

# 汇丰投资信托基金 — 汇丰亚洲债券基金

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
<b>1.汇丰投资信托基金</b>	
<b>1.1 汇丰亚洲债券基金</b>	
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	38
金融衍生工具明细表	39
业绩表现记录	49
收益分配表	57
证券借贷安排和抵押品持有明细表	61
<b>2.行政</b>	82

# 财务状况表

## 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	2025年1月31日 美元	2024年7月31日 美元
<b>资产</b>		
以公允价值计入损益账的金融资产	3,051,264,328	1,181,372,535
应收利息	36,069,542	12,405,118
应收申购款	123,018,216	14,288,930
应收经纪商款项	130,622,796	27,359,965
其他应收账款	-	4,709
现金及现金等价物	16,175,212	4,498,392
	<u>3,357,150,094</u>	<u>1,239,929,649</u>
<b>负债</b>		
以公允价值计入损益账的金融负债	11,738,880	5,475,545
应付赎回款	7,801,271	6,937,797
应付经纪商款项	220,811,954	32,755,478
应付税项	28,737	28,877
应付分配	4,589,381	5,046,748
其他应付款	2,526,257	1,155,009
	<u>247,496,480</u>	<u>51,399,454</u>
<b>基金份额持有人应占资产净值</b>	<u>3,109,653,614</u>	<u>1,188,530,195</u>
相当于： <b>金融负债</b>	<u>3,109,653,614</u>	<u>1,188,530,195</u>
	<b>份额</b>	<b>份额</b>
<b>已发行份额总数</b>		
- AC 类 - 美元	80,888	83,756
- AM2 类 - 港元	152,961,606	166,787,173
- AM2 类 - 美元	62,752,423	64,121,253
- AM3H 类 - 澳元	10,279,415	10,074,149
- AM3H 类 - 加元	-	15,307
- AM3H 类 - 欧元	1,137,258	923,313
- AM3H 类 - 英镑	67,172	11,298
- AM3H 类 - 人民币	12,298,323	12,768,592
- BC 类 - 港元	316,160	315,129
- BC 类 - 人民币	1,532,980,886	143,150,834
- BC 类 - 美元	2,738,358	523,064
- BCH 类 - 人民币	55,918,688	1,795,157
- BM2 类 - 港元	1,292,668	906,197
- BM2 类 - 人民币	83,230,843	53,373,011

# 财务状况表(续)

## 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	2025年1月31日 份额	2024年7月31日 份额
<b>已发行份额总数(续)</b>		
- BM2 类 - 美元	2,616,770	1,517,221
- BM3H 类 - 澳元	276,295	187,243
- BM3H 类 - 人民币	19,119,244	11,836,086
- IC 类 - 美元	973,669	2,024,614
- ID2 类 - 美元	348,297	408,726
- IM2 类 - 美元	25,107,168	24,402,275
- ZD2 类 - 美元	1,017,665	1,804,517
	美元	美元
<b>份额净值</b>		
- AC 类 - 美元	13.517	13.407
- AM2 类 - 港元	0.965	0.985
- AM2 类 - 美元	6.777	6.921
- AM3H 类 - 澳元	4.417	4.726
- AM3H 类 - 加元	-	16.437
- AM3H 类 - 欧元	7.246	7.713
- AM3H 类 - 英镑	12.250	12.940
- AM3H 类 - 人民币	0.985	1.017
- BC 类 - 港元	1.213	1.203
- BC 类 - 人民币	1.326	1.315
- BC 类 - 美元	9.498	9.422
- BCH 类 - 人民币	1.229	1.248
- BM2 类 - 港元	0.963	0.983
- BM2 类 - 人民币	1.057	1.080
- BM2 类 - 美元	7.516	7.676
- BM3H 类 - 澳元	4.626	4.950
- BM3H 类 - 人民币	1.017	1.050
- IC 类 - 美元	14.224	14.077
- ID2 类 - 美元	8.702	8.612
- IM2 类 - 美元	7.394	7.534
- ZD2 类 - 美元	8.920	8.803

