

汇丰投资信托基金 – 汇丰亚洲高收益债券基金

2025年中期报告



HSBC Global Asset Management
汇丰 环球投资管理

汇丰亚洲高收益债券基金
(汇丰投资信托基金之子基金)

2025 年中期报告

目录

	页数
1 汇丰投资信托基金	
11 亚洲高收益债券基金	
财务状况表	1
全面收益表	3
份额持有人应占资产净值变动表	5
现金流量表	12
投资组合报表	13
投资组合变动表	27
金融衍生工具明细表	28
业绩表现记录	36
收益分配表	45
证券借贷安排和抵押品持有明细表	49
2 行政	65

财务状况表

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

	2025年1月31日 美元	2024年7月31日 美元
资产		
以公允价值计入损益账的金融资产	1,090,922,241	1,113,977,023
应收利息	20,285,413	22,061,060
应收申购款	10,157,904	5,064,456
应收经纪商款项	9,232,107	21,719,686
现金及现金等价物	11,277,433	8,089,723
	<u>1,141,875,098</u>	<u>1,170,911,948</u>
负债		
以公允价值计入损益账的金融负债	6,485,437	6,657,407
应付赎回款	4,741,155	5,944,055
应付经纪商款项	11,212,168	8,215,606
应付税项	28,453	28,601
应付分配	5,778,113	6,559,151
其他应付款	1,120,745	1,358,301
	<u>29,366,071</u>	<u>28,763,121</u>
基金份额持有人应占资产净值	<u>1,112,509,027</u>	<u>1,142,148,827</u>
相当于： 金融负债	<u>1,112,509,027</u>	<u>1,142,148,827</u>
	份额	份额
已发行份额总数		
- AC类 - 港元	604,909	886,136
- AC类 - 新加坡元	420,282	426,461
- AC类 - 美元	3,442,460	3,927,043
- AM2类 - 港元	289,333,312	288,673,671
- AM2类 - 新加坡元	3,189,874	3,322,181
- AM2类 - 美元	99,284,676	104,682,894
- AM3H类 - 澳元	9,262,792	10,635,035
- AM3H类 - 欧元	1,977,182	2,412,278
- AM3H类 - 人民币	46,120,328	50,477,664
- AM3H类 - 新加坡元	6,465,523	7,458,968
- BC类 - 港元	257,570	250,430
- BC类 - 人民币	26,997,982	6,451,037
- BC类 - 美元	1,936,136	1,838,110

财务状况表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

	2025年1月31日 份额	2024年7月31日 份额
已发行份额总数(续)		
- BCH 类 - 人民币	5,714,195	4,384,883
- BM2 类 - 港元	2,947,704	3,389,667
- BM2 类 - 人民币	49,612,110	20,276,966
- BM2 类 - 美元	7,406,429	6,433,348
- BM3H 类 - 澳元	646,065	631,092
- BM3H 类 - 人民币	31,301,891	24,868,995
- IC 类 - 美元	16,283,224	16,316,285
- IM2 类 - 港元	187,685	187,685
- IM2 类 - 美元	1,882,787	2,851,152
- IM3H 类 - 新加坡元	69,884	79,774
- ZD2 类 - 美元	419,660	359,778
	美元	美元
份额净值		
- AC 类 - 港元	1.597	1.592
- AC 类 - 新加坡元	5.351	5.333
- AC 类 - 美元	12.417	12.375
- AM2 类 - 港元	0.617	0.641
- AM2 类 - 新加坡元	3.679	3.823
- AM2 类 - 美元	4.792	4.978
- AM3H 类 - 澳元	2.882	3.136
- AM3H 类 - 欧元	4.703	5.092
- AM3H 类 - 人民币	0.641	0.673
- AM3H 类 - 新加坡元	3.589	3.782
- BC 类 - 港元	1.026	1.022
- BC 类 - 人民币	1.118	1.115
- BC 类 - 美元	7.972	7.945
- BCH 类 - 人民币	1.081	1.103
- BM2 类 - 港元	0.676	0.702
- BM2 类 - 人民币	0.735	0.764
- BM2 类 - 美元	5.224	5.426
- BM3H 类 - 澳元	3.230	3.516
- BM3H 类 - 人民币	0.708	0.743
- IC 类 - 美元	8.943	8.895
- IM2 类 - 美元	4.993	5.176
- IM2 类 - 港元	1.291	1.319
- IM3H 类 - 新加坡元	7.092	7.458
- ZD2 类 - 美元	6.180	6.121

注：中期报告执行与本子基金年度报告相同的会计政策和计算方法。

全面收益表

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2025 年 1 月 31 日止期间

	2024 年 8 月 1 日至 2025 年 1 月 31 日 美元	2023 年 8 月 1 日至 2024 年 1 月 31 日 美元
利息收入	90,782	105,235
股息收入	645,219	751,158
以公允价值计入损益账的金融工具的收益净值	9,005,885	19,792,872
净汇兑(亏损)/收益	(175,286)	163,953
其他收入	287,072	540,448
收入总额	9,853,672	21,353,666
管理费 ^{附注 2}	6,754,138	7,263,515
交易费用 ^{附注 1}	39,261	51,235
受托人费用 ^{附注 1}	396,811	425,921
基金注册登记机构费用 ^{附注 1}	123,874	120,566
审计师酬金	5,997	6,069
律师费及专业人员费用 ^{附注 1}	2,952	1,686
保管费、银行手续费及杂费 ^{附注 1}	2,510,504	699,752
总经营开支	9,833,537	8,568,744
税前经营净利润	20,135	12,784,922
税项	-	(1,198)
收益分配前经营净利润	20,135	12,783,724
向基金份额持有人的收益分配	(36,866,552)	(48,161,678)
本期份额持有人应占资产净值和全面收益总额减少	(36,846,417)	(35,377,954)

全面收益表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2025 年 1 月 31 日止期间

附注 1: 在分别截至2025年和2024年1月31日止的期间, 除支付给受托人/关联人士的受托人费用和基金注册登记机构费用外, 支付给受托人/关联人士的其他相关款项如下:

	2024年8月1日至 2025年1月31日 美元	2023年8月1日至 2024年1月31日 美元
交易成本	17,421	19,043
律师费及专业人员费用	2,952	1,686
保管费、银行手续费及杂费	43,215	46,469

附注 2: 在分别截至2025年和2024年1月31日止的期间, 除支付给管理人的管理费外, 未向管理人/关联人士支付任何其他款项。

份额持有人应占资产净值变动表

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2025 年 1 月 31 日止期间

	2024年8月1日至 2025年1月31日 美元	2023年8月1日至 2024年1月31日 美元
期初余额	1,142,148,827	1,450,175,365
本期份额持有人应占资产净值和全面收益总额减少	(36,846,417)	(35,377,954)
份额认/申购(不含均衡)		
- AC 类 - 港元	17,511	775
- AC 类 - 新加坡元	1,767	2,219
- AC 类 - 美元	1,275,998	927,692
- AM2 类 - 港元	32,115,865	7,204,073
- AM2 类 - 美元	208,760,489	155,062,839
- AM2 类 - 新加坡元	91,722	2,484,486
- AM3H 类 - 澳元	3,274,967	5,530,331
- AM3H 类 - 欧元	507,026	1,069,241
- AM3H 类 - 人民币	3,068,062	1,702,360
- AM3H 类 - 新加坡元	480,202	1,175,081
- BC 类 - 港元	21,331	3,721
- BC 类 - 人民币	29,399,066	10,098
- BC 类 - 美元	1,690,077	357,285
- BCH 类 - 人民币	9,357,429	162,288
- BM2 类 - 港元	136,609	47,869
- BM2 类 - 人民币	24,657,953	201,594
- BM2 类 - 美元	8,197,932	261,790
- BM3H 类 - 澳元	82,723	5,106
- BM3H 类 - 人民币	6,659,910	103,387
- IC 类 - 美元	427,652	164,762
- IM2 类 - 美元	-	2,096,504
- IM3H 类 - 新加坡元	-	86,311
- ZD2 类 - 美元	663,665	-
份额赎回(不含均衡)		
- AC 类 - 港元	(475,660)	(647,249)
- AC 类 - 新加坡元	(33,740)	(750,327)
- AC 类 - 美元	(7,228,983)	(22,270,965)
- AM2 类 - 港元	(31,617,191)	(40,741,741)
- AM2 类 - 美元	(235,553,911)	(267,163,359)
- AM2 类 - 新加坡元	(594,818)	(1,834,710)
- AM3H 类 - 澳元	(7,687,883)	(14,527,490)
- AM3H 类 - 欧元	(2,749,887)	(1,218,433)
- AM3H 类 - 人民币	(5,953,699)	(10,873,919)
- AM3H 类 - 新加坡元	(4,355,988)	(5,040,811)

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2025 年 1 月 31 日止期间

	2024年8月1日至 2025年1月31日 美元	2023年8月1日至 2024年1月31日 美元
份额赎回(不含均衡)		
- BC 类 - 港元	(14,041)	(79,183)
- BC 类 - 人民币	(8,129,768)	(483,008)
- BC 类 - 美元	(910,765)	(5,045,481)
- BCH 类 - 人民币	(7,661,972)	(1,064,994)
- BM2 类 - 港元	(449,971)	(272,410)
- BM2 类 - 人民币	(1,120,221)	(1,642,781)
- BM2 类 - 美元	(2,798,522)	(6,762,151)
- BM3H 类 - 澳元	(30,379)	(181,495)
- BM3H 类 - 人民币	(1,691,982)	(4,107,908)
- IC 类 - 美元	(702,552)	(2,369,829)
- IM2 类 - 港元	-	(20,494,765)
- IM2 类 - 美元	(5,019,256)	(22,163,117)
- IM3H 类 - 新加坡元	(75,530)	(91,171)
- ZD2 类 - 美元	(295,857)	(1,349,039)
认购和赎回均衡	1,471,237	4,668,034
	<u>7,206,617</u>	<u>(247,848,490)</u>
期末余额	<u>1,112,509,027</u>	<u>1,166,948,921</u>
	份额	份额
AC 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	886,136	1,396,560
期间发行份额数	11,023	554
期间赎回份额数	(292,250)	(449,264)
结转后期已发行份额数	<u>604,909</u>	<u>947,850</u>
AC 类 - 新加坡元份额		
结转前期已发行份额数	426,461	607,166
期间发行份额数	335	451
期间赎回份额数	(6,514)	(158,722)
结转后期已发行份额数	<u>420,282</u>	<u>448,895</u>

