	450,000	3,239,403	1.56
STANDARD CHART STANLN 7 3/4 PERP	800,000	5,890,604	2.84
STUDIO CITY FIN STCITY 5 01/15/29	200,000	1,286,076	0.62
SUN HUNG KAI BVI SUNHKK 5 09/07/26	1,000,000	6,730,813	3.24
SUNAC CHINA HLDG SUNAC 6 1/2 09/30/27	462,233	370,771	0.18
VANKE REAL ESTAT VNKRL 3.975 11/09/27	400,000	1,864,178	0.90
WANDA PROP GLOBA DALWAN 11 02/13/26	350,000	2,200,864	1.06
WYNN MACAU LTD WYNNAC 5 1/2 01/15/26	300,000	2,145,317	1.03
新加坡 (2.97%)			
CONTINUUM ENERGY COGREN 9 1/2 02/24/27	200,000	1,499,982	0.72
GLP PTE LTD GLPSP 4.6 PERP	600,000	2,713,487	1.31
MEDCO MAPLE TREE MEDCIJ 8.96 04/27/29	250,000	1,907,682	0.92
MODERNLAND OVERS MDLNIJ 3 04/30/27	20,250	51,068	0.02
英国 (1.34%)			
BARCLAYS PLC BACR 9 5/8 PERP	200,000	1,580,180	0.76
STANDARD CHART STANLN 4 3/4 PERP	200,000	1,206,067	0.58
公司债券总计		167,382,093	80.66

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

投资组合 (未经审计) (续)

截至 2024 年 6 月 30 日

	持仓量	公允价值 人民币	占资产净额 百分比(%)
政府债券 (9.02%)			
巴基斯坦 (4.21%)			
REP OF PAKISTAN PKSTAN 6 7/8 12/05/27	1,200,000	7,581,959	3.65
REP OF PAKISTAN PKSTAN 7 3/8 04/08/31	200,000	1,152,995	0.56
斯里兰卡 (4.14%)			
REP OF SRI LANKA 0.00% 11MAY2027	2,000,000	8,581,325	4.14
美国 (0.67%)			
STRIP PRINC 0% 15FEB2054	700,000	1,392,496	0.67
政府债券总计		<u>18,708,775</u>	<u>9.02</u>

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

投资组合 (未经审计) (续)

截至 2024 年 6 月 30 日

衍生金融工具 (-0.67%)

基础资产	对手方	未偿付合约名义值	公允价值 人民币	占资产净额 百分比(%)
外汇远期合约				
买入澳元/卖出美元	花旗银行	5,910 澳元	(1,521,869)	(0.73)
买入澳元/卖出人民币	花旗银行	544,883 澳元	26,322	0.01
买入澳元/卖出人民币	花旗银行	774,591 澳元	37,418	0.02
买入澳元/卖出人民币	花旗银行	9,242 澳元	109	0.00
买入人民币/卖出人民币	渣打银行	117,000,000 人民币	-	-
买入人民币/卖出人民币	花旗银行	176,642 人民币	-	-
买入人民币/卖出人民币	巴克莱银行	47,000,000 人民币	-	-
买入人民币/卖出人民币	巴克莱银行	47,000,000 人民币	-	-
买入欧元/卖出人民币	花旗银行	1,227 欧元	(4)	(0.00)
买入欧元/卖出人民币	花旗银行	103,643 欧元	1,273	0.00
买入港元/卖出人民币	花旗银行	794,935 港元	2,020	0.00
买入港元/卖出人民币	花旗银行	8,130 港元	(3)	(0.00)
买入新加坡元/卖出人民币	花旗银行	10,754 新加坡元	15	0.00
买入新加坡元/卖出人民币	花旗银行	2,673 新加坡元	7	0.00
买入新加坡元/卖出人民币	花旗银行	249,959 新加坡元	2,825	0.00
买入新加坡元/卖出人民币	花旗银行	972,872 新加坡元	10,993	0.01
买入美元/卖出人民币	花旗银行	1,133,213 美元	27,083	0.01
买入美元/卖出人民币	花旗银行	12,624 美元	92	0.00
买入美元/卖出人民币	花旗银行	3,449 美元	38	0.00

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

投资组合 (未经审计) (续)

截至 2024 年 6 月 30 日

衍生金融工具 (-0.67%) (续)

