滙豐
投資管理

基金中心

香港創富債券指數

月度報告 2026年10月31日 | - | **AD**

風險披露

- 本基金為被動式管理的指數追踪交易所買賣基金，旨在追踪Markit iBoxx ABF Hong Kong Index。不能保證或確保完全複製該指數。基於本基金的內在投資性質，經理人將無酌情權應對市場轉變。該指數下跌將引致本基金的資產淨值出現相若的下跌。
- 本基金在香港交易所上市並不擔保其流通性及有可能被除牌。本基金在交易所買賣的市場價格或有別於每單位資產淨值。
- 本基金可投資於金融衍生工具作投資用途，可能使本基金的資產淨值較波動。
- 本基金可從資本中或未扣除開支前撥付股息。派息不獲保證及會導致資本蠶食及資產淨值減少。
- 投資於本基金涉及重大的信貸、信貸評級、貨幣、債務證券、利率、估值、主權債務、地域集中性、被動式投資、終止、買賣、波動性和流動性風險。於動蕩市況下，投資者可能蒙受重大損失。
- 投資者不應僅就此基金資料表作出投資決定，而應閱讀發行文件以獲取詳細信息。

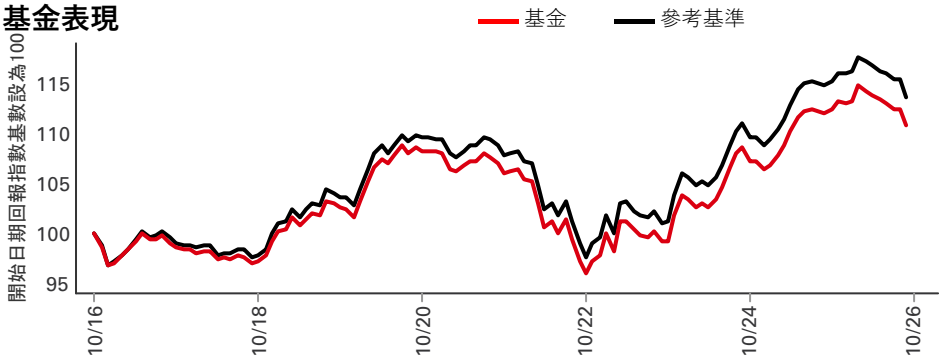
投資目標

信託的投資目標是達致在扣除費用及開支前與Markit iBoxx ABF Hong Kong Index（「相關指數」）的總回報相若的投資回報。經理人將透過將信託的資產主要投資於相關指數的成分證券（「指數證券」），及採取代表性抽樣策略或類似策略，謀求達致信託的投資目標。代表性抽樣投資策略為投資於相關指數內具代表性的若干證券的策略，而該等投資合計的特質與相關指數相類似（例如收益率和期限）。信託一般不會持有相關指數內全部成分證券

投資策略

本基金旨在於扣除費用和開支前達致與iBoxx ABF Hong Kong Index*的總回報相若的投資表現。

基金表現



股份類別详情

關鍵指標	
每股資產淨值	港元 **97.91**
到期收益率	**3.82%**
基金資料	
遵守UCITS V指令	無
股息處理	派息
派息頻率	每半年
除息日	**2026年8月27日**
股息年化收益率	**2.97%**
最後支付股息	**1.450000**
交易頻率	每日
股份類別基本貨幣	港元
註冊地	香港特別行政區
成立日期	**2005年6月17日**
基金規模	港元 **2,647,500,271**
參考基準	**100% Markit iBoxx ABF Hong Kong TR HKD**
基金經理	**Fouad Mouadine Daniel TC Lam**
費用及支出	
最高首次認購費（香港）	**0.000%**
管理費	**0.150%**
編碼	
ISIN代碼	**HK2819031405**
彭博代號	**2819 HK**

過往表現並不預測未來回報。表現以股份類別基本貨幣計算，資產淨值對資產淨值，將股息再作投資，並已扣除費用。如投資業績非以港元或美元計算，以港元或美元作投資的投資者須承受匯率波動的風險。*本基金可從資本中或未扣除開支前撥付股息對本基金表現可能有重大影響的變動：**2017年12月11日** – 提高新增單位費用。**2018年1月29日** – 更改派息政策。