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2025 年 1 月 31 日止期间

	2024年8月1日至 2025年1月31日 份额	2023年8月1日至 2024年1月31日 份额
AC 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	3,927,043	6,872,518
期间发行份额数	103,659	83,857
期间赎回份额数	(588,242)	(2,055,255)
结转后期已发行份额数	<u>3,442,460</u>	<u>4,901,120</u>
AM2 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	288,673,671	343,436,694
期间发行份额数	49,493,387	11,601,946
期间赎回份额数	(48,833,746)	(64,720,874)
结转后期已发行份额数	<u>289,333,312</u>	<u>290,317,766</u>
AM2 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	104,682,894	136,050,778
期间发行份额数	41,607,046	32,414,089
期间赎回份额数	(47,005,264)	(55,268,186)
结转后期已发行份额数	<u>99,284,676</u>	<u>113,196,681</u>
AM2 类 - 新加坡元份额		
结转前期已发行份额数	3,322,181	2,934,366
期间发行份额数	22,985	664,588
期间赎回份额数	(155,292)	(482,576)
结转后期已发行份额数	<u>3,189,874</u>	<u>3,116,378</u>
AM3H 类 - 澳元份额		
结转前期已发行份额数	10,635,035	13,089,979
期间发行份额数	1,019,598	1,868,455
期间赎回份额数	(2,391,841)	(4,696,329)
结转后期已发行份额数	<u>9,262,792</u>	<u>10,262,105</u>

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2025 年 1 月 31 日止期间

	2024年8月1日至 2025年1月31日 份额	2023年8月1日至 2024年1月31日 份额
AM3H 类 - 欧元份额		
结转前期已发行份额数	2,412,278	2,969,917
期间发行份额数	101,823	211,423
期间赎回份额数	(536,919)	(243,592)
结转后期已发行份额数	<u>1,977,182</u>	<u>2,937,748</u>
AM3H 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	50,477,664	62,970,810
期间发行份额数	4,508,829	2,634,932
期间赎回份额数	(8,866,165)	(17,216,760)
结转后期已发行份额数	<u>46,120,328</u>	<u>48,388,982</u>
AM3H 类 - 新加坡元份额		
结转前期已发行份额数	7,458,968	9,116,978
期间发行份额数	123,641	339,026
期间赎回份额数	(1,117,086)	(1,386,334)
结转后期已发行份额数	<u>6,465,523</u>	<u>8,069,670</u>
BC 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	250,430	497,530
期间发行份额数	21,115	3,958
期间赎回份额数	(13,975)	(88,611)
结转后期已发行份额数	<u>257,570</u>	<u>412,877</u>

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2025 年 1 月 31 日止期间

	2024年8月1日至 2025年1月31日 份额	2023年8月1日至 2024年1月31日 份额
BC 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	6,451,037	4,018,391
期间发行份额数	28,546,107	10,406
期间赎回份额数	(7,999,162)	(490,904)
结转后期已发行份额数	<u>26,997,982</u>	<u>3,537,893</u>
BC 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	1,838,110	2,663,285
期间发行份额数	213,408	50,289
期间赎回份额数	(115,382)	(720,478)
结转后期已发行份额数	<u>1,936,136</u>	<u>1,993,096</u>
BCH 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	4,384,883	5,676,242
期间发行份额数	8,631,568	156,710
期间赎回份额数	(7,302,256)	(1,069,784)
结转后期已发行份额数	<u>5,714,195</u>	<u>4,763,168</u>
BM2 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	3,389,667	3,924,520
期间发行份额数	193,250	72,051
期间赎回份额数	(635,213)	(394,691)
结转后期已发行份额数	<u>2,947,704</u>	<u>3,601,880</u>
BM2 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	20,276,966	14,516,537
期间发行份额数	30,735,373	277,276
期间赎回份额数	(1,400,229)	(2,188,238)
结转后期已发行份额数	<u>49,612,110</u>	<u>12,605,575</u>

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2025 年 1 月 31 日止期间

	2024 年 8 月 1 日至 2025 年 1 月 31 日 份额	2023 年 8 月 1 日至 2024 年 1 月 31 日 份额
BM2 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	6,433,348	7,883,358
期间发行份额数	1,484,867	49,031
期间赎回份额数	(511,786)	(1,280,262)
结转后期已发行份额数	<u>7,406,429</u>	<u>6,652,127</u>
BM3H 类 - 澳元份额		
结转前期已发行份额数	631,092	730,182
期间发行份额数	23,267	1,494
期间赎回份额数	(8,294)	(51,801)
结转后期已发行份额数	<u>646,065</u>	<u>679,875</u>
BM3H 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	24,868,995	31,957,151
期间发行份额数	8,702,133	143,369
期间赎回份额数	(2,269,237)	(5,692,203)
结转后期已发行份额数	<u>31,301,891</u>	<u>26,408,317</u>
IC 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	16,316,285	16,488,533
期间发行份额数	47,293	20,987
期间赎回份额数	(80,354)	(325,380)
结转后期已发行份额数	<u>16,283,224</u>	<u>16,184,140</u>
IM2 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	187,685	30,696,710
期间发行份额数	-	-
期间赎回份额数	-	(30,696,710)
结转后期已发行份额数	<u>187,685</u>	<u>-</u>

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2025 年 1 月 31 日止期间

	2024年8月1日至 2025年1月31日 份额	2023年8月1日至 2024年1月31日 份额
IM2 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	2,851,152	6,481,047
期间发行份额数	-	403,764
期间赎回份额数	(968,365)	(4,546,177)
结转后期已发行份额数	<u>1,882,787</u>	<u>2,338,634</u>
IM3H 类 - 新加坡元份额		
结转前期已发行份额数	79,774	79,774
期间发行份额数	-	12,346
期间赎回份额数	(9,890)	(12,346)
结转后期已发行份额数	<u>69,884</u>	<u>79,774</u>
ZD2 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	359,778	1,313,547
期间发行份额数	108,239	-
期间赎回份额数	(48,357)	(238,326)
结转后期已发行份额数	<u>419,660</u>	<u>1,075,221</u>

现金流量表

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2025 年 1 月 31 日止期间

	2024年8月1日至 2025年1月31日 美元	2023年8月1日至 2024年1月31日 美元
经营活动		
已收利息	92,979	105,394
已收股息	645,219	751,158
已付管理费	(6,965,120)	(7,474,376)
已付受托人费用	(409,146)	(438,411)
购买投资的付款	(2,306,719,230)	(2,047,522,891)
出售投资的所得款项(包括已收投资的息票利息)	2,354,907,448	2,327,890,345
存放于经纪商的保证金存款	6,921,424	543,570
存放于经纪商的抵押品	(5,770,000)	3,450,000
应付现金抵押品	(193,354)	-
已付税项	(148)	(1,330)
其他已付经营开支	(2,585,040)	(193,140)
经营活动产生的现金净额	39,925,032	277,110,319
融资活动		
份额发行所得款项(含均衡)	324,447,860	190,387,090
份额赎回付款(含均衡)	(323,537,592)	(429,196,650)
已付分配	(37,647,590)	(51,011,374)
融资活动使用的现金净额	(36,737,322)	(289,820,934)
现金和现金等价物增加/(减少)净额	3,187,710	(12,710,615)
期初现金和现金等价物	8,089,723	32,871,290
期末现金和现金等价物	11,277,433	20,160,675

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

金融资产	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
债务证券			
债券			
上市投资			
澳大利亚			
麦格理集团有限公司 2049年12月31日	2,650,000	2,671,844	0.24
英属维尔京群岛			
CAS CAPITAL NO1 LTD 4% 永续债券 2049年12月31日	12,644,000	12,233,437	1.10
CELESTIAL DYNASTY LTD 6.375% 2028年8月22日	4,789,000	4,341,846	0.39
CENTRAL PLAZA DEV LTD 3.85% 2025年7月14日	4,233,000	4,189,654	0.38
CFAMC IV CO LTD 4.5% 2029年5月29日	5,000,000	4,789,800	0.43
CHAMPION PATH HOLDINGS 4.5% 2026年1月27日	3,538,000	3,484,479	0.31
CHAMPION PATH HOLDINGS 4.85% 2028年1月27日	2,000,000	1,914,278	0.17
ELECT GLOBAL INV LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	4,900,000	4,645,322	0.42
FORTUNE STAR BVI LTD 5% 2026年5月18日	3,434,000	3,307,402	0.30
FORTUNE STAR BVI LTD 5.05% 2027年1月27日	3,459,000	3,264,666	0.29
FORTUNE STAR BVI LTD 8.5% 2028年5月19日	13,673,000	13,789,549	1.24
FORTUNE STAR BVI LTD 8.5% 2028年5月19日	3,479,000	3,504,278	0.31
方兴光耀有限公司 3.2% 2026年4月9日	3,300,000	3,144,591	0.28
方兴光耀有限公司 4.25% 2029年7月23日	14,230,000	11,951,492	1.07
方兴光耀有限公司浮息永续债券 2049年12月31日	914,000	891,852	0.08
HUARONG FINANCE 2017 CO 4.25% 2027年11月7日	8,192,000	7,971,635	0.72