基础资产	对手方	未偿付合约名义值	公允价值 人民币	占资产净额 百分比(%)
外汇远期合约 (续)				
买入美元/卖出人民币	花旗银行	303,588 美元	7,255	0.00
买入美元/卖出人民币	花旗银行	6,681,889 美元	159,691	0.07
买入美元/卖出美元	花旗银行	68,425 美元	(113)	(0.00)
买入美元/卖出美元	花旗银行	80,032 美元	(67,889)	(0.03)
买入美元/卖出美元	花旗银行	901 美元	(71,154)	(0.03)
衍生金融工具总计			(1,385,891)	(0.67)
资产净额总计				
投资总计, 按公允价值			186,090,868	89.68
衍生金融工具			(1,385,891)	(0.67)
银行结余			4,484,221	2.16
其他资产净额			18,318,176	8.83
资产净额总计			207,507,374	100.00
投资总计, 按成本			172,198,289	

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

投资组合持仓变动表 (未经审计)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

	截至 2024 年 1 月 1 日	增添	出售	截至 2024 年 6 月 30 日
有报价投资				
公司债券				
澳大利亚				
MACQUARIE BANK LONDON FRN 31DEC2049	-	200,000	(200,000)	-
MINERAL RESOURCE MINAU 8 11/01/27	200,000	-	-	200,000
百慕大				
CHINA OIL CHIOIL 4.7 06/30/26	400,000	700,000	(400,000)	700,000
CHINA WATER AFF CWAHK 4.85 05/18/26	200,000	-	-	200,000
LI & FUNG LTD LIFUNG 4 1/2 08/18/25	200,000	-	(200,000)	-
LONGFOR PROPRTI LNGFOR 4 1/2 01/16/28	-	400,000	(400,000)	-
英国				
HSBC HOLDINGS HSBC 6 3/8 12/29/49	200,000	-	(200,000)	-
中国内地				
BANK OF COMMUNICATIONS FRN 31DEC2020	350,000	-	(350,000)	-
法国				
BNP PARIBAS BNP 8 PERP	-	200,000	-	200,000
SOCIETE GENERALE SOCGEN 10 PERP	-	200,000	-	200,000
香港				
CHONG HING BANK LTD FRN 31DEC2049	250,000	-	(250,000)	-
CTHY PCFC MTN HK CATHAY 4 7/8 08/17/26	200,000	-	(200,000)	-
EHI CAR SERVICES EHICAR 12 09/26/27	-	568,000	-	568,000
FWD LTD FWDINS 5 1/2 PERP	950,000	600,000	(1,150,000)	400,000
GLP CHINA GLPCHI 2.95 03/29/26	-	200,000	-	200,000
JSW STEEL LTD JSTLIN 5.05 04/05/32	700,000	-	(200,000)	500,000
LAI SUN MTN LTD LASUDE 5 07/28/26	200,000	1,050,000	-	1,250,000
LENOVO GROUP LTD 5.875% 24APR2025	200,000	-	(200,000)	-
NANYANG COMMERC NANYAN 6 1/2 PERP	300,000	-	(300,000)	-
RH INTL FINANCE LTD 6.5% 31DEC2049	600,000	300,000	-	900,000
VEDANTA RESOURCE	-	950,000	(400,000)	550,000
YANLORD LAND HK YLLGSP 5 1/8 05/20/26	-	1,100,000	-	1,100,000
印度				
ADANI RENEW ENER ARENRJ 4 5/8 10/15/39	-	200,000	-	200,000
JABABEKA INTL BV KIJAIJ 7 12/15/27	300,000	300,000	-	600,000
KWG PROPERTY KWGPRO 0% 11/10/24	500,000	-	(500,000)	-
MEDCO BELL MEDCIJ 6 3/8 01/30/27	300,000	-	(300,000)	-
印尼				
ALAM SUTERA REAL ASRIIJ 8 1/4 11/02/25	200,000	-	(200,000)	-
CELESTIAL DYNASTY LTD 4.25% 27JUN2029	255,000	-	(255,000)	-
DELHI INTL AIRPORT 6.125% 31OCT2026	200,000	-	(200,000)	-
INDIKA INTI ENEG INDYIJ 8 3/4 05/07/29	-	600,000	(250,000)	350,000
LONGFOR HOLDINGS LNGFOR 3.95 09/16/29	-	850,000	-	850,000