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	110,926	58,488
股息收入	163,685	84,365
以公允价值计入损益账的金融工具的收益净值	11,412,044	28,506,287
外汇收入净值	542,501	114,894
其他收入	354,927	188,900
<b>收入总额</b>	<b>12,584,083</b>	<b>28,952,934</b>
管理费 <sup>附注 2</sup>	8,250,119	5,133,132
交易费用 <sup>附注 1</sup>	76,577	15,686
受托人费用 <sup>附注 1</sup>	615,767	401,444
基金注册登记机构费用 <sup>附注 1</sup>	77,846	72,078
审计师酬金	7,497	7,587
律师费及专业人员费用 <sup>附注 1</sup>	1,455	1,686
保管费、银行手续费及杂费 <sup>附注 1</sup>	2,340,849	524,730
<b>总经营开支</b>	<b>11,370,110</b>	<b>6,156,343</b>
<b>税前经营净利润</b>	<b>1,213,973</b>	<b>22,796,591</b>
税项	-	-
<b>收益分配前经营净利润</b>	<b>1,213,973</b>	<b>22,796,591</b>
向基金份额持有人的收益分配	(28,864,922)	(31,094,330)
<b>本期份额持有人应占资产净值减少</b>	<b>(27,650,949)</b>	<b>(8,297,739)</b>

## 全面收益表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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	21,624	7,299
律师费及专业人员费用	1,455	1,387
保管费、银行手续费及杂费	62,429	35,798

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	1,188,530,195	1,341,206,208
本期份额持有人应占资产净值和全面收益总额减少	(27,650,949)	(8,297,739)
<b>份额认/申购(不含均衡)</b>		
- AC 类 - 美元	87,702	146,293
- AM2 类 - 港元	41,677,726	8,739,043
- AM2 类 - 美元	57,721,890	11,105,865
- AM3H 类 - 澳元	14,229,719	5,190,170
- AM3H 类 - 加元	-	621,631
- AM3H 类 - 欧元	3,775,325	41,009
- AM3H 类 - 英镑	877,717	8,678
- AM3H 类 - 人民币	3,381,973	15,493,813
- BC 类 - 港元	25,157	83,902
- BC 类 - 人民币	1,340,174,947	670,929
- BC 类 - 美元	22,646,926	711,092
- BCH 类 - 人民币	173,978,471	130,885
- BM2 类 - 港元	522,575	231,320
- BM2 类 - 人民币	66,554,726	3,305,676
- BM2 类 - 美元	10,994,582	1,292,729
- BM3H 类 - 澳元	467,626	157,242
- BM3H 类 - 人民币	15,386,326	1,257,532
- ID2 类 - 美元	82,737	86,739
- IM2 类 - 美元	5,389,455	7,036,394
- ZD2 类 - 美元	7,069,208	2,747,901
<b>份额赎回(不含均衡)</b>		
- AC 类 - 美元	(126,875)	(631,389)
- AM2 类 - 港元	(54,989,246)	(70,528,684)
- AM2 类 - 美元	(66,491,404)	(122,424,251)
- AM3H 类 - 澳元	(12,930,267)	(13,949,455)
- AM3H 类 - 加元	(238,354)	(72,719)
- AM3H 类 - 欧元	(2,017,189)	(4,820,001)
- AM3H 类 - 英镑	(132,776)	-
- AM3H 类 - 人民币	(3,744,001)	(14,423,555)
- BC 类 - 港元	(24,711)	(2,402)
- BC 类 - 人民币	(59,226,215)	(78,622)
- BC 类 - 美元	(3,229,413)	(95,681)
- BCH 类 - 人民币	(22,984,648)	(67,109,485)



## 份额持有人应占资产净值变动表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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
- BM2 类 - 港元	(86,743)	(159,401)
- BM2 类 - 人民币	(25,531,506)	(129,118)
- BM2 类 - 美元	(1,726,429)	(576,875)
- BM3H 类 - 澳元	(1,143)	(44,759)
- BM3H 类 - 人民币	(6,541,624)	(543,908)
- IC 类 - 美元	(14,593,418)	(2,317,713)
- ID2 类 - 美元	(604,940)	(3,717,412)
- ZD2 类 - 美元	(13,802,504)	(9,677,340)
	<hr/>	<hr/>
认购和赎回均衡	472,752,986	1,197,275
	<hr/>	<hr/>
	1,948,774,368	(251,046,652)
	<hr/>	<hr/>
期末余额	3,109,653,614	1,081,861,817
	<hr/>	<hr/>
	份额	份额
AC 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	83,756	128,560
期间发行份额数	6,809	24,924
期间赎回份额数	(9,677)	(65,011)
	<hr/>	<hr/>
结转后期已发行份额数	80,888	88,473
	<hr/>	<hr/>
AM2 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	166,787,173	250,387,891
期间发行份额数	41,949,391	11,157,429
期间赎回份额数	(55,774,958)	(74,732,413)
	<hr/>	<hr/>
结转后期已发行份额数	152,961,606	186,812,907
	<hr/>	<hr/>