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

债券	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资(续)			
英属维尔京群岛(续)			
HUARONG FINANCE 2019 3.375% 2030年2月24日	2,722,000	2,453,257	0.22
HUARONG FINANCE 2019 3.625% 2030年9月30日	2,300,000	2,071,403	0.19
HUARONG FINANCE 2019 3.875% 2029年11月13日	1,500,000	1,392,240	0.12
LS FINANCE 2025 LTD 4.5% 2025年6月26日	2,272,000	2,192,740	0.20
新城环球有限公司 4.5% 2026年5月2日	636,000	530,815	0.05
新城环球有限公司 4.625% 2025年10月15日	4,285,000	3,908,229	0.35
NWD FINANCE (BVI) LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	442,000	116,195	0.01
NWD FINANCE (BVI) LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	1,000,000	220,110	0.02
NWD MTN LTD 4.125% 2029年7月18日	4,744,000	2,161,974	0.19
RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 5.9% 2025年3月5日	500,000	184,222	0.02
RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 6.7% 2024年9月30日	7,381,000	2,543,649	0.23
RKPF OVERSEAS 2020 A LTD 5.125% 2030年1月26日	3,338,000	1,082,908	0.10
RKPF OVERSEAS 2020 A LTD 5.2% 2026年1月12日	6,053,000	2,092,787	0.19
STAR ENERGY GEOTHERMAL WAYANG WINDU LTD 6.75% 2033年4月24日	1,364,000	1,027,854	0.09
STUDIO CITY CO LTD 7% 2027年2月15日	5,000,000	5,046,290	0.45
STUDIO CITY FINANCE LTD 5% 2029年1月15日	850,000	775,260	0.07
STUDIO CITY FINANCE LTD 6% 2025年7月15日	6,980,000	6,976,056	0.63
STUDIO CITY FINANCE LTD 6.5% 2028年1月15日	10,206,000	9,965,087	0.90
		128,165,357	11.52

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

债券	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资(续)			
开曼群岛			
阿里巴巴集团控股有限公司 3.5% 2044年11月28日	37,310,000	5,178,179	0.47
中国宏桥集团有限公司 7.05% 2028年1月10日	3,826,000	3,875,275	0.35
一嗨信息技术服务有限公司 2027年9月26日	6,641,000	4,630,563	0.42
一嗨信息技术服务有限公司 7% 2026年9月21日	5,805,000	4,178,004	0.38
富卫集团控股有限公司 7.635% 2031年7月2日	10,000,000	10,634,310	0.96
富卫集团控股有限公司 8.4% 2029年4月5日	9,025,000	9,483,912	0.85
富卫有限公司浮息永续债券 2049年12月31日	5,919,000	5,701,181	0.51
绿城中国控股有限公司 4.7% 2025年4月29日	706,000	699,118	0.06
健合(H&H)国际控股有限公司 9.125% 2028年7月24日	2,791,000	2,822,723	0.25
龙湖集团控股有限公司 3.375% 2027年4月13日	4,500,000	3,729,271	0.33
龙湖集团控股有限公司 3.85% 2032年1月13日	14,117,000	9,541,116	0.86
龙湖集团控股有限公司 3.95% 2029年9月16日	6,598,000	4,908,124	0.44
龙湖地产有限公司 4.5% 2028年1月16日	12,600,000	10,339,661	0.93
美团 0% 可转换 2028年4月27日	6,000,000	5,739,000	0.52
MELCO RESORTS FINANCE 4.875% 2025年6月6日	5,000,000	4,985,935	0.45
MELCO RESORTS FINANCE 5.25% 2026年4月26日	5,000,000	4,969,372	0.45
MELCO RESORTS FINANCE 5.375% 2029年12月4日	15,757,000	14,595,110	1.31
MELCO RESORTS FINANCE 5.625% 2027年7月17日	4,693,000	4,589,552	0.41
MELCO RESORTS FINANCE 7.625% 2032年4月17日	5,000,000	4,998,900	0.45

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资(续)			
开曼群岛(续)			
美高梅中国控股有限公司 4.75% 2027年2月1日	2,893,000	2,840,047	0.25
美高梅中国控股有限公司 5.25% 2025年6月18日	2,000,000	1,992,572	0.18
美高梅中国控股有限公司 5.875% 2026年5月15日	5,000,000	5,003,825	0.45
美高梅中国控股有限公司 7.125% 2031年6月26日	8,894,000	9,073,445	0.82
当代置业(中国)有限公司 9% 2024年12月28日	1,281,679	9,574	0.00
当代置业(中国)有限公司 9% 2026年12月30日	6,595,721	64,770	0.01
当代置业(中国)有限公司浮息债券 2024年12月30日	2,926,074	27,944	0.00
当代置业(中国)有限公司浮息债券 2025年12月30日	4,946,789	50,210	0.00
当代置业(中国)有限公司浮息债券 2027年12月30日	9,626,086	72,484	0.01
弘阳地产集团 9.5% 2023年9月20日	5,183,000	58,464	0.00
力高地产集团 11% 2023年8月6日	10,908,819	52,379	0.00
力高地产集团 9.9% 2024年2月17日	5,120,000	51,917	0.00
新城控股集团股份有限公司 4.45% 2025年7月13日	2,749,000	2,594,369	0.23
融创中国控股有限公司 2025年9月30日	2,769,710	232,656	0.02
融创中国控股有限公司 2026年9月30日	6,125,000	540,531	0.05
融创中国控股有限公司 FRN 2027年9月30日	21,441,370	1,892,201	0.17
融创中国控股有限公司 FRN 2028年9月30日	11,215,866	1,048,123	0.09
融创中国控股有限公司 FRN 2030年9月30日	4,879,420	444,393	0.04
永利澳门有限公司 5.125% 2029年12月15日	11,293,000	10,525,810	0.95
永利澳门有限公司 5.5% 2027年10月1日	12,278,000	12,025,221	1.08
永利澳门有限公司 5.5% 2026年1月15日	11,265,000	11,237,941	1.01

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资(续)			
开曼群岛(续)			
永利澳门有限公司 5.625% 2028年8月26日	5,500,000	5,311,383	0.48
		<u>180,749,565</u>	<u>16.24</u>
中国内地			
温氏食品集团股份有限公司 2.349% 2025年10月29日	8,449,000	8,216,517	0.74
香港			
FEC FINANCE LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	9,464,000	9,345,700	0.84
普洛斯中国控股有限公司 2.95% 2026年3月29日	20,012,000	17,747,902	1.60
MN MINING/ENERGY RESOURC 12.5% 2026年9月 13日	10,595,000	11,582,539	1.04
PINGAN REAL ESTATE CAP 3.45% 2026年7月29日	3,063,000	2,798,744	0.25
XIAOMI BEST TIME INTL 0% 可转换 2027年12月 17日	1,500,000	1,786,228	0.16
阳光城嘉世国际有限公司 8.25% 2023年11月25日	7,264,000	30,364	0.00
阳光城嘉世国际有限公司 9.25% 2023年4月15日	4,860,000	-	-
仁恒地产(香港)有限公司 5.125% 2026年5月20日	5,252,000	5,001,136	0.45
		<u>48,292,613</u>	<u>4.34</u>

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资(续)			
印度			
10 RENEW POWER SUBSIDIARY 4.5% 2028年7月14日	4,525,000	4,227,171	0.38
CONTINUUM GRN SPV CO-ISS 7.5% 2033年6月26日	9,481,000	9,557,748	0.86
INDIABULLS HOUSING FIN 9.7% 2027年7月3日	6,884,000	6,922,378	0.62
IRB INFRASTRUCTURE DEVE 7.11% 2032年3月11日	10,632,000	10,757,330	0.97
JSW STEEL LTD 5.05% 2032年4月5日	6,000,000	5,410,419	0.48
MANAPPURAM FINANCE LTD 7.375% 2028年5月12日	2,300,000	2,310,218	0.21
MUTHOOT FINANCE LTD 6.375% 2029年4月23日	4,600,000	4,541,806	0.41
MUTHOOT FINANCE LTD 7.125% 2028年2月14日	2,000,000	2,037,696	0.18
PIRAMAL CAPITAL & HOUS 7.8% 2028年1月29日	3,250,000	3,227,708	0.29
RENEW POWER PVT LTD 5.875% 2027年3月5日	5,737,000	5,641,341	0.51
SAEL LTD GROUP ISSUERS 7.8% 2031年7月31日	8,000,000	8,053,836	0.72
SHRIRAM FINANCE LTD 6.15% 2028年4月3日	2,800,000	2,767,880	0.25
SHRIRAM FINANCE LTD 6.625% 2027年4月22日	3,300,000	3,322,358	0.30
		68,777,889	6.18
印度尼西亚			
BANK BUKOPIN PT 5.658% 2027年10月30日	12,180,000	12,088,699	1.09
印度尼西亚国家银行浮息永续债券 2049年12月31日	2,500,000	2,385,629	0.21
FREEPOR T INDONESIA PT 6.2% 2052年4月14日	5,000,000	4,944,940	0.44
INDIKA INTI ENERGI PT 8.75% 2029年5月7日	4,700,000	4,854,111	0.44
INDOFOOD CBP SUKSES MAK M 4.745% 2051年6月9日	10,000,000	8,151,950	0.73
印度尼西亚共和国(政府) 5.45% 2052年9月20日	10,000,000	9,668,140	0.87

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资(续)			
印度尼西亚(续)			
印度尼西亚(共和国) 3.7% 2049年10月30日	2,500,000	1,851,830	0.17
印度尼西亚(共和国) 4.3% 2052年3月31日	5,000,000	4,063,865	0.37
PERTAMINA (PERSERO) PT 4.175% 2050年1月21日	7,500,000	5,684,434	0.51
PERTAMINA PERSERO 5.625% 2043年5月20日	14,500,000	13,701,079	1.23
PERTAMINA PERSERO 6.45% 2044年5月30日	9,500,000	9,695,804	0.87
PERTAMINA PERSERO 6% 2042年5月3日	5,000,000	4,889,045	0.44
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 4% 2050年6月30日	5,000,000	3,474,020	0.31
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 4.375% 2050年2月5日	5,000,000	3,740,580	0.34
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 4.875% 2049年7月17日	8,500,000	6,805,788	0.61
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 5.25% 2047年5月15日	10,000,000	8,635,390	0.78
PERUSAHAAN PENERBIT SBSN 5.65% 2054年11月25日	20,000,000	19,540,240	1.76
PT INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM AND PT MINERAL INDUSTRI INDONESIA (PERSERO) 5.8% 2050年5月15日	7,000,000	6,487,943	0.58
PT PAKUWON JATI 4.875% 2028年4月29日	6,477,000	6,242,260	0.56
		136,905,747	12.31
日本			
第一生命控股株式会社浮息永续债券 2049年12月31日	8,000,000	8,130,768	0.73
乐天集团 11.25% 2027年2月15日	1,400,000	1,531,842	0.14
乐天集团 9.75% 2029年4月15日	1,583,000	1,731,873	0.16
乐天集团浮息永续债券 2049年12月31日	7,862,000	7,796,572	0.70
RAKUTEN GROUP INC VAR PERP 31 DECEMBER 2049	4,000,000	3,863,002	0.35

