

沛富基金

二零二一年中期業績報告

二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日

目錄

| | 頁次 |
|----------------------------|----|
| 經理投資報告 | 2 |
| 簡明資產淨值報表（未經審核） | 5 |
| 簡明綜合收入報表（未經審核） | 6 |
| 基金單位持有人應佔資產淨值變動之簡明報表（未經審核） | 7 |
| 簡明現金流量表（未經審核） | 8 |
| 簡明財務報表附註（未經審核） | 10 |
| 投資組合（未經審核） | 22 |
| 組合持股量變動報表（未經審核） | 38 |
| 相關指數成份股披露 | 38 |
| 證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核） | 39 |
| 行政及管理層 | 68 |

經理投資報告

有關沛富基金

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

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

有關MARKIT IBOXX ABF泛亞洲指數

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

IHS Markit在二零二一年度全年亞洲指數回顧(2021 Asian Annual Index Review)中計算二零二一年iBoxx ABF指數中八個市場的比重，新比重於二零二一年十月三十一日起生效。相關指數過往及現有之市場比重為：

| 市場 | 現有比重* (%) | 過往比重 (%) |
|------|--------------|-------------|
| 中國 | 25.00 | 25.00 |
| 香港 | 8.15 | 8.31 |
| 印尼 | 8.24 | 7.89 |
| 馬來西亞 | 11.49 | 11.53 |
| 菲律賓 | 6.65 | 6.60 |
| 新加坡 | 15.76 | 15.68 |
| 南韓 | 15.18 | 15.32 |
| 泰國 | 9.53 | 9.67 |

* 資料來源：Markit、道富環球投資管理（截至二零二一年十二月三十一日）。

上表所示現有比重為截至二零二一年十二月三十一日的數字。詳情請瀏覽www.ihsmarkit.com。

沛富基金

二零二一年中期業績報告

經理投資報告 (續)

表現報告

| 截至31.12.2021止期間 | 三個月 | 六個月 | 一年 | 三年 | 五年 | 十年 | 自成立 年度化 ^(a) |
|--------------------------------------|-------|--------|--------|-------|-------|-------|---------------------------|
| 沛富基金 ^(b) | 0.80% | -0.44% | -3.67% | 4.21% | 4.38% | 2.37% | 4.19% |
| Markit iBoxx ABF泛亞洲指數 ^(c) | 0.86% | -0.34% | -3.34% | 4.76% | 4.88% | 2.88% | 4.79% |

附註：

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

投資組合及市場回顧

自成立以來，與4.79%之指數回報比較，基金年度化之總回報（包括股息）為4.19%（經扣除費用）。差額為-0.60%（約整後），其中-0.52%之金額主要是因為要達至指數基金之基準，無可避免地受到若干相關因素影響（相關因素指信託契約中允許之費用及開支及稅項）；其餘-0.08%是由於交易成本及管理基金所使用之抽樣方法所產生之追蹤差額。

按未對沖基準計算，Markit iBoxx ABF泛亞洲指數自成立以來之年度化表現為4.79%。有關表現乃受債券市場反彈（佔回報之3.49%）及亞洲貨幣之變動（佔回報之1.30%）所帶動。

投資組合策略

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

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

經理投資報告 (續)

基金增長

於二零二一年七月至十二月期間，基金之總資產淨值下跌至36.82億美元，跌幅為1.5%。以發行在外之基金單位計算，基金於六個月期間上漲0.03%，年末時仍然發行在外之基金單位數目為30,674,204個基金單位。於截至二零二一年十二月三十一日止期間內，基金單位認購扣除贖回（包括股息再投資）後之基金單位數目合共為8,200個基金單位。

金融衍生工具的風險

截至二零二一年十二月三十一日止期間，基金並無面臨任何金融衍生工具風險。

金融衍生工具的環球風險

金融衍生工具的環球風險乃採取承諾方法計量，為以下各項的總和：

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

其他資料

於截至二零二一年十二月三十一日止期間內，基金並無參與任何其他單位信託基金、互惠基金及集體投資計劃的買賣。於截至二零二一年十二月三十一日止期間內，基金亦無進行借貸。概無任何其他重大資料可對基金估值造成不利影響。

沛富基金

二零二一年中期業績報告

簡明資產淨值報表

於二零二一年十二月三十一日（未經審核）

| | 附註 | 於31.12.2021 美元 | 於30.06.2021 美元 | 於31.12.2020 美元 | 於30.06.2020 美元 |
|---------------------------------|------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| 資產 | | | | | |
| 流動資產 | | | | | |
| 投資 | 6(f) | 3,671,627,422 | 3,745,325,374 | 3,900,811,900 | 3,631,886,293 |
| 應收經紀賬款 | | 59,872,560 | 36,614,428 | 18,187,466 | 59,839,372 |
| 應收利息 | 6(e) | 18 | - | - | - |
| 其他應收款項 | | 324,286 | 118,973 | 26,058 | 22,809 |
| 銀行現金 | 6(e) | 14,815,464 | 29,247,055 | 14,332,505 | 8,828,282 |
| 總資產 | | <u>3,746,639,750</u> | <u>3,811,305,830</u> | <u>3,933,357,929</u> | <u>3,700,576,756</u> |
| 負債 | | | | | |
| 流動負債 | | | | | |
| 贖回單位應付款項 | | - | 32,939,703 | - | - |
| 應付經紀賬款 | | 57,193,040 | 30,596,646 | 28,479,564 | 58,639,086 |
| 應付審計費用 | | 22,415 | 62,630 | 26,774 | 65,163 |
| 應付信託人費用 | 6(d) | 156,000 | 155,835 | 164,171 | 158,657 |
| 應付管理費 | 6(c) | 697,631 | 1,036,114 | 1,390,588 | 675,608 |
| 應付指數特許權費 | | 123,129 | 208,472 | 122,889 | 208,473 |
| 其他應付款項 | | 6,719,238 | 7,104,935 | 7,067,481 | 6,649,248 |
| 負債（基金單位持有人 應佔資產淨值除外） | | <u>64,911,453</u> | <u>72,104,335</u> | <u>37,251,467</u> | <u>66,396,235</u> |
| 基金單位持有人應佔資產淨值 | 3 | <u>3,681,728,297</u> | <u>3,739,201,495</u> | <u>3,896,106,462</u> | <u>3,634,180,521</u> |
| 已發行基金單位數目 | 3 | <u>30,674,204</u> | <u>30,666,004</u> | <u>30,606,824</u> | <u>30,314,614</u> |
| 基金單位持有人每單位 應佔資產淨值 | 3 | <u>120.03</u> | <u>121.93</u> | <u>127.30</u> | <u>119.88</u> |

第10至21頁的附註構成本財務報表一部分。

簡明綜合收入報表

自二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間(未經審核)

| | 附註 | 01.07.2021至 31.12.2021 美元 | 01.07.2020至 31.12.2020 美元 |
|--|------|---------------------------------|---------------------------------|
| 收入 | | | |
| 銀行存款利息收入 | 6(e) | 2,540 | 6,665 |
| 投資淨(虧損)/收益 | 4 | (9,387,304) | 274,116,589 |
| 外匯虧損淨額 | | (340,828) | (214,090) |
| 證券借貸收入 | | 142,761 | 158,000 |
| 其他收入 | | 1,152 | 1,664 |
| | | <u> </u> | <u> </u> |
| 總投資(虧損)/收入 | | (9,581,679) | 274,068,828 |
| | | <u>-----</u> | <u>-----</u> |
| 開支 | | | |
| 管理費 | 6(c) | (2,066,704) | (2,224,329) |
| 信託人費用 | 6(d) | (927,938) | (944,886) |
| 指數特許權費 | | (176,438) | (176,438) |
| 出版及印刷開支 | 6(i) | (8,764) | (14,340) |
| 審計費 | | (38,975) | (36,450) |
| 處理代理人費用 | | (16,374) | (5,677) |
| 資產託管費及銀行手續費 | 6(i) | (1,429) | (685) |
| 交易手續費 | 6(i) | (10,030) | (5,275) |
| 法律及專業費用 | 6(i) | (76,164) | (147,696) |
| 其他經營開支 | 6(i) | (6,302) | (6,302) |
| | | <u> </u> | <u> </u> |
| 總經營開支 | | (3,329,118) | (3,562,078) |
| | | <u>-----</u> | <u>-----</u> |
| 經營(虧損)/溢利 | | (12,910,797) | 270,506,750 |
| | | <u>-----</u> | <u>-----</u> |
| 融資成本 | | | |
| 分派予基金單位持有人 | 8 | (41,601,425) | (37,336,175) |
| 利息開支 | 6(e) | (4,627) | (4,074) |
| | | <u> </u> | <u> </u> |
| | | (41,606,052) | (37,340,249) |
| 分派後及除稅前(虧損)/溢利 | | (54,516,849) | 233,166,501 |
| 稅項 | 5 | (3,544,124) | (5,927,086) |
| | | <u> </u> | <u> </u> |
| 分派及除稅後(虧損)/溢利/基金單位 持有人應佔來自營運的資產淨值增加 | | (58,060,973) | 227,239,415 |
| | | <u>-----</u> | <u>-----</u> |

第10至21頁的附註構成本財務報表一部分。

沛富基金

二零二一年中期業績報告

基金單位持有人應佔資產淨值變動之簡明報表

自二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間 (未經審核)

| | 01.07.2021至 31.12.2021 美元 | 01.07.2020至 31.12.2020 美元 |
|--------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| 期初結餘 | <u>3,739,201,495</u> | <u>3,634,180,521</u> |
| 發行基金單位 | 43,047,816 | 55,957,743 |
| 贖回基金單位 | <u>(42,460,041)</u> | <u>(21,271,217)</u> |
| 發行基金單位淨額 | 587,775 | 34,686,526 |
| 基金單位持有人應佔的資產淨值 (減少) / 增加 | <u>(58,060,973)</u> | <u>227,239,415</u> |
| 期終結餘 | <u><u>3,681,728,297</u></u> | <u><u>3,896,106,462</u></u> |

已發行基金單位數目

| | 01.07.2021至 31.12.2021 基金單位 | 01.07.2020至 31.12.2020 基金單位 |
|------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 期初已發行的基金單位 | 30,666,004 | 30,314,614 |
| 發行基金單位 | 358,200 | 462,210 |
| 贖回基金單位 | <u>(350,000)</u> | <u>(170,000)</u> |
| 期終已發行的基金單位 | <u><u>30,674,204</u></u> | <u><u>30,606,824</u></u> |

第10至21頁的附註構成本財務報表一部分。

簡明現金流量表

自二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間（未經審核）

| | 01.07.2021至 31.12.2021 美元 | 01.07.2020至 31.12.2020 美元 |
|-------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| 營運活動的現金流 | | |
| 基金單位持有人應佔的資產淨值（減少）／增加 經調整： | (58,060,973) | 227,239,415 |
| 銀行存款利息收入 | (2,540) | (6,665) |
| 利息開支 | 4,627 | 4,074 |
| 分派予基金單位持有人 | 41,601,425 | 37,336,175 |
| 稅項 | 3,544,124 | 5,927,086 |
| 外匯重估虧損／（收益） | 254,722 | (275,168) |
| 營運資金變動前的經營（虧損）／溢利 | (12,658,615) | 270,224,917 |
| 投資的淨減少／（增加）額 | 73,697,952 | (268,925,607) |
| 應收經紀賬款的淨（增加）／減少額 | (23,258,132) | 41,651,906 |
| 其他應收款項淨增加額 | (205,313) | (3,249) |
| 應付經紀賬款的淨增加／（減少）額 | 26,596,394 | (30,159,522) |
| 應付賬款及應計開支的淨（減少）／增加額 | (486,150) | 473,790 |
| 營運所產生現金 | 63,686,136 | 13,262,235 |
| 已收銀行存款利息收入 | 2,522 | 6,665 |
| 已付稅項 | (3,907,547) | (5,386,122) |
| 營運活動所產生淨現金 | 59,781,111 | 7,882,778 |
| 融資活動的現金流 | | |
| 分派予基金單位持有人 | (41,601,425) | (37,336,175) |
| 已付利息開支 | (4,627) | (4,074) |
| 發行基金單位 | 43,047,816 | 55,957,743 |
| 贖回基金單位 | (75,399,744) | (21,271,217) |
| 融資活動所用的淨現金 | (73,957,980) | (2,653,723) |
| 現金及現金等價物的淨（減少）／增加額 | (14,176,869) | 5,229,055 |
| 貨幣匯兌的影響 | (254,722) | 275,168 |
| 期初現金及現金等價物 | 29,247,055 | 8,828,282 |
| 期終現金及現金等價物 | 14,815,464 | 14,332,505 |
| 現金及現金等價物的結餘分析： | | |
| 銀行現金 | 14,815,464 | 14,332,505 |

第10至21頁的附註構成本財務報表一部分。

沛富基金

二零二一年中期業績報告

簡明現金流量表 (續)

自二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間 (未經審核)

融資活動所產生負債之對賬

| | 01.07.2021至 31.12.2021 美元 | 01.07.2020至 31.12.2020 美元 |
|----------|---------------------------------|---------------------------------|
| 於七月一日 | 32,939,703 | - |
| 融資現金流的變動 | | |
| 已付贖回基金 | (75,399,744) | (21,271,217) |
| 其他變動 | | |
| 贖回基金單位 | 42,460,041 | 21,271,217 |
| 於十二月三十一日 | - | - |

第10至21頁的附註構成本財務報表一部分。

簡明財務報表附註

自二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間（未經審核）

1. 一般資料

沛富基金（「基金」）乃根據新加坡法例第289章《證券及期貨法》第286條以及香港法例第571章《證券及期貨條例》第104條獲認可的新加坡單位信託。基金按照道富環球投資管理新加坡有限公司與滙豐機構信託服務（新加坡）有限公司於二零零五年六月二十一日訂立的信託契約（「信託契約」）而成立。信託契約根據於二零零六年六月二十八日訂立的修訂及重列契約、於二零零七年六月二十八日訂立的第二修訂及重列契約、於二零零八年六月二十七日訂立的補充契約、於二零一一年六月二十四日訂立的第三修訂及重列契約、於二零一八年七月十日訂立的第四修訂及重列契約、於二零一九年十二月二十七日訂立的第五修訂及重列契約及於二零二零年八月十七日訂立的第六修訂及重列契約而作出修訂及重列。信託契約及所有補充契約受新加坡法律管轄。基金同時於香港聯合交易所有限公司及東京證券交易所上市。基金於二零零五年六月二十九日開始運作。

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

2. 編製基準及會計政策

本未經審核簡明中期財務報表（「中期財務報表」）已根據國際會計準則（「國際會計準則」）第34號「中期財務報告」編製。本中期財務報表已按歷史成本慣例法編製，並已就投資重估作出修訂。編製本中期財務報表所用之會計政策及計算方法與截至二零二一年六月三十日止年度之年報財務報表所用者一致。

列報及比較資料的變動

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

沛富基金

二零二一年中期業績報告

簡明財務報表附註(續)

自二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間(未經審核)