## 份额持有人应占资产净值变动表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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
<b>AM2 类 - 美元份额</b>		
结转前期已发行份额数	64,121,253	94,528,501
期间发行份额数	8,376,309	2,708,759
期间赎回份额数	(9,745,139)	(19,074,117)
结转后期已发行份额数	<u>62,752,423</u>	<u>78,163,143</u>
<b>AM3H 类 - 澳元份额</b>		
结转前期已发行份额数	10,074,149	12,948,698
期间发行份额数	2,919,171	1,108,290
期间赎回份额数	(2,713,905)	(2,976,579)
结转后期已发行份额数	<u>10,279,415</u>	<u>11,080,409</u>
<b>AM3H 类 - 加元份额</b>		
结转前期已发行份额数	15,307	-
期间发行份额数	-	85,688
期间赎回份额数	(15,307)	(10,403)
结转后期已发行份额数	<u>-</u>	<u>75,285</u>
<b>AM3H 类 - 欧元份额</b>		
结转前期已发行份额数	923,313	1,847,035
期间发行份额数	492,030	44,054
期间赎回份额数	(278,085)	(660,423)
结转后期已发行份额数	<u>1,137,258</u>	<u>1,230,666</u>

# 份额持有人应占资产净值变动表(续)

## 汇丰亚洲债券基金

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
<b>AM3H 类 - 英镑份额</b>		
结转前期已发行份额数	11,298	-
期间发行份额数	65,651	722
期间赎回份额数	(9,777)	-
结转后期已发行份额数	<u>67,172</u>	<u>722</u>
<b>AM3H 类 - 人民币份额</b>		
结转前期已发行份额数	12,768,592	27,414,288
期间发行份额数	3,317,459	15,148,447
期间赎回份额数	(3,787,728)	(14,462,840)
结转后期已发行份额数	<u>12,298,323</u>	<u>28,099,895</u>
<b>BC 类 - 港元份额</b>		
结转前期已发行份额数	315,129	209,176
期间发行份额数	21,406	77,267
期间赎回份额数	(20,375)	(2,222)
结转后期已发行份额数	<u>316,160</u>	<u>284,221</u>
<b>BC 类 - 人民币份额</b>		
结转前期已发行份额数	143,150,834	303,527
期间发行份额数	1,450,857,475	542,873
期间赎回份额数	(61,027,423)	(64,947)
结转后期已发行份额数	<u>1,532,980,886</u>	<u>781,453</u>

## 份额持有人应占资产净值变动表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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
<b>BC 类 - 美元份额</b>		
结转前期已发行份额数	523,064	253,101
期间发行份额数	2,586,682	79,846
期间赎回份额数	(371,388)	(10,949)
结转后期已发行份额数	<u>2,738,358</u>	<u>321,998</u>
<b>BCH 类 - 人民币份额</b>		
结转前期已发行份额数	1,795,157	54,456,501
期间发行份额数	61,831,066	92,640
期间赎回份额数	(7,707,535)	(54,095,210)
结转后期已发行份额数	<u>55,918,688</u>	<u>453,931</u>
<b>BM2 类 - 港元份额</b>		
结转前期已发行份额数	906,197	578,331
期间发行份额数	467,644	223,371
期间赎回份额数	(81,173)	(154,400)
结转后期已发行份额数	<u>1,292,668</u>	<u>647,302</u>
<b>BM2 类 - 人民币份额</b>		
结转前期已发行份额数	53,373,011	439,924
期间发行份额数	50,214,558	2,926,399
期间赎回份额数	(20,356,726)	(116,969)
结转后期已发行份额数	<u>83,230,843</u>	<u>3,249,354</u>