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资(续)			
日本(续)			
乐天集团浮息永续债券 2049年12月31日	1,000,000	893,893	0.08
软银集团 7% 2031年7月8日	10,000,000	10,162,790	0.91
		<hr/>	<hr/>
		34,110,740	3.07
		<hr/>	<hr/>
泽西岛			
中国西部水泥有限公司 4.95% 2026年7月8日	6,906,000	5,148,143	0.46
		<hr/>	<hr/>
毛里求斯			
CA MAGNUM HOLDINGS 5.375% 2026年10月31日	8,000,000	7,872,000	0.71
CLEAN RENEWABLE POWER 4.25% 2027年3月25日	8,893,000	7,175,980	0.65
DIAMOND II LTD 7.95% 2026年7月28日	11,200,000	11,392,612	1.02
GREENKO POWER II LTD 4.3% 2028年12月13日	6,000,000	4,715,357	0.42
GREENKO POWER II LTD 4.3% 2028年12月13日	4,190,000	3,280,859	0.29
INDIA GREEN POWER HOLDING 4% 2027年2月22日	9,189,000	8,224,457	0.74
NETWORK I2I LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	5,000,000	4,899,790	0.44
UPL CORP LTD 4.5% 2028年3月8日	5,200,000	4,819,282	0.43
UPL CORP LTD 4.625% 2030年6月16日	7,500,000	6,590,220	0.59
UPL CORP LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	12,456,000	11,850,327	1.07
		<hr/>	<hr/>
		70,820,884	6.36
		<hr/>	<hr/>

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资(续)			
蒙古			
蒙古乌兰巴托市 7.75% 2027年8月21日	6,500,000	6,654,375	0.60
GOLOMT BANK OF MONGOLIA 11% 2027年5月20日	13,752,000	14,424,177	1.30
蒙古国际债券 5.125% 2026年4月7日	2,000,000	1,975,140	0.18
MONGOLIAN MORTGAGE CO 11.5% 2027年1月18日	3,800,000	3,842,642	0.34
		<hr/>	<hr/>
		26,896,334	2.42
		<hr/>	<hr/>
荷兰			
GREENKO DUTCH BV 3.85% 2026年3月29日	7,500,000	6,543,932	0.59
MINEJESA CAPITAL BV 5.625% 2037年8月10日	18,000,000	17,032,734	1.53
MONG DUONG FIN HLDGS BV 5.125% 2029年5月7日	251,000	183,987	0.02
		<hr/>	<hr/>
		23,760,653	2.14
		<hr/>	<hr/>
巴基斯坦			
巴基斯坦伊斯兰共和国 6.875% 2027年12月5日	2,500,000	2,328,899	0.21
巴基斯坦(共和国) 6% 2026年4月8日	2,866,000	2,776,359	0.25
巴基斯坦(共和国) 7.375% 2031年4月8日	5,941,000	5,154,108	0.46
巴基斯坦(共和国) 8.25% 2025年9月30日	4,500,000	4,496,992	0.41
巴基斯坦(共和国) 8.875% 2051年4月8日	2,100,000	1,705,682	0.15
		<hr/>	<hr/>
		16,462,040	1.48
		<hr/>	<hr/>
菲律宾			
PETRON CORP 浮息永续债券 2049年12月31日	4,000,000	3,985,398	0.36
菲律宾(共和国) 3.2% 2046年7月6日	10,000,000	6,887,180	0.62
菲律宾(共和国) 5.6% 2049年5月14日	14,500,000	14,111,850	1.27
菲律宾共和国 5.9% 2050年2月4日	9,633,000	9,694,362	0.87

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资(续)			
菲律宾(续)			
SAN MIGUEL CORP 浮息永续债券 2049年12月31日	3,428,000	3,409,108	0.31
SAN MIGUEL GLOBAL POWER 浮息永续债券 2049年12月31日	14,300,000	14,919,719	1.34
SAN MIGUEL GLOBAL POWER 浮息永续债券 2049年12月31日	10,000,000	10,140,910	0.91
SMC GLOBAL POWER HLDGS 浮息永续债券 2049年12月31日	2,547,000	2,460,775	0.22
SMC GLOBAL POWER HOLDINGS 浮息永续债券 2049年12月31日	1,842,000	1,825,851	0.16
		67,435,153	6.06
新加坡			
CONTINUUM ENERGY AURA 9.5% 2027年2月24日	5,359,000	5,609,019	0.50
GLP PTE LTD 3.875% 2025年6月4日	13,504,000	12,969,080	1.17
GLP PTE LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	6,000,000	3,298,530	0.30
JGC VENTURES PTE LTD 3% 2025年6月30日	1,830,769	714,000	0.06
LLPL CAPITAL PTE LTD 6.875% 2039年2月4日	7,000,000	5,361,690	0.48
MEDCO BELL PTE LTD 6.375% 2027年1月30日	2,500,000	2,518,937	0.23
MEDCO LAUREL TREE 6.95% 2028年11月12日	5,300,000	5,338,769	0.48
MEDCO MAPLE TREE PTE LTD 8.96% 2029年4月27日	5,300,000	5,627,259	0.51
MODERNLAND OVERSEAS PTE 6.95% 2027年4月30日	4,147,368	1,259,763	0.11
MODERNLAND OVERSEAS PTE LTD 2027年4月30日	62,211	19,130	0.00
		42,716,177	3.84

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资(续)			
斯里兰卡			
斯里兰卡共和国 2038年2月15日	9,619,083	7,959,791	0.72
斯里兰卡共和国 2035年6月15日	5,486,763	3,909,319	0.35
斯里兰卡共和国 4% 2028年4月15日	5,475,156	4,786,381	0.43
斯里兰卡共和国 STP 2033年3月15日	8,125,768	6,480,300	0.58
斯里兰卡共和国 STP 2036年5月15日	3,807,940	3,107,317	0.28
		26,243,108	2.36
泰国			
曼谷盘谷银行有限公司/香港浮息债券 2034年9月25日	3,000,000	2,738,460	0.24
开泰银行大众有限公司香港浮息债券 2031年10月2日	9,800,000	9,423,058	0.85
泰京银行/开曼 4.4% 永续债券 2049年12月31日	8,764,000	8,589,377	0.77
MUANGTHAI CAPITAL PCL 6.875% 2028年9月30日	6,141,000	6,205,023	0.56
		26,955,918	2.42
英国			
BIOCON BIOLOGICS GLOBAL 6.67% 2029年10月9日	12,778,000	12,469,232	1.12
渣打集团浮息永续债券 2049年12月31日	10,442,000	9,397,831	0.84
渣打集团浮息永续债券 2049年12月31日	7,027,000	7,268,399	0.65
渣打集团浮息永续债券 2049年12月31日	12,000,000	12,054,948	1.09
渣打集团浮息永续债券 2049年12月31日	4,850,000	5,027,733	0.45

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资(续)			
英国(续)			
VEDANTA RESOURCES 10.25% 2028年6月3日	9,000,000	9,228,173	0.83
VEDANTA RESOURCES 10.875% 2029年9月17日	16,000,000	16,664,912	1.50
VEDANTA RESOURCES 11.25% 2031年12月3日	11,633,000	12,379,897	1.11
VEDANTA RESOURCES 9.475% 2030年7月24日	8,646,000	8,648,862	0.78
VEDANTA RESOURCES 9.85% 2033年4月24日	7,763,000	7,837,319	0.71
		<u>100,977,306</u>	<u>9.08</u>
美国			
RESORTS WORLD/RWLV CAP 4.625% 2029年4月16日	8,000,000	7,120,416	0.64
SASOL FINANCING USA LLC 5.5% 2031年3月18日	3,500,000	2,951,907	0.26
SASOL FINANCING USA LLC 8.75% 2029年5月3日	3,500,000	3,557,950	0.32
US TREASURY N/B 4.5% 2054年11月15日	3,500,000	3,334,023	0.30
		<u>16,964,296</u>	<u>1.52</u>
未上市但有报价的投资			
英属维尔京群岛			
FLOURISH CENTURY HOLDINGS 6.6% 2049年2月4日	8,000,000	<u>0.00</u>	<u>0.00</u>
开曼群岛			
MELCO RESORTS FINANCE 高级 S 条例债券 (S 条例) 5.75% 2028年7月21日	3,220,000	<u>3,083,794</u>	<u>0.28</u>

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
未上市但有报价的投资(续)			
印度尼西亚			
PT PERTAMINA (PERSERO) 高级 S 条例债券 (S 条例) 4.15% 2060年2月25日	10,000,000	7,136,450	0.64
毛里求斯			
INDIA CLEAN ENERGY HOLDINGS 4.5% 2027年4月18 日	7,200,000	6,867,000	0.62
荷兰			
JABABEKA INTERNATIONAL 高级 S 条例债券 (S 条 例) STP 2027年12月15日	16,528,000	16,460,632	1.48
债务证券(合计)		1,065,818,160	95.80
单位信托			
上市投资			
爱尔兰			
汇丰环球流动性基金 PL *	16,368,266	16,368,266	1.47
卢森堡			
HSBC INVESTMENT FUNDS LUXEMBOURG SA/LUXEMBOURG-HSBC-ASIAN CURRENCIES BD- ZD	849,608	6,210,634	0.56
单位信托			
未上市但有报价的投资			
香港			
汇丰全方位中国债券基金 ZC-美元	150,000	1,758,900	0.16
单位信托(合计)		24,337,800	2.19

