

博時大中華債券基金

博時投資基金的子基金

中期報告（未經審核）

截至二零二四年六月三十日

博時大中華債券基金

博時投資基金的
子基金

中期報告（未經審核）

截至二零二四年六月三十日

博時投資基金-博時大中華債券基金

中期報告（未經審核）
截至二零二四年六月三十日

目錄	頁碼
基金管理及行政	1
財務狀況表（未經審核）	2 - 3
全面收益表（未經審核）	4 - 5
單位持有人應佔資產淨值變動表（未經審核）	6 - 7
現金流量表（未經審核）	8
投資組合（未經審核）	9 - 10
投資組合變動報告（未經審核）	11 - 12
金融衍生工具之詳情（未經審核）	13

博時投資基金–博時大中華債券基金

基金管理及行政

經理人

博時基金（國際）有限公司
怡和大廈 4109 室
康樂廣場 1 號
中環
香港

法律顧問

西盟斯律師事務所
太古坊一座 30 樓
英皇道 979 號
香港

受託人及過戶處

滙豐機構信託服務（亞洲）有限公司
皇后大道中 1 號
香港

中國保管人

香港上海滙豐銀行有限公司
皇后大道中 1 號
香港

中國保管人的受委人

滙豐銀行（中國）有限公司
滙豐銀行大樓 33 樓
上海國金中心商場
世紀大道 8 號
上海浦東 (200120)
中國

核數師

羅兵咸永道會計師事務所
公爵大廈 21 樓
皇后大道中 15 號
香港

博時投資基金–博時大中華債券基金

財務狀況表（未經審核）
截至二零二四年六月三十日

	截至 2024年6月30日 美元	截至 2023年12月31日 美元
非流動資產		
法定按金	154	191
流動資產		
投資	3,251,479	3,444,775
應收銀行利息	25	5
應收利息	41,899	38,656
應收認購款項	781	-
孖展按金	22,769	46,933
現金及現金等價物	239,311	30,571
總資產	<u>3,556,418</u>	<u>3,561,131</u>
流動負債		
金融衍生工具	405	258
應付贖回款項	1,283	188
應付購買款項	200,000	-
其他應付款項	34,755	38,670
負債（不包括單位持有人應佔資產淨值）	<u>236,443</u>	<u>39,116</u>
單位持有人應佔資產淨值	<u>3,319,975</u>	<u>3,522,015</u>
已發行單位數目	單位	單位
- 類別 A 美元	4,171	4,161
- 類別 A 港元	435,433	452,494
- 類別 I 美元	192,789	209,215
- 類別 I 人民幣	4,896	4,896
- 類別 I 人民幣對沖	60,391	60,391
- 類別 I 港元	241,649	241,649

博時投資基金–博時大中華債券基金

財務狀況表（未經審核）（續）

截至二零二四年六月三十日

	截至 2024年6月30日 美元	截至 2023年12月31日 美元
每單位資產淨值		
- 類別 A 美元	9.91	9.91
- 類別 A 港元	10.21	10.21
- 類別 I 美元	11.72	11.65
- 類別 I 人民幣	15.62	15.15
- 類別 I 人民幣對沖	9.89	10.01
- 類別 I 港元	11.58	11.52

附註：子基金的中期報告乃根據 2023 年年度財務報表所採用的相同會計政策編製。

博時投資基金—博時大中華債券基金

全面收益表（未經審核）
截至二零二四年六月三十日

	2024年1月1日至 2024年6月30日 美元	2023年1月1日至 2023年6月30日 美元
收入		
銀行存款利息	934	4,754
投資利息	60,838	293,964
投資收益淨額	22,905	111,381
匯兌虧損淨額	(409)	(13,610)
投資收入總額	<u>84,268</u>	<u>396,489</u>
開支		
管理費 ^{註釋 2}	9,618	28,626
受託人費用 ^{註釋 1}	35,802	35,704
過戶登記處費用 ^{註釋 1}	497	496
審計費	12,143	15,452
保管費及銀行收費 ^{註釋 1}	333	899
法律及專業費用	97	983
交易成本	-	17
其他開支 ^{註釋 1}	14,655	14,388
營運開支總額	<u>73,145</u>	<u>96,565</u>
稅前營運溢利	<u>11,123</u>	<u>299,924</u>
稅項開支	(1)	(36)
稅後溢利	<u>11,122</u>	<u>299,888</u>
營運所得單位持有人應佔資產淨值增加	<u>11,122</u>	<u>299,888</u>

