

## 百达香港

未经审计半年度报告

瑞士百达策略收益

2024 年 10 月 1 日至 2025 年 3 月 31 日止期间

瑞士百达亚洲债券收益

2024 年 10 月 1 日至 2025 年 3 月 31 日止期间

百达香港之子基金

目录

|                       | 页码    |
|-----------------------|-------|
| 管理及行政                 | 1     |
| 管理人报告                 | 2-4   |
| 财务状况表(未经审计)           | 5-6   |
| 综合收益表(未经审计)           | 7-8   |
| 归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计) | 9-14  |
| 现金流量表(未经审计)           | 15-16 |
| 投资组合(未经审计)            | 17-25 |
| 投资组合持有变动表(未经审计)       | 26-27 |
| 衍生金融工具详情(未经审计)        | 28-33 |
| 派息披露(未经审计)            | 34-38 |
| 业绩记录(未经审计)            | 39-44 |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

管理及行政

管理人

瑞士百达资产管理(香港)有限公司  
香港中环  
干诺道中 8 号  
遮打大厦 8-9 楼

管理人董事

Cédric Jean-Albert Vermesse  
Hau Keung Yeung  
John Alexander Sample  
Junjie Watkins  
Nicolas Leresche

受托人及注册登记机  
构

汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司  
香港中环  
皇后大道中 1 号

托管人

香港上海汇丰银行有限公司  
香港中环  
皇后大道中 1 号

中国内地托管人

汇丰银行(中国)有限公司  
中国  
上海市浦东新区  
世纪大道 8 号  
上海国金中心  
汇丰银行大楼 33 楼

核数师

罗兵咸永道会计师事务所  
香港中环  
太子大厦 22 楼

管理人法律之

的近律师行  
香港中环  
遮打道 18 号  
历山大厦 5 楼

管理人报告

瑞士百达策略收益

2025 年 3 月

进入 2024 年下半年，全球各国的重要选举陆续展开，凸显选民求变诉求。“政策转向”成为市场叙事的主旋律。

- 全球央行货币政策由加息转向降息。
- 更重要的是，地缘政治格局加速重构。过去 80 年建立的世界秩序正悄然发生改变。
- 历经数年发展，中国资本市场的巩固已上升为政治任务。
- “新乒乓外交”印证了地缘裂变加剧。

九月，美国大选成为全球焦点。特朗普在十一月赢得大选后，“政策转向”进一步加速。一方面，政府出台减税政策，放松监管，呼吁重燃“动物精神”，激发市场活力。另一方面，政府成立了联邦政府效率部，调整关税，同时引发了诸多现实挑战，比如文化冲突、高校整顿、司法权威被质疑、美联储独立性危机等。

起初，市场普遍持“乐观”态度。市场证明了特朗普政府之前推行的亲商政策以及宽松监管能带来不少机遇。制造业回流和吸引投资将重燃“动物精神”，唤醒市场活力。

但随后悲观情绪占据上风。特朗普政府本次执政采取了激进策略，有意颠覆联邦机构体系。其于“解放日”宣布的高关税震惊全球，显露禁运实质。“毁灭日”紧随其后，美股美债双双遭受重创。大规模金融动荡接踵而至。外国投资者纷纷撤回资本。美股下跌，但美国国债并未发挥避险作用。美元亦大幅贬值。

市场叙事的另一主旋律是“摩尔定律已死，新摩尔定律万岁”。本质上，虽然长期增长势头强劲且正在加速，但投资策略亟需转变。春节前后，中国企业 DeepSeek 推出了一种计算效率更高的模型蒸馏技术。新的算法不仅代表计算能力的突破，更是科技进步的又一力证。自此以后，市场更加确认中美叙事逆转。美国承接了中国的改革叙事(成立联邦政府效率部/调整关税等)，而中国则续写美国的科技发展/人工智能叙事。

在此背景下，市场出现了重大波动和不确定性。我们自 2025 年初逐步减持美股，从 40%左右降至 15%以内。与此同时，我们逐步拉高在中国的资产配置，比例从 5%以下拉高至接近 20%，重点布局科技、软件/应用、内需消费和资本流动等领域。我们通过增持黄金、非美元投资（包括非美元债券）降低了投资组合的风险。我们亦缩短美债久期。

尽管市场受到严重干扰，但长期增长势头依然强劲，科技进步正处于关键阶段。但投资策略亟需转变。经济增长停滞叠加通胀上行的趋势比过去几年更为严重。美国存托股票可能会受到经济不确定性的影响。供应链正不断打乱重组。硬件面临制裁风险和市场巨变。

我们增加了对人工智能软件和应用的投资，这些领域发展迅速，并且相对不受关税影响。我们更青睐那些经济韧性更强的板块，比如依托新兴营收业务的流媒体，正展现“绿地增长”潜力。网络安全和未来国防以及软件/平台等领域将变得越来越重要。

面对“政策转向”和“摩尔定律已死，新摩尔定律万岁”的叙事旋律，我们降低了投资风险，增持黄金和非美元投资，并调整了长期增长领域的投资策略。

瑞士百达资产管理(香港)有限公司  
2025 年 5 月 22 日

## 管理人报告(续)

### 瑞士百达亚洲债券收益

#### 市场回顾

2024 年第四季度，市场开始消化特朗普赢得美国大选的概率增加的预期。与此同时，季初全球经济前景再次变得明朗，投资者因此降低了对美联储迅速降息的预期。通胀数据进一步印证了这一趋势，美国核心 CPI 上升至六个月高点。这意味着市场削减了对美联储大幅降息的预期。2024 年 11 月，特朗普赢得大选，这一趋势进一步加速。

2024 年第四季度，中国的宏观经济数据有所改善，尤其是制造和出口相关领域。房地产和服务业仍相对低迷，但 2025 年有望出台更大规模的刺激措施，包括针对消费端的刺激措施，以支撑市场发展。2024 年末，亚洲其他地区的基本面颇为乐观，部分得益于 2024 年下半年诸如菲律宾、泰国、韩国和印尼等国家推行的降息政策。印度此前极高的增长率稍有放缓，但来年的增长率预计仍将保持在 6%至 7%。印尼经济增长强劲，菲律宾经济亦因其央行降息而迎来反弹。

#### 投资组合回顾

在过去 6 个月中，本基金的美元口径总收益率为 1.35%，略逊于 JACI 企业指数（1.55%）。2024 年第四季度，策略业绩略微落后基准，但在 2025 年第一季度恢复了相对业绩表现。

2024 年第四季度的主要优势领域是我们对印度金属和矿业及金融板块的超配。在金属和矿业领域，收益率主要得益于个别企业的复苏而非整个行业。在金融领域，我们重点布局非银行金融机构，这些机构通过住房贷款、小额信贷、中小企业贷款和黄金贷款等推动普惠金融，对印度增长起到至关重要的作用。我们的另一优势举措是对台湾工业股的低配，因为该板块对美国国债的负面波动非常敏感。与此同时，在美国国债走软之际，久期成为主要拖累因素。这影响了我们对泰国油气以及韩国金融板块的部分长期债券持仓。

2025 年第一季度的优绩表现主要归功于我们在中国房地产领域的选股，以及对澳门消费和韩国金融板块的超配（主要关注相关券商以及头部银行的次级债券）。我们对泰国油气板块的持仓也收复了之前的部分损失。在市场整体走强的背景下，拖累表现主要集中在低配部分，包括台湾工业股和韩国公用事业股，我们认为这两个领域的估值偏高，因此吸引力不大。

#### 市场展望

鉴于美联储已开启新一轮货币宽松周期，且亚洲的多个国家央行（韩国、印尼、泰国、菲律宾、印度）也已开始放宽货币政策，我们认为目前亚洲美元公司债的前景乐观。

管理人报告(续)

瑞士百达亚洲债券收益

美国关税政策可能引发反通胀效应并减缓经济增长，由此推动地方央行加速宽松周期，并可能催生部分地区（尤其是中国）的财政刺激。亚洲新兴市场的增长起点强劲，且存在缓冲空间，能够吸收贸易疲软带来的影响。美元走弱也构成一大利好因素，进一步锚定通胀预期，为当地市场创造了更加宽松的金融条件，利好企业。

多样化的亚洲市场提供了诸多有吸引力的选择——具体取决于关税政策的进一步发展，因为关税战的结局必定是有赢有输。目前，我们重点关注企业的资产负债表，以确定最佳买入卖出时机。我们更偏好收入稳定且在很大程度上受关税政策保护的企业。我们在管理久期时更倾向在当前水平上适度超配美国国债；我们对信用利差也保持适度超配的立场，但将投资组合重点放在内需导向的债券和防御性板块，包括电信公司。目前的基准情景仍然是美联储进一步逐步放松货币政策，且今年后续美国关税政策的调整可能会加快这一趋势。

我们正在采取更具防御性的策略配置投资组合，削减了部分贝塔系数较高、周期性较强的仓位，转向更稳定的领域。我们还可能在韩国或香港的公用事业、稳健金融和必需消费品领域进一步增加投资。

中国企业也可能受益于预计将出台的进一步货币和财政宽松政策。我们已经看到近期实施的助力消费的举措已显现积极成效。

我们仍看好印度和印尼的结构性机会，但鉴于其贝塔系数较高且估值偏高，我们在该等地区进行了减仓。后续我们可能会在更好的时机重新增加投资。

瑞士百达资产管理(香港)有限公司  
2025 年 5 月 22 日

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

财务状况表(未经审计)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

|                     | 2025 年 3 月 31 日 | 2024 年 9 月 30 日 |
|---------------------|-----------------|-----------------|
|                     | (美元)            | (美元)            |
| 资产                  |                 |                 |
| 投资                  | 863,420,117     | 772,257,498     |
| 衍生金融资产              | 35,004          | 3,997,070       |
| 应收认购款               | 4,160,675       | 8,478,306       |
| 应收经纪款               | 846,231         | 4,450,509       |
| 应收股息                | 409,464         | 434,303         |
| 应收银行利息              | 66,663          | 2,497           |
| 应收投资利息              | 4,082,336       | 2,714,343       |
| 其他应收款               | 140,999         | 140,999         |
| 保证金                 | 4,781,182       | 1,433,592       |
| 现金及现金等价物            | 64,375,014      | 34,732,352      |
| 总资产                 | 942,317,685     | 828,641,469     |
| 负债                  |                 |                 |
| 衍生金融负债              | 1,870,962       | 320,742         |
| 应付赎回款               | 1,413,555       | 3,774,593       |
| 应付经纪款               | 847,403         | 9,688,291       |
| 其他应付款               | 1,552,281       | 1,410,191       |
| 负债(不包括归属于份额持有人的净资产) | 5,684,201       | 15,193,817      |
| 归属于份额持有人的净资产        | 936,633,484     | 813,447,652     |

附注：子基金半年度报告所采用的会计政策和计算方法与年报相同。

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

财务状况表(未经审计)(续)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

|                     | 2025 年 3 月 31 日 | 2024 年 9 月 30 日 |
|---------------------|-----------------|-----------------|
|                     | (美元)            | (美元)            |
| 资产                  |                 |                 |
| 投资                  | 31,685,219      | 25,810,741      |
| 衍生金融资产              | 28,239          | 46,068          |
| 应收认购款               | 183,526         | 29,006          |
| 应收经纪款               | 648,683         | 1,718,078       |
| 应收银行利息              | 891             | 21              |
| 应收投资利息              | 388,524         | 307,223         |
| 其他应收款               | 7,605           | 12,675          |
| 保证金                 | 119,131         | 92,785          |
| 现金及现金等价物            | 1,916,829       | 474,868         |
| 总资产                 | 34,978,647      | 28,491,465      |
| 负债                  |                 |                 |
| 衍生金融负债              | 27,614          | 5,696           |
| 应付经纪款               | 1,916,370       | 1,813,059       |
| 应付成立费用              | 8,450           | 13,520          |
| 其他应付款               | 62,562          | 48,469          |
| 负债(不包括归属于份额持有人的净资产) | 2,014,996       | 1,880,744       |
| 归属于份额持有人的净资产        | 32,963,651      | 26,610,721      |

附注：子基金半年度报告所采用的会计政策和计算方法与年报相同。

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

综合收益表(未经审计)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

|                           | 2024 年 10 月 1 日至<br>2025 年 3 月 31 日止<br>期间 | 2023 年 10 月 1 日至<br>2024 年 3 月 31 日止<br>期间 |
|---------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
|                           | (美元)                                       | (美元)                                       |
| 收益                        |                                            |                                            |
| 股息收入                      | 3,024,392                                  | 1,156,966                                  |
| 银行存款利息收益                  | 319,383                                    | 124,268                                    |
| 投资利息收益                    | 6,430,239                                  | 3,133,587                                  |
| 投资和衍生金融工具公允价值的净变动         | (72,320,676)                               | 52,726,573                                 |
| 汇兑净损失                     | (411,852)                                  | (22,267)                                   |
| 总投资(亏损)/利润                | (62,958,514)                               | 57,119,127                                 |
| 开支                        |                                            |                                            |
| 管理费用 <sup>附注 2</sup>      | 6,001,279                                  | 2,567,057                                  |
| 受托人费用 <sup>附注 1</sup>     | 401,373                                    | 175,718                                    |
| 交易成本 <sup>附注 1</sup>      | 877,717                                    | 151,047                                    |
| 托管费和银行手续费 <sup>附注 1</sup> | 161,862                                    | 59,781                                     |
| 核数师酬金                     | 16,378                                     | 12,164                                     |
| 法律及专业服务费                  | 28,832                                     | 9,074                                      |
| 其他运营费用 <sup>附注 1</sup>    | 55,350                                     | 36,603                                     |
| 营业费用总额                    | 7,542,791                                  | 3,011,444                                  |
| 经营(亏损)/利润                 | (70,501,305)                               | 54,107,683                                 |
| 财务成本                      |                                            |                                            |
| 对份额持有人派发股息                | (16,930,222)                               | (11,601,912)                               |
| 收益分配后及税前(亏损)/利润           | (87,431,527)                               | 42,505,771                                 |
| 股息收入预扣税                   | (617,763)                                  | (238,740)                                  |
| 归属于份额持有人的净资产(减少)/增加       | (88,049,290)                               | 42,267,031                                 |

附注 1 于截至 2025 年 3 月 31 日和 2024 年 3 月 31 日止期间，向受托人或其关联人士支付了受托人费用、托管费和银行手续费，支付给受托人或其关联人士的其他款项如下：

|        | 2024 年 10 月 1 日至<br>2025 年 3 月 31 日止<br>期间 | 2023 年 10 月 1 日至<br>2024 年 3 月 31 日止<br>期间 |
|--------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
| 交易成本   | 112,915                                    | 51,641                                     |
| 其他运营费用 | 13,866                                     | 15,296                                     |

附注 2 于截至 2025 年 3 月 31 日和 2024 年 3 月 31 日止期间，除向管理人支付的管理费用外，未向管理人或其关联人士支付其他任何款项。

瑞士百达策略收益  
 瑞士百达亚洲债券收益  
 (百达香港之子基金)