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
衍生资产		
外币远期合同	766,281	0.07
金融资产合计	<u>1,090,922,241</u>	<u>98.06</u>
金融负债		
衍生负债		
外币远期合同	(943,188)	(0.08)
信用违约互换	(5,524,333)	(0.50)
期货合同	(17,916)	(0.00)
金融负债合计	<u>(6,485,437)</u>	<u>(0.58)</u>
总投资		
(投资成本合计: 1,120,706,339 美元)	<u>1,084,436,804</u>	<u>97.48</u>
其他资产净值	<u>28,072,223</u>	<u>2.52</u>
资产净值总额	<u>1,112,509,027</u>	<u>100.00</u>

投资组合变动表

汇丰亚洲高收益债券基金

2024年8月1日至2025年1月31日期间

	占资产净值百分比 2025年1月31日	占资产净值百分比 2024年7月31日
金融资产		
债务证券		
债券		
上市投资	92.78	91.97
未上市但有报价的投资	3.02	4.43
债务证券(合计)	<u>95.80</u>	<u>96.40</u>
单位信托		
上市投资	2.03	0.87
未上市但有报价的投资	0.16	0.15
单位信托(合计)	<u>2.19</u>	<u>1.02</u>
衍生资产		
外币远期合同	0.07	0.07
期货合同	-	0.04
	<u>0.07</u>	<u>0.11</u>
金融负债		
衍生负债		
外币远期合同	(0.08)	(0.06)
期货合同	(0.00)	-
信用违约互换	(0.50)	(0.52)
	<u>(0.58)</u>	<u>(0.58)</u>
总投资	97.48	96.95
其他资产净值	2.52	3.05
资产净值总额	<u>100.00</u>	<u>100.00</u>

金融衍生工具明细表

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

外币远期合同

2025年1月31日，本基金持有的未平仓外币远期合同如下：

货币/ 买入金额	货币/ 卖出金额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
金融资产：				
43,468,450澳元	27,088,451美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	27,077
3,346,039澳元	2,085,168美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	2,084
8,799,619欧元	9,123,058美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	34,536
31,501,629新加坡 元	23,204,287美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	62,842
671,484新加坡元	494,619美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	1,340
906,281美元	6,552,707元离 岸人民币	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	6,601
411,438美元	654,656澳元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	3,047
170,405美元	1,238,619元离 岸人民币	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	356
55,465美元	403,748元离岸 人民币	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	36
19,087美元	138,193元离岸 人民币	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	113
6,490美元	10,264澳元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	88
6,219美元	45,150元离岸人 民币	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	21

金融衍生工具明细表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

外币远期合同(续)

2025年1月31日，本基金持有的未平仓外币远期合同如下：

货币/ 买入金额	货币/ 卖出金额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
金融资产(续):				
5,328美元	38,683元离岸 人民币	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	18
2,618美元	19,026元离岸 人民币	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	5
6,250,000欧元	6,514,310美元	2025年3月31日	道富银行和信托公 司香港分行	251
1,000,000,000 日元	6,433,577美元	2025年3月31日	巴黎银行巴黎分行	65,230
200,000,000泰 铢	5,820,834美元	2025年3月31日	巴黎银行巴黎分行	137,338
192,000,000泰 铢	5,557,936美元	2025年3月31日	汇丰市场财资服务 香港	161,697
12,092,060美元	11,600,000欧元	2025年3月31日	法国东方汇理银行	1,028
5,795,019美元	42,000,000元离岸 人民币	2025年3月31日	汇丰市场财资服务 香港	19,914
5,661,753美元	8,000,000,000韩元	2025年3月31日	汇丰市场财资服务 香港	141,911
5,612,066美元	8,000,000,000韩元	2025年3月31日	美林国际伦敦	92,467
1,131,624美元	8,200,000元离岸 人民币	2025年3月31日	西太平洋银行悉尼 分行	4,103
456,691美元	3,300,000元离岸 人民币	2025年3月31日	法国东方汇理银行	2,927

金融衍生工具明细表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

外币远期合同(续)

2025年1月31日，本基金持有的未平仓外币远期合同如下：

货币/ 买入金额	货币/ 卖出金额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
金融资产(续)：				
276,257美元	2,000,000元离 岸人民币	2025年3月31日	汇丰市场财资服 务香港	1,251
				<hr/>
				766,281
				<hr/>

金融衍生工具明细表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

外币远期合同(续)

2025年1月31日，本基金持有的未平仓外币远期合同如下：

货币/ 买入金额	货币/ 卖出金额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
金融负债：				
1,773澳元	1,110美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(4)
788澳元	493美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(2)
490澳元	310美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(4)
300澳元	188美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(1)
223,804,857元离岸人民币	30,774,976美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(49,758)
161,758,000元离岸人民币	22,243,032美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(35,964)
44,101,478元离岸人民币	6,064,309美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(9,805)
735,077元离岸人民币	101,260美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(344)
48,774元离岸人民币	6,738美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(42)
40,138元离岸人民币	5,522美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(12)
5,489元离岸人民币	754美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(0)
2,742元离岸人民币	378美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(2)

金融衍生工具明细表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

外币远期合同(续)

2025年1月31日，本基金持有的未平仓外币远期合同如下：

货币/ 买入金额	货币/ 卖出金额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
金融负债(续):				
1,042元离岸人民币	144美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(1)
700元离岸人民币	96美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(0)
398元离岸人民币	55美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(0)
99元离岸人民币	14美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(0)
129,214欧元	134,826美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(352)
8,820欧元	9,270美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(91)
6,860欧元	7,146美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(7)
191欧元	199美元	2025年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(0)
90,500,000,000印尼 盾	5,690,832美元	2025年3月27日	西太平洋银行悉尼 分行	(148,305)
5,508,887美元	90,500,000,000印尼 盾	2025年3月27日	澳新银行墨尔本分 行	(32,335)
107,000,000元离岸 人民币	14,732,758美元	2025年3月31日	汇丰市场财资服务 香港	(20,054)
5,500,000欧元	5,806,591美元	2025年3月31日	法国东方汇理银行	(73,256)
840,000,000日元	5,682,821美元	2025年3月31日	瑞银集团伦敦分行	(221,859)

金融衍生工具明细表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

外币远期合同(续)

2025年1月31日，本基金持有的未平仓外币远期合同如下：

货币/ 买入金额	货币/ 卖出金额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
金融负债(续):				
16,000,000,000韩元	11,055,822美元	2025年3月31日	瑞银集团伦敦分行	(17,409)
11,631,841美元	,800,000,000日元	2025年3月31日	汇丰市场财资服务 香港	(66,793)
9,743,498美元	71,000,000元离 岸人民币	2025年3月31日	瑞银集团伦敦分行	(18,966)
5,901,265美元	43,000,000元离 岸人民币	2025年3月31日	道富银行和信托公 司香港分行	(11,214)
5,807,226美元	200,000,000泰铢	2025年3月31日	巴黎银行巴黎分行	(151,921)
5,694,203美元	192,000,000泰铢	2025年3月31日	汇丰市场财资服务 香港	(26,578)
5,582,416美元	41,000,000元离 岸人民币	2025年3月31日	瑞银集团伦敦分行	(54,883)
1,373,426美元	10,000,000元离 岸人民币	2025年3月31日	汇丰市场财资服务 香港	(1,574)
258,318美元	40,000,000日元	2025年3月31日	西太平洋银行悉尼 分行	(1,652)
				<u>(943,188)</u>

金融衍生工具明细表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

期货

2025年1月31日，本基金持有的期货合同详情如下：

描述	标的资产	合同规模	名义市场价值	状态	交易对手	公允价值 美元
金融负债：						
US 10YR NOTE (CBT) 20/03/2025	US 10YR NOTE	1000	45,170,156	空头	汇丰银行	(17,916)
						<hr/>
						(17,916)
						<hr/>

金融衍生工具明细表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年1月31日

信用违约互换

2025年1月31日，本基金持有的信用违约互换详情如下：

标的资产	交易对手	公允价值 美元
金融负债：		
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 116 147,000,000.00 EUR 06/12/2024 20/12/2024	美林国际	(3,401,667)
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 112 36,000,000.00 USD 04/09/2024 20/06/2029	巴黎银行巴黎分行	(2,122,666)
		<u>(5,524,333)</u>

业绩表现记录

汇丰亚洲高收益债券基金

(a) 价格纪录(交易份额净值)

年份	AC 类 - 港元份额			
	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2014	11.103	12.670	11.447	13.062
2015	11.948	12.793	12.610	13.502
2016	12.188	13.968	12.863	14.742
2017	13.684	15.013	14.592	15.848
2018	14.112	14.999	14.897	15.829
2019	14.059	15.891	14.059	15.891
2020	13.860	17.050	13.860	17.050
2021	16.880	17.875	16.880	17.875
2022	11.155	17.472	11.155	17.472
2023	10.189	12.756	10.189	12.756
2024	10.782	12.359	10.782	12.359
2024年8月1日至2025年1月31日	12.349	12.768	12.349	12.768

年份	AC 类 - 新加坡元份额			
	买入		卖出	
	最低 新加坡元	最高 新加坡元	最低 新加坡元	最高 新加坡元
2014	11.137	12.386	11.482	12.770
2015	12.313	13.648	12.995	14.404
2016	13.388	14.895	14.130	15.270
2017	14.652	16.149	15.426	17.044
2018	15.418	15.854	16.271	16.733
2019	-	-	-	-
2020	8.773	10.163	8.773	10.163
2021	9.977	10.381	9.977	10.381
2022	6.627	10.219	6.627	10.219
2023	6.078	7.198	6.078	7.198
2024	6.262	7.125	6.262	7.125
2024年8月1日至2025年1月31日	6.965	7.362	6.965	7.362

业绩表现记录(续)