3 基金單位持有人應佔資產淨值及已發行基金單位數目

已發行基金單位數目

| | 01.07.2021至 31.12.2021 基金單位 | 01.01.2021至 30.06.2021 基金單位 | 01.07.2020至 31.12.2020 基金單位 |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 期初已發行的基金單位 | 30,666,004 | 30,606,824 | 30,314,614 |
| 發行基金單位 | 358,200 | 379,180 | 462,210 |
| 贖回基金單位 | <u>(350,000)</u> | <u>(320,000)</u> | <u>(170,000)</u> |
| 期終已發行的基金單位 | <u>30,674,204</u> | <u>30,666,004</u> | <u>30,606,824</u> |
| | 美元 | 美元 | 美元 |
| 基金單位持有人應佔資產淨值 | <u>3,681,728,297</u> | <u>3,739,201,495</u> | <u>3,896,106,462</u> |
| 基金單位持有人應佔資產淨值 (每單位) | <u>120.03</u> | <u>121.93</u> | <u>127.30</u> |
| 各新增基金單位的資產淨值 (1個新增基金單位相等於 10,000個單位) | <u>1,200,269</u> | <u>1,219,331</u> | <u>1,272,954</u> |

簡明財務報表附註 (續)

自二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間 (未經審核)

4. 投資淨 (虧損) / 收益

| | 01.07.2021至 31.12.2021 美元 | 01.07.2020至 31.12.2020 美元 |
|------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| 投資未變現價值收益 / 虧損變動 | (63,838,686) | 218,253,235 |
| 出售投資時實現的收益 | <u>54,451,382</u> | <u>55,863,354</u> |
| | <u>(9,387,304)</u> | <u>274,116,589</u> |

5. 稅項

基金於截至二零二一年十二月三十一日止期間產生的稅項為3,544,124美元 (截至二零二零年十二月三十一日止六個月: 5,927,086美元)。該金額包括來自中國、菲律賓及印尼的預扣稅合共3,493,684美元, 以及有關繳付新加坡企業所得稅及其他稅項的餘下部分50,440美元。

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

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

簡明財務報表附註 (續)

自二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間 (未經審核)

5. 稅項 (續)

於二零二一年十二月三十一日，基金就截至二零一八年十一月六日中國非官方債券利息收入作出10%的預扣所得稅撥備4,280,025美元 (相等於人民幣27,285,160元) (於二零二一年六月三十日：4,227,636美元，相等於人民幣27,285,160元)。撥備變動是由於換算產生的匯兌差額所致。該金額於資產淨值報表入賬為「其他應付款項」。此外，根據第36號通知，來自政府債券及地方政府債券的所收利息獲豁免繳納增值稅。根據108號文，境外機構投資者暫時獲豁免就二零一八年十一月七日至二零二一年十一月六日期間收取的中國非官方債券利息收入繳付增值稅，而根據34號文，上述暫時豁免已延長至二零二五年十二月三十一日。然而，現行增值稅規例並無指定豁免境外機構投資者於二零一六年五月一日至二零一八年十一月六日期間的所收利息。因此，於二零一六年五月一日至二零一八年十一月六日期間從非官方債券 (包括企業債券) 賺取的利息收入仍應繳納6%增值稅。

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

根據日期為二零二零年二月二十八日的致基金單位持有人函件，經理人已考慮到信託的現行中國稅務撥備政策，並已向獨立及專業稅務顧問諮詢。於二零二一年十二月三十一日，就二零一六年五月一日至二零一八年十一月六日期間信託於中國非官方債券的投資所收取的債券利息收入作出的增值稅撥備為1,152,783美元 (相等於人民幣7,348,992元) (於二零二一年六月三十日：1,138,672美元，相等於人民幣7,348,992元)。撥備變動是由於換算產生的匯兌差額所致。該金額計入資產淨值報表內的「其他應付款項」。

簡明財務報表附註 (續)

自二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間 (未經審核)

6. 與關連方 (包括經理人、信託人及其關連人士) 進行的交易及結餘

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

(a) 與經理人及信託人的關連人士進行的外匯交易

於截至二零二一年十二月三十一日止期間內，經理人透過其聯屬人士State Street Global Markets, LLC及透過信託人的聯屬人士香港上海滙豐銀行有限公司及香港上海滙豐銀行有限公司悉尼分行作基金投資結算，於外匯交易中進行的交易總值為296,844,416美元 (二零二零年十二月三十一日止六個月：294,013,011美元)，佔截至二零二一年十二月三十一日止期間內基金外匯交易價值的100% (二零二零年十二月三十一日止六個月：100%)。

| 公司名稱 | 外匯交易總值 美元 | 佔外匯交易 總值百分比 % |
|----------------------------------|--------------|---------------------|
| 截至31.12.2021止期間 | | |
| State Street Global Markets, LLC | 18,650,000 | 6.28 |
| 香港上海滙豐銀行有限公司 | 66,350,000 | 22.35 |
| 香港上海滙豐銀行有限公司悉尼分行 | 211,844,416 | 71.37 |
| 截至31.12.2020止期間 | | |
| State Street Global Markets, LLC | 36,383,104 | 12.37 |
| 香港上海滙豐銀行有限公司 | 44,300,000 | 15.07 |
| 香港上海滙豐銀行有限公司悉尼分行 | 213,329,907 | 72.56 |

沛富基金

二零二一年中期業績報告

簡明財務報表附註 (續)

自二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間 (未經審核)

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

(a) 與經理人及信託人的關連人士進行的外匯交易 (續)

於截至二零二一年及二零二零年十二月三十一日止期間內，上述所列經理人及信託人的關連人士已按正常商業條款在日常業務過程中與基金訂立外匯交易正常買賣差價。於截至二零二一年及二零二零年十二月三十一日止期間內，並無向經理人或信託人的關連人士支付任何直接佣金。

(b) 持有單位

於二零二一年十二月三十一日，經理人的董事及高級職員並無持有基金的任何基金單位 (二零二零年：無)。香港上海滙豐銀行有限公司 (信託人的關連方) 作為代表其客戶的代名人持有 28,943,158 個基金單位 (二零二一年六月三十日：28,593,095 個基金單位)，佔基金資產淨值的 94.35% (二零二零年：93.24%)。HSBC Broking Securities (Honk Kong) Ltd (信託人的關連方) 作為代表其客戶的代名人持有 15,093 個基金單位 (二零二一年六月三十日：無)，佔基金資產淨值的 0.04% (二零二一年六月三十日：無)。

(c) 管理費

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

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

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

(d) 信託人費用

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

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

簡明財務報表附註 (續)

自二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間 (未經審核)

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

(e) 銀行結餘及應收利息

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

| | 於 31.12.2021 美元 | 於 30.06.2021 美元 |
|------|-----------------------|-----------------------|
| 銀行結餘 | 14,815,464 | 29,247,055 |
| 應收利息 | <u>18</u> | <u>-</u> |

於截至二零二一年及二零二零年十二月三十一日止期間內，以下於綜合收入報表呈列有關基金銀行結餘的收入及開支乃自信託人的關連方 (即香港上海滙豐銀行有限公司) 賺取／收取／向其支付。

| | 截至31.12.2021 止期間 美元 | 截至31.12.2020 止期間 美元 |
|------|---------------------------|---------------------------|
| 利息收入 | 2,540 | 6,665 |
| 利息開支 | <u>4,627</u> | <u>4,074</u> |

(f) 投資

於截至二零二一年十二月三十一日及二零二一年六月三十日止期間／年度內，基金的投資在信託人的關連方 (即滙豐機構信託服務 (亞洲) 有限公司)。該等投資詳情如下：

| | 於 31.12.2021 美元 | 於 30.06.2021 美元 |
|----|-----------------------|-----------------------|
| 投資 | <u>3,671,627,422</u> | <u>3,745,325,374</u> |

簡明財務報表附註 (續)

自二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間 (未經審核)

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

(g) 證券借貸安排

截至二零二一年及二零二零年十二月三十一日止期間，基金與信託人的關連方 (即HSBC Bank Plc) (作為證券借貸代理) 訂立證券借貸安排。該等交易詳情載列如下：

| | 截至31.12.2021 止期間 美元 | 截至31.12.2020 止期間 美元 |
|-------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 通過HSBC Bank Plc的總證券借貸交易 | 73,658,640 | 203,856,047 |

於期末／年末持有的抵押品詳情載列如下：

| | 於 31.12.2021 美元 | 於 30.06.2021 美元 |
|--------------------------|-----------------------|-----------------------|
| HSBC Bank Plc在獨立賬戶持有的抵押品 | 74,521,380 | 110,211,589 |

簡明財務報表附註 (續)

自二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間 (未經審核)

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

(h) 與經理人及信託人的關連人士進行的債券交易

- (i) 於截至二零二一年及二零二零年十二月三十一日止期間，基金透過信託人的聯屬人士 (作為買方或賣方) 進行的債券交易如下：

| 公司名稱 | 購買交易總值 美元 | 出售交易總值 美元 |
|-----------------|--------------|--------------|
| 截至31.12.2021止期間 | | |
| 滙豐銀行(中國)有限公司 | - | 1,909,380 |
| 滙豐銀行(新加坡)有限公司 | 11,100,011 | - |
| 截至31.12.2020止期間 | | |
| 滙豐銀行(中國)有限公司 | 32,453,018 | 18,378,054 |
| 香港上海滙豐銀行有限公司 | 20,652,317 | - |
| 滙豐銀行(新加坡)有限公司 | 32,503,961 | 6,313,936 |

沛富基金

二零二一年中期業績報告

簡明財務報表附註 (續)

自二零二一年七月一日起至二零二一年十二月三十一日止期間 (未經審核)

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

(h) 與經理人及信託人的關連人士進行的債券交易 (續)

- (ii) 於截至二零二一年及二零二零年十二月三十一日止期間，基金透過信託人的聯屬人士 (作為交付或接收代理) 進行的債券交易如下：

| 公司名稱 | 交易總值 | 交易總值 |
|---------------------------|------------|------------|
| | 31.12.2021 | 31.12.2020 |
| | 美元 | 美元 |
| 滙豐銀行 (中國) 有限公司 | 1,909,380 | 57,689,354 |
| HSBC Bank Malaysia Berhad | 16,650,920 | 6,361,025 |
| PT Bank HSBC Indonesia | 13,097,153 | 16,437,620 |
| 香港上海滙豐銀行有限公司 | 9,640,298 | 20,652,317 |
| 香港上海滙豐銀行有限公司曼谷分行 | 43,759,850 | 13,361,721 |
| 香港上海滙豐銀行有限公司首爾分行 | 9,208,313 | 7,068,339 |
| 滙豐銀行 (新加坡) 有限公司 | 50,209,240 | 8,579,407 |
| 香港上海滙豐銀行有限公司菲律賓分行 | 20,869,304 | 9,279,302 |

(i) 向信託人或經理人及其關連人士支付的其他相關款項

- (ii) 於截至二零二一年及二零二零年十二月三十一日止期間，除向信託人或其關連人士支付的信託人費用外，向信託人或其關連人士支付的其他相關款項如下：

| | 01.07.2021至 31.12.2021 | 01.07.2020至 31.12.2020 |
|-------------|---------------------------|---------------------------|
| | 美元 | 美元 |
| 出版及印刷開支 | 52 | 61 |
| 資產託管費及銀行手續費 | 395 | 334 |
| 交易手續費* | 10,030 | 5,275 |
| 法律及專業費用 | 500 | - |
| 其他經營開支 | 6,302 | 6,302 |

* 交易手續費於購買或出售投資時收取。

- (ii) 於截至二零二一年及二零二零年十二月三十一日止期間，除向經理人支付的管理費外，概無向經理人或其關連人士支付其他相關款項。

簡明財務報表附註 (續)

自二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間 (未經審核)

7. 非金錢利益安排

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

於截至二零二一年十二月三十一日及二零二零年十二月三十一日止期間，經理人並無就基金戶口的有關交易收取任何非金錢利益。

8 分派

| | 01.07.2021至 31.12.2021 美元 | 01.07.2020至 31.12.2020 美元 |
|--|---------------------------------|---------------------------------|
| 期終分派 | | |
| — 於二零二一年八月三日已就30,366,004個基金 單位支付每基金單位1.37美元 | 41,601,425 | — |
| — 於二零二零年八月三日已就30,354,614個基金 單位支付每基金單位1.23美元 | — | 37,336,175 |
| | <u>41,601,425</u> | <u>37,336,175</u> |

沛富基金

二零二一年中期業績報告

簡明財務報表附註 (續)

自二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間 (未經審核)

9. 補充比率

| | 01.01.2021至 31.12.2021止期間 | 01.01.2020至 31.12.2020止期間 |
|----------------------|------------------------------|------------------------------|
| 支出比率 ⁽¹⁾ | 0.18% | 0.19% |
| 營業額比率 ⁽²⁾ | 10.62% | 6.54% |

附註：

- 1 支出比率是按新加坡投資管理協會 (「新加坡投資管理協會」) 釐定的指引計算。期末的支出比率基於二零二一年一月一日至二零二一年十二月三十一日止期間的經營開支總額6,706,558美元 (二零二零年一月一日至二零二零年十二月三十一日止期間：7,103,435美元) 除以二零二一年一月一日至二零二一年十二月三十一日止期間的平均資產淨值3,741,620,645美元 (二零二零年一月一日至二零二零年十二月三十一日止期間：3,682,190,787美元) 計算。經營開支總額不包括 (如適用) 經紀佣金及其他交易成本、業績表現費、利息支出、向單位持有人作出之分派、外匯收益／虧損、購買或銷售其他基金所產生的首次認購費及贖回費、於源頭已扣除的稅項或因所得收入而產生的稅項。基金並無支付任何業績表現費。平均資產淨值乃根據每日結餘而得出。
- 2 組合營業額比率乃根據集體投資計劃守則所載列的公式計算。組合營業額比率按購買或銷售總額較低者，即相關投資的購買額391,185,526美元 (二零二零年：銷售額245,291,628美元) 除以每日平均資產淨值3,681,839,668美元 (二零二零年：3,748,777,070美元) 計算。為符合新加坡註冊會計師協會頒佈的建議會計實務準則第七號「單位信託基金的匯報框架」(「建議會計實務準則第七號」) 的建議，本期間的購買或銷售總額並不包括經紀佣金及其他交易成本。

10. 資產淨值報表日期後續事項

本期間結束後，於二零二二年一月十四日，基金宣佈每個基金單位派息1.48美元。有關股息已於二零二二年二月八日派付。於二零二一年十二月三十一日，基金單位持有人應佔資產淨值並無計入上述應付股息。