博時投資基金–博時大中華債券基金

全面收益表（未經審核）（續）

截至二零二四年六月三十日

^{註釋 1} 截至 2024 年 6 月 30 日及 2023 年 6 月 30 日止期間，除已向受託人或其關連人士支付的受託人費用及過戶登記處費用外，已分別向受託人或其關連人士支付的其他費用如下：

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 美元	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 美元
保管費和銀行費用	333	899
其他開支	13,810	13,386

^{註釋 2} 截至 2024 年 6 月 30 日及 2023 年 6 月 30 日止期間，除已向經理人支付的管理費外，並無向經理人或其關連人士支付的其他款項。

博時投資基金—博時大中華債券基金

單位持有人應佔資產淨值變動表（未經審核）
截至二零二四年六月三十日

	2024年1月1日至 2024年6月30日 美元	2023年1月1日至 2023年6月30日 美元
期初單位持有人應佔資產淨值	3,522,015	17,200,914
發行單位	21,307	41,675
贖回單位	(234,469)	(10,219,231)
單位交易之減少淨額	(213,162)	(10,177,556)
營運所得單位持有人應佔資產淨值增加	11,122	299,888
期末單位持有人應佔資產淨值	3,319,975	7,323,246
已發行單位數目	單位	單位
類別 A 美元		
期初已發行單位	4,161	3,919
發行單位	139	309
贖回單位	(129)	(183)
期末已發行單位	4,171	4,045
類別 A 港元		
期初已發行單位	452,494	523,820
發行單位	15,284	216,605
贖回單位	(32,345)	(242,722)
期末已發行單位	435,433	497,703

博時投資基金—博時大中華債券基金

單位持有人應佔資產淨值變動表（未經審核）（續）
截至二零二四年六月三十日

	2024年1月1日至 2024年6月30日	2023年1月1日至 2023年6月30日
	單位	單位
已發行單位數目		
類別 I 美元		
期初已發行單位	209,215	1,444,258
發行單位	-	-
贖回單位	(16,426)	(896,073)
期末已發行單位	<u>192,789</u>	<u>548,185</u>
類別 I 人民幣		
期初已發行單位	4,896	78
發行單位	-	-
贖回單位	-	-
期末已發行單位	<u>4,896</u>	<u>78</u>
類別 I 人民幣對沖		
期初已發行單位	60,391	60,391
發行單位	-	-
贖回單位	-	-
期末已發行單位	<u>60,391</u>	<u>60,391</u>
類別 I 港元		
期初已發行單位	241,649	241,649
發行單位	-	-
贖回單位	-	-
期末已發行單位	<u>241,649</u>	<u>241,649</u>

博時投資基金—博時大中華債券基金

現金流量表（未經審核）
截至二零二四年六月三十日

	2024年1月1日至 2024年6月30日 美元	2023年1月1日至 2023年6月30日 美元
來自營運活動的現金流		
營運所得單位持有人應佔資產淨值增加	11,122	299,888
以下項目之調整：		
投資利息	(60,838)	(293,964)
銀行存款利息	(934)	(4,754)
稅項開支	1	36
未計營運資金變動前的經營（虧損）／收益	(50,649)	1,206
投資減少淨額	193,296	8,891,463
金融衍生工具減少／（增加）淨額	147	(13,536)
存款準備金減少淨額	37	537
孖展按金減少淨額	24,164	139,736
應付經紀人款項增加淨額	200,000	-
其他應付款項減少淨額	(3,915)	(19,252)
營運所得現金	363,080	9,000,154
已收投資利息	57,595	375,237
已收銀行存款利息	914	5,321
已付稅款	(1)	(36)
營運活動所得現金淨額	421,588	9,380,676
來自融資活動的現金流		
發行單位所得款項	20,526	41,785
贖回單位付款	(233,374)	(10,225,030)
融資活動所用現金淨額	(212,848)	(10,183,245)
現金及現金等價物增加／（減少）淨額	208,740	(802,569)
期初現金及現金等價物	30,571	815,617
期末現金及現金等值項目	239,311	13,048
現金及現金等價物結餘分析		
銀行現金	239,311	13,048