AC 类 - 美元份额				
年份	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2014	11.128	12.702	11.473	13.095
2015	11.970	12.825	12.633	13.536
2016	12.217	13.993	12.894	14.768
2017	13.706	14.952	14.465	15.780
2018	13.980	14.903	14.755	15.729
2019	13.957	15.790	13.957	15.790
2020	13.927	17.156	13.927	17.156
2021	16.931	17.927	16.931	17.927
2022	11.057	17.466	11.057	17.466
2023	10.094	12.645	10.094	12.645
2024	10.554	12.377	10.554	12.377
2024年8月1日至2025年1月31日	12.338	12.772	12.338	12.772
AM2 类 - 港元份额				
年份	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2014	9.800	10.553	10.104	10.880
2015	9.664	10.593	10.199	11.180
2016	9.445	10.304	9.968	10.875
2017	9.943	10.382	10.260	10.957
2018	9.450	10.378	9.976	10.956
2019	9.209	9.952	9.209	10.213
2020	8.361	10.150	8.361	10.150
2021	9.388	10.173	9.388	10.173
2022	5.566	9.585	5.566	9.585
2023	4.883	5.986	4.883	5.986
2024	4.600	5.032	4.600	5.032
2024年8月1日至2025年1月31日	4.799	5.067	4.799	5.067
AM2 类 - 新加坡元份额				
年份	买入		卖出	
	最低 新加坡元	最高 新加坡元	最低 新加坡元	最高 新加坡元
2020	9.995	10.616	9.995	10.616
2021	9.748	10.653	9.748	10.653
2022	5.891	9.984	5.891	9.984
2023	5.092	6.213	5.092	6.213
2024	4.868	5.197	4.868	5.197
2024年8月1日至2025年1月31日	4.957	5.111	4.957	5.111

业绩表现记录(续)

年份	AM2 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2014	9.821	10.584	10.125	10.912
2015	9.686	10.624	10.223	11.213
2016	9.449	10.327	9.973	10.899
2017	9.964	10.405	10.204	10.982
2018	9.354	10.329	9.872	10.901
2019	9.139	9.885	9.139	10.113
2020	8.381	10.121	8.381	10.121
2021	9.386	10.200	9.386	10.200
2022	5.517	9.570	5.517	9.570
2023	4.834	5.949	4.834	5.949
2024	4.576	5.004	4.576	5.004
2024年8月1日至2025年1月31日	4.788	5.066	4.788	5.066

年份	AM3H 类 - 澳元份额			
	买入		卖出	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2014	9.887	10.281	10.193	10.599
2015	9.391	10.319	9.911	10.891
2016	9.176	10.052	9.684	10.609
2017	9.690	10.123	9.953	10.684
2018	9.131	10.075	9.637	10.634
2019	8.917	9.634	8.917	9.872
2020	8.131	9.871	8.131	9.871
2021	9.110	9.897	9.110	9.897
2022	5.342	9.288	5.342	9.288
2023	4.676	5.746	4.676	5.746
2024	4.415	4.824	4.415	4.824
2024年8月1日至2025年1月31日	4.617	4.883	4.617	4.883

业绩表现记录(续)

年份	AM3H 类 - 欧元份额			
	买入		卖出	
	最低 欧元	最高 欧元	最低 欧元	最高 欧元
2014	10.009	10.334	10.319	10.654
2015	9.418	10.374	9.940	10.949
2016	9.117	9.918	9.622	10.468
2017	9.544	9.993	9.736	10.547
2018	8.884	9.849	9.376	10.394
2019	8.668	9.417	8.668	9.601
2020	8.000	9.646	8.000	9.646
2021	8.966	9.722	8.966	9.722
2022	5.252	9.139	5.252	9.139
2023	4.603	7.546	4.603	7.546
2024	4.335	4.727	4.335	4.727
2024年8月1日至2025年1月31日	4.521	4.783	4.521	4.783

年份	AM3H 类 - 人民币份额			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020	8.324	10.000	8.324	10.000
2021	9.257	10.094	9.257	10.094
2022	5.438	9.448	5.438	9.448
2023	4.754	5.818	4.754	5.818
2024	4.483	4.885	4.483	4.885
2024年8月1日至2025年1月31日	4.673	4.938	4.673	4.938

年份	AM3H 类 - 新加坡元份额			
	买入		卖出	
	最低 新加坡元	最高 新加坡元	最低 新加坡元	最高 新加坡元
2020	10.000	10.312	10.000	10.312
2021	9.621	10.455	9.621	10.455
2022	5.630	9.809	5.630	9.809
2023	4.931	6.059	4.931	6.059
2024	4.691	5.071	4.691	5.071
2024年8月1日至2025年1月31日	4.861	5.140	4.861	5.140

业绩表现记录(续)

年份	BC 类 - 港元份额			
	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2020	10.000	10.979	10.000	10.979
2021	10.835	11.478	10.835	11.478
2022	7.166	11.218	7.166	11.218
2023	6.542	8.191	6.542	8.191
2024	6.954	7.837	6.954	7.837
2024年8月1日至2025年1月31日	7.932	8.201	7.932	8.201

年份	BC 类 - 人民币份额			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020	10.000	10.830	10.000	10.830
2021	9.964	10.858	9.964	10.858
2022	6.720	10.189	6.720	10.189
2023	6.554	7.727	6.554	7.727
2024	6.960	8.097	6.960	8.097
2024年8月1日至2025年1月31日	7.916	8.281	7.916	8.281

年份	BC 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2020	10.000	11.015	10.000	11.015
2021	10.871	11.511	10.871	11.511
2022	7.099	11.215	7.099	11.215
2023	6.481	8.119	6.481	8.119
2024	6.802	7.930	6.802	7.930
2024年8月1日至2025年1月31日	7.922	8.201	7.922	8.201

年份	BCH 类 - 人民币份额			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020	10.000	11.106	10.000	11.106
2021	10.967	11.788	10.967	11.788
2022	7.479	11.566	7.479	11.566
2023	6.814	8.468	6.814	8.468
2024	6.962	7.975	6.962	7.975
2024年8月1日至2025年1月31日	7.844	8.166	7.844	8.166

业绩表现记录(续)

年份	BM2 类 - 港元份额			
	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2020	10.000	10.981	10.000	10.981
2021	10.286	11.152	10.286	11.152
2022	6.109	10.507	6.109	10.507
2023	5.352	6.565	5.352	6.565
2024	5.049	5.511	5.049	5.511
2024年8月1日至2025年1月31日	5.255	5.533	5.255	5.533

年份	BM2 类 - 人民币份额			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020	10.000	10.835	10.000	10.835
2021	9.300	10.803	9.300	10.803
2022	5.708	9.510	5.708	9.510
2023	5.348	6.181	5.348	6.181
2024	5.153	5.598	5.153	5.598
2024年8月1日至2025年1月31日	5.320	5.544	5.320	5.544

年份	BM2 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2020	10.000	10.952	10.000	10.952
2021	10.232	11.120	10.232	11.120
2022	6.015	10.432	6.015	10.432
2023	5.271	6.485	5.271	6.485
2024	4.988	5.456	4.988	5.456
2024年8月1日至2025年1月31日	5.216	5.522	5.216	5.522

年份	BM3H 类 - 澳元份额			
	买入		卖出	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2020	9.885	10.918	9.885	10.918
2021	10.220	11.087	10.220	11.087
2022	5.992	10.419	5.992	10.419
2023	5.244	6.443	5.244	6.443
2024	5.012	5.375	5.012	5.375
2024年8月1日至2025年1月31日	5.170	5.475	5.170	5.475

业绩表现记录(续)

年份	BM3H 类 - 人民币份额			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020	9.985	10.956	9.985	10.956
2021	10.199	11.117	10.199	11.117
2022	5.998	10.416	5.998	10.416
2023	5.250	6.427	5.250	6.427
2024	4.948	5.395	4.948	5.395
2024年8月1日至2025年1月31日	5.155	5.450	5.155	5.450

年份	IC 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2017	9.799	10.728	10.425	11.322
2018	10.019	10.728	10.574	11.322
2019	10.071	10.378	10.629	10.953
2020	9.840	12.136	9.840	12.136
2021	11.985	12.711	11.985	12.711
2022	7.883	12.409	7.883	12.409
2023	7.205	9.035	7.205	9.035
2024	7.730	8.710	7.730	8.710
2024年8月1日至2025年1月31日	8.884	9.189	8.884	9.189

年份	IM2 类 - 港元份额			
	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2021	9.543	10.121	9.543	10.121
2022	5.683	9.748	5.683	9.748
2023	4.993	6.119	4.993	6.119
2024	5.095	10.172	5.095	10.172
2024年8月1日至2025年1月31日	10.046	10.592	10.046	10.592

年份	IM2 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2020	8.561	10.334	8.561	10.334
2021	9.638	10.454	9.638	10.454
2022	5.687	9.830	5.687	9.830
2023	4.990	6.145	4.990	6.145
2024	4.780	5.203	4.780	5.203
2024年8月1日至2025年1月31日	4.989	5.271	4.989	5.271

业绩表现记录(续)

年份	IM3H 类 - 新加坡元份额			
	买入		卖出	
	最低 新加坡元	最高 新加坡元	最低 新加坡元	最高 新加坡元
2023	9.935	10.159	9.935	10.159
2024	9.554	9.786	9.554	9.786
2024年8月1日至2025年1月31日	9.605	10.145	9.605	10.145

年份	ZD2 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2017	9.711	10.684	10.388	11.276
2018	9.629	10.720	10.163	11.314
2019	9.382	10.703	9.382	10.703
2020	8.975	11.096	8.975	11.096
2021	9.969	11.023	9.969	11.023
2022	6.266	10.185	6.266	10.185
2023	5.530	6.950	5.530	6.950
2024	5.552	6.310	5.552	6.310
2024年8月1日至2025年1月31日	6.114	6.334	6.114	6.334

业绩表现记录(续)

(b) 总资产净值(按《香港财务报告准则》计算)

	2025年1月31日	2024 美元	2023 美元	2022 美元
总资产净值	1,112,509,027	1,142,148,827	1,450,175,365	1,706,435,867

(c) 份额净值(按《香港财务报告准则》计算)