投資組合

於二零二一年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分

| 已上市債券 | 於31.12.2021 的持有量 | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|--|---------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| 中國(25.09%) | | | |
| AGRICUL 4.39% 08SEP2027 (INTERBANK) | 70,000,000 | 11,955,248 | 0.32 |
| AGRICUL DEV BANK 3.83% 06JAN2024 | 70,000,000 | 11,662,663 | 0.32 |
| AGRICUL DEV BANK CHINA 3.75% 25JAN2029 (INTERBANK) | 140,000,000 | 23,658,707 | 0.64 |
| CHINA (GOVT OF) 1.99% 09APR2025 (INTERBANK) | 25,000,000 | 3,918,279 | 0.11 |
| CHINA (GOVT OF) 2.56% 21OCT2023 (INTERBANK) | 40,000,000 | 6,330,313 | 0.17 |
| CHINA (GOVT OF) 2.57% 20MAY2023 (INTERBANK) | 8,000,000 | 1,279,401 | 0.03 |
| CHINA (GOVT OF) 2.68% 21MAY2030 (INTERBANK) | 100,000,000 | 15,638,163 | 0.42 |
| CHINA (GOVT OF) 2.75% 01SEP2023 (INTERBANK) | 80,000,000 | 12,747,880 | 0.35 |
| CHINA (GOVT OF) 2.77% 24JUN2030 (INTERBANK) | 100,000,000 | 15,585,870 | 0.42 |
| CHINA (GOVT OF) 2.84% 08APR2024 (INTERBANK) | 50,000,000 | 8,081,272 | 0.22 |
| CHINA (GOVT OF) 2.89% 18NOV2031 (INTERBANK) | 110,000,000 | 17,494,332 | 0.48 |
| CHINA (GOVT OF) 2.95% 16JUN23 (INTERBANK) | 215,000,000 | 34,571,496 | 0.94 |
| CHINA (GOVT OF) 3.02% 27MAY2031 (INTERBANK) | 185,000,000 | 29,718,743 | 0.81 |
| CHINA (GOVT OF) 3.12% 05DEC2026 (INTERBANK) | 135,000,000 | 21,730,869 | 0.59 |
| CHINA (GOVT OF) 3.13% 21NOV2029 (INTERBANK) | 190,000,000 | 30,545,885 | 0.83 |
| CHINA (GOVT OF) 3.19% 11APR2024 (INTERBANK) | 400,000,000 | 65,274,219 | 1.77 |
| CHINA (GOVT OF) 3.25% 06JUN2026 (INTERBANK) | 50,000,000 | 8,209,252 | 0.22 |
| CHINA (GOVT OF) 3.27% 19NOV2030 (INTERBANK) | 70,000,000 | 11,463,590 | 0.31 |
| CHINA (GOVT OF) 3.28% 03DEC2027 (INTERBANK) | 36,000,000 | 5,833,365 | 0.16 |
| CHINA (GOVT OF) 3.29% 23MAY2029 (INTERBANK) | 70,000,000 | 11,395,811 | 0.31 |
| CHINA (GOVT OF) 3.39% 16MAR2050 (INTERBANK) | 50,000,000 | 7,904,163 | 0.21 |
| CHINA (GOVT OF) 3.4% 17APR2023 | 65,663,000 | 10,517,480 | 0.29 |
| CHINA (GOVT OF) 3.51% 16JUL2025 (INTERBANK) | 20,000,000 | 3,293,566 | 0.09 |
| CHINA (GOVT OF) 3.52% 25APR2046 (INTERBANK) | 60,000,000 | 9,737,017 | 0.26 |
| CHINA (GOVT OF) 3.53% 18OCT2051 (INTERBANK) | 30,000,000 | 4,926,890 | 0.13 |
| CHINA (GOVT OF) 3.54% 16AUG2028 (INTERBANK) | 90,000,000 | 15,134,303 | 0.41 |
| CHINA (GOVT OF) 3.64% 09APR25 (INTERBANK) | 100,000,000 | 16,381,282 | 0.45 |
| CHINA (GOVT OF) 3.7% 23MAY2066 (INTERBANK) | 20,000,000 | 3,384,765 | 0.09 |
| CHINA (GOVT OF) 3.72% 12APR2051 (INTERBANK) | 130,000,000 | 21,714,680 | 0.59 |
| CHINA (GOVT OF) 3.77% 20FEB2047 (INTERBANK) | 55,000,000 | 9,323,654 | 0.25 |
| CHINA (GOVT OF) 3.82% 02SEP2030 | 20,000,000 | 3,432,036 | 0.09 |
| CHINA (GOVT OF) 3.86% 22JUL2049 (INTERBANK) | 90,000,000 | 15,525,031 | 0.42 |
| CHINA (GOVT OF) 3.91% 23OCT2038 | 20,000,000 | 3,483,394 | 0.09 |
| CHINA (GOVT OF) 3.96% 29JUL2040 | 30,000,000 | 5,323,059 | 0.14 |
| CHINA (GOVT OF) 4% 19JUN2024 | 60,000,000 | 9,778,353 | 0.27 |
| CHINA (GOVT OF) 4% 24JUN2069 (INTERBANK) | 90,000,000 | 16,217,188 | 0.44 |

沛富基金

二零二一年中期業績報告

投資組合 (續)

於二零二一年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

| 已上市債券 (續) | 於31.12.2021 的持有量 | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|--|---------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| 中國(25.09%) (續) | | | |
| CHINA (GOVT OF) 4% 27AUG2029 | 30,000,000 | 5,167,273 | 0.14 |
| CHINA (GOVT OF) 4.08% 01MAR2040 | 15,000,000 | 2,690,635 | 0.07 |
| CHINA (GOVT OF) 4.23% 09DEC2040 | 30,000,000 | 5,441,027 | 0.15 |
| CHINA (GOVT OF) 4.31% 24FEB2041 | 20,000,000 | 3,705,096 | 0.10 |
| CHINA (GOVT OF) 4.35% 15NOV2062 | 40,000,000 | 7,663,550 | 0.21 |
| CHINA (GOVT OF) 4.5% 08MAY2038 | 20,000,000 | 3,712,401 | 0.10 |
| CHINA (GOVT OF) 4.5% 23JUN2041 (INTERBANK) | 20,000,000 | 3,751,439 | 0.10 |
| CHINA (GOVT) 3.81% 14SEP2050 (INTERBANK) | 80,000,000 | 13,613,673 | 0.37 |
| CHINA (REP OF) 2.9% 5MAY2026 (INTERBANK) | 80,000,000 | 12,778,737 | 0.35 |
| CHINA DEVELOPMENT BANK 3.18% 05APR2026 | 180,000,000 | 29,304,294 | 0.80 |
| CHINA DEVELOPMENT BANK 3.48% 08JAN2029 (INTERBANK) | 200,000,000 | 33,294,513 | 0.90 |
| CHINA DEVELOPMENT BANK 3.65% 21MAY2029 (INTERBANK) | 100,000,000 | 16,608,784 | 0.45 |
| CHINA DEVELOPMENT BANK 3.66% 01MAR2031 | 70,000,000 | 11,774,203 | 0.32 |
| CHINA DEVELOPMENT BANK 3.74% 10SEP2025 | 80,000,000 | 13,116,218 | 0.36 |
| CHINA DEVELOPMENT BANK 3.8% 30OCT2036 | 10,000,000 | 1,662,975 | 0.05 |
| CHINA DEVELOPMENT BANK 4.04% 06JUL2028 (INTERBANK) | 70,000,000 | 11,873,456 | 0.32 |
| CHINA DEVELOPMENT BANK 4.04% 10APR2027 (INTERBANK) | 30,000,000 | 5,107,775 | 0.14 |
| CHINA DEVELOPMENT BANK 4.1% 30AUG2025 | 28,000,000 | 4,661,215 | 0.13 |
| CHINA DEVELOPMENT BANK 4.3% 17MAR2030 | 30,000,000 | 5,165,888 | 0.14 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.75% 17MAR2023 | 52,000,000 | 8,380,231 | 0.23 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.85% 28JAN2026 | 70,000,000 | 11,241,236 | 0.31 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.9% 24MAY2032 | 20,000,000 | 3,175,254 | 0.09 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.02% 22OCT2025 (INTERBANK) | 100,000,000 | 16,053,715 | 0.44 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.25% 22NOV2028 (INTERBANK) | 165,000,000 | 26,801,529 | 0.73 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.7% 26JUN2026 | 10,000,000 | 1,644,013 | 0.04 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.86% 19FEB2029 | 20,000,000 | 3,400,024 | 0.09 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.96% 15APR2030 | 20,000,000 | 3,440,076 | 0.09 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 4.03% 21JUN2040 | 20,000,000 | 3,529,597 | 0.10 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 4.12% 02AUG2042 | 20,000,000 | 3,640,021 | 0.10 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 4.16% 28FEB2023 | 6,000,000 | 974,673 | 0.03 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 4.22% 19MAR2048 | 50,000,000 | 9,072,884 | 0.25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 4.25% 17MAY2062 | 20,000,000 | 3,757,871 | 0.10 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 4.27% 17MAY2037 | 10,000,000 | 1,799,968 | 0.05 |

投資組合 (續)

於二零二一年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

| 已上市債券 (續) | 於31.12.2021 的持有量 | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|--|---------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| 中國(25.09%) (續) | | | |
| CHINA GOVERNMENT BOND 4.3% 30NOV2059 | 20,000,000 | 3,776,157 | 0.10 |
| CHINA GOVT 2.85% 04JUN2027 (INTERBANK) | 80,000,000 | 12,877,777 | 0.35 |
| CHINA GOVT 2.99% 15OCT2025 (INTERBANK) | 100,000,000 | 16,047,510 | 0.44 |
| CHINA GOVT 3.27% 22AUG2046 (INTERBANK) | 90,000,000 | 14,070,735 | 0.38 |
| CHINA GOVT BOND 2.74% 04AUG2026 (INTERBANK) | 50,000,000 | 7,985,621 | 0.22 |
| CHINA GOVT BOND 3.69% 21SEP2024 (INTERBANK) | 50,000,000 | 8,177,640 | 0.22 |
| CHINA GOVT BOND 3.77% 18DEC2024 (INTERBANK) | 60,000,000 | 9,774,071 | 0.27 |
| CHINA GOVT BOND 4.05% 24JUL2047 (INTERBANK) | 30,000,000 | 5,328,806 | 0.14 |
| EXPORT-IMPORT 3.33% 22FEB2026 (INTERBANK) | 20,000,000 | 3,288,050 | 0.09 |
| EXPORT-IMPORT BANK CHINA 3.28% 11FEB2024 (INTERBANK) | 100,000,000 | 16,371,268 | 0.44 |
| EXPORT-IMPORT BANK CHINA 3.86% 20MAY2029 (INTERBANK) | 100,000,000 | 16,864,320 | 0.46 |
| EXPORT-IMPORT BANK CHINA 4.89% 26MAR2028 (INTERBANK) | 100,000,000 | 17,939,236 | 0.49 |
| | | 923,677,654 | 25.09 |
| 香港(7.74%) | | | |
| CORP ANDINA DE 3.265% 24MAR2027 | 8,000,000 | 1,100,177 | 0.03 |
| HK GOVERNMENT BOND 1.09% 05JUN2023 | 76,000,000 | 9,846,591 | 0.27 |
| HK GOVERNMENT BOND 2.39% 20AUG2025 | 55,000,000 | 7,478,594 | 0.20 |
| HK SCIENCE & TECH PARKS 3.2% 11JUL2024 | 21,000,000 | 2,860,203 | 0.08 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.14% 24MAY2023 | 18,000,000 | 2,300,294 | 0.06 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.15% 23AUG2023 | 10,000,000 | 1,303,844 | 0.04 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.16% 22FEB2023 | 60,000,000 | 7,686,511 | 0.21 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.33% 23MAY2022 | 30,000,000 | 3,847,596 | 0.10 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.36% 15APR2024 | 12,000,000 | 1,527,132 | 0.04 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.51% 23OCT2023 | 20,000,000 | 2,563,753 | 0.07 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.55% 05DEC2022 | 25,000,000 | 3,216,741 | 0.09 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.8% 27AUG2027 | 54,000,000 | 6,811,944 | 0.18 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.97% 20JUN2022 | 70,000,000 | 9,009,840 | 0.24 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.1% 17JAN2023 | 170,000,000 | 22,096,961 | 0.60 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.16% 18MAY2022 | 280,000,000 | 36,070,227 | 0.98 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.49% 22FEB2028 | 7,000,000 | 918,222 | 0.02 |

沛富基金

二零二一年中期業績報告

投資組合 (續)

於二零二一年十二月三十一日 (未經審核)

基本 - 按地理位置劃分 (續)

| 已上市債券 (續) | 於31.12.2021 的持有量 | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|--|---------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| 香港(7.74%) (續) | | | |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.51% 24FEB2027 | 55,000,000 | 7,232,577 | 0.20 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.59% 04MAR2036 | 20,000,000 | 2,583,355 | 0.07 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.68% 21JAN2026 | 85,000,000 | 11,251,915 | 0.31 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.73% 20FEB2024 | 54,000,000 | 7,122,007 | 0.19 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.84% 09DEC2024 | 47,000,000 | 6,204,510 | 0.17 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.89% 02MAR2032 | 100,000,000 | 13,381,341 | 0.36 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.96% 03JUN2024 | 70,500,000 | 9,317,131 | 0.25 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.97% 17JAN2029 | 160,000,000 | 21,675,089 | 0.59 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.02% 07MAR2034 | 120,000,000 | 16,315,586 | 0.44 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.13% 16JUL2030 | 147,000,000 | 20,181,901 | 0.55 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.22% 07AUG2024 | 55,000,000 | 7,371,581 | 0.20 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.6% 20AUG2024 | 55,000,000 | 7,450,861 | 0.20 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.71% 20FEB2023 | 51,000,000 | 6,782,264 | 0.18 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.95% 24FEB2025 | 55,000,000 | 7,575,188 | 0.21 |
| HONG KONG (GOVT OF) 3.32% 25FEB2026 | 56,000,000 | 7,941,136 | 0.22 |
| HONG KONG (GOVT OF) 4.65% 29AUG2022 | 54,000,000 | 7,227,754 | 0.20 |
| HONG KONG GOVERNMENT 1.94% 04DEC2023 | 52,000,000 | 6,846,531 | 0.19 |
| | | 285,099,357 | 7.74 |
| 印尼(8.23%) | | | |
| INDONESIA (GOVT OF) 8.75% 15MAY2031 | 73,000,000,000 | 5,959,366 | 0.16 |
| INDONESIA (REP OF) 10% 15FEB2028 FR47 | 69,000,000,000 | 6,053,269 | 0.16 |
| INDONESIA (REP OF) 10.5% 15AUG2030 FR52 | 112,000,000,000 | 10,339,302 | 0.28 |
| INDONESIA (REP OF) 10.5% 15JUL2038 FR50 | 62,000,000,000 | 5,956,309 | 0.16 |
| INDONESIA (REP OF) 11% 15SEP2025 FR40 | 76,000,000,000 | 6,591,203 | 0.18 |
| INDONESIA (REP OF) 11.75% 15AUG23 FR39 | 20,000,000,000 | 1,640,341 | 0.05 |
| INDONESIA (REP OF) 12% 15SEP2026 FR37 | 14,000,000,000 | 1,286,692 | 0.04 |
| INDONESIA (REP OF) 5.125% 15APR2027 FR90 | 37,000,000,000 | 2,644,372 | 0.07 |
| INDONESIA (REP OF) 5.5% 15APR2026 | 92,000,000,000 | 6,617,169 | 0.18 |
| INDONESIA (REP OF) 6.25% 15JUN2036 FR88 | 10,000,000,000 | 701,637 | 0.02 |
| INDONESIA (REP OF) 6.375% 15APR2032 FR91 | 45,370,000,000 | 3,255,117 | 0.09 |
| INDONESIA (REP OF) 6.375% 15APR2042 | 37,000,000,000 | 2,578,730 | 0.07 |
| INDONESIA (REP OF) 6.5% 15FEB2031 | 160,000,000,000 | 11,581,256 | 0.32 |
| INDONESIA (REP OF) 6.5% 15JUN2025 | 210,000,000,000 | 15,571,561 | 0.42 |
| INDONESIA (REP OF) 6.625% 15MAY2033 | 128,000,000,000 | 9,121,299 | 0.25 |

投資組合 (續)