综合收益表(未经审计)(续)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

|                           | 2024 年 10 月 1 日至<br>2025 年 3 月 31 日止<br>期间 | 2023 年 10 月 1 日至<br>2024 年 3 月 31 日止<br>期间 |
|---------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
|                           | (美元)                                       | (美元)                                       |
| 收益                        |                                            |                                            |
| 银行存款利息收益                  | 6,790                                      | 9,264                                      |
| 投资利息收益                    | 699,961                                    | 600,649                                    |
| 投资和衍生金融工具公允价值的净变动         | (478,382)                                  | 1,426,383                                  |
| 汇兑净利得/(损失)                | 752                                        | (317)                                      |
| 其他收入                      | 557                                        | 500                                        |
| 总投资利润                     | 229,678                                    | 2,036,479                                  |
| 开支                        |                                            |                                            |
| 管理费用 <sup>附注 2</sup>      | 93,976                                     | 84,422                                     |
| 受托人费用 <sup>附注 1</sup>     | 36,066                                     | 34,691                                     |
| 托管费和银行手续费 <sup>附注 1</sup> | 6,915                                      | 6,949                                      |
| 核数师酬金                     | 11,515                                     | 10,736                                     |
| 法律及专业服务费                  | 1,945                                      | 246                                        |
| 成立费用                      | 5,070                                      | 5,915                                      |
| 其他运营费用 <sup>附注 1</sup>    | 23,442                                     | 22,167                                     |
| 营业费用总额                    | 178,929                                    | 165,126                                    |
| 经营利润                      | 50,749                                     | 1,871,353                                  |
| 财务成本                      |                                            |                                            |
| 利息支出 <sup>附注 1</sup>      | (166)                                      | -                                          |
| 对份额持有人派发股息                | (663,076)                                  | (529,223)                                  |
| 归属于份额持有人的净资产(减少)/增加       | (612,493)                                  | 1,342,130                                  |

附注 1 于截至 2025 年 3 月 31 日和 2024 年 3 月 31 日止期间，向受托人或其关联人士支付了受托人费用、托管费和银行手续费，支付给受托人或其关联人士的其他款项如下：

|        | 2024 年 10 月 1 日至<br>2025 年 3 月 31 日止<br>期间 | 2023 年 10 月 1 日至<br>2024 年 3 月 31 日止<br>期间 |
|--------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
| 其他运营费用 | 18,235<br>166                              | 17,859<br>-                                |

附注 2 于截至 2025 年 3 月 31 日和 2024 年 3 月 31 日止期间，除向管理人支付的管理费用外，未向管理人或其关联人士支付其他任何款项。

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

|                     | 2024 年 10 月 1 日至<br>2025 年 3 月 31 日止<br>期间 | 2023 年 10 月 1 日至<br>2024 年 3 月 31 日止<br>期间 |
|---------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
|                     | (美元)                                       | (美元)                                       |
| 期初余额                | 813,447,652                                | 337,988,669                                |
| 分配份额                | 434,531,980                                | 130,134,109                                |
| 赎回份额                | (223,296,858)                              | (77,423,834)                               |
| 份额交易净增加             | 211,235,122                                | 52,710,275                                 |
| 归属于份额持有人的净资产(减少)/增加 | (88,049,290)                               | 42,267,031                                 |
| 期末余额                | <u>936,633,484</u>                         | <u>432,965,975</u>                         |
| 已发行份额数目             | 份额                                         | 份额                                         |
| I 累计 美元份额           |                                            |                                            |
| 期初已发行份额             | 588,473.2175                               | 136,730.1894                               |
| 已分配份额               | 189,275.8581                               | 59,866.7098                                |
| 已赎回份额               | (4,600.0000)                               | (132,310.3425)                             |
| 期末已发行份额             | <u>773,149.0756</u>                        | <u>64,286.5567</u>                         |
| I 每月派息 美元份额         |                                            |                                            |
| 期初已发行份额             | 936,896.8470                               | 429,844.8252                               |
| 已分配份额               | 28,508.5468                                | -                                          |
| 已赎回份额               | (100,799.3390)                             | -                                          |
| 期末已发行份额             | <u>864,606.0548</u>                        | <u>429,844.8252</u>                        |
| M 人民币份额             |                                            |                                            |
| 期初已发行份额             | -                                          | -                                          |
| 已分配份额               | 40,191,079.1800                            | -                                          |
| 已赎回份额               | (279,909.4000)                             | -                                          |
| 期末已发行份额             | <u>39,911,169.7800</u>                     | <u>-</u>                                   |
| M 美元份额              |                                            |                                            |
| 期初已发行份额             | 3,076,929.9800                             | -                                          |
| 已分配份额               | 3,961,491.6500                             | -                                          |
| 已赎回份额               | (386,459.6200)                             | -                                          |
| 期末已发行份额             | <u>6,651,962.0100</u>                      | <u>-</u>                                   |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)(续)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

|                       | 2024 年 10 月 1 日至<br>2025 年 3 月 31 日止<br>期间 | 2023 年 10 月 1 日至<br>2024 年 3 月 31 日止<br>期间 |
|-----------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
| <u>已发行份额数目(续)</u>     | <u>份额</u>                                  | <u>份额</u>                                  |
| <b>P 美元份额</b>         |                                            |                                            |
| 期初已发行份额               | 106,367.5018                               | -                                          |
| 已分配份额                 | 12,084.0000                                | -                                          |
| 已赎回份额                 | -                                          | -                                          |
| 期末已发行份额               | <u>118,451.5018</u>                        | <u>-</u>                                   |
| <b>P 每月派息 港元份额</b>    |                                            |                                            |
| 期初已发行份额               | 120,257,575.4037                           | 94,172,193.5879                            |
| 已分配份额                 | 44,386,303.0857                            | 23,569,443.3443                            |
| 已赎回份额                 | <u>(43,991,230.9351)</u>                   | <u>(17,652,223.3525)</u>                   |
| 期末已发行份额               | <u>120,652,647.5543</u>                    | <u>100,089,413.5797</u>                    |
| <b>P 每月派息 美元份额</b>    |                                            |                                            |
| 期初已发行份额               | 20,483,217.6224                            | 14,772,544.7284                            |
| 已分配份额                 | 8,115,267.3613                             | 4,154,615.0550                             |
| 已赎回份额                 | <u>(5,292,947.2070)</u>                    | <u>(3,595,566.3454)</u>                    |
| 期末已发行份额               | <u>23,305,537.7767</u>                     | <u>15,331,593.4380</u>                     |
| <b>P 每月派息 3 港元份额</b>  |                                            |                                            |
| 期初已发行份额               | -                                          | 40,768.2840                                |
| 已分配份额                 | -                                          | -                                          |
| 已赎回份额                 | -                                          | -                                          |
| 期末已发行份额               | <u>-</u>                                   | <u>40,768.2840</u>                         |
| <b>P 每月派息 3 美元份额</b>  |                                            |                                            |
| 期初已发行份额               | -                                          | 600.0000                                   |
| 已分配份额                 | -                                          | -                                          |
| 已赎回份额                 | -                                          | -                                          |
| 期末已发行份额               | <u>-</u>                                   | <u>600.0000</u>                            |
| <b>HI 累计 新加坡元份额</b>   |                                            |                                            |
| 期初已发行份额               | 250,076.2320                               | 250,076.2320                               |
| 已分配份额                 | -                                          | -                                          |
| 已赎回份额                 | -                                          | -                                          |
| 期末已发行份额               | <u>250,076.2320</u>                        | <u>250,076.2320</u>                        |
| <b>HI 每月派息 新加坡元份额</b> |                                            |                                            |
| 期初已发行份额               | 237,933.6280                               | 224,770.6280                               |
| 已分配份额                 | 41,815.9670                                | 13,163.0000                                |
| 已赎回份额                 | -                                          | -                                          |
| 期末已发行份额               | <u>279,749.5950</u>                        | <u>237,933.6280</u>                        |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)(续)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

|                        | 2024 年 10 月 1 日至<br>2025 年 3 月 31 日止<br>期间 | 2023 年 10 月 1 日至<br>2024 年 3 月 31 日止<br>期间 |
|------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
| <u>已发行份额数目(续)</u>      | <u>份额</u>                                  | <u>份额</u>                                  |
| <b>HM 人民币份额</b>        |                                            |                                            |
| 期初已发行份额                | 82,517,032.3100                            | 456,677.4600                               |
| 已分配份额                  | 72,128,437.1800                            | 230,572.5200                               |
| 已赎回份额                  | (22,861,016.9900)                          | (329,094.4200)                             |
| 期末已发行份额                | <u>131,784,452.5000</u>                    | <u>358,155.5600</u>                        |
| <b>HP 每月派息 澳元份额</b>    |                                            |                                            |
| 期初已发行份额                | 13,377,216.1741                            | 8,156,050.1673                             |
| 已分配份额                  | 4,909,251.4639                             | 2,907,971.5463                             |
| 已赎回份额                  | (4,718,793.5055)                           | (1,447,211.0310)                           |
| 期末已发行份额                | <u>13,567,674.1325</u>                     | <u>9,616,810.6826</u>                      |
| <b>HP 每月派息 瑞士法郎份额</b>  |                                            |                                            |
| 期初已发行份额                | 464,643.1224                               | 129,576.6452                               |
| 已分配份额                  | 541,717.5540                               | 95,283.9299                                |
| 已赎回份额                  | (94,995.3266)                              | (5,000.0000)                               |
| 期末已发行份额                | <u>911,365.3498</u>                        | <u>219,860.5751</u>                        |
| <b>HP 每月派息 欧元份额</b>    |                                            |                                            |
| 期初已发行份额                | -                                          | -                                          |
| 已分配份额                  | 150.0000                                   | -                                          |
| 已赎回份额                  | -                                          | -                                          |
| 期末已发行份额                | <u>150.0000</u>                            | <u>-</u>                                   |
| <b>HP 每月派息 日元份额</b>    |                                            |                                            |
| 期初已发行份额                | 11,472,186.2156                            | 3,003,619.5724                             |
| 已分配份额                  | 3,512,051.5344                             | 4,810,215.9271                             |
| 已赎回份额                  | (3,280,086.5666)                           | (969,544.7626)                             |
| 期末已发行份额                | <u>11,704,151.1834</u>                     | <u>6,844,290.7369</u>                      |
| <b>HP 每月派息 人民币份额</b>   |                                            |                                            |
| 期初已发行份额                | 47,100,003.3667                            | 29,581,091.3783                            |
| 已分配份额                  | 9,970,879.1271                             | 10,271,807.3477                            |
| 已赎回份额                  | (13,714,244.2486)                          | (4,961,517.5084)                           |
| 期末已发行份额                | <u>43,356,638.2452</u>                     | <u>34,891,381.2176</u>                     |
| <b>HP 每月派息 3 人民币份额</b> |                                            |                                            |
| 期初已发行份额                | -                                          | 3,000.0000                                 |
| 已分配份额                  | -                                          | -                                          |
| 已赎回份额                  | -                                          | -                                          |
| 期末已发行份额                | <u>-</u>                                   | <u>3,000.0000</u>                          |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)(续)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

|                   | 2024 年 10 月 1 日至<br>2025 年 3 月 31 日止<br>期间 | 2023 年 10 月 1 日至<br>2024 年 3 月 31 日止<br>期间 |
|-------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
| <u>已发行份额数目(续)</u> | <u>份额</u>                                  | <u>份额</u>                                  |
| <b>Z 累计 港元份额</b>  |                                            |                                            |
| 期初已发行份额           | -                                          | -                                          |
| 已分配份额             | 100.0000                                   | -                                          |
| 已赎回份额             | -                                          | -                                          |
| 期末已发行份额           | <u>100.0000</u>                            | <u>-</u>                                   |
| <b>Z 累计 美元份额</b>  |                                            |                                            |
| 期初已发行份额           | -                                          | -                                          |
| 已分配份额             | 100.0000                                   | -                                          |
| 已赎回份额             | -                                          | -                                          |
| 期末已发行份额           | <u>100.0000</u>                            | <u>-</u>                                   |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)(续)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

|                     | 2024 年 10 月 1 日至<br>2025 年 3 月 31 日止<br>期间 | 2023 年 10 月 1 日至<br>2024 年 3 月 31 日止<br>期间 |
|---------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
|                     | (美元)                                       | (美元)                                       |
| 期初余额                | 26,610,721                                 | 31,798,418                                 |
| 分配份额                | 10,265,857                                 | 1,413,339                                  |
| 赎回份额                | (3,300,434)                                | (8,220,235)                                |
| 份额交易净增加/(减少)        | 6,965,423                                  | (6,806,896)                                |
| 归属于份额持有人的净资产(减少)/增加 | (612,493)                                  | 1,342,130                                  |
| 期末余额                | <u>32,963,651</u>                          | <u>26,333,652</u>                          |
| 已发行份额数目             | 份额                                         | 份额                                         |
| I 累计 美元份额           |                                            |                                            |
| 期初已发行份额             | 817,066.0000                               | 1,716,097.0000                             |
| 已分配份额               | 5,457.0000                                 | -                                          |
| 已赎回份额               | (223,458.0000)                             | (722,325.0000)                             |
| 期末已发行份额             | <u>599,065.0000</u>                        | <u>993,772.0000</u>                        |
| I 每月派息 美元份额         |                                            |                                            |
| 期初已发行份额             | 974,048.0436                               | 1,100,012.3166                             |
| 已分配份额               | 60,354.0000                                | 23,856.9429                                |
| 已赎回份额               | (97,848.0000)                              | (71,497.2159)                              |
| 期末已发行份额             | <u>936,554.0436</u>                        | <u>1,052,372.0436</u>                      |
| P 每月派息 港元份额         |                                            |                                            |
| 期初已发行份额             | 1,624,394.4463                             | 695,746.5814                               |
| 已分配份额               | 1,240,542.8466                             | 411,352.4087                               |
| 已赎回份额               | (46,735.4438)                              | (147,947.6390)                             |
| 期末已发行份额             | <u>2,818,201.8491</u>                      | <u>959,151.3511</u>                        |
| P 每月派息 美元份额         |                                            |                                            |
| 期初已发行份额             | 755,826.5677                               | 743,768.6124                               |
| 已分配份额               | 90,662.7031                                | 43,620.8557                                |
| 已赎回份额               | (20,846.3532)                              | -                                          |
| 期末已发行份额             | <u>825,642.9176</u>                        | <u>787,389.4681</u>                        |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

归属于份额持有人的净资产变动表(未经审计)(续)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

|                      | 2024 年 10 月 1 日至<br>2025 年 3 月 31 日止<br>期间 | 2023 年 10 月 1 日至<br>2024 年 3 月 31 日止<br>期间 |
|----------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
| <u>已发行份额数目</u>       | <u>份额</u>                                  | <u>份额</u>                                  |
| <b>HI 累计 新加坡元份额</b>  |                                            |                                            |
| 期初已发行份额              | 205,578.9779                               | 440,177.3309                               |
| 已分配份额                | -                                          | -                                          |
| 已赎回份额                | -                                          | (214,655.7220)                             |
| 期末已发行份额              | <u>205,578.9779</u>                        | <u>225,521.6089</u>                        |
| <b>HP 每月派息 澳元份额</b>  |                                            |                                            |
| 期初已发行份额              | 159,031.4519                               | 146,827.3640                               |
| 已分配份额                | 23,477.6834                                | 38,607.6048                                |
| 已赎回份额                | (13,186.6251)                              | (12,630.1450)                              |
| 期末已发行份额              | <u>169,322.5102</u>                        | <u>172,804.8238</u>                        |
| <b>HP 每月派息 人民币份额</b> |                                            |                                            |
| 期初已发行份额              | 1,861,269.7230                             | 301,059.5522                               |
| 已分配份额                | 1,884,788.7204                             | 359,502.3541                               |
| 已赎回份额                | (224,300.5634)                             | (39,919.8717)                              |
| 期末已发行份额              | <u>3,521,757.8800</u>                      | <u>620,642.0346</u>                        |
| <b>Z 累计 美元份额</b>     |                                            |                                            |
| 期初已发行份额              | -                                          | -                                          |
| 已分配份额                | 600,000.00                                 | -                                          |
| 已赎回份额                | -                                          | -                                          |
| 期末已发行份额              | <u>600,000.00</u>                          | <u>-</u>                                   |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