	计价货币	2025年1月 31日	2024	2023	2022
份额净值					
- AC 类 - 港元	港元	12.443	12.437	11.394	11.649
- AC 类 - 新加坡元	新加坡元	7.252	7.133	6.497	6.877
- AC 类 - 美元	美元	12.417	12.375	11.361	11.543
- AM2 类 - 港元	港元	4.807	5.007	5.054	5.762
- AM2 类 - 美元	美元	4.792	4.978	5.035	5.703
- AM2 类 - 新加坡元	新加坡元	4.986	5.114	5.131	6.050
- AM3H 类 - 澳元	澳元	4.620	4.802	4.863	5.522
- AM3H 类 - 欧元	欧元	4.524	4.706	4.773	5.435
- AM3H 类 - 人民币	人民币	4.674	4.864	4.936	5.618
- AM3H 类 - 新加坡元	新加坡元	4.864	5.059	5.127	6.050
- BC 类 - 港元	港元	7.993	7.987	7.317	7.483
- BC 类 - 人民币	人民币	8.154	8.057	7.309	7.022
- BC 类 - 美元	美元	7.972	7.945	7.294	7.412
- BCH 类 - 人民币	人民币	7.883	7.973	7.500	7.809
- BM2 类 - 港元	港元	5.266	5.484	5.538	6.314
- BM2 类 - 人民币	人民币	5.361	5.521	5.521	5.905
- BM2 类 - 美元	美元	5.224	5.426	5.488	6.217
- BM3H 类 - 澳元	澳元	5.179	5.385	5.456	6.193
- BM3H 类 - 人民币	人民币	5.159	5.369	5.444	6.196
- IC 类 - 美元	美元	8.943	8.895	8.134	8.231
- IM2 类 - 港元	港元	10.059	10.304	5.178	5.880
- IM2 类 - 美元	美元	4.993	5.176	5.212	5.879
- IM3H 类 - 新加坡元	新加坡元	9.612	9.976	10.071	-
- ZD2 类 - 美元	美元	6.180	6.121	5.908	6.304

收益分配表

汇丰亚洲高收益债券基金

AM2 类 - 港元份额	除息日期	付款日期	每份额分配 港元	分配总额 港元
第 1 次分配	2024年8月30日	2024年9月10日	0.0361	10,208,646
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0360	10,320,605
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0338	10,210,143
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0333	9,766,312
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0331	9,499,991
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0326	9,430,737

AM2 类 - 美元份额	除息日期	付款日期	每份额分配 美元	分配总额 美元
第 1 次分配	2024年8月30日	2024年9月10日	0.0360	3,804,920
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0359	3,840,672
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月12日	0.0338	3,698,544
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0332	3,490,905
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0331	3,393,891
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0325	3,227,941

AM2 类 - 新加坡元份额	除息日期	付款日期	每份额分配 新加坡元	分配总额 新加坡元
第 1 次分配	2024年8月30日	2024年9月10日	0.0365	120,923
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0358	117,189
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0339	110,911
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0342	111,894
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0343	110,470
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0343	109,413

AM3H 类 - 澳元份额	除息日期	付款日期	每份额分配 澳元	分配总额 澳元
第 1 次分配	2024年8月30日	2024年9月10日	0.0312	334,568
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0309	310,725
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0301	289,771
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0304	299,499
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0309	300,013
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0303	280,663

收益分配表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

AM3H 类 - 欧元份额	除息日期	付款日期	每份额分配 欧元	分配总额 欧元
第 1 次分配	2024年8月30日	2024年9月10日	0.0277	65,678
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0275	57,647
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0257	53,182
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0258	53,732
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0257	53,711
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0252	49,825

AM3H 类 - 人民币份 额	除息日期	付款日期	每份额分配 人民币	分配总额 人民币
第 1 次分配	2024年8月30日	2024年9月10日	0.0242	1,193,670
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0186	914,697
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0177	877,321
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0220	1,083,500
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0271	1,296,949
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0267	1,230,817

AM3H 类 - 新加坡元份额	除息日期	付款日期	每份额分配 新加坡元	分配总额 新加坡元
第 1 次分配	2024年8月30日	2024年9月10日	0.0295	191,855
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0281	181,123
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0262	170,596
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0268	173,632
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0279	180,977
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0274	177,458

BM2 类 - 港元份额	除息日期	付款日期	每份额分配 港元	分配总额 港元
第 1 次分配	2024年8月30日	2024年9月10日	0.0396	134,928
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0395	130,813
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0370	123,503
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0364	106,994
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0363	105,669
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0357	105,233

收益分配表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

BM2 类 - 人民币份额	除息日期	付款日期	每份额分配 人民币	分配总额 人民币
第 1 次分配	2024年8月30日	2024年9月10日	0.0395	916,456
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0391	1,036,289
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0368	1,103,603
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0369	1,313,761
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0370	1,446,053
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0366	1,812,307

BM2 类 - 美元份额	除息日期	付款日期	每份额分配 美元	分配总额 美元
第 1 次分配	2024年8月30日	2024年9月10日	0.0393	258,176
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0391	265,948
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月12日	0.0368	265,796
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0362	268,232
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0361	264,938
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0354	261,913

BM3H 类 - 澳元份额	除息日期	付款日期	每份额分配 澳元	分配总额 澳元
第 1 次分配	2024年8月30日	2024年9月10日	0.0350	21,902
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0347	21,764
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0338	21,243
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0341	22,019
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0346	22,310
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0340	21,966

BM3H 类 - 人民币份额	除息日期	付款日期	每份额分配 人民币	分配总额 人民币
第 1 次分配	2024年8月30日	2024年9月10日	0.0266	688,369
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0205	563,849
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0195	622,052
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0242	767,706
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0300	946,255
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0295	924,197

收益分配表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

IM2 类 - 美元份额	除息日期	付款日期	每份额分配 美元	分配总额 美元
第 1 次分配	2024年8月30日	2024年9月10日	0.0374	106,169
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0373	94,748
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月12日	0.0351	89,160
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0346	72,708
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0345	71,483
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0338	63,638
IM2 类 - 港元份额	除息日期	付款日期	每份额分配 港元	分配总额 港元
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0707	13,269
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0696	13,063
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0693	13,007
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0682	12,800
IM3H 类 - 新加坡元份额	除息日期	付款日期	每份额分配 新加坡元	分配总额 新加坡元
第 1 次分配	2024年8月30日	2024年9月10日	0.0583	4,651
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0554	4,420
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0518	3,620
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0530	3,704
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0551	3,851
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0542	3,788

证券借贷安排和抵押品持有明细表

以下部分系依据香港证券及期货事务监察委员会颁布的《单位信托及互惠基金守则》之要求进行披露。

(A) 抵押品持有明细表

2025年1月31日

抵押品提供方	抵押品提供方信用评级 ¹	抵押品性质	非现金抵押品盯市价值(如适用) 美元	抵押品公允价值 美元
巴黎银行伦敦分行	AA-	固定收益证券	7,977,948	7,977,948
Jefferies International Limited (母公司)	BBB+	固定收益证券	5,297,338	5,297,338
摩根士丹利国际公司	AA-	固定收益证券	16,314,442	16,314,442
				<hr/>
				29,589,728
				<hr/>

2024年1月31日

无

¹ 惠誉评级赋予的信用评级

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(B) 固定收益抵押品信用评级

2025年1月31日

抵押品提供方	资产类别	评级机构	抵押品信用评级	抵押品公允价值 美元
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	1
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaau	1
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaau	1,508,873
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	36,405
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	1,508,873
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	4,658
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	27
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3u	1,499,480
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	1,496,405
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	6,799
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	42
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	A1	3,857
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	1,492,727
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	412,944
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	6,856
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1u	4,058
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1u	1,002
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	499,982
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	361,350
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	7,130
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	1
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	906
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	9,841
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	140,638
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	4,342
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	256
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	361,076
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	641,159
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	12,730
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	1,703
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	1,047
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	360,613

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(B) 固定收益抵押品信用评级(续)

2025年1月31日

抵押品提供方	资产类别	评级机构	抵押品信用评级	抵押品公允价值 美元
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	8,310
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	137
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	790,128
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	398,394
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	27,243
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	259,640
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	133,342
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	786
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	162
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	709,853
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	309,573
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	132,724
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	90,397
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	27,091
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	1,724
摩根士丹利国际公司	GIL	穆迪	Aa3u	3,099,744
摩根士丹利国际公司	GIL	穆迪	未评级	42,874
摩根士丹利国际公司	GIL	穆迪	未评级	4,303
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	未评级	3,094,908
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	63
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	815,234
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	88
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	3,065,133
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	3,095,888
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	3,096,207
				29,589,728

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表

证券借贷交易

截至 2025 年 1 月 31 日止期间

交易对手	抵押品类型	货币	剩余期限 ²	抵押品提供方 所在地	结算/清算	借出证券公允 价值 美元
Jefferies International Limited (母公司)	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	54,748,964
巴黎银行伦敦分行	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	84,477,400
摩根士丹利国际公司	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	87,845,759
						227,072,123

² 在截至2025年1月31日止的期间，当期借出但尚未归还的证券详见下表的披露。

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易

2025年1月31日

借出证券	抵押品类型	货币	剩余期限	证券借贷代理人所在地	现金抵押品 与非现金抵 押品占比	非现金抵 押品剩余 期限	结算/清算	占资产净值 百分比	借出证券公允 价值 ³ 美元
美高梅中国控 股有限公司 7.125% 2031 年 6 月 26 日	公司债	美元	无固定期 限	伦敦	0%		三方抵押品	0.18%	2,040,352
渣打集团浮息 永续债券 2049 年 12 月 31 日	公司债	美元	无固定期 限	伦敦	0%		三方抵押品	0.47%	5,171,765
渣打集团浮息 永续债券 2049 年 12 月 31 日	公司债	美元	无固定期 限	伦敦	0%		三方抵押品	0.68%	7,534,343
乐天集团浮息 永续债券 2049 年 12 月 31 日	公司债	美元	无固定期 限	伦敦	0%	详见下表	三方抵押品	0.04%	479,127
LS FINANCE 2025 LTD 4.5% 2025 年 6 月 26 日	公司债	美元	无固定期 限	伦敦	0%		三方抵押品	0.10%	1,158,137
CHAMPION PATH HOLDINGS 4.85% 2028 年 1 月 27 日	公司债	美元	无固定期 限	伦敦	0%		三方抵押品	0.16%	1,818,564
软银集团 7% 2031 年 7 月 8 日	公司债	美元	无固定期 限	伦敦	0%		三方抵押品	0.87%	9,654,651
								2.50%	27,856,939