於二零二一年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

| 已上市債券 (續) | 於31.12.2021 的持有量 | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|---|---------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| 印尼(8.23%) (續) | | | |
| INDONESIA (REP OF) 6.875% 15AUG2051 FR89 | 35,000,000,000 | 2,531,492 | 0.07 |
| INDONESIA (REP OF) 7% 15MAY2027 FR59 | 163,000,000,000 | 12,363,653 | 0.34 |
| INDONESIA (REP OF) 7% 15SEP2030 | 115,000,000,000 | 8,549,713 | 0.23 |
| INDONESIA (REP OF) 7.125% 15JUN2042 FR92 | 30,000,000,000 | 2,152,936 | 0.06 |
| INDONESIA (REP OF) 7.375% 15MAY2048 | 150,000,000,000 | 10,918,841 | 0.30 |
| INDONESIA (REP OF) 7.5% 15APR2040 FR83 | 60,000,000,000 | 4,459,831 | 0.12 |
| INDONESIA (REP OF) 7.5% 15JUN2035 | 150,000,000,000 | 11,080,711 | 0.30 |
| INDONESIA (REP OF) 7.5% 15MAY2038 | 94,500,000,000 | 7,061,064 | 0.19 |
| INDONESIA (REP OF) 8.25% 15JUN2032 FR58 | 97,000,000,000 | 7,641,961 | 0.21 |
| INDONESIA (REP OF) 8.25% 15MAY2036 | 217,000,000,000 | 17,048,099 | 0.46 |
| INDONESIA (REP OF) 8.375% 15MAR2024 | 166,000,000,000 | 12,970,437 | 0.35 |
| INDONESIA (REP OF) 8.375% 15MAR2034 | 175,000,000,000 | 14,086,532 | 0.38 |
| INDONESIA (REP OF) 8.375% 15SEP2026 FR56 | 150,000,000,000 | 12,138,094 | 0.33 |
| INDONESIA (REP OF) 9% 15MAR2029 | 147,000,000,000 | 12,310,588 | 0.33 |
| INDONESIA (REP OF) 9.5% 15JUL2023 FR46 | 44,000,000,000 | 3,485,558 | 0.10 |
| INDONESIA (REP OF) 9.5% 15JUL2031 FR54 | 29,000,000,000 | 2,548,395 | 0.07 |
| INDONESIA (REP OF) 9.5% 15MAY2041 FR57 | 56,000,000,000 | 4,957,619 | 0.14 |
| INDONESIA (REP OF) 9.75% 15MAY2037 FR45 | 20,000,000,000 | 1,773,537 | 0.05 |
| INDONESIA GOV 8.125% 15MAY2024 | 146,000,000,000 | 11,262,296 | 0.31 |
| INDONESIA GOVERNMENT 5.625% 15MAY2023 | 68,000,000,000 | 4,926,022 | 0.13 |
| INDONESIA GOVERNMENT 6.125% 15MAY2028 | 125,000,000,000 | 8,985,058 | 0.24 |
| INDONESIA GOVERNMENT 7.5% 15AUG2032 | 40,000,000,000 | 3,065,580 | 0.08 |
| INDONESIA GOVERNMENT 8.25% 15MAY2029 | 150,000,000,000 | 11,857,927 | 0.32 |
| INDONESIA GOVERNMENT 8.375% 15APR2039 | 110,000,000,000 | 8,828,960 | 0.24 |
| INDONESIA GOVERNMENT 8.75% 15FEB2044 | 25,000,000,000 | 2,113,494 | 0.06 |
| INDONESIA GOVT 10% 15SEP2024 FR44 | 32,000,000,000 | 2,626,729 | 0.07 |
| INDONESIA GOVT 10.25% 15JUL2027 SER FR42 | 44,000,000,000 | 3,921,420 | 0.11 |
| PERUSAHAAN PENERBIT SBSN SER PBS 6.125% 15OCT2025 | 15,000,000,000 | 1,112,879 | 0.03 |
| PERUSAHAAN PENERBIT SBSN SER PBS 8.25% 15SEP2023 | 50,000,000,000 | 3,844,228 | 0.10 |
| PERUSAHAAN PENERBIT SURAT BERHARGA SYARIAH 7.75% 15OCT2046 | 30,000,000,000 | 2,311,016 | 0.06 |
| | | <u>302,832,293</u> | <u>8.23</u> |

沛富基金

二零二一年中期業績報告

投資組合 (續)

於二零二一年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

| 已上市債券 (續) | 於31.12.2021 的持有量 | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|--|---------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| 菲律賓(6.55%) | | | |
| PHILIPPINE (GOVT OF) 3.5% 21APR2023 | 420,000,000 | 8,396,016 | 0.23 |
| PHILIPPINE (GOVT OF) 4% 06DEC2022 | 80,000,000 | 1,595,626 | 0.04 |
| PHILIPPINE (GOVT OF) 4.125% 20AUG2024 | 415,000,000 | 8,451,692 | 0.23 |
| PHILIPPINE GOVERNMENT 3.625% 09SEP2025 | 1,010,000,000 | 20,036,683 | 0.54 |
| PHILIPPINE GOVERNMENT 4.625% 09SEP2040 | 660,000,000 | 12,576,052 | 0.34 |
| PHILIPPINE GOVERNMENT 4.75% 04MAY2027 | 400,000,000 | 8,055,115 | 0.22 |
| PHILIPPINE GOVERNMENT 5.25% 18MAY2037 | 225,000,000 | 4,553,736 | 0.12 |
| PHILIPPINE GOVERNMENT 5.5% 08MAR2023 | 320,000,000 | 6,575,628 | 0.18 |
| PHILIPPINE GOVERNMENT 5.75% 12APR2025 | 410,000,000 | 8,622,674 | 0.23 |
| PHILIPPINE GOVERNMENT 6.25% 22MAR2028 | 400,000,000 | 8,591,271 | 0.23 |
| PHILIPPINE GOVERNMENT 6.75% 24JAN2039 | 110,000,000 | 2,591,087 | 0.07 |
| PHILIPPINE GOVERNMENT 6.875% 10JAN2029 | 735,000,000 | 16,494,639 | 0.45 |
| PHILIPPINES (REP OF) 10.25% 19JAN2026 | 77,000,000 | 1,872,463 | 0.05 |
| PHILIPPINES (REP OF) 18.25% 29NOV2025 | 50,000,000 | 1,412,503 | 0.04 |
| PHILIPPINES (REP OF) 2.375% 10SEP2023 | 320,000,000 | 6,314,266 | 0.17 |
| PHILIPPINES (REP OF) 2.875% 09JUL2030 | 100,000,000 | 1,770,735 | 0.05 |
| PHILIPPINES (REP OF) 3.375% 08APR2026 | 175,000,000 | 3,400,976 | 0.09 |
| PHILIPPINES (REP OF) 3.625% 21MAR2033 | 365,000,000 | 6,556,209 | 0.18 |
| PHILIPPINES (REP OF) 3.625% 22APR2028 | 405,000,000 | 7,687,294 | 0.21 |
| PHILIPPINES (REP OF) 3.75% 12AUG2028 | 185,000,000 | 3,546,670 | 0.10 |
| PHILIPPINES (REP OF) 4% 22JUL2031 | 370,000,000 | 6,964,009 | 0.19 |
| PHILIPPINES (REP OF) 4.25% 17OCT2024 | 240,000,000 | 4,868,091 | 0.13 |
| PHILIPPINES (REP OF) 4.75% 13SEP2022 | 108,000,000 | 2,182,769 | 0.06 |
| PHILIPPINES (REP OF) 4.875% 02AUG2022 | 240,000,000 | 4,870,842 | 0.13 |
| PHILIPPINES (REP OF) 5.125% 15JUL2041 | 175,000,000 | 3,540,101 | 0.10 |
| PHILIPPINES (REP OF) 5.75% 16AUG2037 | 50,000,000 | 1,072,075 | 0.03 |
| PHILIPPINES (REP OF) 6.25% 14FEB2026 | 340,000,000 | 7,315,955 | 0.20 |
| PHILIPPINES (REP OF) 8% 19JUL2031 | 1,431,174,950 | 34,595,211 | 0.94 |
| PHILIPPINES (REP OF) 8% 30SEP2035 | 110,000,000 | 2,754,117 | 0.08 |
| PHILIPPINES (REP OF) 8.125% 16DEC2035 | 796,902,627 | 19,900,269 | 0.54 |
| PHILIPPINES (REP OF) 8.5% 29NOV2032 | 100,000,000 | 2,468,247 | 0.07 |
| PHILIPPINES (REP OF) 8.625% 06SEP2027 | 54,000,000 | 1,272,948 | 0.03 |
| PHILIPPINES (REP OF) 8.75% 27MAY2030 | 180,000,000 | 4,357,055 | 0.12 |
| PHILIPPINES (REP OF) 9.25% 05NOV2034 | 113,000,000 | 3,010,359 | 0.08 |

投資組合 (續)

於二零二一年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

| 已上市債券 (續) | 於31.12.2021 的持有量 | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|--|---------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| 菲律賓(6.55%) (續) | | | |
| PHILIPPINES (REP OF) 9.375% 05OCT2031 | 50,000,000 | 1,284,344 | 0.04 |
| PHILIPPINES (REP OF) 9.5% 04DEC2028 | 66,000,000 | 1,612,003 | 0.04 |
| | | 241,169,730 | 6.55 |
| 新加坡(15.80%) | | | |
| HOUSING & DEVELOPMENT BRD 1.54% 12OCT2028 | 3,000,000 | 2,197,390 | 0.06 |
| HOUSING & DEVELOPMENT BRD 1.645% 23NOV2026 | 2,500,000 | 1,861,524 | 0.05 |
| HOUSING & DEVELOPMENT BRD 1.865% 21JUL2033 | 15,000,000 | 10,918,845 | 0.30 |
| HOUSING & DEVELOPMENT BRD 2.088% 30AUG2022 | 5,500,000 | 4,138,548 | 0.11 |
| HOUSING & DEVELOPMENT BRD 2.5% 29JAN2023 | 10,000,000 | 7,618,203 | 0.21 |
| HOUSING & DEVELOPMENT BRD 2.505% 27JUN2024 | 11,000,000 | 8,401,174 | 0.23 |
| HOUSING & DEVELOPMENT BRD 2.545% 04JUL2031 | 2,500,000 | 1,983,536 | 0.05 |
| LAND TRANSPORT 3.35% 19MAR2048 | 9,500,000 | 8,007,516 | 0.22 |
| LAND TRANSPORT 3.45% 30JUL2058 | 7,750,000 | 6,682,523 | 0.18 |
| LAND TRANSPORT 3.51% 18SEP2030 | 3,000,000 | 2,532,103 | 0.07 |
| LAND TRANSPORT AUTHORITY 2.9% 19JUN2023 | 2,000,000 | 1,524,255 | 0.04 |
| LAND TRANSPORT AUTHORITY 3.3% 03JUN2054 | 500,000 | 415,423 | 0.01 |
| LAND TRANSPORT AUTHORITY 3.38% 30JAN2059 | 3,250,000 | 2,761,928 | 0.08 |
| LAND TRANSPORT AUTHORITY 3.43% 30OCT2053 | 1,500,000 | 1,280,818 | 0.03 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.125% 01JUN2026 | 53,000,000 | 40,697,365 | 1.11 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.375% 01JUN2025 | 30,200,000 | 23,341,630 | 0.63 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.75% 01APR2042 | 29,000,000 | 24,008,992 | 0.65 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.75% 01JUL2023 | 35,000,000 | 27,055,564 | 0.74 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030 | 48,000,000 | 39,242,305 | 1.07 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 3% 01SEP2024 | 46,700,000 | 36,746,797 | 1.00 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 3.375% 01SEP2033 | 34,000,000 | 29,673,556 | 0.81 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 3.5% 1MAR2027 | 49,300,000 | 40,683,473 | 1.11 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 0.5% 01NOV2025 | 14,500,000 | 10,468,120 | 0.28 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.625% 01JUL2031 | 12,500,000 | 9,306,033 | 0.25 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.75% 01FEB2023 | 46,000,000 | 34,734,540 | 0.94 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.875% 01MAR2050 | 44,700,000 | 31,674,900 | 0.86 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.875% 01OCT2051 | 12,500,000 | 8,834,592 | 0.24 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2% 01FEB2024 | 20,000,000 | 15,272,108 | 0.41 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.25% 01AUG2036 | 38,500,000 | 29,929,397 | 0.81 |

沛富基金

二零二一年中期業績報告

投資組合 (續)

於二零二一年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

| 已上市債券 (續) | 於31.12.2021 的持有量 | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|--|---------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| 新加坡(15.80%) (續) | | | |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.375% 01JUL2039 | 14,000,000 | 11,042,289 | 0.30 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.625% 01MAY2028 | 31,600,000 | 25,048,615 | 0.68 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.75% 01MAR2046 | 46,900,000 | 39,234,307 | 1.07 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.875% 01JUL2029 | 41,000,000 | 33,412,220 | 0.91 |
| TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.8% 17AUG2071 | 5,000,000 | 3,806,856 | 0.10 |
| TEMASEK FINANCIAL I LTD 4.2% 02AUG2050 | 5,750,000 | 5,628,696 | 0.15 |
| TEMASEK FINANCIAL LTD 1.8% 24NOV2026 | 2,000,000 | 1,502,794 | 0.04 |
| | | 581,668,935 | 15.80 |
| 南韓(14.83%) | | | |
| (D) KOREA (REP OF) 1% 10JUN2023 | 5,500,000,000 | 4,593,983 | 0.12 |
| (D) KOREA (REP OF) 1% 28FEB2025 | 5,000,000,000 | 4,162,337 | 0.11 |
| (D) KOREA (REP OF) 1.125% 10JUN2024 | 30,500,000,000 | 25,295,161 | 0.69 |
| (D) KOREA (REP OF) 1.125% 10SEP2025 | 8,000,000,000 | 6,562,219 | 0.18 |
| (D) KOREA (REP OF) 1.25% 10DEC2022 | 2,000,000,000 | 1,682,077 | 0.05 |
| (D) KOREA (REP OF) 1.25% 10MAR2026 | 14,500,000,000 | 11,891,470 | 0.32 |
| (D) KOREA (REP OF) 1.25% 10SEP2023 | 7,000,000,000 | 5,875,312 | 0.16 |
| (D) KOREA (REP OF) 1.375% 10DEC2029 | 18,000,000,000 | 14,205,820 | 0.39 |
| (D) KOREA (REP OF) 1.375% 10JUN2030 | 15,000,000,000 | 11,779,028 | 0.32 |
| (D) KOREA (REP OF) 1.375% 10SEP2024 | 20,000,000,000 | 16,714,477 | 0.45 |
| (D) KOREA (REP OF) 1.5% 10MAR2025 | 15,000,000,000 | 12,536,594 | 0.34 |
| (D) KOREA (REP OF) 1.5% 10MAR2050 | 24,500,000,000 | 17,241,555 | 0.47 |
| (D) KOREA (REP OF) 1.5% 10SEP2040 | 6,000,000,000 | 4,421,209 | 0.12 |
| (D) KOREA (REP OF) 1.625% 10SEP2070 | 2,000,000,000 | 1,354,171 | 0.04 |
| (D) KOREA (REP OF) 1.75% 10SEP2026 | 7,000,000,000 | 5,853,341 | 0.16 |
| (D) KOREA (REP OF) 1.875% 10JUN2029 | 7,000,000,000 | 5,753,824 | 0.16 |
| (D) KOREA (REP OF) 1.875% 10MAR2051 | 31,500,000,000 | 24,187,423 | 0.66 |
| (D) KOREA (REP OF) 2% 10JUN2031 | 17,000,000,000 | 13,996,569 | 0.38 |
| (D) KOREA (REP OF) 2% 10MAR2049 | 20,000,000,000 | 15,843,618 | 0.43 |
| (D) KOREA (REP OF) 3.5% 10MAR2024 | 18,000,000,000 | 15,884,664 | 0.43 |
| (D) KOREA (REPUBLIC OF) 2.375% 10SEP2038 | 9,000,000,000 | 7,674,817 | 0.21 |
| (D) KOREA MONETARY STAB 1.03% 02APR2022 | 5,000,000,000 | 4,206,688 | 0.11 |
| (D) KOREA TREASURY 3.75% 10DEC2033 | 15,200,000,000 | 14,767,692 | 0.40 |