博時投資基金-博時大中華債券基金

投資組合（未經審核）

截至二零二四年六月三十日

	名義 價值 美元	市場 價值 美元	佔資產 淨值百分比 (%)
有報價債券			
澳洲			
AUSTRALIA AND NEALAND BANKING GROUP SER REGS (REG S) VAR 18SEP2034	200,000	198,886	5.99
開曼群島			
POSEIDON FINANCE 1 LTD (REG) (REG S) 0% CONV 01FEB2025	200,000	207,850	6.26
中國			
CENTRAL PLAZA DEV LTD SER EMTN (REG) (REG S) 3.85% 14JUL2025	200,000	190,032	5.72
CHONGQING NANAN CON DEV (REG) (REG S) 4.2% 07JUL2024	200,000	199,930	6.02
GEELY AUTOMOBILE (REG) (REG S) VAR PERP 31DEC2049	200,000	197,700	5.95
GREENTOWN CHINA HLDGS (REG) (REG S) 5.65% 13JUL2025	200,000	190,236	5.73
HUARONG FINANCE 2017 CO 4.75% 27APR2027	200,000	188,750	5.69
MEITUAN (REG) (REG S) 0% CONV 27APR2027	200,000	190,400	5.74
SCIENCE CITY GZ INV GRP (REG) (REG S) 6.8% 05AUG2025	200,000	201,359	6.07
ZHONGSHENG GROUP (REG) (REG S) 3% 13JAN2026	200,000	190,649	5.74
香港			
AIRPORT AUTHORITY HK (REG) (REG S) VAR PERP 31DEC2049	200,000	184,660	5.56
BANK OF EAST ASIA LTD SER EMTN (REG) (REG S) VAR 15MAR2027	250,000	252,066	7.59
FWD GROUP HOLDINGS LTD SER EMTN (REG) (REG S) 7.635% 02JUL2031	200,000	204,133	6.15
沙地阿拉伯			
SAUDI INTERNATIONAL BOND SER REGS (REG S) 5% 18JAN2053	200,000	176,480	5.32
美國			
US TREASURY 4.125% 15AUG2053	300,000	278,930	8.40
維京群島			
JOY TRSR ASSETS HLD SER EMTN (REG) (REG S) 5.75% 06JUN2029	200,000	199,418	6.01
債務證券總額		<u>3,251,479</u>	<u>97.94</u>

博時投資基金-博時大中華債券基金

投資組合（未經審核）（續）

截至二零二四年六月三十日

	名義 價值 美元	市場 價值 美元	佔資產 淨值百分比 (%)
期貨合約		(405)	(0.01)
投資*及金融衍生工具總額		<u>3,251,074</u>	<u>97.93</u>
投資總額（按成本）*		<u>3,256,656</u>	

*投資按交易日基準入賬。

博時投資基金—博時大中華債券基金

投資組合變動報告（未經審核）
截至二零二四年六月三十日

	名義價值（美元）			2024年6月30日
	2024年1月1日	增添	減少	
有報價債券				
澳洲				
AUSTRALIA AND NEALAND BANKING GROUP SER REGS (REG S) VAR 18SEP2034	-	200,000	-	200,000
開曼群島				
POSEIDON FINANCE 1 LTD (REG) (REG S) 0% CONV 01FEB2025	-	200,000	-	200,000
中國				
CENTRAL PLAZA DEV LTD SER EMTN (REG) (REG S) 3.85% 14JUL2025	200,000	-	-	200,000
CHINA HONGQIAO GROUP LTD (REG) (REG S) 6.25% 08JUN2024	200,000	-	200,000	-
CHONGQING NANAN CON DEV (REG) (REG S) 4.2% 07JUL2024	200,000	-	-	200,000
COASTAL EMERALD LTD (REG) (REG S) VAR PERP 31DEC2049	200,000	-	200,000	-
GEELY AUTOMOBILE (REG) (REG S) VAR PERP 31DEC2049	200,000	-	-	200,000
GREENTOWN CHINA HLDGS (REG) (REG S) 5.65% 13JUL2025	200,000	-	-	200,000
HANSOH PHARMACEUTICAL (REG) (REG S) 0% CONV 22JAN2026	200,000	-	200,000	-
HUAFA 2021 I CO LTD (REG) (REG S) VAR PERP 31DEC2049	200,000	-	200,000	-
HUARONG FINANCE 2017 CO 4.75% 27APR2027	200,000	-	-	200,000
MEITUAN (REG) (REG S) 0% CONV 27APR2027	-	200,000	-	200,000
SCIENCE CITY GZ INV GRP (REG) (REG S) 6.8% 05AUG2025	-	200,000	-	200,000
SHUNTONG INTERNATIONAL (REG) (REG S) 6.7% 18NOV2024	200,000	-	200,000	-
ZHONGSHENG GROUP (REG) (REG S) 3% 13JAN2026	-	200,000	-	200,000