有關詞彙的定義，請參閱詞彙表二維碼。
資料來源：滙豐投資管理，數據截至 **2026年10月31日**

基金表現 (%)	年初至今	1個月	3個月	6個月	1年	3年	5年
AD	**-0.94**	**1.17**	**-0.40**	**-1.62**	**-0.34**	**12.81**	**5.66**
參考基準	-0.79	1.17	-0.37	-1.60	-0.22	13.56	6.65

曆年表現 (%)	2021	2022	2023	2024	2025
AD	**-1.68**	**-7.94**	**6.08**	**2.50**	**6.27**
參考基準	-1.24	-7.84	6.40	2.68	6.44

如股份類別成立少於五年，其首年年度表現為成立日至年底。
當計算期超過一年，業績為累積表現。

3年 風險衡量指標	AD	參考基準
波幅	3.13%	3.15%
夏普比率	22.67	22.57
追踪誤差	0.17%	--
資訊比率	-1.38	--

5年 風險衡量指標	AD	參考基準
波幅	3.98%	4.01%
夏普比率	12.27	12.24
追踪誤差	0.16%	--
資訊比率	-1.16	--

固定收益特點	基金	參考基準	相對
持倉數目（不包括現金）	86	188	--
平均票息	3.09	3.12	-0.03
投資組合收益率	3.82%	3.85%	-0.04%
到期收益率	3.82%	3.85%	-0.04%
當前收益率	3.18%	3.21%	-0.03%
期權調整存續期	3.93	3.95	-0.03
平均到期日	4.72	4.75	-0.03
平均信貸質素	AA+/AA	AA+/AA	--
發行人數量	20	26	--

信用評級 (%)	基金	參考基準	相對
AAA	28.91	27.92	0.99
AA	70.71	68.89	1.83
A	--	0.19	-0.19
無評級	--	3.01	-3.01
現金	0.38	--	0.38

到期日分佈 (期權調整存續期)	基金	參考基準	相對
1年期以下債券	0.02	--	0.02
10年期以上債券	0.92	0.94	-0.01
1至2年期債券	0.32	0.38	-0.05
2至3年期債券	0.58	0.55	0.03
3至4年期債券	0.64	0.51	0.14
4至5年期債券	0.35	0.54	-0.19
5至10年期債券	1.08	1.04	0.04
總計	**3.93**	**3.95**	**-0.03**

過往表現並不預測未來回報。表現以股份類別基本貨幣計算，資產淨值對資產淨值，將股息再作投資，並已扣除費用。如投資業績非以港元或美元計算，以港元或美元作投資的投資者須承受匯率波動的風險。*本基金可從資本中或未扣除開支前撥付股息
有關詞彙的定義，請參閱詞彙表二維碼。
資料來源：滙豐投資管理，數據截至 **2026**年**10**月**31**日

行業配置 (%)	基金	參考基準	相對
政府支持機構	39.62	38.81	0.81
超國家	30.89	31.58	-0.70
國庫券	29.11	29.61	-0.50
現金	0.38	--	0.38

十大持倉	比重 (%)
ASIAN INFRASTRUC 3.847 26/02/28	3.87
HK GOVT BOND PRO 2.130 16/07/30	3.26
HK GOVT INFRA 3.230 05/12/29	3.26
ASIAN DEV BANK 3.810 23/01/30	3.08
HK GOVT INFRA 2.760 25/04/28	3.00
URBAN RENEWAL AU 3.450 27/08/29	2.74
HK GOVT BOND PRO 2.020 07/03/34	2.71
HK GOVT BOND PRO 1.890 02/03/32	2.44
HK GOVT BOND PRO 1.970 17/01/29	2.40
AFRICAN DEV BANK 2.615 23/06/29	2.22

指數免責聲明

Markit iBoxx 是Markit Indices Limited (前稱為"International Index Company Limited") (簡稱「Markit」) 的註冊商標，本基金的經理人及受託人已獲許可使用該商標。Markit並沒有同意、認可或推薦經理人、受託人或本基金。本基金並不是由Markit所贊助、認可或售賣，而Markit亦不對投資於本基金的合適性作出任何聲明。