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

投资组合持仓变动表 (未经审计) (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

公司债券 (续)	截至 2024 年 1 月 1 日	增添	出售	截至 2024 年 6 月 30 日
日本				
RAKUTEN GROUP RAKUTN 9 3/4 04/15/29	-	600,000	-	600,000
泽西岛				
WEST CHINA CEM WESCHI 4.95 07/08/26	200,000	200,000	-	400,000
毛里求斯				
DIAMOND II LTD RNW 7.95 07/28/26	200,000	-	-	200,000
蒙古				
MGM CHINA HOLDIN MGMCHI 5 7/8 05/15/26	500,000	-	(500,000)	-
MODERNLAND OVERS MDLNIJ 6.95 04/13/24	-	1,350,000	-	1,350,000
荷兰				
MINEJESA CAPITAL MINCAP 5 5/8 08/10/37	200,000	-	-	200,000
巴基斯坦				
NETWORK I2I LTD FRN 31DEC2049	300,000	-	(300,000)	-
中国内地				
AGILE GROUP AGILE 5 1/2 04/21/25	500,000	-	-	500,000
AGILE GROUP HOLDINGS LTD 6.05% 13OCT2025	300,000	-	(300,000)	-
BANK OF EAST ASIA LTD FRN 31DEC2049	500,000	250,000	(250,000)	500,000
BUKIT MAKMUR MAN DOIDIJ 7 3/4 02/10/26	300,000	-	(300,000)	-
CA MAGNUM HLDING HEXWIN 5 3/8 10/31/26	400,000	200,000	(400,000)	200,000
CAS CAPITAL NO1 CASHLD 4 PERP	550,000	-	-	550,000
CELESTIAL NWSZF 5 3/4 PERP	200,000	-	(200,000)	-
CFLD CAYMAN INV CHFOTN 0 01/31/31	-	50,000	(50,000)	-
CFLD CAYMAN INV CHFOTN 9 07/31/21	1,000,000	-	(1,000,000)	-
CFLD CAYMAN INVESTMENT 0.00% 31 JAN2031	-	1,000,000	(1,000,000)	-
CHAMPION PATH SOCJOG 4 1/2 01/27/26	200,000	-	(200,000)	-
CIFI HOLDINGS GROUP	1,400,000	-	(700,000)	700,000
EHI CAR SERVICES EHICAR 7 09/21/26	200,000	200,000	-	400,000
EHI CAR SERVICES EHICAR 7 3/4 11/14/24	-	200,000	(200,000)	-
ESTATE SKY LTD CSIPRO 5.45 07/21/25	-	200,000	-	200,000
FORTUNE STAR FOSUNI 5 05/18/26	200,000	-	-	200,000
FORTUNE STAR FOSUNI 5.05 01/27/27	500,000	600,000	-	1,100,000
GLP PTE LTD GLPSP 4 1/2 PERP	-	250,000	(250,000)	-
GREENKO DUTCH BV GRNKEN 3.85 03/29/26	1,100,000	-	(600,000)	500,000
GREENTOWN CHINA GRNCH 5.65 07/13/25	-	400,000	-	400,000
HDFC BANK LTD HDFCB 3.7 PERP	400,000	-	(400,000)	-
HILONG HOLDING HILOHO 9 3/4 11/18/24	400,000	-	(400,000)	-
HUARONG FINANCE HRAM 4 1/4 11/07/27	1,000,000	-	(1,000,000)	-
ICBC LTD ICBCAS 3.2 PERP	500,000	-	(500,000)	-
ING GROEP NV INTNED 8 PERP	-	200,000	-	200,000
KAISA GROUP 0% 30JUN2099	550,000	-	(550,000)	-
KAISA GROUP KAISAG 9 3/4 09/28/99	2,500,000	-	(2,500,000)	-
KWG GROUP KWGPRO 5.95 08/10/25	250,000	-	(250,000)	-