博時投資基金—博時大中華債券基金

投資組合變動報告（未經審核）（續）
截至二零二四年六月三十日

	名義價值（美元）			2024年6月30日
	2024年1月1日	增添	減少	
有報價債券（續）				
香港				
AIRPORT AUTHORITY HK (REG) (REG S) VAR PERP 31DEC2049	200,000	-	-	200,000
BANK OF EAST ASIA LTD SER EMTN (REG) (REG S) VAR 15MAR2027	-	250,000	-	250,000
CHINA CITIC BANK INTL SER EMTN (REG) (REG S) VAR 05DEC2033	250,000	-	250,000	-
CMB INTERNATIONAL LEASING SER EMTN (REG) (REG S) FRN 04JUN2027	-	200,000	200,000	-
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD (REG) (REG S) 3% 22SEP2030	200,000	-	200,000	-
FAR EAST HORIZON LTD SER EMTN (REG) (REG S) 6.625% 16APR2027	-	200,000	200,000	-
FWD GROUP HOLDINGS LTD SER EMTN (REG) (REG S) 7.635% 02JUL2031	-	200,000	-	200,000
韓國				
POSCO SER REGS (REG S) 4.875% 23JAN2027	-	200,000	200,000	-
沙地阿拉伯				
SAUDI INTERNATIONAL BOND SER REGS (REG S) 5% 18JAN2053	200,000	-	-	200,000
新加坡				
OVERSEA-CHINESE BANKING SER GMTN (REG S) VAR 21MAY2034	-	200,000	200,000	-
英國				
HSBC HOLDINGS PLC (REG) VAR 14AUG2027	-	200,000	200,000	-
美國				
BOC AVIATION USA CORP SER REGS (REG) (REG S) 5.25% 14JAN2030	-	200,000	200,000	-
US TREASURY 3.625% 15FEB2053	360,000	-	360,000	-
US TREASURY 4% 15NOV2052	400,000	-	400,000	-
US TREASURY 4.125% 15AUG2053	-	350,000	50,000	300,000
US TREASURY BILL 0% 21MAR2024	-	340,000	340,000	-
US TREASURY BILL 0% 28MAR2024	-	200,000	200,000	-
維京群島				
JOY TRSR ASSETS HLD SER EMTN (REG) (REG S) 5.75% 06JUN2029	-	200,000	-	200,000
期貨合約				
新加坡				
美元／離岸人民幣 2024009016	-	-	1	(1)
美元／離岸人民幣 2024003018	(1)	1	-	-
美元／離岸人民幣 2024006017	-	1	1	-

博時投資基金—博時大中華債券基金

金融衍生工具詳情（未經審核）

截至二零二四年六月三十日

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金所持有的金融衍生工具如下：

期貨合約

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金所持有的期貨合約詳情如下：

截至二零二四年六月三十日

描述	相關資產	持倉	合約價值	名義市值 美元	倉位	交易對手方	公允價值 美元
<u>金融負債：</u>							
美元／離岸人民幣 16/09/2024	美元／離岸 人民幣外匯	(1)	100,000	(99,328)	短倉	廣發期貨（香港） 有限公司	(405)
							<u>(405)</u>
							<u><u>(405)</u></u>