投資組合 (續)

於二零二一年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

| 已上市債券 (續) | 於31.12.2021 的持有量 | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|--|---------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| 南韓(14.83%) (續) | | | |
| (D) KOREA TREASURY BOND 0.875% 10DEC2023 | 4,000,000,000 | 3,317,422 | 0.09 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 1.5% 10DEC2026 | 12,000,000,000 | 9,836,213 | 0.27 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 1.5% 10DEC2030 | 10,000,000,000 | 7,901,169 | 0.21 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 1.5% 10SEP2036 | 4,000,000,000 | 3,041,781 | 0.08 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 1.875% 10JUN2026 | 10,000,000,000 | 8,368,408 | 0.23 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 2% 10MAR2046 | 10,000,000,000 | 7,958,868 | 0.22 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 2% 10SEP2022 | 10,000,000,000 | 8,496,572 | 0.23 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 2.125% 10JUN2027 | 15,000,000,000 | 12,634,581 | 0.34 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 2.125% 10MAR2047 | 22,000,000,000 | 17,930,446 | 0.49 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 2.25% 10DEC2025 | 13,000,000,000 | 11,068,610 | 0.30 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 2.25% 10JUN2025 | 16,000,000,000 | 13,634,840 | 0.37 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 2.25% 10SEP2023 | 6,000,000,000 | 5,135,348 | 0.14 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 2.375% 10DEC2027 | 15,000,000,000 | 12,792,974 | 0.35 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 2.375% 10DEC2028 | 15,000,000,000 | 12,783,352 | 0.35 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 2.375% 10MAR2023 | 14,000,000,000 | 11,989,170 | 0.32 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 2.625% 10MAR2048 | 21,000,000,000 | 18,854,372 | 0.51 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 2.625% 10SEP2035 | 15,000,000,000 | 13,204,091 | 0.36 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 2.75% 10DEC2044 | 15,000,000,000 | 13,581,604 | 0.37 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 3% 10DEC2042 | 23,000,000,000 | 21,511,174 | 0.58 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 3% 10MAR2023 | 23,000,000,000 | 19,874,748 | 0.54 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 3% 10SEP2024 | 3,000,000,000 | 2,625,836 | 0.07 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 3.375% 10SEP2023 | 13,000,000,000 | 11,368,782 | 0.31 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 4% 10DEC2031 | 8,000,000,000 | 7,777,000 | 0.21 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 4.75% 10DEC2030 | 9,000,000,000 | 9,103,531 | 0.25 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 5.25% 10MAR2027 | 6,000,000,000 | 5,905,266 | 0.16 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 5.5% 10DEC2029 | 7,000,000,000 | 7,293,598 | 0.20 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 5.5% 10MAR2028 | 9,000,000,000 | 9,156,562 | 0.25 |
| (D) KOREA TREASURY BOND 5.75% 10MAR2026 | 11,000,000,000 | 10,809,020 | 0.29 |
| (D) KOREA LAND & HOUSING COR 6.37% 26JUN2023 | 1,000,000,000 | 897,868 | 0.02 |
| KOREA RAILROAD CORP 2.6% 25MAY2023 | 2,000,000 | 266,511 | 0.01 |
| KOREA RAILROAD CORP 3.375% 07JUN2023 | 3,000,000 | 405,475 | 0.01 |
| | | 546,009,241 | 14.83 |

沛富基金

二零二一年中期業績報告

投資組合 (續)

於二零二一年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

| 已上市債券 (續) | 於31.12.2021 的持有量 | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|--|---------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| 泰國(0.20%) | | | |
| THAILAND (GOVT OF) 1.585% 17DEC2035 | 265,000,000 | 7,264,247 | 0.20 |
| | | <u>7,264,247</u> | <u>0.20</u> |
| 非上市債券 | | | |
| 香港(0.34%) | | | |
| AIRPORT AUTHORITY 1.95% 20NOV2030 | 60,000,000 | 7,666,676 | 0.21 |
| HONG KONG MORTGAGE CORP 3.15% 26FEB2049 | 35,000,000 | 4,932,163 | 0.13 |
| | | <u>12,598,839</u> | <u>0.34</u> |
| 馬來西亞(11.55%) | | | |
| BANK PEMBANGUNAN MALAY 4.75% 12SEP2029 | 10,000,000 | 2,569,088 | 0.07 |
| DANAINFRA NASIONAL 3.7% 27OCT2028 | 5,000,000 | 1,200,456 | 0.03 |
| DANAINFRA NASIONAL 5.06% 12FEB2049 | 5,000,000 | 1,317,982 | 0.04 |
| DANGA CAPITAL BHD 4.94% 26JAN2033 | 5,000,000 | 1,312,842 | 0.04 |
| GOVCO HOLDINGS BHD 4.29% 22FEB2024 | 5,000,000 | 1,252,216 | 0.03 |
| GOVCO HOLDINGS BHD 4.55% 22FEB2027 | 10,000,000 | 2,554,539 | 0.07 |
| GOVCO HOLDINGS BHD 4.95% 20FEB2032 | 10,000,000 | 2,643,413 | 0.07 |
| JAMBATAN KEDUA SDN BHD 4.3% 28MAY2025 | 5,000,000 | 1,245,482 | 0.03 |
| JOHOR CORP 3.84% 14JUN2022 | 5,000,000 | 1,215,759 | 0.03 |
| KHAZANAH NASIONAL BHD 0% 14AUG2023 | 10,000,000 | 2,302,548 | 0.06 |
| LEMBAGA PEMBIAYAAN PERUM 4.9% 05APR2033 | 10,000,000 | 2,622,164 | 0.07 |
| LEMBAGA PEMBIAYAAN PERUM 4.94% 16APR2032 | 5,000,000 | 1,304,731 | 0.04 |
| MALAYSIA (GOVT OF) 3.892% 15MAR2027 | 32,000,000 | 7,995,681 | 0.22 |
| MALAYSIA (GOVT OF) 3.99% 15OCT2025 | 28,000,000 | 6,981,676 | 0.19 |
| MALAYSIA (GOVT OF) 4.498% 15APR2030 | 53,500,000 | 13,728,730 | 0.37 |
| MALAYSIA (GOVT OF) 4.709% 15SEP2026 | 1,000,000 | 258,936 | 0.01 |
| MALAYSIA (GOVT OF) 4.736% 15MAR2046 | 70,000,000 | 17,983,641 | 0.49 |
| MALAYSIA (GOVT OF) 4.786% 31OCT2035 | 30,000,000 | 7,818,989 | 0.21 |
| MALAYSIA GOVERNMENT 3.478% 14JUN2024 | 32,000,000 | 7,805,742 | 0.21 |
| MALAYSIA GOVERNMENT 3.757% 22MAY2040 | 34,000,000 | 7,806,454 | 0.21 |
| MALAYSIA GOVERNMENT 3.8% 17AUG2023 | 70,000,000 | 17,407,025 | 0.47 |

投資組合 (續)

於二零二一年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

| 非上市債券 (續) | 於31.12.2021 的持有量 | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|--|---------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| 馬來西亞(11.55%) (續) | | | |
| MALAYSIA GOVERNMENT 3.828% 05JUL2034 | 35,000,000 | 8,452,510 | 0.23 |
| MALAYSIA GOVERNMENT 3.882% 14MAR2025 | 18,000,000 | 4,490,558 | 0.12 |
| MALAYSIA GOVERNMENT 3.885% 15AUG2029 | 42,000,000 | 10,419,490 | 0.28 |
| MALAYSIA GOVERNMENT 3.9% 30NOV2026 | 8,000,000 | 1,990,592 | 0.05 |
| MALAYSIA GOVERNMENT 3.906% 15JUL2026 | 9,000,000 | 2,262,864 | 0.06 |
| MALAYSIA GOVERNMENT 4.065% 15JUN2050 | 52,000,000 | 12,224,910 | 0.33 |
| MALAYSIA GOVERNMENT 4.254% 31MAY2035 | 17,000,000 | 4,231,072 | 0.12 |
| MALAYSIA GOVERNMENT 4.893% 08JUN2038 | 15,000,000 | 3,934,369 | 0.11 |
| MALAYSIA GOVERNMENT 4.921% 06JUL2048 | 21,500,000 | 5,740,932 | 0.16 |
| MALAYSIA INVESTMENT 4.724% 15JUN2033 | 30,000,000 | 7,753,927 | 0.21 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 3.151% 15MAY2023 | 10,000,000 | 2,433,669 | 0.07 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 3.447% 15JUL2036 | 20,000,000 | 4,596,093 | 0.13 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 3.465% 15OCT2030 | 55,000,000 | 13,131,250 | 0.36 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 3.655% 15OCT2024 | 21,000,000 | 5,174,417 | 0.14 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 3.699%15NOV2022 | 2,000,000 | 489,468 | 0.01 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 3.726% 31MAR2026 | 35,000,000 | 8,633,853 | 0.24 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 3.871% 08AUG2028 | 10,000,000 | 2,479,039 | 0.07 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 3.899%15JUN2027 | 10,000,000 | 2,464,831 | 0.07 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.07% 30SEP2026 | 70,000,000 | 17,560,197 | 0.48 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.094% 30NOV2023 | 14,100,000 | 3,492,571 | 0.10 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.119% 30NOV2034 | 20,000,000 | 4,887,060 | 0.13 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.128% 15AUG2025 | 25,000,000 | 6,283,627 | 0.17 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.369% 31OCT2028 | 70,000,000 | 17,833,602 | 0.48 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.39% 07JUL2023 | 30,000,000 | 7,579,980 | 0.21 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.417% 30SEP2041 | 24,000,000 | 6,009,265 | 0.16 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.444% 22MAY2024 | 8,500,000 | 2,125,667 | 0.06 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.755% 04AUG2037 | 60,000,000 | 15,624,544 | 0.42 |
| MALAYSIA INVESTMENT ISSUE 4.895% 08MAY2047 | 10,000,000 | 2,575,083 | 0.07 |
| MALAYSIA INVESTMNT ISSUE 4.467% 15SEP2039 | 5,000,000 | 1,252,854 | 0.03 |
| MALAYSIA INVESTMNT ISSUE 4.638% 15NOV2049 | 18,000,000 | 4,456,128 | 0.12 |
| MALAYSIAN (GOVT OF) 3.48% 15MAR2023 | 31,000,000 | 7,648,192 | 0.21 |
| MALAYSIAN (GOVT OF) 3.502% 31MAY2027 | 16,300,000 | 3,966,417 | 0.11 |
| MALAYSIAN (GOVT OF) 3.899% 16NOV2027 | 31,000,000 | 7,709,068 | 0.21 |

沛富基金

二零二一年中期業績報告

投資組合 (續)

於二零二一年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

| 非上市債券 (續) | 於31.12.2021 的持有量 | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|--|---------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| 馬來西亞(11.55%) (續) | | | |
| MALAYSIAN (GOVT OF) 3.955% 15SEP2025 | 42,000,000 | 10,516,800 | 0.29 |
| MALAYSIAN (GOVT OF) 4.127% 15APR2032 | 17,000,000 | 4,209,390 | 0.11 |
| MALAYSIAN (GOVT OF) 4.181% 15JUL2024 | 35,200,000 | 8,867,689 | 0.24 |
| MALAYSIAN (GOVT OF) 4.232% 30JUN2031 | 40,200,000 | 10,075,180 | 0.27 |
| MALAYSIAN (GOVT OF) 4.392% 15APR2026 | 29,000,000 | 7,371,437 | 0.20 |
| MALAYSIAN (GOVT OF) 4.762% 07APR2037 | 20,000,000 | 5,273,188 | 0.14 |
| MALAYSIAN GOVERNMENT 3.733% 15JUN2028 | 73,500,000 | 17,996,421 | 0.49 |
| MALAYSIAN GOVERNMENT 3.844% 15APR2033 | 49,000,000 | 11,834,883 | 0.32 |
| MALAYSIAN GOVERNMENT 4.837% 15JUL2025 | 17,670,000 | 4,592,080 | 0.13 |
| MALAYSIAN GOVERNMENT 4.935% 30SEP2043 | 20,000,000 | 5,283,585 | 0.14 |
| MALAYSIAN GOVERNMENT 5.248% 15SEP2028 | 8,000,000 | 2,149,481 | 0.06 |
| PENGURUSAN AIR SPV BHD 4.06% 06JUN2022 | 15,000,000 | 3,639,070 | 0.10 |
| PERBADANAN TABUNG PENDID 4.85% 26JUL2041 | 10,000,000 | 2,594,134 | 0.07 |
| PERBADANAN TABUNG PENDID 4.86% 12MAR2032 | 20,000,000 | 5,191,983 | 0.14 |
| RANTAU ABANG CAPITAL 4.57% 19OCT2022 | 5,000,000 | 1,232,354 | 0.03 |
| SYARIKAT PRASARANA NEGAR 3.77% 06SEP2022 | 5,000,000 | 1,228,433 | 0.03 |
| SYARIKAT PRASARANA NEGAR 4.35% 04AUG2026 | 5,000,000 | 1,264,350 | 0.03 |
| SYARIKAT PRASARANA NEGAR 4.85% 27SEP2024 | 5,000,000 | 1,271,744 | 0.04 |
| SYARIKAT PRASARANA NEGAR 5.07% 28SEP2029 | 5,000,000 | 1,314,578 | 0.04 |
| | | 425,142,973 | 11.55 |
| 南韓(0.02%) | | | |
| (D) KR SMES & STARTUPS AGEN 2.507% 14JUL2023 | 1,000,000,000 | 854,141 | 0.02 |
| | | 854,141 | 0.02 |

投資組合 (續)

