

第CF(QR)號表格

《強制性公積金計劃條例》（第485章）

成分基金每季統計資料申報表

注意：

- (1) 本表格必須由成分基金（基金）所屬註冊計劃（計劃）的核准受託人（受託人）填報。
- (2) 計劃的受託人請參閱《註冊計劃每季統計資料申報表指引》，以便提交計劃的基金的每季統計資料申報表。
- (3) 計劃的受託人在填寫本表格前，請先細閱本表格的註釋。
- (4) 本表格所有問題均須回答。如有任何問題不適用，請填上「不適用」。
- (5) *請刪去不適用者。

只供管理局填寫

檔號： _____ 收訖日期： _____

負責人員： _____ 資料輸入員： _____

第I部—基金的資料

- (1) 基金名稱： _____
- (2) 基金所屬計劃的名稱： _____
- (3) 計劃受託人的名稱： _____

第II部—報告季度

截至右列季度： 3月／ 6月／ 9月／ 12月*
年

第III部—投資概況

用以釐定投資概況的基準：交易日／結算日*

(1) 資產分配^{註1}

請列出基金所持有各項資產的比重（包括基金所投資的基礎匯集投資基金內各投資項目的比率）：

	存款及現金 %	債務證券** %	股票 %	其他 %	總計 %
香港					
北美					
日本					
亞洲#					
歐洲					
其他					
總計					

**包括可轉換債務證券

不包括日本及香港，但包括澳洲、新西蘭及印度

(2) 有效貨幣風險^{註2}

請按淨資產值的百分比列出基金的有效貨幣風險（包括基金所投資的基礎匯集投資基金內各投資項目的比率）：

	(%)
港元	_____
美元	_____
日圓	_____
亞洲貨幣（不包括日圓及港元，但包括澳元、新西蘭元及印度盧比）	_____
歐元	_____
其他貨幣	_____
總計	100

(3) 投資回報^{註3}

季內的淨投資回報(%)：

計算基準：

註釋

1. 資產分配

收集及編製這項資料的目的，是對基金的主要投資類別（即存款、債務證券及股票等）進行高層次的評估，以及評估基金的地域及貨幣風險分布。

以聯接基金或投資組合管理基金形式運作的成分基金，其貨幣風險應是各基礎基金的貨幣風險總和。填報資產分配時，須根據下列各項，以每類投資項目佔基金淨資產值的百分比表示：

- (a) 存款及現金須按有關帳戶面值貨幣計算。
- (b) 債務證券（包括債券及可轉換債務證券）須按面值貨幣計算。
- (c) 股票（包括認股權證、美國預託證券及環球預託證券）須按其第一上市國家／地區填報。

2. 有效貨幣風險

這項資料須反映季度終結時，各種貨幣對基金所造成的經濟風險。

某特定貨幣的有效貨幣風險應按該貨幣所佔淨資產值的百分比計算，並因應任何未平倉貨幣遠期合約而調節。以聯接基金或投資組合管理基金形式運作的成分基金，其貨幣風險應是各基礎基金的貨幣風險總和。

3. 投資回報

- (a) 就單位化的基金而言，季度的淨投資回報應是以港元單位淨資產值為計算基礎的基本回報，即：

$$\{[\text{單位淨資產值（截至匯報季度終結為止）} / \text{單位淨資產值（截至上一季度終結為止）}] - 1\} \times 100。$$

- (b) 就非單位化的保證基金而言，計算淨投資回報的方法應與上述方法一致，並須披露計算基礎。