## 份额持有人应占资产净值变动表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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
<b>BM2 类 - 美元份额</b>		
结转前期已发行份额数	1,517,221	420,452
期间发行份额数	1,310,358	166,460
期间赎回份额数	(210,809)	(76,448)
结转后期已发行份额数	<u>2,616,770</u>	<u>510,464</u>
<b>BM3H 类 - 澳元份额</b>		
结转前期已发行份额数	187,243	133,829
期间发行份额数	89,264	31,908
期间赎回份额数	(212)	(9,599)
结转后期已发行份额数	<u>276,295</u>	<u>156,138</u>
<b>BM3H 类 - 人民币份额</b>		
结转前期已发行份额数	11,836,086	2,673,598
期间发行份额数	13,276,224	1,184,217
期间赎回份额数	(5,993,066)	(526,505)
结转后期已发行份额数	<u>19,119,244</u>	<u>3,331,310</u>
<b>IC 类 - 美元份额</b>		
结转前期已发行份额数	2,024,614	3,626,494
期间发行份额数	-	2,101,890
期间赎回份额数	(1,050,945)	(2,280,296)
结转后期已发行份额数	<u>973,669</u>	<u>3,448,088</u>

## 份额持有人应占资产净值变动表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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
<b>ID2 类 - 美元份额</b>		
结转前期已发行份额数	408,726	858,649
期间发行份额数	9,571	10,609
期间赎回份额数	(70,000)	(460,532)
	<hr/>	<hr/>
结转后期已发行份额数	348,297	408,726
	<hr/>	<hr/>
<b>IM2 类 - 美元份额</b>		
结转前期已发行份额数	24,402,275	22,703,135
期间发行份额数	704,893	942,425
期间赎回份额数	-	-
	<hr/>	<hr/>
结转后期已发行份额数	25,107,168	23,645,560
	<hr/>	<hr/>
<b>ZD2 类 - 美元份额</b>		
结转前期已发行份额数	1,804,517	2,610,448
期间发行份额数	796,184	328,461
期间赎回份额数	(1,583,036)	(1,172,295)
	<hr/>	<hr/>
结转后期已发行份额数	1,017,665	1,766,614
	<hr/>	<hr/>

# 现金流量表

## 汇丰亚洲债券基金

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
<b>经营活动</b>		
已收利息	75,423	59,788
已收股息	163,685	84,365
已付管理费	(7,243,028)	(5,299,164)
已付受托人费用	(547,227)	(412,946)
购买投资的付款	(3,225,127,820)	(510,593,474)
出售投资的所得款项(包括已收投资的息票利息)	1,436,626,774	793,684,129
存放于经纪商的保证金存款	(5,448,248)	1,849,589
已付税项	(140)	(145)
其他已付经营开支	(1,306,470)	(329,513)
现金抵押品负债增加	2,897,604	-
<b>经营活动(使用)/产生的现金净额</b>	<b>(1,799,909,447)</b>	<b>279,042,629</b>
<b>融资活动</b>		
份额发行所得款项(含均衡)	2,132,986,174	58,266,802
份额赎回付款(含均衡)	(292,077,618)	(309,990,343)
已付分配	(29,322,289)	(32,351,700)
<b>融资活动产生/(使用)的现金净额</b>	<b>1,811,586,267</b>	<b>(284,075,241)</b>
<b>现金和现金等价物增加/(减少)净额</b>	<b>11,676,820</b>	<b>(5,032,612)</b>
期初现金和现金等价物	4,498,392	8,433,776
期末现金和现金等价物	16,175,212	3,401,164