於二零二一年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

| 非上市債券 (續) | 於31.12.2021 的持有量 | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|---|---------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| 泰國(9.38%) | | | |
| BANK AGRICULTURE & AGRICULTURE COOP 2.62% 27JUL2031 | 40,000,000 | 1,265,201 | 0.04 |
| BANK OF THAILAND BOND 1.44% 16SEP2022 | 100,000,000 | 3,025,090 | 0.08 |
| THAILAND (GOVT OF) 2.5% 17JUN2071 | 30,000,000 | 743,431 | 0.02 |
| THAILAND (GOVT OF) 0.75% 17JUN2024 | 210,000,000 | 6,292,309 | 0.17 |
| THAILAND (GOVT OF) 0.75% 17SEP2024 | 200,000,000 | 5,996,134 | 0.16 |
| THAILAND (GOVT OF) 1% 17JUN2027 | 425,000,000 | 12,496,572 | 0.34 |
| THAILAND (GOVT OF) 1.45% 17DEC2024 | 400,000,000 | 12,196,500 | 0.33 |
| THAILAND (GOVT OF) 1.6% 17DEC2029 | 440,000,000 | 13,058,625 | 0.36 |
| THAILAND (GOVT OF) 1.6% 17JUN2035 | 280,000,000 | 7,754,384 | 0.21 |
| THAILAND (GOVT OF) 1.875% 17JUN2049 | 140,000,000 | 3,390,842 | 0.09 |
| THAILAND (GOVT OF) 2% 17DEC2031 | 360,000,000 | 10,891,714 | 0.30 |
| THAILAND (GOVT OF) 3.4% 17JUN2036 | 346,000,000 | 11,541,844 | 0.31 |
| THAILAND (GOVT OF) 3.58% 17DEC2027 | 238,000,000 | 8,009,210 | 0.22 |
| THAILAND (GOVT OF) 3.625% 16JUN2023 | 672,000,000 | 21,043,455 | 0.57 |
| THAILAND (GOVT OF) 3.65% 20JUN2031 | 348,000,000 | 12,081,822 | 0.33 |
| THAILAND (GOVT OF) 3.775% 25JUN2032 | 513,150,000 | 18,035,407 | 0.49 |
| THAILAND (GOVT OF) 3.8% 14JUN2041 | 109,000,000 | 3,834,341 | 0.10 |
| THAILAND (GOVT OF) 3.85% 12DEC2025 | 610,000,000 | 20,256,777 | 0.55 |
| THAILAND (GOVT OF) 4.5% 9APR2024 | 89,000,000 | 2,919,930 | 0.08 |
| THAILAND (GOVT OF) 4.675% 29JUN2044 | 373,000,000 | 14,502,950 | 0.39 |
| THAILAND (GOVT OF) 4.75% 20DEC2024 | 90,000,000 | 3,008,193 | 0.08 |
| THAILAND (GOVT OF) 4.85% 17JUN2061 | 281,000,000 | 11,763,218 | 0.32 |
| THAILAND (GOVT OF) 4.875% 22JUN2029 | 534,000,000 | 19,593,812 | 0.53 |
| THAILAND (GOVT OF) 5.5% 13MAR2023 | 150,000,000 | 4,831,827 | 0.13 |
| THAILAND (GOVT OF) 5.67% 13MAR2028 | 164,000,000 | 6,216,774 | 0.17 |
| THAILAND (GOVT OF) 6.15% 07JUL2026 | 150,000,000 | 5,607,087 | 0.15 |
| THAILAND GOVERN BOND 2.125% 17DEC2026 | 210,000,000 | 6,546,656 | 0.18 |
| THAILAND GOVERNMENT 1.875% 17JUN2022 | 375,000,000 | 11,307,699 | 0.31 |
| THAILAND GOVERNMENT BOND 0.95% 17JUN2025 | 420,000,000 | 12,597,262 | 0.34 |
| THAILAND GOVERNMENT BOND 2% 17DEC2022 | 140,000,000 | 4,256,315 | 0.12 |
| THAILAND GOVERNMENT BOND 2% 17JUN2042 | 445,000,000 | 11,806,165 | 0.32 |
| THAILAND GOVERNMENT BOND 2.4% 17DEC2023 | 235,100,000 | 7,284,616 | 0.20 |
| THAILAND GOVERNMENT BOND 2.875% 17JUN2046 | 100,100,000 | 3,005,886 | 0.08 |

沛富基金
二零二一年中期業績報告

投資組合 (續)

於二零二一年十二月三十一日 (未經審核)

基本 – 按地理位置劃分 (續)

| | 於31.12.2021 的持有量 | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|---|---------------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| 非上市債券 (續) | | | |
| 泰國(9.38%) (續) | | | |
| THAILAND GOVERNMENT BOND 3.3% 17JUN2038 | 382,150,000 | 12,643,887 | 0.34 |
| THAILAND GOVERNMENT BOND 3.6% 17JUN2067 | 305,000,000 | 10,133,586 | 0.28 |
| THAILAND GOVERNMENT BOND 4% 17JUN2066 | 449,000,000 | 16,287,123 | 0.44 |
| THAILAND GOVT BOND 2.875% 17DEC2028 | 280,000,000 | 9,083,368 | 0.25 |
| | | <u>345,310,012</u> | <u>9.38</u> |
| 報價債券總額 | | <u>3,671,627,422</u> | <u>99.73</u> |
| 總債權 | | <u>3,671,627,422</u> | <u>99.73</u> |
| 總債券，以成本計算 | | <u><u>3,648,043,070</u></u> | |

投資組合 (續)

於二零二一年十二月三十一日 (未經審核)

| | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|--|---------------------------|--------------------------------------|
| 投資分佈 | | |
| (a) 下表概列於二零二一年十二月三十一日S&P's或iBoxx 對基金債券作出的信貸評級 | | |
| 按信貸評級 | | |
| AAA | 139,178,918 | 3.78 |
| AA+ | 168,299,010 | 4.57 |
| AA | 260,201,901 | 7.07 |
| A+ | 1,100,177 | 0.03 |
| A | 433,607,786 | 11.78 |
| A- | 122,699,080 | 3.33 |
| BBB | 270,418,864 | 7.35 |
| 無評級 | 2,276,121,686 | 61.82 |
| | <u>3,671,627,422</u> | <u>99.73</u> |
| 投資組合 | | |
| (b) 按資產類別 | | |
| 債券 | <u>3,671,627,422</u> | <u>99.73</u> |
| | <u>3,671,627,422</u> | <u>99.73</u> |
| (c) 按行業 | | |
| 非週期性消費品 | 1,215,759 | 0.03 |
| 金融 | 227,072,140 | 6.17 |
| 政府部門 | 3,432,703,880 | 93.24 |
| 工業 | 6,996,573 | 0.19 |
| 公用事業 | 3,639,070 | 0.10 |
| | <u>3,671,627,422</u> | <u>99.73</u> |

沛富基金

二零二一年中期業績報告

投資組合 (續)

於二零二一年十二月三十一日 (未經審核)

十大持股量

| | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|---|---------------------------|--------------------------------------|
| CHINA (GOVT OF) 3.19% 11APR2024 (INTERBANK) | 65,274,219 | 1.77 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.125% 01JUN2026 | 40,697,365 | 1.11 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 3.5% 1MAR2027 | 40,683,473 | 1.11 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030 | 39,242,305 | 1.07 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.75% 01MAR2046 | 39,234,307 | 1.07 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 3% 01SEP2024 | 36,746,797 | 1.00 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.16% 18MAY2022 | 36,070,227 | 0.98 |
| CHINA (GOVT OF) 2.95% 16JUN23 (INTERBANK) | 34,571,496 | 0.94 |
| PHILIPPINES (REP OF) 8% 19JUL2031 | 34,595,211 | 0.94 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.75% 01FEB2023 | 34,734,540 | 0.94 |
| | <u>401,849,940</u> | <u>10.93</u> |

| | 於31.12.2021 的公平值 美元 | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|--|---------------------------|--------------------------------------|
| CHINA (GOVT OF) 3.19% 11APR2024 (INTERBANK) | 63,135,158 | 1.69 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.25% 22NOV2028 (INTERBANK) | 51,836,742 | 1.39 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.75% 01JUL2023 | 47,270,647 | 1.26 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030 | 45,644,745 | 1.22 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.75% 01MAR2046 | 43,570,380 | 1.17 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 3.5% 1MAR2027 | 41,953,108 | 1.12 |
| PHILIPPINES (REP OF) 8% 19JUL2031 | 39,797,935 | 1.06 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.875% 01MAR2050 | 37,737,085 | 1.01 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 3% 01SEP2024 | 37,683,224 | 1.01 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.16% 18MAY2022 | 36,430,174 | 0.97 |
| | <u>445,059,198</u> | <u>11.90</u> |

組合持股量變動報表

自二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間(未經審核)

| | 於31.12.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) | 於30.6.2021 佔總資產淨值 的百分比 (%) |
|---------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 報價投資 | | |
| 債券 | | |
| 中國 | 25.09 | 25.09 |
| 香港 | 8.08 | 8.31 |
| 印尼 | 8.23 | 7.87 |
| 馬來西亞 | 11.55 | 11.57 |
| 菲律賓 | 6.55 | 6.45 |
| 新加坡 | 15.80 | 15.73 |
| 南韓 | 14.85 | 15.41 |
| 泰國 | 9.58 | 9.73 |
| | <hr/> | <hr/> |
| 報價投資總額 | 99.73 | 100.16 |
| | <hr/> <hr/> | <hr/> <hr/> |

相關指數成份股披露

於二零二一年十二月三十一日

基金的相關指數為Markit iBoxx ABF泛亞洲指數，其於二零二一年十二月三十一日並無任何佔指數10%以上的成份股。

於二零二一年七月一日至二零二一年十二月三十一日止期間內，Markit iBoxx ABF泛亞洲指數下跌-0.34%，而基金每單位資產淨值下跌-0.44%。

沛富基金

二零二一年中期業績報告

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）

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

(A) 持有的抵押品

於30.12.2021

| 抵押品提供者 | 抵押品提供者的 信貸評級 ¹ | 抵押品性質 | 非現金抵押品的 市值（如適用） 美元 | 抵押品公平值 美元 |
|--------------------------------------|------------------------------|--------|--------------------------|--------------------|
| BNP Paribas London | Aa3 | 固定收入證券 | 24,600,189 | 24,600,190 |
| Credit Suisse AG Singapore Branch | A1 | 固定收入證券 | 255,161,428 | 255,161,429 |
| Nomura International PLC | Baa1 | 固定收入證券 | 74,521,380 | 74,521,380 |
| | | | | <u>354,282,999</u> |

於30.06.2021

| 抵押品提供者 | 抵押品提供者的 信貸評級 ¹ | 抵押品性質 | 非現金抵押品的 市值（如適用） 美元 | 抵押品公平值 美元 |
|--------------------------------------|------------------------------|--------|--------------------------|--------------------|
| BNP Paribas London | Aa3 | 固定收入證券 | 31,226,799 | 31,226,799 |
| Credit Suisse AG Singapore Branch | A1 | 固定收入證券 | 257,223,055 | 257,223,055 |
| Nomura International PLC | Baa1 | 固定收入證券 | 110,211,589 | 110,211,589 |
| | | | | <u>398,661,443</u> |

¹ 穆迪評級服務作出的信貸評級

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(B) 固定收入抵押品的信貸評級

於31.12.2021

| 抵押品提供者 | 資產類別 | 評級機構 | 抵押品信貸評級 | 抵押品公平值 美元 |
|--------------------|------|------|---------|--------------|
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | AAA | 56,129 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | AAA | 1,682,925 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | AAA | 2,978,396 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | AA2 | 4,840 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 58,646 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 38,865 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 3,796,415 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 84,756 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 87,648 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 41,127 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 21,795 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 136,069 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 6,055 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 3,282,126 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 1,201,838 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 159,729 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 55,391 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 661,975 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 261,008 |

證券借貸安排及持有的抵押品詳情 (未經審核) (續)

(B) 固定收入抵押品的信貸評級 (續)

於31.12.2021 (續)

| 抵押品提供者 | 資產類別 | 評級機構 | 抵押品信貸評級 | 抵押品公平值 美元 |
|-----------------------------------|------|------|---------|--------------|
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 48,177 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 28,278 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 5,090,854 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 1,690,883 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 2,887,554 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 238,711 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | AAA | 6,383,680 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | AAA | 15,246 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | AAA | 196,099 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | AAA | 7,711,706 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | AAA | 1,411,769 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 127,683,672 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 26,071,174 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 24,714,961 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 25,166,075 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 13,104,969 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 21,350,249 |

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(B) 固定收入抵押品的信貸評級（續）

於31.12.2021（續）

| 抵押品提供者 | 資產類別 | 評級機構 | 抵押品信貸評級 | 抵押品公平值 美元 |
|-----------------------------------|------|------|---------|--------------------|
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 1,325,317 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | AAA | 26,512 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 穆迪評級 | AA2 | 524,928 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 穆迪評級 | AA2 | 876,088 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 穆迪評級 | AA2 | 3,572,573 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 穆迪評級 | AA2 | 360,922 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 穆迪評級 | AA2 | 16,954 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 穆迪評級 | AA2 | 143,132 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 69,026,783 |
| | | | | <u>354,282,999</u> |

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(B) 固定收入抵押品的信貸評級（續）

於30.06.2021（續）

| 抵押品提供者 | 資產類別 | 評級機構 | 抵押品信貸評級 | 抵押品公平值 美元 |
|-----------------------------------|------|------|---------|--------------|
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 1,487,926 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 2,764,433 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 139,512 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 335,804 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 98,970 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 1,406,519 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 569,976 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 209,009 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 5,773,821 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 12,309,027 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 6,131,802 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | AAA | 1,248,377 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | AAA | 5,277,265 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | AAA | 8,251,272 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | AAA | 36,201,790 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 340,970 |

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(B) 固定收入抵押品的信貸評級（續）

於30.06.2021（續）

| 抵押品提供者 | 資產類別 | 評級機構 | 抵押品信貸評級 | 抵押品公平值 美元 |
|-----------------------------------|------|------|---------|--------------|
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 49,023,077 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 22,564,501 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 11,146,276 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 2,397,687 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 2,204,160 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 26,587,227 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 18,632,842 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 2,367,073 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 1,498,291 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 21,523,563 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 2,081,596 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 10,410,073 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 25,792,001 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 2,865,397 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 6,809,617 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 穆迪評級 | AAA | 4,873,289 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 穆迪評級 | AAA | 1,359,321 |

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(B) 固定收入抵押品的信貸評級（續）

於30.06.2021（續）

| 抵押品提供者 | 資產類別 | 評級機構 | 抵押品信貸評級 | 抵押品公平值 美元 |
|--------------------------|------|------|---------|--------------------|
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 穆迪評級 | AA2 | 115,635 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 穆迪評級 | AA2 | 115,426 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 穆迪評級 | AA2 | 576,975 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 穆迪評級 | AA2 | 134,506 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 穆迪評級 | AA2 | 780,354 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 101,921,578 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 穆迪評級 | A1 | 334,505 |
| | | | | <u>398,661,443</u> |

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(C) 證券借貸及購回交易分析

證券借貸交易

截至31.12.2021止期間

| 對手方 | 抵押品類別 | 貨幣 | 到期日期 ² | 抵押品提供者 的地理位置 | 結算／清算 | 已借出的證券 公平值 美元 |
|--------------------------------------|-------|------|-------------------|-----------------|-------|---------------------|
| Credit Suisse AG Singapore Branch | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 三方抵押品 | 30,773,444 |
| Credit Suisse AG Singapore Branch | 政府債券 | 泰銖 | 無固定期限 | 倫敦 | 三方抵押品 | 933,614 |
| Nomura International PLC | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 雙方抵押品 | 4,342,372 |
| Nomura International PLC | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 雙方抵押品 | 19,273,332 |
| Nomura International PLC | 政府債券 | 泰銖 | 無固定期限 | 倫敦 | 雙方抵押品 | 18,335,878 |
| | | | | | | <u>73,658,640</u> |

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(C) 證券借貸及購回交易分析（續）

證券借貸交易（續）

截至31.12.2020止期間

| 對手方 | 抵押品類別 | 貨幣 | 到期日期 ² | 抵押品提供者 的地理位置 | 結算／清算 | 已借出的證券 公平值 美元 |
|--|-------|------|-------------------|-----------------|-------|---------------------|
| BNP Paribas London | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 三方抵押品 | 4,683,605 |
| Credit Suisse Securities (Europe) Limited | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 三方抵押品 | 8,085,205 |
| Nomura International PLC | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 雙方抵押品 | 32,994,434 |
| Nomura International PLC | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 雙方抵押品 | 10,886,924 |
| Nomura International PLC | 政府債券 | 泰銖 | 無固定期限 | 倫敦 | 雙方抵押品 | 147,205,879 |
| | | | | | | <u>203,856,047</u> |