现金流量表(未经审计)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

|                     | 2024 年 10 月 1 日至<br>2025 年 3 月 31 日止<br>期间 | 2023 年 10 月 1 日至<br>2024 年 3 月 31 日止<br>期间 |
|---------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
|                     | (美元)                                       | (美元)                                       |
| 经营活动产生的现金流量         |                                            |                                            |
| 归属于份额持有人的净资产(减少)/增加 | (88,049,290)                               | 42,267,031                                 |
| 调整:                 |                                            |                                            |
| 股息收入                | (3,024,392)                                | (1,156,966)                                |
| 银行存款利息收益            | (319,383)                                  | (124,268)                                  |
| 投资利息收益              | (6,430,239)                                | (3,133,587)                                |
| 股息收入预扣税             | 617,763                                    | 238,740                                    |
| 对份额持有人派发股息          | 16,930,222                                 | 11,601,912                                 |
| 营运资金变动前的经营(亏损)/收益   | (80,275,319)                               | 49,692,862                                 |
| 投资和衍生金融工具的净增加       | (85,650,333)                               | (81,520,616)                               |
| 应收经纪款减少             | 3,604,278                                  | 6,439,269                                  |
| 其他应收款减少             | -                                          | 899                                        |
| 保证金(增加)/减少          | (3,347,590)                                | 666,290                                    |
| 应付经纪款减少             | (8,840,888)                                | (11,116,613)                               |
| 其他应付款增加             | 142,090                                    | 123,950                                    |
| 经营使用的现金             | (174,367,762)                              | (35,713,959)                               |
| 已收股息(扣除已付预扣税)       | 2,431,468                                  | 763,794                                    |
| 已收银行存款利息            | 255,217                                    | 121,601                                    |
| 已收投资利息              | 5,062,246                                  | 3,515,591                                  |
| 经营活动所用现金净额          | (166,618,831)                              | (31,312,973)                               |
| 融资活动产生的现金流量         |                                            |                                            |
| 分配份额所得款项            | 438,849,611                                | 128,898,109                                |
| 赎回份额付款              | (225,657,896)                              | (76,131,158)                               |
| 已付收益分配              | (16,930,222)                               | (11,601,912)                               |
| 融资活动产生现金净额          | 196,261,493                                | 41,165,039                                 |
| 现金及现金等价物之增加         | 29,642,662                                 | 9,852,066                                  |
| 期初现金及现金等价物          | 34,732,352                                 | 11,560,924                                 |
| 期末现金及现金等价物          | <b>64,375,014</b>                          | <b>21,412,990</b>                          |
| 现金及现金等价物余额分析        |                                            |                                            |
| 银行存款                | <b>64,375,014</b>                          | <b>21,412,990</b>                          |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

现金流量表(未经审计)(续)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

|                          | 2024 年 10 月 1 日至<br>2025 年 3 月 31 日止<br>期间 | 2023 年 10 月 1 日至<br>2024 年 3 月 31 日止<br>期间 |
|--------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
|                          | (美元)                                       | (美元)                                       |
| <b>经营活动产生的现金流量</b>       |                                            |                                            |
| 归属于份额持有人的净资产(减少)/增加      | (612,493)                                  | 1,342,130                                  |
| <b>调整:</b>               |                                            |                                            |
| 银行存款利息收益                 | (6,790)                                    | (9,264)                                    |
| 投资利息收益                   | (699,961)                                  | (600,649)                                  |
| 利息支出                     | 166                                        | -                                          |
| 对份额持有人派发股息               | 663,076                                    | 529,223                                    |
| <b>营运资金变动前的经营(亏损)/收益</b> | <b>(656,002)</b>                           | <b>1,261,440</b>                           |
| 投资和衍生金融工具的净(增加)/减少       | (5,834,731)                                | 5,323,736                                  |
| 应收经纪款减少/(增加)             | 1,069,395                                  | (76,089)                                   |
| 其他应收款减少                  | 5,070                                      | 5,915                                      |
| 保证金(增加)/减少               | (26,346)                                   | 1,019                                      |
| 应付经纪款增加                  | 103,311                                    | 619,824                                    |
| 应付成立费用减少                 | (5,070)                                    | (5,070)                                    |
| 其他应付款增加                  | 14,093                                     | 11,141                                     |
| <b>经营活动(所用)/产生现金</b>     | <b>(5,330,280)</b>                         | <b>7,141,916</b>                           |
| 已收银行存款利息                 | 5,920                                      | 9,235                                      |
| 已收投资利息                   | 618,660                                    | 664,660                                    |
| 已付利息                     | (166)                                      | -                                          |
| <b>经营活动(所用)/产生现金净额</b>   | <b>(4,705,866)</b>                         | <b>7,815,811</b>                           |
| <b>融资活动产生的现金流量</b>       |                                            |                                            |
| 分配份额所得款项                 | 10,111,337                                 | 1,137,097                                  |
| 赎回份额付款                   | (3,300,434)                                | (8,341,231)                                |
| 已付收益分配                   | (663,076)                                  | (529,223)                                  |
| <b>融资活动产生/(所用)现金净额</b>   | <b>6,147,827</b>                           | <b>(7,733,357)</b>                         |
| <b>现金及现金等价物之增加</b>       | <b>1,441,961</b>                           | <b>82,454</b>                              |
| 期初现金及现金等价物               | 474,868                                    | 195,696                                    |
| <b>期末现金及现金等价物</b>        | <b><u>1,916,829</u></b>                    | <b><u>278,150</u></b>                      |
| <b>现金及现金等价物余额分析</b>      |                                            |                                            |
| 银行存款                     | <b><u>1,916,829</u></b>                    | <b><u>278,150</u></b>                      |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

| 国家/地区      | 投资                                                   | 单位数目      | 市值<br>(美元)        | 占净资<br>产百分比  |
|------------|------------------------------------------------------|-----------|-------------------|--------------|
| 上市股票       |                                                      |           |                   |              |
| 澳大利亚 0.21% |                                                      |           |                   |              |
|            | Goodman Group Stapled Sec 普通股(无面值)                   | 113,003   | 2,001,979         | 0.21         |
|            |                                                      |           | <u>2,001,979</u>  | <u>0.21</u>  |
| 中国 10.66%  |                                                      |           |                   |              |
|            | 阿里巴巴集团控股有限公司普通股(每股面值 0.000003125 美元)                 | 1,383,000 | 22,752,850        | 2.43         |
|            | 安踏体育用品有限公司普通股(每股面值 0.1 港元)                           | 990,000   | 10,866,676        | 1.16         |
|            | 贵州茅台酒股份有限公司 CC 普通股(每股面值 1 人民币)                       | 28,600    | 6,144,401         | 0.66         |
|            | 美团点评普通股(每股面值 0.00001 港元)                             | 1,059,040 | 21,207,207        | 2.26         |
|            | 美的集团股份有限公司 SZHK 普通股(每股面值 1 人民币)                      | 16,900    | 182,586           | 0.02         |
|            | 腾讯控股有限公司(每股面值 0.0002 港元)                             | 603,800   | 38,570,312        | 4.12         |
|            | 腾讯音乐娱乐集团 A 类普通股(每股面值 0.000083 美元)                    | 16,000    | 113,723           | 0.01         |
|            |                                                      |           | <u>99,837,755</u> | <u>10.66</u> |
| 香港 4.35%   |                                                      |           |                   |              |
|            | 友邦保险控股有限公司                                           | 231,600   | 1,744,375         | 0.19         |
|            | 香港交易及结算所有限公司普通股(每股面值 1 港元)                           | 880,000   | 38,999,010        | 4.16         |
|            |                                                      |           | <u>40,743,385</u> | <u>4.35</u>  |
| 日本 1.05%   |                                                      |           |                   |              |
|            | 日本三菱重工业股份有限公司                                        | 428,000   | 7,229,691         | 0.77         |
|            | 三菱日联金融集团                                             | 191,600   | 2,576,619         | 0.28         |
|            |                                                      |           | <u>9,806,310</u>  | <u>1.05</u>  |
| 韩国 2.99%   |                                                      |           |                   |              |
|            | Samsung Electronics Co Ltd 普通股(每股面值 100 韩元)          | 7,833     | 307,468           | 0.03         |
|            | Samsung Electronics Company Limited 优先股(每股面值 100 韩元) | 7,648     | 245,152           | 0.03         |
|            | SK Hynix Inc 普通股(每股面值 5,000 韩元)                      | 212,000   | 27,455,620        | 2.93         |
|            |                                                      |           | <u>28,008,240</u> | <u>2.99</u>  |
| 瑞士 0.22%   |                                                      |           |                   |              |
|            | 历峰集团注册普通股(每股面值 1 瑞士法郎)                               | 12,000    | 2,074,484         | 0.22         |
|            |                                                      |           | <u>2,074,484</u>  | <u>0.22</u>  |
| 台湾 1.73%   |                                                      |           |                   |              |
|            | 联发科技股份有限公司                                           | 207,000   | 8,665,914         | 0.92         |
|            | 台湾积体电路制造股份有限公司                                       | 276,000   | 7,564,490         | 0.81         |
|            |                                                      |           | <u>16,230,404</u> | <u>1.73</u>  |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

| 国家/地区     | 投资                                            | 单位数目       | 市值<br>(美元)         | 占净资产<br>百分比  |
|-----------|-----------------------------------------------|------------|--------------------|--------------|
| 上市股票(续)   |                                               |            |                    |              |
| 美国 22.37% |                                               |            |                    |              |
|           | Alphabet Inc A 类普通股(每股面值 0.001 美元)            | 212,102    | 32,799,453         | 3.50         |
|           | Amazon Com Inc 普通股(每股面值 0.01 美元)              | 22,600     | 4,299,876          | 0.46         |
|           | American Homes 4 Rent- REIT                   | 108,000    | 4,083,480          | 0.44         |
|           | American Tower Corp A 类 REIT(每股面值 0.01 美元)    | 10,000     | 2,176,000          | 0.23         |
|           | Apple Inc 普通股(无面值)                            | 83,800     | 18,614,494         | 1.99         |
|           | Avalonbay Communities Inc                     | 28,000     | 6,009,360          | 0.64         |
|           | Costco Wholesale Corporation                  | 330        | 312,108            | 0.03         |
|           | Eli Lilly & Co                                | 1,200      | 991,092            | 0.11         |
|           | Essex Property Trust Inc REIT(每股面值 0.0001 美元) | 16,600     | 5,089,062          | 0.54         |
|           | Goldman Sachs Group Inc                       | 9,200      | 5,025,868          | 0.54         |
|           | JPMorgan Chase And Co 普通股(每股面值 1 美元)          | 11,800     | 2,894,540          | 0.31         |
|           | Meta Platforms Inc 普通股(每股面值 0.000006 美元)      | 44,500     | 25,648,020         | 2.74         |
|           | Microsoft Corp                                | 22,823     | 8,567,526          | 0.91         |
|           | Morgan Stanley 普通股(每股面值 0.01 美元)              | 43,800     | 5,110,146          | 0.55         |
|           | Nike Inc B 类                                  | 240,000    | 15,235,200         | 1.63         |
|           | Nvidia Corporation                            | 262,000    | 28,395,560         | 3.03         |
|           | Palantir Technologies Inc 普通股(每股面值 0.001 美元)  | 188,000    | 15,867,200         | 1.69         |
|           | Palo Alto Networks Inc 普通股(每股面值 0.0001 美元)    | 59,200     | 10,101,888         | 1.08         |
|           | Prologis Inc REIT(每股面值 0.01 美元)               | 18,000     | 2,012,220          | 0.21         |
|           | Raytheon Technologies Corporation             | 16,000     | 2,119,360          | 0.23         |
|           | Regency Centers Corporation                   | 60,000     | 4,425,600          | 0.47         |
|           | Salesforce.Com Inc                            | 10,000     | 2,683,600          | 0.29         |
|           | ServiceNow Inc 普通股(每股面值 0.001 美元)             | 3,600      | 2,866,104          | 0.31         |
|           | Simon Property Group Inc                      | 12,000     | 1,992,960          | 0.21         |
|           | Welltower Inc REIT(每股面值 1 美元)                 | 14,000     | 2,144,940          | 0.23         |
|           |                                               |            | <u>209,465,657</u> | <u>22.37</u> |
| 固定收益      |                                               |            |                    |              |
| 美国 38.44% |                                               |            |                    |              |
|           | 美国国库 3.5% 15/02/2033                          | 30,600,000 | 29,300,693         | 3.13         |
|           | 美国国库 3.875% 15/05/2043                        | 9,000,000  | 8,209,688          | 0.88         |
|           | 美国国库 4% 31/01/2029                            | 77,300,000 | 77,512,884         | 8.27         |
|           | 美国国库 4.125% 15/11/2032                        | 74,730,000 | 74,829,241         | 7.99         |
|           | 美国国库 证券 4.75% 15/02/2041                      | 83,400,000 | 85,934,568         | 9.17         |
|           | 美国国库 N/B 4.25% 31/12/2026                     | 63,800,000 | 64,132,717         | 6.85         |
|           | 美国国库 N/B 4.625% 15/02/2055                    | 20,000,000 | 20,103,130         | 2.15         |
|           |                                               |            | <u>360,022,921</u> | <u>38.44</u> |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

| 国家/地区         | 投资                                  | 单位数目       | 市值<br>(美元)         | 占净资<br>产百分比   |
|---------------|-------------------------------------|------------|--------------------|---------------|
| 浮动收益          |                                     |            |                    |               |
| 美国 4.47%      |                                     |            |                    |               |
|               | JP Morgan Chase & Co Var 26/04/2033 | 43,000,000 | 41,906,424         | 4.47          |
|               |                                     |            | <u>41,906,424</u>  | <u>4.47</u>   |
| 上市/报价投资基金     |                                     |            |                    |               |
| 香港 0.65%      |                                     |            |                    |               |
|               | 瑞士百达资产管理(香港)有限公司一百达香港—瑞士百达亚洲债券收益    | 600,000    | 6,129,600          | 0.65          |
|               |                                     |            | <u>6,129,600</u>   | <u>0.65</u>   |
| 爱尔兰 4.69%     |                                     |            |                    |               |
|               | 景顺实物黄金 Etc ETF                      | 146,000    | 43,883,220         | 4.69          |
|               |                                     |            | <u>43,883,220</u>  | <u>4.69</u>   |
| 卢森堡 0.35%     |                                     |            |                    |               |
|               | 百达—人民币债券—Z 每月派息 人民币                 | 18,023     | 1,885,062          | 0.20          |
|               | 百达—全球环境机会—Z 美元                      | 3,300      | 1,424,676          | 0.15          |
|               |                                     |            | <u>3,309,738</u>   | <u>0.35</u>   |
| 期货合约          |                                     |            |                    |               |
| 德国(0.04%)     |                                     |            |                    |               |
|               | 欧洲斯托克 50 20/06/2025                 | 330        | (359,219)          | (0.04)        |
|               |                                     |            | <u>(359,219)</u>   | <u>(0.04)</u> |
| 香港(0.03%)     |                                     |            |                    |               |
|               | 恒生中国企业指数期货 29/04/2025               | 345        | (314,834)          | (0.03)        |
|               |                                     |            | <u>(314,834)</u>   | <u>(0.03)</u> |
| 远期外汇合约(0.12%) |                                     |            |                    |               |
|               |                                     |            | <u>(1,161,905)</u> | <u>(0.12)</u> |
| 上市股票合计        |                                     |            | <u>408,168,214</u> |               |
| 固定收益合计        |                                     |            | <u>360,022,921</u> |               |
| 浮动收益合计        |                                     |            | <u>41,906,424</u>  |               |
| 投资基金合计        |                                     |            | <u>53,322,558</u>  |               |
| 期货合约合计        |                                     |            | <u>(674,053)</u>   |               |
| 远期外汇合约合计      |                                     |            | <u>(1,161,905)</u> |               |
| 组合投资合计        |                                     |            | <u>861,584,159</u> |               |
| 组合投资合计，按成本    |                                     |            | <u>862,746,064</u> |               |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