# 投资组合报表

## 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>金融资产</b>			
<b>债务证券</b>			
<b>债券</b>			
上市投资			
<b>澳大利亚</b>			
澳新银行集团浮息债券 2035年9月30日	17,163,000	16,391,532	0.53
澳新银行集团浮息永续债券 2049年12月29日	10,000,000	10,173,980	0.33
CIMIC FINANCE USA PTY LT 7% 2034年3月25日	12,121,000	12,654,772	0.41
澳洲联邦银行 3.61% 2034年9月12日	10,000,000	9,244,335	0.30
澳洲联邦银行 5.837% 2034年3月13日	2,300,000	2,320,607	0.07
麦格理银行有限公司浮息债券 2036年3月3日	2,800,000	2,415,486	0.08
澳大利亚国民银行浮息票据 2036年1月14日	29,000,000	29,035,351	0.93
PERENTI FINANCE PTY LTD 7.5% 2029年4月26日	1,800,000	1,878,156	0.06
西太平洋银行浮息债券 2030年2月4日	2,800,000	2,799,878	0.09
西太平洋银行浮息债券 2036年11月18日	2,900,000	2,469,082	0.08
西太平洋银行浮息债券 2031年11月23日	1,000,000	986,243	0.03
西太平洋银行浮息永续债券 2049年12月29日	11,500,000	11,338,977	0.36
WOODSIDE FINANCE LTD 5.1% 2034年9月12日	3,000,000	2,870,434	0.09
WOODSIDE FINANCE LTD 5.7% 2054年9月12日	5,211,000	4,854,781	0.16
		<hr/>	<hr/>
		109,433,614	3.52
		<hr/>	<hr/>



## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>百慕大</b>			
STAR ENERGY CO ISSUE 4.85% 2038年10月14日	15,550,000	14,416,312	0.46
<b>英属维尔京群岛</b>			
CAS CAPITAL NO1 LTD 4% 永续债券 2049年12月 31日	2,860,000	2,767,133	0.09
CELESTIAL DYNASTY LTD 6.375% 2028年8月22日	4,589,000	4,160,520	0.13
CENTRAL PLAZA DEV LTD 3.85% 2025年7月14日	600,000	593,856	0.02
CENTRAL PLAZA DEV LTD 4.65% 2026年1月19日	1,110,000	1,093,206	0.04
CFAMC II CO LTD 4.625% 03 JUN 2026	11,900,000	11,838,477	0.38
CFAMC II CO LTD 4.875% 2026年11月22日	6,000,000	5,979,906	0.19
CFAMC III CO LTD 4.75% 2027年4月27日	5,480,000	5,384,374	0.17
CFAMC III CO. LTD 4.25% 2027年11月7日	7,334,000	7,136,715	0.23
CFAMC IV CO LTD 4.5% 2029年5月29日	5,000,000	4,789,800	0.15
中铝香港投资有限公司 2.1% 2026年7月28日	2,467,000	2,370,237	0.08
CHAMPION PATH HOLDINGS 4.5% 2026年1月27日	2,580,000	2,540,971	0.08
创光投资有限公司 4.375% 2027年12月21日	5,465,000	5,342,874	0.17
CHINA CINDA 2020 I MNGMN 3% 2031年1月20日	4,950,000	4,385,539	0.14
CHINA CINDA 2020 I MNGMN 3.125% 2030年3月18 日	2,100,000	1,902,299	0.06
CHINA CINDA 2020 I MNGMN 5.5% 2030年1月23日	2,000,000	2,018,835	0.07
CHINA CINDA 2020 I MNGMN 5.75% 2029年5月28 日	2,760,000	2,808,562	0.09
CHINA CINDA FINANCE 2017 4.75% 2028年2月8日	20,000,000	19,767,070	0.64

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>英属维尔京群岛(续)</b>			
CHINA CINDA FINANCE 2017 4.75% 2029年2月21日	937,000	920,057	0.03
CICC HK FINANCE 2016 中期票据 2% 2026年1月26日	3,883,000	3,782,162	0.12
中国华能集团香港财资 2.85% 永续债券 2049年12月31日	2,974,000	2,928,678	0.09
CNOOC FINANCE 2013 LTD 3.3% 2049年9月30日	4,000,000	2,967,584	0.10
CNOOC FINANCE 2013 LTD 4.25% 2043年5月9日	5,300,000	4,765,898	0.15
CONTEMPRY RUIDNG DEVELOP 1.5% 2026年9月9日	3,000,000	2,844,579	0.09
ELECT GLOBAL INV LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	3,125,000	2,962,578	0.10
新奥清洁能源 3.375% 2026年5月12日	12,749,000	12,461,274	0.40
FORTUNE STAR BVI LTD 5% 2026年5月18日	7,545,000	7,266,846	0.23
FORTUNE STAR BVI LTD 5.05% 2027年1月27日	11,180,000	10,551,885	0.34
FORTUNE STAR BVI LTD 8.5% 2028年5月19日	10,439,000	10,527,982	0.34
FORTUNE STAR BVI LTD SER 8.5% 2028年5月19日	1,304,000	1,313,475	0.04
方兴光耀有限公司 3.2% 2026年4月9日	20,166,000	19,216,313	0.62
方兴光耀有限公司 4.25% 2029年7月23日	18,321,000	15,387,441	0.50
富庆投资管理有限公司 3.25% 2025年6月23日	400,000	389,161	0.01
恒健国际投资有限公司 1.875% 2025年6月23日	4,205,000	4,153,947	0.13
HKT CAPITAL NO 6 LTD 3% 2032年1月18日	8,671,000	7,501,200	0.24
HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD 2.25% 2030年6月9日	6,877,000	6,027,759	0.19
HUARONG FINANCE 2019 3.375% 2030年2月24日	1,000,000	901,270	0.03
HUARONG FINANCE 2019 3.625% 2030年9月30日	7,520,000	6,772,587	0.22