³ 有关借出证券的信息基于本基金的会计记录。外币交易按折算日期的现行汇率折算为功能货币，资产和负债按期间终了日的现行汇率折算为功能货币。

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易抵押品

2025年1月31日

抵押品提供方	抵押品类型	货币	剩余期限	抵押品提供方所在地	现金抵押品与非现金抵押品占比	非现金抵押品剩余期限	结算/清算	抵押品覆盖的资产净值百分比	抵押品公允价值 美元
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年10月20日	三方抵押品	0.00%	4,058
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2027年4月20日	三方抵押品	0.00%	1,002
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年2月20日	三方抵押品	0.04%	499,982
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年3月28日	三方抵押品	0.03%	361,350
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2057年6月22日	三方抵押品	0.00%	7,130
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年6月22日	三方抵押品	0.00%	1
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年6月22日	三方抵押品	0.00%	1
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2043年6月22日	三方抵押品	0.00%	906
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2055年6月22日	三方抵押品	0.00%	9,841
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年6月22日	三方抵押品	0.01%	140,638
摩根士丹利国际公司	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2041年10月22日	三方抵押品	0.28%	3,099,744
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2048年8月15日	三方抵押品	0.00%	1

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易抵押品

2025年1月31日

抵押品提供方	抵押品类型	货币	剩余期限	抵押品提供方所在地	现金抵押品与非现金抵押品占比	非现金抵押品剩余期限	结算/清算	抵押品覆盖的资产净值百分比	抵押品公允价值美元
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年2月15日	三方抵押品	0.14%	1,508,873
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年5月15日	三方抵押品	0.00%	4,342
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年11月15日	三方抵押品	0.00%	256
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2034年7月4日	三方抵押品	0.03%	361,076
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2040年7月4日	三方抵押品	0.06%	641,159
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2042年7月4日	三方抵押品	0.00%	12,730
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年12月10日	三方抵押品	0.00%	36,405
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年4月18日	三方抵押品	0.14%	1,508,873
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2031年4月15日	三方抵押品	0.00%	4,658
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2034年4月25日	三方抵押品	0.00%	27
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年4月25日	三方抵押品	0.00%	1,703
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2039年6月25日	三方抵押品	0.00%	1,047
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2027年5月25日	三方抵押品	0.03%	360,613
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2048年5月25日	三方抵押品	0.00%	8,310

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易抵押品

2025年1月31日

抵押品提供方	抵押品类型	货币	剩余期限	抵押品提供方所在地	现金抵押品与非现金抵押品占比	非现金抵押品剩余期限	结算/清算	抵押品覆盖的资产净值百分比	抵押品公允价值美元
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年3月1日	三方抵押品	0.13%	1,499,480
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年2月25日	三方抵押品	0.13%	1,496,405
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年3月1日	三方抵押品	0.00%	137
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2036年3月1日	三方抵押品	0.07%	790,128
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2027年2月25日	三方抵押品	0.04%	398,394
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年5月25日	三方抵押品	0.00%	27,243
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年2月25日	三方抵押品	0.02%	259,640
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年11月25日	三方抵押品	0.00%	6,799
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年9月24日	三方抵押品	0.00%	42
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年9月24日	三方抵押品	0.01%	133,342
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年2月25日	三方抵押品	0.00%	786
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2055年5月25日	三方抵押品	0.00%	162
摩根士丹利国际公司	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2073年10月22日	三方抵押品	0.00%	42,874

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易抵押品

2025年1月31日

抵押品提供方	抵押品类型	货币	剩余期限	抵押品提供方所在地	现金抵押品与非现金抵押品占比	非现金抵押品剩余期限	结算/清算	抵押品覆盖的资产净值百分比	抵押品公允价值美元
摩根士丹利国际公司	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2038年1月29日	三方抵押品	0.00%	4,303
巴黎银行伦敦分行	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2036年12月20日	三方抵押品	0.00%	3,857
摩根士丹利国际公司	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2029年6月20日	三方抵押品	0.28%	3,094,908
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2042年1月15日	三方抵押品	0.06%	709,853
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2047年1月15日	三方抵押品	0.03%	309,573
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年1月15日	三方抵押品	0.13%	1,492,727
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2052年1月15日	三方抵押品	0.04%	412,944
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2049年8月15日	三方抵押品	0.00%	63
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2051年2月15日	三方抵押品	0.07%	815,234
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2052年11月15日	三方抵押品	0.00%	88
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2043年8月15日	三方抵押品	0.01%	132,724
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2053年11月15日	三方抵押品	0.28%	3,065,133
巴黎银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2026年7月15日	三方抵押品	0.00%	6,856
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2030年5月15日	三方抵押品	0.28%	3,095,888

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易抵押品

2025年1月31日

抵押品提供方	抵押品类型	货币	剩余期限	抵押品提供方所在地	现金抵押品与非现金抵押品占比	非现金抵押品剩余期限	结算/清算	抵押品覆盖的资产净值百分比	抵押品公允价值 美元
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028年3月31日	三方抵押品	0.01%	90,397
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2029年1月31日	三方抵押品	0.28%	3,096,207
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2027年11月30日	三方抵押品	0.00%	27,091
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2026年2月15日	三方抵押品	0.00%	1,724
								2.63%	29,589,728

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

回购交易

不适用。

(D) 借出的可转让证券

2025 年 1 月 31 日

借出的可转让证 券总值 ³ 美元	借出证券金额占可 借出资产总额的百 分比 ³ %	借出证券金额占本基 金管理资产规模的百 分比 ³ %	回购交易的绝 对金额 美元
27,856,939	2.7071	2.5040	不适用

2024 年 1 月 31 日

无

- 3 有关借出证券的信息基于本基金的会计记录。外币交易按折算日期的现行汇率折算为功能货币，资产和负债按期间终了日的现行汇率折算为功能货币。

(E) 使用现金抵押品进行的投资

不适用。截至 2025 年 1 月 31 日，本基金并未收到任何现金抵押品。

(F) 所收到属于再利用或再抵押的抵押品占最大授权金额(如有)的比例，以及有关证券类型限制(如适用)的信息

在截至 2025 年 1 月 31 日止期间，所收到的抵押品中无任何部分用于借出证券的再利用或再抵押。

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(G) 十大抵押品发行人

	抵押品公允价值 美元	占资产净值总 额的百分比 %
2025年1月31日		
巴黎银行伦敦分行	7,977,948	0.7171%
Jefferies International Limited (母公司)	5,297,338	0.4762%
摩根士丹利国际公司	16,314,442	1.4665%
	<hr/>	<hr/>
	29,589,728	2.6598%
	<hr/> <hr/>	<hr/> <hr/>
2024年1月31日		
无		

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(H) 本基金持仓收到的十大抵押品证券

	公允价值 美元	占资产净值总 额的百分比 %
2025年1月31日		
UNITED KINGDOM UKT 1 1/4 10/22/41	3,099,744	0.2786%
US TREASURY UST 1.750 01/31/29	3,096,207	0.2783%
US TREASURY UST 0.625 05/15/30	3,095,888	0.2783%
JAPAN JPGV 0.500 06/20/29	3,094,908	0.2782%
US TREASURY UST 4.750 11/15/53	3,065,133	0.2755%
GERMANY DEGV 2.400 04/18/30	1,508,873	0.1356%
GERMANY DEGV 0.250 02/15/29	1,508,873	0.1356%
FRANCE FRGV 0.100 03/01/29	1,499,480	0.1348%
FRANCE FRGV 02/25/26	1,496,405	0.1345%
NETHERLANDS NLGV 2.500 01/15/30	1,492,727	0.1342%
	22,958,238	2.0636%

2024年1月31日

无

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(I) 十大证券借贷和回购交易对手方

	2025年1月31日借出 证券的公允价值 ³ 美元	占2025年1月31日资 产净值总额的百分比 ³ %
巴黎银行伦敦分行	7,534,343	0.6772%
Jefferies International Limited (母公司)	5,017,053	0.4510%
摩根士丹利国际公司	15,305,543	1.3758%
	27,856,939	2.5040%

2024年1月31日

无

³ 有关借出证券的信息基于本基金的会计记录。外币交易按折算日期的现行汇率折算为功能货币，资产和负债按期间终了日的现行汇率折算为功能货币。

(J) 保管人及每家保管人持有的资产金额

	公允价值 2025年1月31日 美元
抵押品证券保管人 汇丰银行	29,589,728
	29,589,728

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(J) 保管人及每家保管人持有的资产金额(续)

公允价值
2025年1月31日
美元

借给借券人的证券保管人^{3,5} 27,856,939

2024年1月31日

无

³ 有关借出证券的信息基于本基金的会计记录。外币交易按折算日期的现行汇率折算为功能货币，资产和负债按期间终了日的现行汇率折算为功能货币。

⁴ 抵押品依据双边抵押品保管安排，通过汇丰银行的独立账户持有。

⁵ 所有借给借券人的证券均在独立账户中持有。汇丰银行担任证券借贷代理人，负责安排借券交易并管理抵押品。

⁶ 欧洲清算银行和摩根大通担任三方抵押品管理人，证券借贷代理人汇丰银行将某些抵押品管理、保证金计算和抵押品职能委托给三方抵押品管理人。

(K) 本基金通过证券借贷赚得的收入

	截至2025年1月 31日止期间 美元	截至2024年1月 31日止期间 美元
通过计划赚得的收入		
- 本基金的净利润	2,848	-
- 管理费	380	-
- HSS收入	570	-
	<u>3,797</u>	<u>-</u>

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(L) 证券借贷和回购交易收益与现金抵押品再投资收益的划分

	截至2025年1月3 1日止期间 美元	截至2024年1月3 1日止期间 美元
证券借贷和回购交易收益	3,797	
现金抵押品再投资收益	-	-

行政

管理人

汇丰投资基金(香港)有限公司
香港中环
皇后大道中1号
汇丰总行大厦

管理人董事

Michael CROSS
刘嘉燕
何慧芬
谭振邦
郭永嘉

投资顾问

汇丰环球投资管理(香港)有限公司
香港中环
皇后大道中1号
汇丰总行大厦

保管人、受托人和基金注册登记机构

汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司
香港中环
皇后大道中1号
汇丰总行大厦

审计师

毕马威会计师事务所
香港中环
遮打道10号
太子大厦8楼