重要資訊

投資者應注意，本基金有別於一般單位信託。投資者應參閱發售文件，以便了解當中詳細差異以及投資本基金涉及的費用和開支。投資者應注意，本基金單位在交易所的市場價格可能有別於本基金的每單位資產淨值，而單位可能會從證券交易所除牌。
這些參考價值不應被視為本基金每單位資產淨值的「實時」更新。本基金的參考每單位資產淨值與本基金的實際每單位資產淨值（在下一個交易日刊載）可能有所不同。
參考資產淨值
滙豐環球投資管理（香港）有限公司網站所示的參考資產淨值計算（「參考資產淨值計算」）乃由Solactive AG 提供（見 「What we do - ETF Services」），並在香港聯合交易所（聯交所）的交易時段更新。
參考資產淨值計算僅屬指示性質並只供參考。參考資產淨值計算僅供說明，並非擬作交易用途。無論如何，任何用戶一概不得刊登、轉遞、轉發或透過其他方式複製任何格式的參考資產淨值計算予他人，亦不得在任何業務或商業企業使用任何參考資產淨值計算或針對任何業務或商業企業使用任何參考資產淨值計算，包括但不限於任何證券、投資、會計、銀行、法律或傳媒業務或企業。參考資產淨值計算乃按「現狀」提供。Solactive AG及其各自的第三方供應商概不就參考資產淨值計算作出明示或暗示的保證，亦不就用戶及基金或透過其他方式使用參考資產淨值計算所得的結果作出明示或暗示的保證，包括但不限於關乎適銷性、特定目的或用途的合適性之明示或暗示保證。在依據參考資產淨值計算執行證券交易前，謹請自行諮詢經紀或其他財務代表以便核證定價資料。
延時數據
本網站所示延時數據（「數據」）乃由參考資產淨值計算的供應商Solactive AG提供。為免產生疑問，參考資產淨值計算不會每秒刷新，因此稱為延遲數據。Solactive AG及其各自的控股公司及／或有關控股公司旗下任何附屬公司概不就所提供數據的準確性或可靠性作出保證，亦不就 閣下因應或基於使用數據而可能蒙受或引致的任何損失或損害承擔任何責任（不論是民事侵權行為或合約或其他責任），包括因數據不準確、不完整或延時而產生的損失或損害，且不論有關損失或損害如何產生。 閣下理解所示數據僅供參考，不應就任何目的而加以倚賴。
本基金並非由Solactive AG或其各自的第三方供應商保薦、認可、銷售或推銷。
Solactive AG或其第三方供應商不作任何明示或暗示的保證，並謹此明確聲明，概不對最優投資組合參考價值、基金或當中所載任何基金數據就某一用途而言的適銷性或適用性作出任何保證。在任何情況下，Solactive AG概不就任何特殊、懲罰性、直接、間接或相應損失（包括利潤損失）承擔任何責任，即使Solactive AG知悉該等損失的風險。
本文所含資料僅供營銷之用，且僅供閣下參考。本文件不具有合約效力，亦無任何法律規定要求我們須向閣下提供。其不構成法律、稅務或投資建議，亦不構成對本資料任何讀者買賣投資的建議。因此，在作出任何投資決策時，閣下不得依賴本文件的內容。
投資者不應僅依賴於本文件中提供的資訊而投資本基金，並且應閱讀本基金的發售文件獲取詳情。本文件只提供一般性資料，並不針對任何可能收到本文件的人士的具體投資目標、財務狀況和特別需求。在此表達之意見可因應情況修改而不作另行通知。本文件並非銷售文件，且不構成建議、要約出售或招攬購買或認購任何投資。本文件所載任何預測、預計或目標僅供說明用途，且並非任何形式的保證。滙豐環球投資管理（香港）有限公司（「滙豐環球投資管理」）就預測、預計或目標未能達成概不承擔任何責任。本文件內的資料乃取自滙豐環球投資管理合理地相信可靠的來源。然而，無論明示或暗示，滙豐環球投資管理不保證、擔保或代表本文件內該等資料的準確性、有效性或完整性。投資附帶風險，過去的業績並不代表將來的表現。此文件並未經證券及期貨事務監察委員會批閱。版權 © HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited （滙豐環球投資管理（香港）有限公司）2026。版權所有。
本文件由HSBC Asset Management (Hong Kong) Limited （滙豐環球投資管理（香港）有限公司）刊發。
有關詞彙的定義，請參閱詞彙表二維碼。
資料來源：滙豐投資管理，數據截至 **2026**年**10**月**31**日

關注我們:
HSBC Asset Management
網站：
www.assetmanagement.hsbc.com/hk

術語

www.assetmanagement.hsbc.com.hk/api/v1/download/document/lu0164865239/hk/zh/glossary