² 於期內／年內借出且未於截至二零二一年十二月三十一日及二零二一年六月三十日止期間／年度獲歸還的證券披露於下表。

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(C) 證券借貸及購回交易分析（續）

證券借貸交易（續）

於31.12.2021

| 貸款抵押 | 抵押品類別 | 貨幣 | 到期日期 | 證券借貸代理人的地理位置 | 現金與非現金抵押品的比例 | 非現金抵押品的到期日期 | 結算/清算 | 資產淨值百分比 | 已借出的證券公平值 ³ 美元 |
|--|-------|----|-------|--------------|--------------|-------------|-------|---------|------------------------------|
| HK GOVERNMENT BOND 2.39% 20AUG2025 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.10% | 3,739,297 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.16% 22FEB2023 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.11% | 3,843,256 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.33% 23MAY2022 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.05% | 1,923,798 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.55% 05DEC2022 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.04% | 1,608,371 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.97% 20JUN2022 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.12% | 4,504,920 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.1% 17JAN2023 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.18% | 6,499,106 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.1% 17JAN2023 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.12% | 4,549,374 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.16% 18MAY2022 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 參考下表 | 雙方抵押品 | 0.35% | 12,882,224 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.16% 18MAY2022 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.14% | 5,152,890 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.51% 24FEB2027 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.10% | 3,616,289 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.68% 21JAN2026 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.15% | 5,625,958 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.84% 09DEC2024 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.08% | 3,102,255 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.96% 03JUN2024 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.09% | 3,336,987 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.97% 17JAN2029 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.09% | 3,386,733 |

沛富基金

二零二一年中期業績報告

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(C) 證券借貸及購回交易分析（續）

證券借貸交易（續）

於31.12.2021（續）

| 貸款抵押 | 抵押品類別 | 貨幣 | 到期日期 | 證券借貸代理人的地理位置 | 現金與非現金抵押品的比例 | 非現金抵押品的到期日期 | 結算/清算 | 資產淨值百分比 | 已借出的證券公平值 ³ 美元 |
|---|-------|------|-------|--------------|--------------|-------------|-------|---------|------------------------------|
| HONG KONG (GOVT OF) 1.97% 17JAN2029 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.20% | 7,450,812 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.02% 07MAR2034 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.08% | 2,991,191 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.13% 16JUL2030 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.04% | 1,372,918 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.22% 07AUG2024 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.10% | 3,685,791 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.6% 20AUG2024 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.10% | 3,725,431 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.71% 20FEB2023 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.09% | 3,324,639 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.95% 24FEB2025 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.10% | 3,787,594 |
| HONG KONG (GOVT OF) 4.65% 29AUG2022 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 參考下表 | 三方抵押品 | 0.03% | 936,931 |
| HONG KONG (GOVT OF) 4.65% 29AUG2022 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.07% | 2,676,946 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.125% 01JUN2026 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.24% | 8,792,167 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.125% 01JUN2026 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.31% | 11,556,516 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.375% 01JUN2025 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.20% | 7,342,566 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.375% 01JUN2025 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.12% | 4,328,249 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.75% 01APR2042 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.25% | 9,106,859 |

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(C) 證券借貸及購回交易分析（續）

證券借貸交易（續）

於31.12.2021（續）

| 貸款抵押 | 抵押品類別 | 貨幣 | 到期日期 | 證券借貸代理人的地理位置 | 現金與非現金抵押品的比例 | 非現金抵押品的到期日期 | 結算/清算 | 資產淨值百分比 | 已借出的證券公平值 ³ 美元 |
|---|-------|------|-------|--------------|--------------|-------------|-------|---------|------------------------------|
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.75% 01APR2042 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.08% | 2,897,637 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.75% 01JUL2023 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.37% | 13,527,782 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.38% | 14,102,703 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.05% | 1,635,096 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.02% | 613,161 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.02% | 899,303 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.04% | 1,308,077 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 2.875% 01SEP2030 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 參考下表 | 三方抵押品 | 0.03% | 981,058 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 3% 01SEP2024 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.50% | 18,373,399 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 3.375% 01SEP2033 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.40% | 14,618,590 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 3.5% 1MAR2027 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.55% | 20,341,737 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 0.5% 01NOV2025 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.11% | 4,151,151 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.75% 01FEB2023 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.21% | 7,550,987 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.75% 01FEB2023 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.06% | 2,265,296 |

沛富基金

二零二一年中期業績報告

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(C) 證券借貸及購回交易分析（續）

證券借貸交易（續）

於31.12.2021（續）

| 貸款抵押 | 抵押品類別 | 貨幣 | 到期日期 | 證券借貸代理人的地理位置 | 現金與非現金抵押品的比例 | 非現金抵押品的到期日期 | 結算/清算 | 資產淨值百分比 | 已借出的證券公平值 ³ 美元 |
|---------------------------------------|-------|------|-------|--------------|--------------|-------------|-------|---------|------------------------------|
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.75% 01FEB2023 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.06% | 2,265,296 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.75% 01FEB2023 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.04% | 1,283,668 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.75% 01FEB2023 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.11% | 4,002,023 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.875% 01MAR2050 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.33% | 12,046,383 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.875% 01MAR2050 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.07% | 2,480,138 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.875% 01OCT2051 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.08% | 3,003,761 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.875% 01OCT2051 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.04% | 1,413,535 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2% 01FEB2024 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 參考下表 | 三方抵押品 | 0.21% | 7,636,054 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.25% 01AUG2036 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.34% | 12,632,538 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.375% 01JUL2039 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.07% | 2,760,572 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.375% 01JUL2039 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.07% | 2,760,572 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.625% 01MAY2028 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.34% | 12,524,308 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.75% 01MAR2046 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.53% | 19,617,154 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.875% 01JUL2029 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.45% | 16,706,110 |
| | | | | | | | | 9.21% | 339,248,157 |

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(C) 證券借貸及購回交易分析（續）

證券借貸交易（續）

於30.06.2021

| 貸款抵押 | 抵押品類別 | 貨幣 | 到期日期 | 證券借貸 代理人的 地理位置 | 現金與 非現金 抵押品 的比例 | 非現金 抵押品 的到期 日期 | 結算/清算 | 資產淨值 百分比 | 已借出的證券 公平值 ³ 美元 |
|--|-------|----|-------|----------------------|--------------------------|-------------------------|-------|-------------|----------------------------------|
| HK GOVERNMENT BOND 1.09% 05JUN2023 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.10% | 3,740,243 |
| HK GOVERNMENT BOND 2.39% 20AUG2025 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.10% | 3,835,719 |
| HONG KONG (GOVT OF) 22FEB2023 0.16% | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.10% | 3,869,144 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.33% 23MAY2022 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.05% | 1,935,396 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.55% 05DEC2022 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.04% | 1,621,155 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.8% 27AUG2027 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.09% | 3,469,516 |
| HONG KONG (GOVT OF) 0.97% 20JUN2022 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.12% | 4,549,249 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.1% 17JAN2023 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 參考下表 | 雙方抵押品 | 0.18% | 6,567,477 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.1% 17JAN2023 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.12% | 4,597,234 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.16% 18MAY2022 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.36% | 13,010,776 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.16% 18MAY2022 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.14% | 5,204,311 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.19% 06DEC2021 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.10% | 3,560,994 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.49% 22FEB2028 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.07% | 2,680,095 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.51% 24FEB2027 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.10% | 3,695,094 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.68% 21JAN2026 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.15% | 5,761,710 |

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(C) 證券借貸及購回交易分析（續）

證券借貸交易（續）

於30.06.2021（續）

| 貸款抵押 | 抵押品類別 | 貨幣 | 到期日期 | 證券借貸代理人的地理位置 | 現金與非現金抵押品的比例 | 非現金抵押品的到期日期 | 結算/清算 | 資產淨值百分比 | 已借出的證券公平值 ³ 美元 |
|--|-------|----|-------|--------------|--------------|-------------|-------|---------|------------------------------|
| HONG KONG (GOVT OF) 1.73% 20FEB2024 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.10% | 3,631,282 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.84% 09DEC2024 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.09% | 3,175,042 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.89% 02MAR2032 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.14% | 5,145,724 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.96% 03JUN2024 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.09% | 3,410,223 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.97% 17JAN2029 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.09% | 3,468,474 |
| HONG KONG (GOVT OF) 1.97% 17JAN2029 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.20% | 7,630,642 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.02% 07MAR2034 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.08% | 3,049,875 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.02% 07MAR2034 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 參考下表 | 雙方抵押品 | 0.14% | 5,267,966 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.13% 16JUL2030 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.26% | 9,837,754 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.22% 07AUG2024 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.10% | 3,774,798 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.24% 27AUG2029 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.07% | 2,540,577 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.46% 04AUG2021 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.05% | 1,698,415 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.48% 28FEB2029 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.06% | 2,222,262 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.6% 20AUG2024 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.10% | 3,819,678 |
| HONG KONG (GOVT OF) 2.71% 20FEB2023 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.09% | 3,387,660 |

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(C) 證券借貸及購回交易分析（續）

證券借貸交易（續）

於30.06.2021（續）

| 貸款抵押 | 抵押品類別 | 貨幣 | 到期日期 | 證券借貸 代理人的 地理位置 | 現金與 非現金 抵押品 的比例 | 非現金 抵押品 的到期 日期 | 結算/清算 | 資產淨值 百分比 | 已借出的證券 公平值 ³ 美元 |
|---|-------|------|-------|----------------------|--------------------------|-------------------------|-------|-------------|----------------------------------|
| HONG KONG (GOVT OF) 24FEB2025 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.11% | 3,895,149 |
| HONG KONG (GOVT OF) 25FEB2026 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.07% | 2,771,820 |
| HONG KONG (GOVT OF) 29AUG2022 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.03% | 963,549 |
| HONG KONG (GOVT OF) 29AUG2022 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.07% | 2,752,997 |
| HONG KONG GOVERNMENT 1.94% 04DEC2023 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.09% | 3,357,243 |
| HONG KONG GOVERNMENT 2.49% 22AUG2028 | 政府債券 | 港元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 雙方抵押品 | 0.07% | 2,576,322 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 01JUN2026 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.24% | 9,031,149 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 01JUN2025 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.20% | 7,532,693 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 01APR2042 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.25% | 9,419,190 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 01JUL2023 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.63% | 23,635,324 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 01SEP2030 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.39% | 14,447,190 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 01SEP2030 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.05% | 1,675,037 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 01SEP2030 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.02% | 628,139 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 01SEP2024 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.50% | 18,841,612 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 01SEP2022 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.12% | 4,460,408 |

參考下表

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(C) 證券借貸及購回交易分析（續）

證券借貸交易（續）

於30.06.2021（續）

| 貸款抵押 | 抵押品類別 | 貨幣 | 到期日期 | 證券借貸代理人的地理位置 | 現金與非現金抵押品的比例 | 非現金抵押品的到期日期 | 結算/清算 | 資產淨值百分比 | 已借出的證券公平值 ³ 美元 |
|---------------------------------------|-------|------|-------|--------------|--------------|-------------|-------|---------------|------------------------------|
| SINGAPORE (GOVT OF) 3.375% 01SEP2033 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.45% | 16,777,423 |
| SINGAPORE (GOVT OF) 3.5% 1MAR2027 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.56% | 20,976,554 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.75% 01FEB2023 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.21% | 7,650,593 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.75% 01FEB2023 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.06% | 2,295,178 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.75% 01FEB2023 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.06% | 2,295,178 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.875% 01MAR2050 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.02% | 751,735 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 1.875% 01MAR2050 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 參考下表 | 三方抵押品 | 0.34% | 12,779,491 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2% 01FEB2024 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.35% | 13,224,160 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.25% 01AUG2036 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.34% | 12,817,949 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.625% 01MAY2028 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.37% | 13,859,262 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.75% 01MAR2046 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.61% | 22,702,002 |
| SINGAPORE GOVERNMENT 2.875% 01JUL2029 | 政府債券 | 新加坡元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | | 三方抵押品 | 0.46% | 17,207,675 |
| | | | | | | | | <u>10.15%</u> | <u>379,483,507</u> |

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

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(C) 證券借貸及購回交易分析（續）

證券借貸交易的抵押品

於31.12.2021

| 抵押品提供者 | 抵押品類別 | 貨幣 | 到期日期 | 抵押品 提供者 的地理 位置 | 現金與 非現金 抵押品 | | 結算/清算 | 抵押品所 覆蓋之 資產淨值 百分比 | 抵押品公平值 美元 |
|--------------------|-------|------|-------|-------------------------|-------------------|-----------------|-------|----------------------------|--------------|
| | | | | | 比例 | 非現金抵押品的 到期日期 | | | |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 澳元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零三三年四月二十一日 | 三方抵押品 | 0.00% | 56,129 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 澳元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二八年五月二十一日 | 三方抵押品 | 0.05% | 1,682,925 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 加拿大元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二零年六月一日 | 三方抵押品 | 0.08% | 2,978,396 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 歐元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零四八年五月二十五日 | 三方抵押品 | 0.00% | 4,840 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零三一年六月二十日 | 三方抵押品 | 0.00% | 58,646 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二二年六月二十日 | 三方抵押品 | 0.00% | 38,865 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二二年十二月二十日 | 三方抵押品 | 0.10% | 3,796,415 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二四年十二月二十日 | 三方抵押品 | 0.00% | 84,756 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二五年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.00% | 87,648 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二零年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.00% | 41,127 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零三二年九月二十日 | 三方抵押品 | 0.00% | 21,795 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零三三年九月二十日 | 三方抵押品 | 0.00% | 136,069 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零三四年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.00% | 6,055 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零三五年十二月二十日 | 三方抵押品 | 0.09% | 3,282,126 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二六年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.03% | 1,201,838 |

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(C) 證券借貸及購回交易分析（續）

證券借貸交易的抵押品（續）

於31.12.2021（續）

| 抵押品提供者 | 抵押品類別 | 貨幣 | 到期日期 | 抵押品 提供者的 地理 位置 | 現金與 非現金 抵押品 | | 結算/清算 | 抵押品所 覆蓋之 資產淨值 百分比 | 抵押品公平值 美元 |
|--------------------------------------|-------|----|-------|-------------------------|-------------------|--------------|-------|----------------------------|--------------|
| | | | | | 非現金抵押品的 比例 | 到期日期 | | | |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二零年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.01% | 159,729 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零四三年九月二十日 | 三方抵押品 | 0.00% | 55,391 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零四四年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.02% | 661,975 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零四四年九月二十日 | 三方抵押品 | 0.01% | 261,008 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零四五年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.00% | 48,177 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零四六年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.00% | 28,278 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零四九年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.14% | 5,090,854 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零五六年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.05% | 1,690,883 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零五八年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.08% | 2,887,554 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零五九年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.01% | 238,711 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 澳元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零三三年四月二十一日 | 三方抵押品 | 0.17% | 6,383,680 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 澳元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零三五年六月二十一日 | 三方抵押品 | 0.00% | 15,246 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 澳元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二七年十一月二十一日 | 三方抵押品 | 0.01% | 196,099 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 澳元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二二年十一月二十一日 | 三方抵押品 | 0.21% | 7,711,706 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 澳元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二九年十一月二十一日 | 三方抵押品 | 0.04% | 1,411,769 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二三年三月二十日 | 三方抵押品 | 3.47% | 127,683,672 |