| 国家/地区         | 投资                                                                | 单位数目    | 市值<br>(美元)       | 占净资产<br>百分比  |
|---------------|-------------------------------------------------------------------|---------|------------------|--------------|
| 固定收益          |                                                                   |         |                  |              |
| 百慕大 0.56%     |                                                                   |         |                  |              |
|               | Star Energy Co Issue Ser (Reg) (Reg S) 4.85% 14/10/2038           | 200,000 | 183,603          | 0.56         |
|               |                                                                   |         | <b>183,603</b>   | <b>0.56</b>  |
| 英属维尔京群岛 4.01% |                                                                   |         |                  |              |
|               | Cheung Kong Infra Fin Bv (Reg) (Reg S) 4% Perp 31/12/2049         | 200,000 | 135,148          | 0.41         |
|               | China Cinda 2020 I Mngmn Ser Emtn (Reg) (Reg S) 3.25% 28/01/2027  | 200,000 | 194,875          | 0.59         |
|               | CNPC HK Overseas Capital Ltd Ser Regs 5.95Pct 28/04/2041          | 400,000 | 442,544          | 1.35         |
|               | Huarong Finance 2019 Ser Emtn (Reg S) 3.375% 24/02/2030           | 400,000 | 366,500          | 1.11         |
|               | Nan Fung Treasury Ltd Ser Emtn (Reg) (Regs) 3.625% 27/08/2030     | 200,000 | 181,739          | 0.55         |
|               |                                                                   |         | <b>1,320,806</b> | <b>4.01</b>  |
| 开曼群岛 4.86%    |                                                                   |         |                  |              |
|               | Alibaba Group Holding (Reg) 2.125% 09/02/2031                     | 500,000 | 437,182          | 1.33         |
|               | Alibaba Group Holding 3.15% 09/02/2051                            | 200,000 | 132,315          | 0.40         |
|               | Alibaba Group Holding 3.25% 09/02/2061                            | 200,000 | 126,903          | 0.38         |
|               | CH OVS Grand Oce Finance (Reg) (Reg S) 2.45% 09/02/2026           | 200,000 | 193,960          | 0.59         |
|               | China Overseas Fin. Vi 6.45% 11/06/2034                           | 300,000 | 323,942          | 0.98         |
|               | VII International Inc Ser Emtn (Reg) (Reg S) 7.25% 20/07/2027     | 200,000 | 190,440          | 0.58         |
|               | Wynn Macau Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.5% 15/01/2026             | 200,000 | 198,790          | 0.60         |
|               |                                                                   |         | <b>1,603,532</b> | <b>4.86</b>  |
| 中国 14.12%     |                                                                   |         |                  |              |
|               | 阿里巴巴集团控股有限公司 Ser Regs 5.25% 26/05/2035                            | 400,000 | 402,489          | 1.22         |
|               | Central Plaza Dev Ltd 7.15% 21/03/2028                            | 200,000 | 202,001          | 0.61         |
|               | China Cinda 2020 I Mngmn Ser Emtn (Reg) (Reg S) 5.375% 23/07/2027 | 200,000 | 202,432          | 0.61         |
|               | China Cinda 2020 I Mngmn Ser Emtn (Reg) (Reg S) 5.5% 23/01/2030   | 200,000 | 205,009          | 0.62         |
|               | China Cinda 2020 I Mngmn Ser Emtn (Reg) (Reg S) 5.75% 28/05/2029  | 286,000 | 294,915          | 0.89         |
|               | 中国平安保险海外 Ser Emtn (Reg) (Reg S) 6.125% 16/05/2034                 | 200,000 | 210,264          | 0.64         |
|               | Far East Horizon Ltd Ser Emtn (Reg) (Reg S) 6% 01/10/2028         | 424,000 | 420,678          | 1.28         |
|               | Fortune Star Bvi Ltd 8.5% 19/05/2028                              | 200,000 | 203,283          | 0.62         |
|               | 方兴光耀有限公司(Reg S) 4.25% 23/07/2029                                  | 200,000 | 177,947          | 0.54         |
|               | 长城国际第五期(Reg) (Reg S) 2.375% 18/08/2030                            | 200,000 | 173,525          | 0.53         |
|               | Great Wall Intl V (Reg) (Reg S) 2.875% 23/11/2026                 | 200,000 | 192,994          | 0.59         |
|               | 绿城中国控股有限公司 8.45% 24/02/2028                                       | 396,000 | 404,442          | 1.23         |
|               | HPHT Finance Ltd 5% 21/02/2030                                    | 200,000 | 198,550          | 0.60         |
|               | Huarong Finance II Ser Emtn (Reg) (Regs) 4.875% 22/11/2026        | 200,000 | 200,051          | 0.61         |
|               | Huarong Finance II Ser Emtn (Reg) (Regs) 5% 19/11/2025            | 200,000 | 200,356          | 0.61         |
|               | Sinopec Group Overseas Development 2012 Regs 4.875% 17/05/2042    | 200,000 | 198,472          | 0.60         |
|               | Weibo Corp (Reg) 3.375% 08/07/2030                                | 200,000 | 184,687          | 0.56         |
|               | Xiaomi Best Time Intl Ser (Reg) (Reg S) 3.375% 29/04/2030         | 200,000 | 188,098          | 0.57         |
|               | 仁恒地产(香港)有限公司 (Reg) (Reg S) 5.125% 20/05/2026                      | 200,000 | 196,103          | 0.59         |
|               | 众安在线财产保险股份有限公司 3.5% 08/03/2026                                    | 200,000 | 196,812          | 0.60         |
|               |                                                                   |         | <b>4,653,108</b> | <b>14.12</b> |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

| 国家/地区     | 投资                                                                        | 单位数目    | 市值<br>(美元)       | 占净资产<br>百分比 |
|-----------|---------------------------------------------------------------------------|---------|------------------|-------------|
| 固定收益(续)   |                                                                           |         |                  |             |
| 香港 6.12%  |                                                                           |         |                  |             |
|           | 友邦保险控股有限公司 Ser Regs (Reg S) 5.4% 30/09/2054                               | 200,000 | 187,888          | 0.57        |
|           | 友邦保险控股有限公司 Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.375%<br>05/04/2034                    | 400,000 | 406,048          | 1.23        |
|           | CK Hutchison International 23 Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.875%<br>21/04/2033 | 300,000 | 293,080          | 0.89        |
|           | CK Hutchison Intl 4.375% 13/03/2030                                       | 300,000 | 294,785          | 0.90        |
|           | 健合国际控股有限公司 (Reg) 9.125% 24/07/2028                                        | 200,000 | 202,153          | 0.61        |
|           | Hysan Mtn Ltd Ser Emtn (Reg) (Reg S) 2.82% 04/09/2029                     | 200,000 | 181,073          | 0.55        |
|           | 香港铁路有限公司 Ser Emtn 5.25% 01/04/2055                                        | 300,000 | 298,287          | 0.91        |
|           | NWD Mtn Ltd (Reg) (Reg S) 8.625% 08/02/2028                               | 200,000 | 152,628          | 0.46        |
|           |                                                                           |         | <b>2,015,942</b> | <b>6.12</b> |
| 印度 6.82%  |                                                                           |         |                  |             |
|           | ABJA Investment Co (Reg) (Reg S) 5.45% 24/01/2028                         | 200,000 | 201,619          | 0.61        |
|           | Biocon Biologics Global Ser Regs 6.67% 09/10/2029                         | 200,000 | 188,027          | 0.57        |
|           | Diamond li Ltd Ser Regs (Reg S) 7.95% 28/07/2026                          | 200,000 | 201,546          | 0.61        |
|           | Gz Mtr Fin BVI Ser Emtn (Reg) (Reg S) 2.31% 17/09/2030                    | 200,000 | 161,231          | 0.49        |
|           | India Green Power Hold Ser Regs (Reg S) 4% 22/02/2027                     | 250,000 | 206,697          | 0.63        |
|           | Muthoot Finance Ltd Ser Regs 6.375% 23/04/2029                            | 200,000 | 196,874          | 0.60        |
|           | REC Limited Ser Emtn (Reg) (Reg S) 2.25% 01/09/2026                       | 200,000 | 192,850          | 0.59        |
|           | REC Limited Ser Emtn (Reg) (Reg S) 2.75% 13/01/2027                       | 200,000 | 192,597          | 0.58        |
|           | Reliance Industries Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.875%<br>12/01/2032       | 250,000 | 217,223          | 0.66        |
|           | Sael Ltd Group Issuers Ser Regs (Reg S) 7.8% 31/07/2031                   | 200,000 | 190,819          | 0.58        |
|           | Shriram Finance Ltd Ser Regs (Reg) 6.15% 03/04/2028                       | 300,000 | 297,813          | 0.90        |
|           |                                                                           |         | <b>2,247,296</b> | <b>6.82</b> |
| 印尼 3.65%  |                                                                           |         |                  |             |
|           | Japfa Comfeed Tbk Pt (Reg) (Reg S) 5.375% 23/03/2026                      | 200,000 | 196,899          | 0.60        |
|           | Krakatau Posco Pt (Reg) (Reg S) 6.375% 11/06/2027                         | 200,000 | 201,943          | 0.61        |
|           | Krakatau Posco Pt (Reg) (Reg S) 6.375% 11/06/2029                         | 200,000 | 202,121          | 0.61        |
|           | Medco Maple Tree Pte Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 8.96%<br>27/04/2029       | 250,000 | 258,694          | 0.78        |
|           | Minejesa Capital Bv Ser Regs (Regs) 4.625% 10/08/2030                     | 200,000 | 154,039          | 0.47        |
|           | PT Pakuwon Jati (Reg S) 4.875% 29/04/2028                                 | 200,000 | 190,828          | 0.58        |
|           |                                                                           |         | <b>1,204,524</b> | <b>3.65</b> |
| 马恩岛 1.19% |                                                                           |         |                  |             |
|           | GOHL Capital Ltd 4.25% 24/01/2027                                         | 400,000 | 393,736          | 1.19        |
|           |                                                                           |         | <b>393,736</b>   | <b>1.19</b> |
| 日本 0.66%  |                                                                           |         |                  |             |
|           | 乐天集团股份有限公司 Ser Regs (Reg S) 9.75% 15/04/2029                              | 200,000 | 217,484          | 0.66        |
|           |                                                                           |         | <b>217,484</b>   | <b>0.66</b> |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

| 国家/地区      | 投资                                                             | 单位数目    | 市值<br>(美元)       | 占净资产<br>百分比 |
|------------|----------------------------------------------------------------|---------|------------------|-------------|
| 固定收益(续)    |                                                                |         |                  |             |
| 韩国 9.10%   |                                                                |         |                  |             |
|            | 现代资本服务公司 Ser Regs 5.25% 22/01/2028                             | 200,000 | 202,519          | 0.61        |
|            | Hyundai Card Co Ltd (Reg) (Reg S) 5.75% 24/04/2029             | 400,000 | 410,720          | 1.25        |
|            | Kookmin Bank Ser Gmtn (Reg) (Reg S) 4.5% 01/02/2029            | 400,000 | 395,398          | 1.20        |
|            | Korea Inv & Secs Co Ltd (Reg) (Reg S) 2.125% 19/07/2026        | 200,000 | 193,430          | 0.58        |
|            | LG 新能源 Ser Regs 5.875% 02/04/2035                              | 352,000 | 353,286          | 1.07        |
|            | Mirae Asset Securities (Reg) (Reg S) 5.5% 31/07/2027           | 266,000 | 269,651          | 0.82        |
|            | Mirae Asset Securities Ser Emtn 5.25% 06/03/2028               | 200,000 | 201,413          | 0.61        |
|            | Shinhan Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) 4% 23/04/2029              | 200,000 | 193,505          | 0.59        |
|            | Shinhan Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.375% 13/04/2032          | 200,000 | 190,584          | 0.58        |
|            | SK Hynix Inc Ser Regs (Reg S) 6.25% 17/01/2026                 | 200,000 | 202,165          | 0.61        |
|            | SK Hynix Inc Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.5% 17/01/2033            | 200,000 | 214,861          | 0.65        |
|            | SK Hynix Inc Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.375% 19/01/2031          | 200,000 | 173,649          | 0.53        |
|            |                                                                |         | <b>3,001,181</b> | <b>9.10</b> |
| 澳门 3.76%   |                                                                |         |                  |             |
|            | Melco Resorts Finance Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.375% 04/12/2029 | 200,000 | 184,308          | 0.56        |
|            | 美高梅中国控股有限公司 Ser Regs (Reg S) 4.75% 01/02/2027                  | 200,000 | 196,120          | 0.59        |
|            | 金沙中国有限公司 (Reg) 3.75% 08/08/2031                                | 200,000 | 173,414          | 0.53        |
|            | 金沙中国有限公司 Ser Wi (Reg) 5.125% 08/08/2025                        | 200,000 | 199,953          | 0.61        |
|            | Studio City Finance Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.5% 15/01/2028 | 300,000 | 291,607          | 0.89        |
|            | 永利澳门有限公司 Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.625% 26/08/2028              | 200,000 | 192,546          | 0.58        |
|            |                                                                |         | <b>1,237,948</b> | <b>3.76</b> |
| 马来西亚 1.81% |                                                                |         |                  |             |
|            | Axiata Spv5 Labuan Ltd Ser Emtn (Reg S) 3.064% 19/08/2050      | 200,000 | 133,521          | 0.41        |
|            | GENM Capital Labuan Ser Regs (Reg S) 3.882% 19/04/2031         | 300,000 | 268,048          | 0.81        |
|            | Khazanah Capital Ltd Ser Emtn (Reg) (Reg S) 4.759% 05/09/2034  | 200,000 | 194,568          | 0.59        |
|            |                                                                |         | <b>596,137</b>   | <b>1.81</b> |
| 毛里求斯 0.61% |                                                                |         |                  |             |
|            | Greenko Wind Projects Mu Ser Regs (Reg S) 5.5% 06/04/2025      | 200,000 | 199,853          | 0.61        |
|            |                                                                |         | <b>199,853</b>   | <b>0.61</b> |
| 蒙古 0.63%   |                                                                |         |                  |             |
|            | Golomt Bank of Mongolia Ser Regs (Reg) (Reg S) 11% 20/05/2027  | 200,000 | 208,790          | 0.63        |
|            |                                                                |         | <b>208,790</b>   | <b>0.63</b> |
| 荷兰 0.96%   |                                                                |         |                  |             |
|            | Prosus Nv Ser Regs (Reg S) 4.027% 03/08/2050                   | 200,000 | 134,688          | 0.41        |
|            | Veon Holdings Bv Ser Regs 3.375% 25/11/2027                    | 200,000 | 182,995          | 0.55        |
|            |                                                                |         | <b>317,683</b>   | <b>0.96</b> |
| 菲律宾 2.84%  |                                                                |         |                  |             |
|            | Globe Telecom Inc (Reg) (Reg S) 3% 23/07/2035                  | 200,000 | 160,429          | 0.49        |
|            | Jollibee Worldwide Pte L 5.332% 02/04/2030                     | 200,000 | 201,657          | 0.61        |
|            | 首都银行及信托公司 Ser Emtn 5.5% 06/03/2034                             | 200,000 | 201,841          | 0.61        |
|            | 菲律宾国家银行 Ser Emtn (Reg S) 4.85% 23/10/2029                      | 200,000 | 197,988          | 0.60        |
|            | 菲律宾长途电话公司 (Reg) (Reg S) 2.5% 23/01/2031                        | 200,000 | 174,024          | 0.53        |
|            |                                                                |         | <b>935,939</b>   | <b>2.84</b> |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