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

投资组合持仓变动表 (未经审计) (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

	截至 2024 年 1 月 1 日	增添	出售	截至 2024 年 6 月 30 日
公司债券 (续)				
中国内地 (续)				
LI & FUNG LTD LIFUNG 5 1/4 12/29/49	-	2,450,000	-	2,450,000
LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.25% 19JUN2024	200,000	-	(200,000)	-
LOGAN GROUP CO LTD 0.00% 12JUL2025	750,000	-	(750,000)	-
LS FINANCE 2017 LIHKK 4.8 06/18/26	400,000	800,000	-	1,200,000
MELCO RESORTS MPEL 5 3/4 07/21/28	1,200,000	-	(1,000,000)	200,000
MGM CHINA HOLDIN MGMCHI 5 1/4 06/18/25	200,000	-	(200,000)	-
MONG DUONG FIN MONDFI 5 1/8 05/07/29	1,000,000	-	(1,000,000)	-
MONGO MIN/ENG RE MONMIN 12 1/2 09/13/26	200,000	300,000	-	500,000
NEW METRO GLOBAL FTLNHD 4 1/2 05/02/26	300,000	200,000	-	500,000
NEW METRO GLOBAL FTLNHD 4 5/8 10/15/25	300,000	-	(300,000)	-
NWD FINANCE (BVI) LTD FRN 31DEC2049	450,000	550,000	-	1,000,000
NWD FINANCE(BVI) NWDEVL 4.8 PERP	-	1,550,000	(700,000)	850,000
RAKUTEN GROUP RAKUTN 11 1/4 02/15/27	-	400,000	(400,000)	-
RENEW POWER PVT LTD 5.875% 05MAR2027	208,000	-	(208,000)	-
RKPF OVRS 2020 A ROADKG 5 1/8 07/26/26	500,000	400,000	(700,000)	200,000
SHUI ON DEVELOP SHUION 5 1/2 03/03/25	550,000	700,000	(600,000)	650,000
SHUI ON DEVELOP SHUION 5 1/2 06/29/26	-	400,000	-	400,000
SMC GLOBAL POWER SMCGL 5.95 PERP	1,000,000	250,000	(800,000)	450,000
STANDARD CHART STANLN 7 3/4 PERP	500,000	300,000	-	800,000
STUDIO CITY FIN STCITY 5 01/15/29	400,000	-	(200,000)	200,000
STUDIO CITY FIN STCITY 6 07/15/25	300,000	-	(300,000)	-
SUN HUNG KAI BVI SUNHKC 5 09/07/26	500,000	500,000	-	1,000,000
SUNAC CHINA HLDG SUNAC 1 09/30/32	276,698	-	(276,698)	-
SUNAC CHINA HLDG SUNAC 6 1/2 09/30/27	447,683	14,550	-	462,233
SUNAC CHINA HLDG SUNAC 6 1/4 09/30/26	223,841	-	(223,841)	-
SUNAC CHINA HLDG SUNAC 6 3/4 09/30/28	671,525	22,665	(694,190)	-
THETA CAPITAL PTE LTD 8.125% 22JAN2025	250,000	-	(250,000)	-
VANKE REAL ESTAT VNKRL 3.975 11/09/27	200,000	400,000	(200,000)	400,000
WANDA PROP GLOBA DALWAN 11 02/13/26	-	550,000	(200,000)	350,000
WYNN MACAU LTD WYNNAC 5 1/2 01/15/26	1,300,000	-	(1,000,000)	300,000
新加坡				
CONTINUUM ENERGY COGREN 9 1/2 02/24/27	200,000	-	-	200,000
GLP PTE LTD GLPSP 4.6 PERP	-	600,000	-	600,000
LLPL CAPITAL PTE LTD 6.875% 04FEB2039	200,000	-	(200,000)	-
LMIRT CAPITAL LMRTSP 7 1/2 02/09/26	-	850,000	(850,000)	-
MEDCO MAPLE TREE MEDCIJ 8.96 04/27/29	250,000	-	-	250,000
MODERNLAND OVERS MDLNIJ 3 04/30/27	-	40,500	(20,250)	20,250
斯里兰卡				
瑞士				
UBS GROUP UBS 7 3/4 PERP	-	200,000	(200,000)	-
英国				
BARCLAYS PLC BACR 9 5/8 PERP	-	200,000	-	200,000
STANDARD CHART STANLN 4 3/4 PERP	-	200,000	-	200,000

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

投资组合持仓变动表 (未经审计) (续)

截至 2024 年 6 月 30 日止六个月

	截至 2024 年 1 月 1 日	增添	出售	截至 2024 年 6 月 30 日
政府债券				
蒙古				
MONGOLIA MONGOL 7 7/8 06/05/29	200,000	-	(200,000)	-
巴基斯坦				
REP OF PAKISTAN PKSTAN 6 7/8 12/05/27	1,600,000	-	(400,000)	1,200,000
REP OF PAKISTAN PKSTAN 7 3/8 04/08/31	-	200,000	-	200,000
斯里兰卡				
REP OF SRI LANKA 0.00% 11MAY2027	2,400,000	-	(400,000)	2,000,000
美国				
STRIP PRINC 0% 15FEB2054	-	700,000	-	700,000
投资基金				
香港				
INCOME PART RMB BOND-4A USDA	32,500	-	(32,500)	-

弘收高收益波幅管理债券基金
(弘收策略基金的子基金)

抵押品持仓 (未经审计)

截至 2024 年 6 月 30 日

抵押品提供方	抵押品性质	信用评级	评级机构	到期期限	计价货币	占抵押品所覆盖资产净值的比例(%)	抵押品价值人民币
巴克莱银行	现金	N/A	N/A	N/A	美元	1.28%	2,646,826
渣打银行	现金	N/A	N/A	N/A	美元	4.32%	8,974,371
瑞银	现金	N/A	N/A	N/A	美元	0.00%	169
"KGI Securities (Singapore) Pte.Ltd."	现金	N/A	N/A	N/A	美元	0.01%	21,512

有关现金抵押品再投资的详情

进行再投资的已收取现金抵押品	发行文件中指明的最高金额	进行再投资的已收取现金抵押品占发行文件中指明的最高金额的比例	现金抵押品再投资产生的回报
-	N/A	-	-