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(C) 證券借貸及購回交易分析（續）

證券借貸交易的抵押品（續）

於31.12.2021（續）

| 抵押品提供者 | 抵押品類別 | 貨幣 | 到期日期 | 抵押品 提供者的 地理 位置 | 現金與 非現金 抵押品 | | 結算/清算 | 抵押品所 覆蓋之 資產淨值 百分比 | 抵押品公平值 美元 |
|--------------------------------------|-------|-----|-------|-------------------------|-------------------|--------------|-------|----------------------------|--------------------|
| | | | | | 非現金抵押品的 比例 | 到期日期 | | | |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二四年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.71% | 26,071,174 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二一年六月二十日 | 三方抵押品 | 0.67% | 24,714,961 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二七年十二月二十日 | 三方抵押品 | 0.68% | 25,166,075 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零三九年九月二十日 | 三方抵押品 | 0.36% | 13,104,969 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零四五年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.58% | 21,350,249 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零四六年九月二十日 | 三方抵押品 | 0.04% | 1,325,317 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | USD | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二六年四月三十日 | 三方抵押品 | 0.00% | 26,512 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 歐元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二五年十一月二十五日 | 雙方抵押品 | 0.01% | 524,928 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 歐元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二六年五月二十五日 | 雙方抵押品 | 0.02% | 876,088 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 歐元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零三九年六月二十五日 | 雙方抵押品 | 0.10% | 3,572,573 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 歐元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二八年五月二十五日 | 雙方抵押品 | 0.01% | 360,922 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 歐元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二九年十一月二十五日 | 雙方抵押品 | 0.00% | 16,954 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 歐元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二七年二月二十五日 | 雙方抵押品 | 0.00% | 143,132 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 日元 | 無固定期限 | 倫敦 | 0% | 二零二五年三月二十日 | 雙方抵押品 | 1.87% | 69,026,783 |
| | | | | | | | | <u>9.62%</u> | <u>354,282,999</u> |

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(C) 證券借貸及購回交易分析（續）

證券借貸交易的抵押品（續）

於30.06.2021

| 抵押品提供者 | 抵押品類別 | 貨幣 | 到期日期 | 抵押品提供者的地理位置 | 現金與非現金抵押品的比例 | | 結算/清算 | 抵押品所覆蓋之資產淨值百分比 | 抵押品公平值 美元 |
|-----------------------------------|-------|----|-------|-------------|--------------|--------------|-------|----------------|--------------|
| | | | | | 現金 | 非現金 | | | |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二四年六月二十日 | 三方抵押品 | 0.04% | 1,487,926 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二七年六月二十日 | 三方抵押品 | 0.07% | 2,764,433 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二八年十二月二十日 | 三方抵押品 | 0.00% | 139,512 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二九年六月二十日 | 三方抵押品 | 0.01% | 335,804 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零三一年九月二十日 | 三方抵押品 | 0.00% | 98,970 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零三二年六月二十日 | 三方抵押品 | 0.04% | 1,406,519 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零三四年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.02% | 569,976 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零三五年九月二十日 | 三方抵押品 | 0.01% | 209,009 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零三五年九月二十日 | 三方抵押品 | 0.15% | 5,773,821 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零四八年九月二十日 | 三方抵押品 | 0.33% | 12,309,027 |
| BNP PARIBAS LONDON | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零五一年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.16% | 6,131,802 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 澳元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零三五年六月二十一日 | 三方抵押品 | 0.03% | 1,248,377 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 澳元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二七年十一月二十一日 | 三方抵押品 | 0.14% | 5,277,265 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 澳元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二二年十一月二十一日 | 三方抵押品 | 0.22% | 8,251,272 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二九年十一月二十一日 | 三方抵押品 | 0.97% | 36,201,790 |

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(C) 證券借貸及購回交易分析（續）

證券借貸交易的抵押品（續）

於30.06.2021（續）

| 抵押品提供者 | 抵押品類別 | 貨幣 | 到期日期 | 抵押品提供者的地理位置 | 現金與非現金抵押品的比例 | 非現金抵押品的到期日期 | 結算/清算 | 抵押品所覆蓋之資產淨值百分比 | 抵押品公平值 美元 |
|-----------------------------------|-------|----|-------|-------------|--------------|-------------|-------|----------------|--------------|
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二五年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.01% | 340,970 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二二年三月二十日 | 三方抵押品 | 1.31% | 49,023,077 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二二年九月二十日 | 三方抵押品 | 0.60% | 22,564,501 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二二年十二月二十日 | 三方抵押品 | 0.30% | 11,146,276 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二四年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.06% | 2,397,687 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二九年十二月二十日 | 三方抵押品 | 0.06% | 2,204,160 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零九六年十一月一日 | 三方抵押品 | 0.71% | 26,587,227 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二二年九月二十日 | 三方抵押品 | 0.50% | 18,632,842 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二九年六月二十日 | 三方抵押品 | 0.06% | 2,367,073 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二零年三月二十日 | 三方抵押品 | 0.04% | 1,498,291 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二零年六月二十日 | 三方抵押品 | 0.58% | 21,523,563 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零三二年十二月二十日 | 三方抵押品 | 0.06% | 2,081,596 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零三五年六月二十日 | 三方抵押品 | 0.28% | 10,410,073 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零三九年九月二十日 | 三方抵押品 | 0.69% | 25,792,001 |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二七年九月二十日 | 三方抵押品 | 0.08% | 2,865,397 |

沛富基金

二零二一年中期業績報告

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(C) 證券借貸及購回交易分析（續）

證券借貸交易的抵押品（續）

於30.06.2021（續）

| 抵押品提供者 | 抵押品類別 | 貨幣 | 到期日期 | 抵押品提供者的地理位置 | 現金與非現金抵押品的比例 | | 結算/清算 | 抵押品所覆蓋之資產淨值百分比 | 抵押品公平值 美元 |
|-----------------------------------|-------|----|-------|-------------|--------------|--------------|-------|----------------|--------------------|
| | | | | | 現金 | 非現金抵押品 | | | |
| CREDIT SUISSE AG SINGAPORE BRANCH | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零四六年九月二十日 | 三方抵押品 | 0.18% | 6,809,617 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 歐元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二六年八月十五日 | 雙方抵押品 | 0.13% | 4,873,289 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 歐元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二二年九月四日 | 雙方抵押品 | 0.04% | 1,359,321 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 歐元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二三年十月二十五日 | 雙方抵押品 | 0.00% | 115,635 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 歐元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二七年十月二十五日 | 雙方抵押品 | 0.00% | 115,426 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 歐元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二四年十一月二十五日 | 雙方抵押品 | 0.02% | 576,975 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 歐元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零三一年十一月二十五日 | 雙方抵押品 | 0.00% | 134,506 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 歐元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二七年二月二十五日 | 雙方抵押品 | 0.02% | 780,354 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 歐元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零二二年九月二十日 | 雙方抵押品 | 2.73% | 101,921,578 |
| NOMURA INTERNATIONAL PLC | 政府債券 | 日元 | 無固定限期 | 倫敦 | 0% | 二零五九年三月二十日 | 雙方抵押品 | 0.01% | 334,505 |
| | | | | | | | | <u>10.66%</u> | <u>398,661,443</u> |

購回交易

不適用。

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(D) 已借出的可轉讓證券

於31.12.2021

| 已借出的可轉讓 證券總值 ³ 美元 | 借出證券數額 佔可借出資產總值 的比例 ³ % | 借出證券數額 佔基金管理資產 的比例 ³ % | 購回交易的 絕對金額 美元 |
|------------------------------------|---|--|---------------------|
| 339,248,157 | 38.2913 | 9.2144 | 不適用 |

於30.06.2021

| 已借出的可轉讓 證券總值 ³ 美元 | 借出證券數額 佔可借出資產總值 的比例 ³ % | 借出證券數額 佔基金管理資產 的比例 ³ % | 購回交易的 絕對金額 美元 |
|------------------------------------|---|--|---------------------|
| 379,483,507 | 41.4272 | 10.1488 | 不適用 |

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

(E) 以現金抵押品作出的投資

不適用。於二零二一年十二月三十一日及二零二一年六月三十日，基金並無收取任何現金抵押品。

沛富基金

二零二一年中期業績報告

證券借貸安排及持有的抵押品詳情 (未經審核) (續)

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

於截至二零二一年及二零二零年十二月三十一日止期內, 概無所佔已收抵押品已就貸款抵押被重新使用或重新抵押。

(G) 十大抵押品發行人

| | 抵押品公平值 美元 | 佔總資產淨值 的百分比 % |
|-----------------------------------|--------------------|---------------------|
| 於31.12.2021 | | |
| Credit Suisse AG Singapore Branch | 255,161,429 | 6.9305% |
| Nomura International PLC | 74,521,380 | 2.0241% |
| BNP Paribas London | 24,600,190 | 0.6681% |
| | <u>354,282,999</u> | <u>9.6227%</u> |
| 於30.06.2021 | | |
| Credit Suisse AG Singapore Branch | 257,223,055 | 6.8791% |
| Nomura International PLC | 110,211,589 | 2.9475% |
| BNP Paribas London | 31,226,799 | 0.8351% |
| | <u>398,661,443</u> | <u>10.6617%</u> |

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(H) 基金收取的十大抵押證券

| | 公平值 美元 | 佔總資產淨值 的百分比 % |
|---------------------------------------|--------------------|---------------------|
| 於31.12.2021 | | |
| JAPAN JPGV 0.60% 20 March 2023 | 127,683,672 | 3.4680% |
| JAPAN JPGV 0.10% 20 March 2025 | 69,026,783 | 1.8749% |
| JAPAN JPGV 0.60% 20 March 2024 | 26,071,174 | 0.7081% |
| JAPAN JPGV 0.60% 20 December 2037 | 25,166,075 | 0.6835% |
| JAPAN JPGV 0.10% 20 June 2031 | 24,773,606 | 0.6729% |
| JAPAN JPGV 1.50% 20 March 2045 | 21,398,426 | 0.5812% |
| JAPAN JPGV 0.30% 20 September 2039 | 13,104,969 | 0.3559% |
| AUSTRALIA AUGV 2.25% 21 November 2022 | 7,711,706 | 0.2095% |
| AUSTRALIA AUGV 4.50% 21 April 2033 | 6,439,808 | 0.1749% |
| JAPAN JPGV 2.20% 20 March 2049 | 5,090,854 | 0.1383% |
| | <u>326,467,073</u> | <u>8.8672%</u> |
| 於30.06.2021 | | |
| JAPAN JPGV 0.80% 20 September 2022 | 124,486,079 | 3.3292% |
| JAPAN JPGV 1.0% 20 March 2022 | 49,023,077 | 1.3111% |
| AUSTRALIA AUGV 2.75% 21 November 2029 | 36,201,790 | 0.9682% |
| JAPAN JPGV 20 August 2022 FRN | 26,587,227 | 0.7110% |
| JAPAN JPGV 0.30% 20 September 2039 | 25,792,001 | 0.6898% |
| JAPAN JPGV 1.80% 20 June 2030 | 21,523,563 | 0.5756% |
| JAPAN JPGV 1.90% 20 September 2022 | 18,632,842 | 0.4983% |
| JAPAN JPGV 0.90% 20 September 2048 | 12,309,027 | 0.3292% |
| JAPAN JPGV 0.80% 20 December 2022 | 11,146,276 | 0.2981% |
| JAPAN JPGV 1.30% 20 June 2035 | 10,410,073 | 0.2784% |
| | <u>336,111,955</u> | <u>8.9889%</u> |

沛富基金

二零二一年中期業績報告

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(i) 證券借貸及購回交易的十大交易對手

| | 借出證券 之公平值 ³ 美元 | 佔總資產淨值 的百分比 ³ % |
|-----------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 於31.12.2021 | | |
| Credit Suisse AG Singapore Branch | 244,558,277 | 6.6425% |
| BNP Paribas London | 71,144,082 | 1.9324% |
| Nomura International PLC | 23,545,798 | 0.6395% |
| | <u>339,248,157</u> | <u>9.2144%</u> |
| 於30.06.2021 | | |
| Credit Suisse AG Singapore Branch | 245,288,001 | 6.5599% |
| Nomura International PLC | 104,495,854 | 2.7946% |
| BNP Paribas London | 29,699,652 | 0.7943% |
| | <u>379,483,507</u> | <u>10.1488%</u> |

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

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(J) 託管人及每位託管人持有的資產數額

| | 公平值 31.12.2021 美元 | 公平值 30.06.2021 美元 |
|---|-------------------------|-------------------------|
| 抵押證券的託管人 | | |
| HSBC Bank Plc ⁴ | 74,521,380 | 110,211,589 |
| JP Morgan Bank Luxembourg S.A. ⁶ | 279,761,619 | 288,449,854 |
| | <u>354,282,999</u> | <u>398,661,443</u> |
| 向借款方提供的證券借貸的託管人 ^{3,5} | | |
| HSBC Bank Plc | <u>339,248,157</u> | <u>379,483,507</u> |

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

⁴ 抵押品由HSBC Bank Plc根據雙方抵押品託管安排以獨立賬戶持有。

⁵ 向借方提供的所有證券借貸均以獨立賬戶持有。HSBC Bank Plc作為證券借貸代理以安排貸款交易並管理抵押品。

⁶ JP Morgan Bank Luxembourg S.A.為一間三方抵押品經理人，證券借貸代理HSBC Bank Plc向其轉授若干抵押品管理、保證金融資及託管職能。

沛富基金

二零二一年中期業績報告

證券借貸安排及持有的抵押品詳情（未經審核）（續）

(K) 基金證券借貸所賺取的收入

| | 截至31.12.2021 止期間 美元 | 截至31.12.2020 止期間 美元 |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
| 基金所賺取的收入 | 142,761 | 158,000 |
| 經理人所賺取的收入 | — | — |
| | <u>142,761</u> | <u>158,000</u> |

(L) 在證券借貸及購回交易的回報與現金抵押品再投資的回報之間進行分配

| | 截至31.12.2021 止期間 美元 | 截至31.12.2020 止期間 美元 |
|--------------|---------------------------|---------------------------|
| 證券借貸及購回交易的回報 | 142,761 | 158,000 |
| 現金抵押品再投資的回報 | — | — |

行政及管理層

經理人的董事

Mr. James MacNevin
Mr. Kheng Siang Ng
Mr. Kevin David Anderson
Mr. Louis Anthony Boscia

監察委員會成員

Dr. Guy Debelle
Ms. Tokiko Shimizu
Mr. Mathee Supapongse
Mr. Edmond Lau
Mr. Chen Yulu
Mr. Geoff Bascand
Mrs. Maria Ramona Gertrudes T. Santiago
Mr. Dody Budi Waluyo
Mr. Abdul Rasheed Ghaffour
Mr. Leong Sing Chiong
Dr. Hwanseok Lee

信託人

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

託管人、行政管理人、過戶登記處及收款代理人

匯豐機構信託服務（亞洲）有限公司
香港
皇后大道中1號
匯豐總行大廈

經理人

道富環球投資管理新加坡有限公司

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

香港分行辦事處：
香港
中環
金融街8號
國際金融中心二期68樓

服務代理人

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

核數師

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