| 国家/地区         | 投资                                                                      | 单位数目      | 市值<br>(美元)       | 占净资产<br>百分比 |
|---------------|-------------------------------------------------------------------------|-----------|------------------|-------------|
| 固定收益(续)       |                                                                         |           |                  |             |
| 新加坡 0.50%     |                                                                         |           |                  |             |
|               | Yinson Production Offsho (Reg S) 9.625% 03/05/2029                      | 158,379   | 165,194          | 0.50        |
|               |                                                                         |           | <u>165,194</u>   | <u>0.50</u> |
| 台湾 0.59%      |                                                                         |           |                  |             |
|               | Nanshan Life Pte Ltd (Reg) (Reg S) 5.45% 11/09/2034                     | 200,000   | 194,829          | 0.59        |
|               |                                                                         |           | <u>194,829</u>   | <u>0.59</u> |
| 泰国 1.90%      |                                                                         |           |                  |             |
|               | Muangthai Capital Pcl (Reg) 6.875% 30/09/2028                           | 200,000   | 201,794          | 0.61        |
|               | Thaioil Treasury Center Ser Regs (Reg S) 3.5% 17/10/2049                | 200,000   | 125,207          | 0.38        |
|               | Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg S) 3.75% 18/06/2050                  | 200,000   | 130,966          | 0.40        |
|               | Thaioil Trsry Center Ser Regs 5.375% 20/11/2048                         | 200,000   | 169,458          | 0.51        |
|               |                                                                         |           | <u>627,425</u>   | <u>1.90</u> |
| 美国 5.74%      |                                                                         |           |                  |             |
|               | Las Vegas Sands Corp (Reg) 6.2% 15/08/2034                              | 200,000   | 200,644          | 0.61        |
|               | SK Battery America Inc (Reg) (Reg S) 2.125% 26/01/2026                  | 200,000   | 194,289          | 0.59        |
|               | Treasury Bill 22/04/2025                                                | 1,500,000 | 1,496,285        | 4.54        |
|               |                                                                         |           | <u>1,891,218</u> | <u>5.74</u> |
| 越南 0.56%      |                                                                         |           |                  |             |
|               | Mong Duong Finance Holdings BV Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.125% 07/05/2029 | 250,000   | 184,862          | 0.56        |
|               |                                                                         |           | <u>184,862</u>   | <u>0.56</u> |
| 维尔京群岛 0.59%   |                                                                         |           |                  |             |
|               | Expand Lead Ltd (Reg) (Reg S) 4.95% 22/07/2026                          | 200,000   | 195,048          | 0.59        |
|               |                                                                         |           | <u>195,048</u>   | <u>0.59</u> |
| 浮动收益          |                                                                         |           |                  |             |
| 英属维尔京群岛 0.60% |                                                                         |           |                  |             |
|               | China Huaneng Gp HK Treasury (Reg) (Reg S) Var Perpetual 31/12/2049     | 200,000   | 197,660          | 0.60        |
|               |                                                                         |           | <u>197,660</u>   | <u>0.60</u> |
| 中国 1.01%      |                                                                         |           |                  |             |
|               | 中国工商银行 (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049                                | 300,000   | 297,975          | 0.90        |
|               | 融创中国控股有限公司 Frn 30/09/2028                                               | 300,000   | 34,500           | 0.11        |
|               |                                                                         |           | <u>332,475</u>   | <u>1.01</u> |
| 香港 4.83%      |                                                                         |           |                  |             |
|               | 东亚银行有限公司 Ser Emtn (Reg) (Reg S) Var 22/04/2032                          | 250,000   | 244,751          | 0.74        |
|               | 东亚银行有限公司 Ser Emtn (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049                     | 250,000   | 248,334          | 0.75        |
|               | CAS Capital No.1 Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049                  | 200,000   | 193,317          | 0.59        |
|               | 大新银行有限公司 Ser Emtn (Reg) (Reg S) Var 02/11/2031                          | 300,000   | 288,807          | 0.88        |
|               | 南洋商业银行有限公司 (Reg S) Var Perp 31/12/2049                                  | 250,000   | 253,510          | 0.77        |
|               | 南洋商业银行有限公司 (Reg) (Reg S) Var 06/08/2034                                 | 250,000   | 255,543          | 0.77        |
|               | 新世界财务(BVI)有限公司 (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049                        | 200,000   | 108,494          | 0.33        |
|               |                                                                         |           | <u>1,592,756</u> | <u>4.83</u> |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

| 国家/地区      | 投资                                                                   | 单位数目    | 市值<br>(美元)       | 占净资产<br>百分比 |
|------------|----------------------------------------------------------------------|---------|------------------|-------------|
| 浮动收益(续)    |                                                                      |         |                  |             |
| 印度 2.19%   |                                                                      |         |                  |             |
|            | Axis Bank Gift City Ser Regs (Reg S) Var Perp 31/12/2049             | 200,000 | 193,317          | 0.59        |
|            | HDFC Bank Ltd Ser Regs (Reg S) Var Perp 31/12/2049                   | 200,000 | 191,532          | 0.58        |
|            | Vedanta Resources Ser Regs 9.475% 24/07/2030                         | 341,000 | 337,795          | 1.02        |
|            |                                                                      |         | <b>722,644</b>   | <b>2.19</b> |
| 日本 0.61%   |                                                                      |         |                  |             |
|            | 第一生命控股有限公司 Ser Regs Var Perp 31/12/2049                              | 200,000 | 201,129          | 0.61        |
|            |                                                                      |         | <b>201,129</b>   | <b>0.61</b> |
| 韩国 1.56%   |                                                                      |         |                  |             |
|            | Woori Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049                | 507,000 | 515,116          | 1.56        |
|            |                                                                      |         | <b>515,116</b>   | <b>1.56</b> |
| 毛里求斯 1.19% |                                                                      |         |                  |             |
|            | Network I2I Ltd Ser Regs (Reg S) Var Perp 31/12/2049                 | 400,000 | 393,570          | 1.19        |
|            |                                                                      |         | <b>393,570</b>   | <b>1.19</b> |
| 菲律宾 2.44%  |                                                                      |         |                  |             |
|            | Rizal Commercial Banking (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049           | 200,000 | 199,909          | 0.61        |
|            | San Miguel Corp Ser Emtn (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049           | 200,000 | 198,768          | 0.60        |
|            | San Miguel Global Power (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049            | 200,000 | 206,246          | 0.63        |
|            | SMC Global Power Hldgs (Reg) (Reg S) Var Perp 31/12/2049             | 200,000 | 197,749          | 0.60        |
|            |                                                                      |         | <b>802,672</b>   | <b>2.44</b> |
| 新加坡 1.00%  |                                                                      |         |                  |             |
|            | GLP Pte Ltd (Reg S) Var Perp 31/12/2049                              | 200,000 | 130,508          | 0.40        |
|            | 大东方人寿保险 Ser Emtn Var Perp 31/12/2049                                 | 200,000 | 198,442          | 0.60        |
|            |                                                                      |         | <b>328,950</b>   | <b>1.00</b> |
| 泰国 2.39%   |                                                                      |         |                  |             |
|            | Bangkok Bank PCL/HK Ser Regs (Reg S) Var Perp 31/12/2049             | 200,000 | 198,947          | 0.60        |
|            | Bangkok Bank Pcl/Hk Ser Regs Var 25/03/2040                          | 200,000 | 199,228          | 0.61        |
|            | Kasikornbank PCL HK Ser Emtn (Reg) (Reg S) Var 02/10/2031            | 200,000 | 194,048          | 0.59        |
|            | Muang Thai Life Assuranc (Reg) (Reg S) Var 27/01/2037                | 200,000 | 195,790          | 0.59        |
|            |                                                                      |         | <b>788,013</b>   | <b>2.39</b> |
| 英国 6.72%   |                                                                      |         |                  |             |
|            | Standard Charter Ser Regs (Reg S) Var 29/06/2032                     | 200,000 | 173,189          | 0.53        |
|            | Standard Chartered Plc Ser Emtn (Reg S) Var 15/03/2033               | 600,000 | 593,531          | 1.80        |
|            | Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 12/01/2033         | 800,000 | 706,810          | 2.14        |
|            | Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 18/02/2036         | 400,000 | 353,890          | 1.07        |
|            | Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp<br>31/12/2049 | 400,000 | 386,676          | 1.18        |
|            |                                                                      |         | <b>2,214,096</b> | <b>6.72</b> |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

投资组合(未经审计)(续)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

| 国家/地区         | 投资                             | 单位数目 | 市值<br>(美元)        | 占净资产<br>百分比   |
|---------------|--------------------------------|------|-------------------|---------------|
| 期货合约          |                                |      |                   |               |
| 美国 0.90%      |                                |      |                   |               |
|               | 美国长期国债(芝加哥交易所) 18/06/2025      | 2    | <u>1,547</u>      | <u>0.00</u>   |
|               | 美国 10 年国库票据(芝加哥交易所) 18/06/2025 | (2)  | <u>(1,313)</u>    | <u>(0.00)</u> |
|               | 美国超长期国债(芝加哥交易所) 18/06/2025     | (2)  | <u>(2,625)</u>    | <u>(0.01)</u> |
|               | 美国 5 年国库票据(芝加哥交易所) 30/06/2025  | 24   | <u>22,031</u>     | <u>0.07</u>   |
|               | 美国 2 年国库票据(芝加哥交易所) 30/06/2025  | 5    | <u>3,594</u>      | <u>0.01</u>   |
|               |                                |      | <u>23,234</u>     | <u>0.07</u>   |
| 远期外汇合约(0.07%) |                                |      | <u>(22,609)</u>   | <u>(0.07)</u> |
| 固定收益合计        |                                |      | <u>23,596,138</u> |               |
| 浮动收益合计        |                                |      | <u>8,089,081</u>  |               |
| 期货合约合计        |                                |      | <u>23,234</u>     |               |
| 远期外汇合约合计      |                                |      | <u>(22,609)</u>   |               |
| 组合投资合计        |                                |      | <u>31,685,844</u> |               |
| 组合投资合计, 按成本   |                                |      | <u>31,178,222</u> |               |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

投资组合持有变动表(未经审计)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

|           | 于 2025 年 3 月 31 日<br>占资产净值百分比 | 于 2024 年 9 月 30 日<br>占资产净值百分比 |
|-----------|-------------------------------|-------------------------------|
| 上市股票      |                               |                               |
| 澳大利亚      | 0.21                          | 0.36                          |
| 中国大陆      | 10.66                         | 6.62                          |
| 丹麦        | -                             | 0.13                          |
| 香港        | 4.35                          | 1.05                          |
| 印尼        | -                             | 0.06                          |
| 日本        | 1.05                          | 5.09                          |
| 韩国        | 2.99                          | 3.24                          |
| 瑞士        | 0.22                          | -                             |
| 台湾        | 1.73                          | 4.67                          |
| 美国        | 22.37                         | 36.16                         |
|           | <u>43.58</u>                  | <u>57.38</u>                  |
| 固定收益      |                               |                               |
| 美国        | 38.44                         | 28.62                         |
|           | <u>38.44</u>                  | <u>28.62</u>                  |
| 浮动收益      |                               |                               |
| 美国        | 4.47                          | 4.50                          |
|           | <u>4.47</u>                   | <u>4.50</u>                   |
| 上市/报价投资基金 |                               |                               |
| 香港        | 0.65                          | -                             |
| 爱尔兰       | 4.69                          | 3.71                          |
| 卢森堡       | 0.35                          | 0.44                          |
| 美国        | -                             | 0.27                          |
|           | <u>5.69</u>                   | <u>4.42</u>                   |
| 期货合约      |                               |                               |
| 德国        | (0.04)                        | -                             |
| 香港        | (0.03)                        | 0.02                          |
| 印度        | -                             | (0.00)                        |
| 日本        | -                             | 0.03                          |
|           | <u>(0.07)</u>                 | <u>0.05</u>                   |
| 远期外汇合约    | <u>(0.12)</u>                 | <u>0.41</u>                   |
| 组合投资合计    | <u>91.99</u>                  | <u>95.38</u>                  |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

投资组合持有变动表(未经审计)(续)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

| 瑞士百达亚洲债券收益 | 于 2025 年 3 月 31 日占<br>资产净值百分比 | 于 2024 年 9 月 30 日占<br>资产净值百分比 |
|------------|-------------------------------|-------------------------------|
| 固定收益       |                               |                               |
| 百慕大        | 0.56                          | 0.72                          |
| 英属维尔京群岛    | 4.01                          | 6.57                          |
| 开曼群岛       | 4.86                          | 6.27                          |
| 中国大陆       | 14.12                         | 9.12                          |
| 香港         | 6.12                          | 8.44                          |
| 印度         | 6.82                          | 12.10                         |
| 印尼         | 3.65                          | 5.57                          |
| 马恩岛        | 1.19                          | 0.74                          |
| 日本         | 0.66                          | -                             |
| 韩国         | 9.10                          | 6.94                          |
| 澳门         | 3.76                          | 3.16                          |
| 马来西亚       | 1.81                          | 1.79                          |
| 毛里求斯       | 0.61                          | 0.75                          |
| 蒙古         | 0.63                          | -                             |
| 荷兰         | 0.96                          | 1.37                          |
| 菲律宾        | 2.84                          | 0.62                          |
| 新加坡        | 0.50                          | 2.71                          |
| 台湾         | 0.59                          | 0.75                          |
| 泰国         | 1.90                          | 2.50                          |
| 美国         | 5.74                          | 4.17                          |
| 越南         | 0.56                          | 0.77                          |
| 维尔京群岛      | 0.59                          | -                             |
|            | <u>71.58</u>                  | <u>75.06</u>                  |
| 浮动收益       |                               |                               |
| 英属维尔京群岛    | 0.60                          | 0.74                          |
| 中国大陆       | 1.01                          | -                             |
| 香港         | 4.83                          | 5.15                          |
| 印度         | 2.19                          | -                             |
| 印尼         | -                             | 0.72                          |
| 日本         | 0.61                          | -                             |
| 韩国         | 1.56                          | 1.19                          |
| 毛里求斯       | 1.19                          | 1.47                          |
| 菲律宾        | 2.44                          | 1.52                          |
| 新加坡        | 1.00                          | 1.25                          |
| 泰国         | 2.39                          | 2.94                          |
| 英国         | 6.72                          | 6.95                          |
|            | <u>24.54</u>                  | <u>21.93</u>                  |
| 期货合约       |                               |                               |
| 美国         | 0.07                          | 0.01                          |
|            | <u>0.07</u>                   | <u>0.01</u>                   |
| 远期外汇合约     | (0.07)                        | 0.15                          |
|            | <u>(0.07)</u>                 | <u>0.15</u>                   |
| 组合投资合计     | <u>96.12</u>                  | <u>97.15</u>                  |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

衍生金融工具详情(未经审计)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

期货合约

于 2025 年 3 月 31 日，子基金持有的期货合约详情如下：

于 2025 年 3 月 31 日

| 说明                       | 相关资产         | 合约规模 | 名义市值<br>美元 | 持仓量 | 交易对手     | 公允价值<br>美元                    |
|--------------------------|--------------|------|------------|-----|----------|-------------------------------|
| 金融资产：                    |              |      |            |     |          |                               |
| 欧洲斯托克 50<br>20/06/2025   | 欧洲斯托克 50     | 10   | 18,497,021 | 330 | 瑞银集团伦敦分行 | (359,219)                     |
| 恒生中国企业指数期货<br>29/04/2025 | 恒生中国企业<br>指数 | 50   | 18,887,800 | 345 | 瑞银集团伦敦分行 | (314,834)<br><u>(674,053)</u> |

远期外汇合约

于 2025 年 3 月 31 日，子基金持有的远期外汇合约详情如下：

于 2025 年 3 月 31 日

| 交割合约           | 折算额           | 结算日期       | 交易对手         | 公允价值<br>美元 |
|----------------|---------------|------------|--------------|------------|
| 金融资产：          |               |            |              |            |
| 澳元 320,255     | 美元 201,137    | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 1,525      |
| 澳元 174,394     | 美元 109,866    | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 1,168      |
| 澳元 171,200     | 美元 107,276    | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 568        |
| 瑞士法郎 100,719   | 美元 114,354    | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 133        |
| 离岸人民币 301,529  | 美元 41,650     | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 61         |
| 离岸人民币 244,846  | 美元 33,790     | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 19         |
| 离岸人民币 199,783  | 美元 27,560     | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 4          |
| 港元 250,000,000 | 美元 32,173,703 | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 19,309     |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

衍生金融工具详情(未经审计)(续)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

远期外汇合约(续)

于 2025 年 3 月 31 日(续)

| 交割合约          | 折算额               | 结算日期       | 交易对手         | 公允价值<br>美元    |
|---------------|-------------------|------------|--------------|---------------|
| 金融资产：         |                   |            |              |               |
| 日元 18,206,663 | 美元 122,685        | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 550           |
| 新加坡元 53,800   | 美元 40,176         | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 86            |
| 新加坡元 48,230   | 美元 36,016         | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 77            |
| 美元 225,976    | 离岸人民币 1,639,949   | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 220           |
| 美元 54,041     | 离岸人民币 392,000     | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 27            |
| 美元 64,270     | 离岸人民币 466,166     | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 27            |
| 美元 12,481     | 离岸人民币 90,572      | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 11            |
| 美元 55,582     | 离岸人民币 403,000     | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 3             |
| 美元 76,764,580 | 日元 11,444,815,879 | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 10,010        |
| 美元 63,836     | 日元 9,586,851      | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 475           |
| 美元 46,678     | 日元 7,025,975      | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 454           |
| 美元 37,274     | 日元 5,597,400      | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 275           |
| 美元 1,784      | 日元 266,250        | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 2             |
|               |                   |            |              | <u>35,004</u> |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

衍生金融工具详情(未经审计)(续)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

远期外汇合约(续)

于 2025 年 3 月 31 日(续)

| 交割合约            | 折算额            | 结算日期       | 交易对手         | 公允价值<br>美元 |
|-----------------|----------------|------------|--------------|------------|
| 金融负债：           |                |            |              |            |
| 离岸人民币 467,261   | 美元 64,389      | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (60)       |
| 离岸人民币 1,009,508 | 美元 139,175     | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (65)       |
| 离岸人民币 260,268   | 美元 35,827      | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (71)       |
| 日元 2,795,971    | 美元 18,664      | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (92)       |
| 日元 10,405,558   | 美元 69,138      | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (665)      |
| 日元 21,990,392   | 美元 146,441     | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (1,076)    |
| 美元 7,480        | 澳元 11,938      | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (40)       |
| 美元 5,225        | 澳元 8,282       | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (63)       |
| 美元 6,237        | 澳元 9,900       | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (66)       |
| 美元 2,963,644    | 澳元 4,718,757   | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (22,485)   |
| 美元 66,761,999   | 澳元 106,088,292 | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (638,121)  |
| 美元 50,376       | 瑞士法郎 44,325    | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (110)      |
| 美元 10,379,518   | 瑞士法郎 9,122,268 | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (34,383)   |
| 美元 136          | 离岸人民币 985      | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (0)        |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

衍生金融工具详情(未经审计)(续)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达策略收益

远期外汇合约(续)

于 2025 年 3 月 31 日(续)

| 交割合约           | 折算额                 | 结算日期       | 交易对手         | 公允价值<br>美元         |
|----------------|---------------------|------------|--------------|--------------------|
| 金融负债：          |                     |            |              |                    |
| 美元 224,068     | 离岸人民币 1,624,205     | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (44)               |
| 美元 82,637      | 离岸人民币 598,761       | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (51)               |
| 美元 149,333     | 离岸人民币 1,081,029     | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (228)              |
| 美元 57,700,044  | 离岸人民币 417,646,591   | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (94,793)           |
| 美元 229,243,754 | 离岸人民币 1,659,320,624 | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (376,616)          |
| 美元 1,578       | 欧元 1,453            | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (6)                |
| 美元 80,046      | 日元 11,880,000       | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (352)              |
| 美元 1,795,541   | 新加坡元 2,392,724      | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (12,585)           |
| 美元 2,003,358   | 新加坡元 2,668,457      | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (14,937)           |
|                |                     |            |              | <u>(1,196,909)</u> |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

衍生金融工具详情(未经审计)(续)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

期货合约

于 2025 年 3 月 31 日，子基金持有的期货合约详情如下：

于 2025 年 3 月 31 日

| 说明                                | 相关资产   | 合约规模  | 名义市值<br>美元 | 持仓量 | 交易对手           | 公允价值<br>美元                              |
|-----------------------------------|--------|-------|------------|-----|----------------|-----------------------------------------|
| <b>金融资产：</b>                      |        |       |            |     |                |                                         |
| 美国长期国债(芝加哥交易所) 18/06/2025         | 美国国库票据 | 1,000 | 117,281    | 1   | 摩根大通证券<br>有限公司 | 1,109                                   |
| 美国长期国债(芝加哥交易所) 18/06/2025         | 美国国库票据 | 1,000 | 117,281    | 1   |                | 438                                     |
| 美国 2 年国库票据(芝加哥交易所)<br>30/06/2025  | 美国国库票据 | 2,000 | 1,035,859  | 5   | 摩根大通证券<br>有限公司 | 3,594                                   |
| 美国 5 年国库票据(芝加哥交易所)<br>30/06/2025  | 美国国库票据 | 1,000 | 1,622,344  | 15  | 摩根大通证券<br>有限公司 | 15,359                                  |
| 美国 5 年国库票据(芝加哥交易所)<br>30/06/2025  | 美国国库票据 | 1,000 | 216,313    | 2   | 摩根大通证券<br>有限公司 | 2,641                                   |
| 美国 5 年国库票据(芝加哥交易所)<br>30/06/2025  | 美国国库票据 | 1,000 | 432,625    | 4   | 摩根大通证券<br>有限公司 | 2,531                                   |
| 美国 5 年国库票据(芝加哥交易所)<br>30/06/2025  | 美国国库票据 | 1,000 | 324,469    | 3   | 摩根大通证券<br>有限公司 | 1,500                                   |
|                                   |        |       |            |     |                | <b><u>27,172</u></b>                    |
| <b>金融负债：</b>                      |        |       |            |     |                |                                         |
| 美国 10 年国库票据(芝加哥交易所)<br>18/06/2025 | 美国国库票据 | 1,000 | (222,438)  | (2) | 摩根大通证券<br>有限公司 | (1,313)                                 |
| 美国超长期国债 芝加哥交易所 18/06/2025         | 美国国库票据 | 1,000 | (244,500)  | (2) | 摩根大通证券<br>有限公司 | <u>(2,625)</u><br><b><u>(3,938)</u></b> |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

衍生金融工具详情(未经审计)(续)

于 2025 年 3 月 31 日

瑞士百达亚洲债券收益

远期外汇合约

于 2025 年 3 月 31 日，子基金持有的远期外汇合约详情如下：

于 2025 年 3 月 31 日

| 交割合约            | 折算额              | 结算日期       | 交易对手         | 公允价值<br>美元      |
|-----------------|------------------|------------|--------------|-----------------|
| <b>金融资产：</b>    |                  |            |              |                 |
| 离岸人民币 1,000,000 | 美元 139,136       | 12/06/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 826             |
| 美元 138,084      | 离岸人民币 1,000,000  | 12/06/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 227             |
| 美元 27,158       | 离岸人民币 197,000    | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | 14              |
|                 |                  |            |              | <u>1,067</u>    |
| <b>金融负债：</b>    |                  |            |              |                 |
| 美元 720,153      | 澳元 1,143,816     | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (7,223)         |
| 美元 3,319,300    | 离岸人民币 24,024,222 | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (5,682)         |
| 美元 1,444,503    | 新加坡元 1,924,067   | 30/04/2025 | 香港上海汇丰银行有限公司 | (10,771)        |
|                 |                  |            |              | <u>(23,676)</u> |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

派息披露(未经审计)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

I 每月派息 美元

| 记录日              | 除息日              | 派息日              | 每份额派息额<br>(美元) | 有权收取派息之<br>份额 | 总派息额<br>(美元) | 总派息额<br>(美元) |
|------------------|------------------|------------------|----------------|---------------|--------------|--------------|
| 2024 年 10 月 18 日 | 2024 年 10 月 21 日 | 2024 年 10 月 25 日 | 0.045          | 936,896.8470  | 42,160.36    | 42,160.36    |
| 2024 年 11 月 19 日 | 2024 年 11 月 20 日 | 2024 年 11 月 26 日 | 0.045          | 965,405.3938  | 43,443.24    | 43,443.24    |
| 2024 年 12 月 19 日 | 2024 年 12 月 20 日 | 2024 年 12 月 30 日 | 0.045          | 965,405.3938  | 43,443.24    | 43,443.24    |
| 2025 年 1 月 17 日  | 2025 年 1 月 20 日  | 2025 年 1 月 24 日  | 0.045          | 965,405.3938  | 43,443.24    | 43,443.24    |
| 2025 年 2 月 19 日  | 2025 年 2 月 20 日  | 2025 年 2 月 26 日  | 0.045          | 864,606.0548  | 38,907.27    | 38,907.27    |
| 2025 年 3 月 19 日  | 2025 年 3 月 20 日  | 2025 年 3 月 26 日  | 0.045          | 864,606.0548  | 38,907.27    | 38,907.27    |

P 每月派息 港元

| 记录日              | 除息日              | 派息日              | 每份额派息额<br>(港元) | 有权收取派息之<br>份额    | 总派息额<br>(港元) | 总派息额<br>(港元) |
|------------------|------------------|------------------|----------------|------------------|--------------|--------------|
| 2024 年 10 月 18 日 | 2024 年 10 月 21 日 | 2024 年 10 月 25 日 | 0.045          | 117,056,920.0749 | 5,267,561.41 | 677,608.80   |
| 2024 年 11 月 19 日 | 2024 年 11 月 20 日 | 2024 年 11 月 26 日 | 0.045          | 111,841,624.5959 | 5,032,873.12 | 646,607.97   |
| 2024 年 12 月 19 日 | 2024 年 12 月 20 日 | 2024 年 12 月 30 日 | 0.045          | 109,072,010.2745 | 4,908,240.47 | 631,516.44   |
| 2025 年 1 月 17 日  | 2025 年 1 月 20 日  | 2025 年 1 月 24 日  | 0.045          | 125,501,504.0103 | 5,647,567.69 | 725,773.18   |
| 2025 年 2 月 19 日  | 2025 年 2 月 20 日  | 2025 年 2 月 26 日  | 0.045          | 127,371,997.4947 | 5,731,739.90 | 737,163.35   |
| 2025 年 3 月 19 日  | 2025 年 3 月 20 日  | 2025 年 3 月 26 日  | 0.045          | 121,081,723.8986 | 5,448,677.58 | 700,997.41   |

P 每月派息 美元

| 记录日              | 除息日              | 派息日              | 每份额派息额<br>(美元) | 有权收取派息之<br>份额   | 总派息额<br>(美元) | 总派息额<br>(美元) |
|------------------|------------------|------------------|----------------|-----------------|--------------|--------------|
| 2024 年 10 月 18 日 | 2024 年 10 月 21 日 | 2024 年 10 月 25 日 | 0.045          | 20,787,675.4580 | 935,445.40   | 935,445.40   |
| 2024 年 11 月 19 日 | 2024 年 11 月 20 日 | 2024 年 11 月 26 日 | 0.045          | 19,979,367.1964 | 899,071.52   | 899,071.52   |
| 2024 年 12 月 19 日 | 2024 年 12 月 20 日 | 2024 年 12 月 30 日 | 0.045          | 20,090,258.7888 | 904,061.63   | 904,061.63   |
| 2025 年 1 月 17 日  | 2025 年 1 月 20 日  | 2025 年 1 月 24 日  | 0.045          | 22,334,138.2627 | 1,005,036.20 | 1,005,036.20 |
| 2025 年 2 月 19 日  | 2025 年 2 月 20 日  | 2025 年 2 月 26 日  | 0.045          | 22,921,546.9761 | 1,031,469.62 | 1,031,469.62 |
| 2025 年 3 月 19 日  | 2025 年 3 月 20 日  | 2025 年 3 月 26 日  | 0.045          | 22,863,212.7441 | 1,028,844.58 | 1,028,844.58 |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

派息披露(未经审计)(续)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

HI 每月派息 新加坡元

| 记录日              | 除息日              | 派息日              | 每份额派息额<br>(新加坡元) | 有权收取派息之<br>份额 | 总派息额<br>(新加坡元) | 总派息额<br>(美元) |
|------------------|------------------|------------------|------------------|---------------|----------------|--------------|
| 2024 年 10 月 18 日 | 2024 年 10 月 21 日 | 2024 年 10 月 25 日 | 0.045            | 237,933.6280  | 10,707.01      | 8,146.86     |
| 2024 年 11 月 19 日 | 2024 年 11 月 20 日 | 2024 年 11 月 26 日 | 0.045            | 279,749.5950  | 12,588.73      | 9,361.74     |
| 2024 年 12 月 19 日 | 2024 年 12 月 20 日 | 2024 年 12 月 30 日 | 0.045            | 279,749.5950  | 12,588.73      | 9,251.32     |
| 2025 年 1 月 17 日  | 2025 年 1 月 20 日  | 2025 年 1 月 24 日  | 0.045            | 279,749.5950  | 12,588.73      | 9,278.59     |
| 2025 年 2 月 19 日  | 2025 年 2 月 20 日  | 2025 年 2 月 26 日  | 0.045            | 279,749.5950  | 12,588.73      | 9,429.05     |
| 2025 年 3 月 19 日  | 2025 年 3 月 20 日  | 2025 年 3 月 26 日  | 0.045            | 279,749.5950  | 12,588.73      | 9,423.76     |

HP 每月派息 澳元

| 记录日              | 除息日              | 派息日              | 每份额派息额<br>(澳元) | 有权收取派息之<br>份额   | 总派息额<br>(澳元) | 总派息额<br>(美元) |
|------------------|------------------|------------------|----------------|-----------------|--------------|--------------|
| 2024 年 10 月 18 日 | 2024 年 10 月 21 日 | 2024 年 10 月 25 日 | 0.050          | 12,884,388.7530 | 644,219.43   | 429,855.41   |
| 2024 年 11 月 19 日 | 2024 年 11 月 20 日 | 2024 年 11 月 26 日 | 0.050          | 13,032,801.9940 | 651,640.10   | 422,914.42   |
| 2024 年 12 月 19 日 | 2024 年 12 月 20 日 | 2024 年 12 月 30 日 | 0.050          | 10,982,073.9451 | 549,103.70   | 343,382.00   |
| 2025 年 1 月 17 日  | 2025 年 1 月 20 日  | 2025 年 1 月 24 日  | 0.050          | 12,341,964.5030 | 617,098.22   | 386,149.21   |
| 2025 年 2 月 19 日  | 2025 年 2 月 20 日  | 2025 年 2 月 26 日  | 0.050          | 13,102,006.5934 | 655,100.35   | 418,936.67   |
| 2025 年 3 月 19 日  | 2025 年 3 月 20 日  | 2025 年 3 月 26 日  | 0.050          | 13,042,665.5134 | 652,133.27   | 410,811.35   |

HP 每月派息 瑞士法郎

| 记录日              | 除息日              | 派息日              | 每份额派息额<br>(瑞士法郎) | 有权收取派息之<br>份额 | 总派息额<br>(瑞士法郎) | 总派息额<br>(美元) |
|------------------|------------------|------------------|------------------|---------------|----------------|--------------|
| 2024 年 10 月 18 日 | 2024 年 10 月 21 日 | 2024 年 10 月 25 日 | 0.050            | 487,692.4387  | 24,384.62      | 28,187.05    |
| 2024 年 11 月 19 日 | 2024 年 11 月 20 日 | 2024 年 11 月 26 日 | 0.050            | 479,442.6820  | 23,972.14      | 27,073.40    |
| 2024 年 12 月 19 日 | 2024 年 12 月 20 日 | 2024 年 12 月 30 日 | 0.050            | 495,765.7715  | 24,788.29      | 27,608.50    |
| 2025 年 1 月 17 日  | 2025 年 1 月 20 日  | 2025 年 1 月 24 日  | 0.050            | 807,202.4877  | 40,360.12      | 44,439.68    |
| 2025 年 2 月 19 日  | 2025 年 2 月 20 日  | 2025 年 2 月 26 日  | 0.050            | 831,414.1030  | 41,570.70      | 46,202.50    |
| 2025 年 3 月 19 日  | 2025 年 3 月 20 日  | 2025 年 3 月 26 日  | 0.050            | 891,830.7034  | 44,591.54      | 50,520.07    |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

派息披露(未经审计)(续)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达策略收益

HP 每月派息 欧元

| 记录日             | 除息日             | 派息日             | 每份额派息额<br>(欧元) | 有权收取派息之<br>份额 | 总派息额<br>(欧元) | 总派息额<br>(美元) |
|-----------------|-----------------|-----------------|----------------|---------------|--------------|--------------|
| 2025 年 3 月 19 日 | 2025 年 3 月 20 日 | 2025 年 3 月 26 日 | 0.050          | 150.0000      | 7.50         | 8.14         |

HP 每月派息 日元

| 记录日              | 除息日              | 派息日              | 每份额派息额<br>(日元) | 有权收取派息之<br>份额   | 总派息额<br>(日元)  | 总派息额<br>(美元) |
|------------------|------------------|------------------|----------------|-----------------|---------------|--------------|
| 2024 年 10 月 18 日 | 2024 年 10 月 21 日 | 2024 年 10 月 25 日 | 5.000          | 11,491,111.6415 | 57,455,558.00 | 382,412.45   |
| 2024 年 11 月 19 日 | 2024 年 11 月 20 日 | 2024 年 11 月 26 日 | 5.000          | 11,351,344.1770 | 56,756,721.00 | 364,772.14   |
| 2024 年 12 月 19 日 | 2024 年 12 月 20 日 | 2024 年 12 月 30 日 | 5.000          | 11,699,241.2983 | 58,496,208.00 | 370,945.23   |
| 2025 年 1 月 17 日  | 2025 年 1 月 20 日  | 2025 年 1 月 24 日  | 5.000          | 11,835,878.5175 | 59,179,393.00 | 380,122.64   |
| 2025 年 2 月 19 日  | 2025 年 2 月 20 日  | 2025 年 2 月 26 日  | 5.000          | 11,865,377.2341 | 59,326,885.00 | 396,875.17   |
| 2025 年 3 月 19 日  | 2025 年 3 月 20 日  | 2025 年 3 月 26 日  | 5.000          | 11,758,474.4824 | 58,792,373.00 | 394,937.51   |

HP 每月派息 人民币

| 记录日              | 除息日              | 派息日              | 每份额派息额<br>(人民币) | 有权收取派息之<br>份额   | 总派息额<br>(人民币)  | 总派息额<br>(美元) |
|------------------|------------------|------------------|-----------------|-----------------|----------------|--------------|
| 2024 年 10 月 18 日 | 2024 年 10 月 21 日 | 2024 年 10 月 25 日 | 0.050           | 46,447,038.2731 | 2,322,351.9200 | 325,546.62   |
| 2024 年 11 月 19 日 | 2024 年 11 月 20 日 | 2024 年 11 月 26 日 | 0.050           | 42,117,982.4438 | 2,105,899.13   | 290,396.75   |
| 2024 年 12 月 19 日 | 2024 年 12 月 20 日 | 2024 年 12 月 30 日 | 0.050           | 42,194,394.7548 | 2,109,719.73   | 288,542.22   |
| 2025 年 1 月 17 日  | 2025 年 1 月 20 日  | 2025 年 1 月 24 日  | 0.050           | 41,617,701.3437 | 2,080,885.07   | 286,020.52   |
| 2025 年 2 月 19 日  | 2025 年 2 月 20 日  | 2025 年 2 月 26 日  | 0.050           | 41,534,824.5635 | 2,076,741.24   | 286,751.62   |
| 2025 年 3 月 19 日  | 2025 年 3 月 20 日  | 2025 年 3 月 26 日  | 0.050           | 43,240,473.0387 | 2,162,023.66   | 298,019.02   |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

派息披露(未经审计)(续)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

I 每月派息 美元

| 记录日              | 除息日              | 派息日              | 每份额派息额<br>(美元) | 有权收取派息之<br>份额  | 总派息额<br>(美元) | 总派息额<br>(美元) |
|------------------|------------------|------------------|----------------|----------------|--------------|--------------|
| 2024 年 10 月 18 日 | 2024 年 10 月 21 日 | 2024 年 10 月 25 日 | 0.042          | 974,048.0436   | 40,910.02    | 40,910.02    |
| 2024 年 11 月 19 日 | 2024 年 11 月 20 日 | 2024 年 11 月 26 日 | 0.042          | 1,017,590.0436 | 42,738.78    | 42,738.78    |
| 2024 年 12 月 19 日 | 2024 年 12 月 20 日 | 2024 年 11 月 30 日 | 0.042          | 1,024,637.0436 | 43,034.76    | 43,034.76    |
| 2025 年 1 月 17 日  | 2025 年 1 月 20 日  | 2025 年 1 月 24 日  | 0.042          | 1,024,637.0436 | 43,034.76    | 43,034.76    |
| 2025 年 2 月 19 日  | 2025 年 2 月 20 日  | 2025 年 2 月 26 日  | 0.042          | 1,019,750.0436 | 42,829.50    | 42,829.50    |
| 2025 年 3 月 19 日  | 2025 年 3 月 20 日  | 2025 年 3 月 26 日  | 0.042          | 926,789.0436   | 38,925.14    | 38,925.14    |

P 每月派息 港元

| 记录日              | 除息日              | 派息日              | 每份额派息额<br>(港元) | 有权收取派息之<br>份额  | 总派息额<br>(港元) | 总派息额<br>(美元) |
|------------------|------------------|------------------|----------------|----------------|--------------|--------------|
| 2024 年 10 月 18 日 | 2024 年 10 月 21 日 | 2024 年 10 月 25 日 | 0.042          | 1,758,510.8945 | 73,857.46    | 9,500.88     |
| 2024 年 11 月 19 日 | 2024 年 11 月 20 日 | 2024 年 11 月 26 日 | 0.042          | 2,022,945.0114 | 84,963.70    | 10,915.94    |
| 2024 年 12 月 19 日 | 2024 年 12 月 20 日 | 2024 年 11 月 30 日 | 0.042          | 2,022,945.0114 | 84,963.70    | 10,931.81    |
| 2025 年 1 月 17 日  | 2025 年 1 月 20 日  | 2025 年 1 月 24 日  | 0.042          | 2,023,055.6064 | 84,968.34    | 10,915.84    |
| 2025 年 2 月 19 日  | 2025 年 2 月 20 日  | 2025 年 2 月 26 日  | 0.042          | 2,458,680.3461 | 103,264.58   | 13,280.93    |
| 2025 年 3 月 19 日  | 2025 年 3 月 20 日  | 2025 年 3 月 26 日  | 0.042          | 2,750,753.3864 | 115,531.65   | 14,868.56    |

P 每月派息 美元

| 记录日              | 除息日              | 派息日              | 每份额派息额<br>(美元) | 有权收取派息之<br>份额 | 总派息额<br>(美元) | 总派息额<br>(美元) |
|------------------|------------------|------------------|----------------|---------------|--------------|--------------|
| 2024 年 10 月 18 日 | 2024 年 10 月 21 日 | 2024 年 10 月 25 日 | 0.042          | 764,384.7419  | 32,104.16    | 32,104.16    |
| 2024 年 11 月 19 日 | 2024 年 11 月 20 日 | 2024 年 11 月 26 日 | 0.042          | 773,761.1017  | 32,497.96    | 32,497.96    |
| 2024 年 12 月 19 日 | 2024 年 12 月 20 日 | 2024 年 11 月 30 日 | 0.042          | 773,897.3804  | 32,503.68    | 32,503.68    |
| 2025 年 1 月 17 日  | 2025 年 1 月 20 日  | 2025 年 1 月 24 日  | 0.042          | 763,897.3804  | 32,083.68    | 32,083.68    |
| 2025 年 2 月 19 日  | 2025 年 2 月 20 日  | 2025 年 2 月 26 日  | 0.042          | 796,692.4666  | 33,461.07    | 33,461.07    |
| 2025 年 3 月 19 日  | 2025 年 3 月 20 日  | 2025 年 3 月 26 日  | 0.042          | 808,488.3399  | 33,956.50    | 33,956.50    |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

派息披露(未经审计)(续)

截至 2025 年 3 月 31 日止 6 个月期间

瑞士百达亚洲债券收益

HP 每月派息 澳元

| 记录日              | 除息日              | 派息日              | 每份额派息额<br>(澳元) | 有权收取派息之<br>份额 | 总派息额<br>(澳元) | 总派息额<br>(美元) |
|------------------|------------------|------------------|----------------|---------------|--------------|--------------|
| 2024 年 10 月 18 日 | 2024 年 10 月 21 日 | 2024 年 10 月 25 日 | 0.047          | 167,689.2164  | 7,881.39     | 5,258.86     |
| 2024 年 11 月 19 日 | 2024 年 11 月 20 日 | 2024 年 11 月 26 日 | 0.047          | 176,108.8750  | 8,277.11     | 5,397.09     |
| 2024 年 12 月 19 日 | 2024 年 12 月 20 日 | 2024 年 11 月 30 日 | 0.047          | 179,269.1491  | 8,425.65     | 5,268.98     |
| 2025 年 1 月 17 日  | 2025 年 1 月 20 日  | 2025 年 1 月 24 日  | 0.047          | 179,269.1491  | 8,425.65     | 5,240.75     |
| 2025 年 2 月 19 日  | 2025 年 2 月 20 日  | 2025 年 2 月 26 日  | 0.047          | 169,322.5102  | 7,958.15     | 5,089.24     |
| 2025 年 3 月 19 日  | 2025 年 3 月 20 日  | 2025 年 3 月 26 日  | 0.047          | 169,322.5102  | 7,958.15     | 5,037.91     |

HP 每月派息 人民币

| 记录日              | 除息日              | 派息日              | 每份额派息额<br>(人民币) | 有权收取派息之<br>份额  | 总派息额<br>(人民币) | 总派息额<br>(美元) |
|------------------|------------------|------------------|-----------------|----------------|---------------|--------------|
| 2024 年 10 月 18 日 | 2024 年 10 月 21 日 | 2024 年 10 月 25 日 | 0.047           | 2,130,787.9620 | 100,147.04    | 14,038.58    |
| 2024 年 11 月 19 日 | 2024 年 11 月 20 日 | 2024 年 11 月 26 日 | 0.047           | 2,664,268.1619 | 125,220.61    | 17,305.58    |
| 2024 年 12 月 19 日 | 2024 年 12 月 20 日 | 2024 年 11 月 30 日 | 0.047           | 2,981,801.7252 | 140,144.68    | 19,167.31    |
| 2025 年 1 月 17 日  | 2025 年 1 月 20 日  | 2025 年 1 月 24 日  | 0.047           | 2,945,976.8213 | 138,460.91    | 18,869.28    |
| 2025 年 2 月 19 日  | 2025 年 2 月 20 日  | 2025 年 2 月 26 日  | 0.047           | 3,270,632.1283 | 153,719.71    | 21,225.26    |
| 2025 年 3 月 19 日  | 2025 年 3 月 20 日  | 2025 年 3 月 26 日  | 0.047           | 3,492,960.4996 | 164,169.14    | 22,683.13    |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

业绩记录(未经审计)

瑞士百达策略收益

|               |      | 2025 年 3 月 31 日 | 2024 年 9 月 30 日 | 2023 年 9 月 30 日 |
|---------------|------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 净资产总值         |      | 美元 936,633,484  | 美元 813,447,652  | 美元 337,988,669  |
| 每份额资产净值       |      |                 |                 |                 |
| I 累计 美元       | 美元   | 10.4478         | 10.9470         | 8.7243          |
| I 每月派息 美元     | 美元   | 8.2732          | 8.9418          | 7.6048          |
| M 人民币         | 人民币  | 9.6264          | -               | -               |
| M 美元          | 美元   | 9.9336          | 10.4479         | -               |
| P 美元          | 美元   | 9.4546          | 9.9410          | -               |
| P 每月派息 港元     | 港元   | 9.4720          | 10.2162         | 8.7484          |
| P 每月派息 美元     | 美元   | 9.3837          | 10.1400         | 8.6180          |
| P 每月派息 3 港元   | 港元   | -               | -               | 9.5517          |
| P 每月派息 3 美元   | 美元   | -               | -               | 9.5726          |
| HI 累计 新加坡元    | 新加坡元 | 10.3944         | 10.9920         | 8.9202          |
| HI 每月派息 新加坡元  | 新加坡元 | 8.3318          | 9.0858          | 7.8547          |
| HM 人民币        | 人民币  | 12.3469         | 13.1264         | 10.7956         |
| HP 每月派息 澳元    | 澳元   | 7.9467          | 8.6853          | 7.6177          |
| HP 每月派息 瑞士法郎  | 瑞士法郎 | 9.7251          | 10.7562         | 9.5333          |
| HP 每月派息 欧元    | 欧元   | 9.4786          | -               | -               |
| HP 每月派息 日元    | 日元   | 954.0161        | 1,058.5917      | 953.1872        |
| HP 每月派息 人民币   | 人民币  | 9.4286          | 10.3307         | 9.0445          |
| HP 每月派息 3 人民币 | 人民币  | -               | -               | 9.3121          |
| Z 累计 港元       | 港元   | 9.7129          | -               | -               |
| Z 累计 美元       | 美元   | 9.7048          | -               | -               |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

业绩记录(未经审计)(续)

瑞士百达亚洲债券收益

|             |      | 2025 年 3 月 31 日 | 2024 年 9 月 30 日 | 2023 年 9 月 30 日 |
|-------------|------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 净资产总值       |      | 美元 32,963,651   | 美元 26,610,721   | 美元 31,798,418   |
| 每份额资产净值     |      |                 |                 |                 |
| I 累计 美元     | 美元   | 9.6376          | 9.5515          | 8.3926          |
| I 每月派息 美元   | 美元   | 7.4332          | 7.6201          | 7.1677          |
| P 每月派息 港元   | 港元   | 7.2988          | 7.4932          | 7.1466          |
| P 每月派息 美元   | 美元   | 7.2588          | 7.4655          | 7.0659          |
| HI 累计 新加坡元  | 新加坡元 | 9.3315          | 9.3259          | 8.3357          |
| HP 每月派息 澳元  | 澳元   | 6.7394          | 6.9904          | 6.7777          |
| HP 每月派息 人民币 | 人民币  | 6.8581          | 7.1732          | 7.0274          |
| Z 累计 美元     | 美元   | 10.2149         | -               | -               |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

业绩记录(未经审计)(续)

瑞士百达策略收益

每份额最高/最低资产净值(自成立日)

|             | 财务期间截止日         | 每份额最高资产净值   | 每份额最低资产净值  |
|-------------|-----------------|-------------|------------|
| I 累计 美元     | 2025 年 3 月 31 日 | 美元 11.0934  | 美元 10.4478 |
|             | 2024 年 9 月 30 日 | 美元 10.9951  | 美元 8.4911  |
|             | 2023 年 9 月 30 日 | 美元 9.2299   | 美元 7.6538  |
|             | 2022 年 9 月 30 日 | 美元 10.1201  | 美元 7.7220  |
| I 每月派息 美元   | 2025 年 3 月 31 日 | 美元 8.9978   | 美元 8.2732  |
|             | 2024 年 9 月 30 日 | 美元 9.1203   | 美元 7.3572  |
|             | 2023 年 9 月 30 日 | 美元 8.1573   | 美元 7.1198  |
|             | 2022 年 9 月 30 日 | 美元 10.1635  | 美元 7.2219  |
|             | 2021 年 9 月 30 日 | 美元 10.0200  | 美元 9.6038  |
| M 人民币       | 2025 年 3 月 31 日 | 人民币 10.2524 | 人民币 9.6269 |
| M 美元        | 2025 年 3 月 31 日 | 美元 10.5569  | 美元 9.9337  |
|             | 2024 年 9 月 30 日 | 美元 10.5155  | 美元 9.5896  |
| P 美元        | 2025 年 3 月 31 日 | 美元 10.0467  | 美元 9.4546  |
|             | 2024 年 9 月 30 日 | 美元 10.0000  | 美元 9.1200  |
| P 每月派息 港元   | 2025 年 3 月 31 日 | 港元 10.2784  | 港元 9.4719  |
|             | 2024 年 9 月 30 日 | 港元 10.4742  | 港元 8.4548  |
|             | 2023 年 9 月 30 日 | 港元 9.3645   | 港元 8.1935  |
|             | 2022 年 9 月 30 日 | 港元 11.5894  | 港元 8.3097  |
|             | 2021 年 9 月 30 日 | 港元 11.5827  | 港元 9.6904  |
|             | 2020 年 9 月 30 日 | 港元 10.1189  | 港元 8.3032  |
|             | 2019 年 9 月 30 日 | 港元 10.0475  | 港元 9.1808  |
|             | 2018 年 9 月 30 日 | 港元 10.8433  | 港元 9.9794  |
|             | 2017 年 9 月 30 日 | 港元 10.1609  | 港元 9.5253  |
|             |                 |             |            |
| P 每月派息 美元   | 2025 年 3 月 31 日 | 美元 10.2001  | 美元 9.3836  |
|             | 2024 年 9 月 30 日 | 美元 10.3398  | 美元 8.3391  |
|             | 2023 年 9 月 30 日 | 美元 9.2384   | 美元 8.0591  |
|             | 2022 年 9 月 30 日 | 美元 11.4960  | 美元 8.1740  |
|             | 2021 年 9 月 30 日 | 美元 11.5467  | 美元 9.6576  |
|             | 2020 年 9 月 30 日 | 美元 10.0910  | 美元 8.2699  |
|             | 2019 年 9 月 30 日 | 美元 9.9269   | 美元 9.0702  |
|             | 2018 年 9 月 30 日 | 美元 10.7456  | 美元 9.8417  |
|             | 2017 年 9 月 30 日 | 美元 10.0694  | 美元 9.5151  |
|             |                 |             |            |
| P 每月派息 3 港元 | 2025 年 3 月 31 日 | -           | -          |
|             | 2024 年 9 月 30 日 | 港元 11.7650  | 港元 9.2627  |
|             | 2023 年 9 月 30 日 | 港元 10.1097  | 港元 8.6279  |
|             | 2022 年 9 月 30 日 | 港元 10.0190  | 港元 10.7198 |
| P 每月派息 3 美元 | 2025 年 3 月 31 日 | -           | -          |
|             | 2024 年 9 月 30 日 | 美元 10.9804  | 美元 9.2653  |
|             | 2023 年 9 月 30 日 | 美元 10.1742  | 美元 8.6234  |
|             | 2022 年 9 月 30 日 | 美元 10.0181  | 美元 8.7149  |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

业绩记录(未经审计)(续)

瑞士百达策略收益

每份额最高/最低资产净值(自成立日)

|              | 财务期间截止日         | 每份额最高资产净值     | 每份额最低资产净值    |
|--------------|-----------------|---------------|--------------|
| HI 累计 新加坡元   | 2025 年 3 月 31 日 | 新加坡元 11.0798  | 新加坡元 10.3944 |
|              | 2024 年 9 月 30 日 | 新加坡元 11.0902  | 新加坡元 8.6720  |
|              | 2023 年 9 月 30 日 | 新加坡元 9.4668   | 新加坡元 7.9102  |
|              | 2022 年 9 月 30 日 | 新加坡元 10.6310  | 新加坡元 7.9849  |
|              | 2021 年 9 月 30 日 | 新加坡元 10.0000  | 新加坡元 10.0000 |
| HI 每月派息 新加坡元 | 2025 年 3 月 31 日 | 新加坡元 9.1326   | 新加坡元 8.3317  |
|              | 2024 年 9 月 30 日 | 新加坡元 9.3065   | 新加坡元 7.5920  |
|              | 2023 年 9 月 30 日 | 新加坡元 8.4561   | 新加坡元 7.4182  |
|              | 2022 年 9 月 30 日 | 新加坡元 10.5845  | 新加坡元 7.5248  |
|              | 2021 年 9 月 30 日 | 新加坡元 10.0000  | 新加坡元 10.0000 |
| HM 人民币       | 2025 年 3 月 31 日 | 人民币 13.2048   | 人民币 12.3469  |
|              | 2024 年 9 月 30 日 | 人民币 13.2948   | 人民币 10.4934  |
|              | 2023 年 9 月 30 日 | 人民币 11.4869   | 人民币 9.7840   |
|              | 2022 年 9 月 30 日 | 人民币 13.0378   | 人民币 9.8749   |
|              | 2021 年 9 月 30 日 | 人民币 12.6958   | 人民币 10.1741  |
| HP 每月派息 澳元   | 2020 年 9 月 30 日 | 人民币 10.4957   | 人民币 10.0149  |
|              | 2025 年 3 月 31 日 | 澳元 8.7336     | 澳元 7.9467    |
|              | 2024 年 9 月 30 日 | 澳元 8.9295     | 澳元 7.3523    |
|              | 2023 年 9 月 30 日 | 澳元 8.2463     | 澳元 7.3472    |
|              | 2022 年 9 月 30 日 | 澳元 10.7455    | 澳元 7.4711    |
|              | 2021 年 9 月 30 日 | 澳元 10.8503    | 澳元 9.1813    |
|              | 2020 年 9 月 30 日 | 澳元 9.5697     | 澳元 7.9808    |
|              | 2019 年 9 月 30 日 | 澳元 9.8450     | 澳元 9.1565    |
|              | 2018 年 9 月 30 日 | 澳元 10.7144    | 澳元 9.7659    |
| HP 每月派息 瑞士法郎 | 2017 年 9 月 30 日 | 澳元 10.0260    | 澳元 9.5342    |
|              | 2025 年 3 月 31 日 | 瑞士法郎 10.8019  | 瑞士法郎 9.7251  |
|              | 2024 年 9 月 30 日 | 瑞士法郎 11.0742  | 瑞士法郎 9.1996  |
| HP 每月派息 欧元   | 2023 年 9 月 30 日 | 瑞士法郎 10.2117  | 瑞士法郎 9.5133  |
|              | 2025 年 3 月 31 日 | 欧元 10.1427    | 欧元 9.4786    |
| HP 每月派息 日元   | 2025 年 3 月 31 日 | 日元 1062.6694  | 日元 954.0064  |
|              | 2024 年 9 月 30 日 | 日元 1,091.9113 | 日元 918.0091  |
|              | 2023 年 9 月 30 日 | 日元 1,021.0830 | 日元 951.0621  |
| HP 每月派息 人民币  | 2025 年 3 月 31 日 | 人民币 10.3760   | 人民币 9.4286   |
|              | 2024 年 9 月 30 日 | 人民币 10.6190   | 人民币 8.7418   |
|              | 2023 年 9 月 30 日 | 人民币 9.7785    | 人民币 8.6988   |
|              | 2022 年 9 月 30 日 | 人民币 12.2902   | 人民币 8.8290   |
|              | 2021 年 9 月 30 日 | 人民币 12.1353   | 人民币 10.0983  |
|              | 2020 年 9 月 30 日 | 人民币 10.5191   | 人民币 8.6004   |
|              | 2019 年 9 月 30 日 | 人民币 10.3085   | 人民币 9.7658   |
|              | 2018 年 9 月 30 日 | 人民币 11.0396   | 人民币 10.2153  |
|              | 2017 年 9 月 30 日 | 人民币 10.2390   | 人民币 9.5287   |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

业绩记录(未经审计)(续)

瑞士百达策略收益

每份额最高/最低资产净值(自成立日)

|               | 财务期间截止日         | 每份额最高资产净值   | 每份额最低资产净值  |
|---------------|-----------------|-------------|------------|
| HP 每月派息 3 人民币 | 2025 年 3 月 31 日 | -           | -          |
|               | 2024 年 9 月 30 日 | 人民币 10.5399 | 人民币 9.0345 |
|               | 2023 年 9 月 30 日 | 人民币 9.9449  | 人民币 8.6092 |
|               | 2022 年 9 月 30 日 | 人民币 10.0156 | 人民币 8.7053 |
| Z 累计 港元       | 2025 年 3 月 31 日 | 港元 10.0119  | 港元 9.7129  |
| Z 累计 美元       | 2025 年 3 月 31 日 | 美元 10.0146  | 美元 9.7047  |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

业绩记录(未经审计)(续)

瑞士百达亚洲债券收益

每份额最高/最低资产净值(自成立日)

|             | 财务期间截止日         | 每份额最高资产净值    | 每份额最低资产净值   |
|-------------|-----------------|--------------|-------------|
| I 累计 美元     | 2025 年 3 月 31 日 | 美元 9.6666    | 美元 9.3703   |
|             | 2024 年 9 月 30 日 | 美元 9.5515    | 美元 8.2871   |
|             | 2023 年 9 月 30 日 | 美元 8.7522    | 美元 7.6791   |
|             | 2022 年 9 月 30 日 | 美元 9.8327    | 美元 8.1470   |
|             | 2021 年 9 月 30 日 | 美元 10.0801   | 美元 9.8146   |
| I 每月派息 美元   | 2025 年 3 月 31 日 | 美元 7.6312    | 美元 7.3355   |
|             | 2024 年 9 月 30 日 | 美元 7.6201    | 美元 7.0373   |
|             | 2023 年 9 月 30 日 | 美元 7.8287    | 美元 6.9806   |
|             | 2022 年 9 月 30 日 | 美元 9.5434    | 美元 7.4496   |
|             | 2021 年 9 月 30 日 | 美元 10.0801   | 美元 9.5258   |
| P 每月派息 港元   | 2025 年 3 月 31 日 | 港元 7.4997    | 港元 7.2142   |
|             | 2024 年 9 月 30 日 | 港元 7.5153    | 港元 7.0076   |
|             | 2023 年 9 月 30 日 | 港元 7.8341    | 港元 7.0051   |
|             | 2022 年 9 月 30 日 | 港元 9.5491    | 港元 7.4791   |
|             | 2021 年 9 月 30 日 | 港元 10.0745   | 港元 9.5297   |
| P 每月派息 美元   | 2025 年 3 月 31 日 | 美元 7.4762    | 美元 7.1719   |
|             | 2024 年 9 月 30 日 | 美元 7.4655    | 美元 6.9349   |
|             | 2023 年 9 月 30 日 | 美元 7.7488    | 美元 6.9145   |
|             | 2022 年 9 月 30 日 | 美元 9.5084    | 美元 7.3829   |
|             | 2021 年 9 月 30 日 | 美元 10.0746   | 美元 9.4916   |
| HI 累计 新加坡元  | 2025 年 3 月 31 日 | 新加坡元 9.3720  | 新加坡元 9.1022 |
|             | 2024 年 9 月 30 日 | 新加坡元 9.3259  | 新加坡元 8.2215 |
|             | 2023 年 9 月 30 日 | 新加坡元 8.7603  | 新加坡元 7.6957 |
|             | 2022 年 9 月 30 日 | 新加坡元 9.8408  | 新加坡元 8.1647 |
|             | 2021 年 9 月 30 日 | 新加坡元 10.0802 | 新加坡元 9.8222 |
| HP 每月派息 澳元  | 2025 年 3 月 31 日 | 澳元 7.0005    | 澳元 6.6781   |
|             | 2024 年 9 月 30 日 | 澳元 6.9955    | 澳元 6.6387   |
|             | 2023 年 9 月 30 日 | 澳元 7.5663    | 澳元 6.7717   |
|             | 2022 年 9 月 30 日 | 澳元 9.4629    | 澳元 7.2553   |
|             | 2021 年 9 月 30 日 | 澳元 10.0378   | 澳元 9.4456   |
| HP 每月派息 人民币 | 2025 年 3 月 31 日 | 人民币 7.1801   | 人民币 6.8200  |
|             | 2024 年 9 月 30 日 | 人民币 7.2390   | 人民币 6.8864  |
|             | 2023 年 9 月 30 日 | 人民币 7.8964   | 人民币 7.0198  |
|             | 2022 年 9 月 30 日 | 人民币 9.6514   | 人民币 7.5895  |
|             | 2021 年 9 月 30 日 | 人民币 10.1072  | 人民币 9.6329  |
| Z 累计 美元     | 2025 年 3 月 31 日 | 美元 10.2418   | 美元 9.9585   |

瑞士百达策略收益  
瑞士百达亚洲债券收益  
(百达香港之子基金)

欲知更多信息，  
请访问我们的网站：

[www.assetmanagement.pictet](http://www.assetmanagement.pictet)  
[www.pictet.com](http://www.pictet.com)