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>英属维尔京群岛(续)</b>			
HYSAN MTN LTD 2.82% 2029年9月4日	2,820,000	2,489,112	0.08
HYSAN MTN LTD 2.875% 2027年6月2日	2,400,000	2,270,797	0.07
INVENTIVE GLOBAL INVESTMENT LTD 1.65% 2025 年9月3日	5,000,000	4,909,153	0.16
JOY TRSR ASSETS HOLDINGS 5.75% 2029年6月6日	6,694,000	6,788,981	0.22
LS FINANCE 2025 LTD 4.5% 2025年6月26日	500,000	482,557	0.02
NAN FUNG TREASURY LTD 3.625% 2030年8月27 日	11,151,000	9,846,116	0.32
NAN FUNG TREASURY LTD 3.875% 2027年10月3 日	11,500,000	10,979,395	0.35
NAN FUNG TREASURY LTD 5% 2028年9月5日	14,513,000	14,098,255	0.45
新城环球有限公司 4.5% 2026年5月2日	3,960,000	3,305,071	0.11
新城环球有限公司 4.625% 2025年10月15日	2,830,000	2,581,164	0.08
RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 6.7% 2028年3月30日	3,738,000	1,288,194	0.04
RKPF OVERSEAS 2020 A LTD 5.2% 2026年1月12日	2,500,000	864,359	0.03
RONGSHI INTERNATIONAL FINANCE LTD 3.75% 2029年5月21日	2,800,000	2,693,295	0.09
SF HOLDING INVESTMENT LTD 2.875% 2030年2月 20日	9,777,000	8,856,183	0.29
SHANGHAI PORT GROUP (BVI) DEVELOPMENT CO LTD 1.5% 2025年7月13日	5,300,000	5,220,537	0.17
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT (2018) LTD 2.7% 2030年5月13日	10,200,000	9,346,949	0.30
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT (2018) LTD 2.95% 2029年11月12日	10,000,000	9,330,650	0.30
STUDIO CITY FINANCE LTD 5% 2029年1月15日	400,000	364,828	0.01
STUDIO CITY FINANCE LTD 6% 2025年7月15日	4,800,000	4,797,288	0.15
STUDIO CITY FINANCE LTD 6.5% 2028年1月15日	688,000	671,760	0.02

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>英属维尔京群岛(续)</b>			
SUNNY EXPRESS ENTERPRISES CORP 2.625% 2025 年4月23日	3,000,000	2,984,616	0.10
永达投资有限公司 2.25% 2025年6月16日	4,900,000	4,847,984	0.16
YUNDA HOLDING INVESTMENT LTD 2.25% 2025年 8月19日	9,316,000	9,147,893	0.29
		326,688,187	10.51
<b>开曼群岛</b>			
AAC 瑞声声学科技控股有限公司 3.75% 2031年6月2 日	6,005,000	5,388,250	0.17
阿里巴巴集团控股有限公司 3.15% 2051年2月9日	7,429,000	4,797,091	0.15
阿里巴巴集团控股有限公司 3.25% 2061年2月9日	7,410,000	4,551,722	0.15
阿里巴巴集团控股有限公司 3.5% 2044年11月28日	122,920,000	17,059,815	0.55
阿里巴巴集团控股有限公司 4.4% 2057年12月6日	1,500,000	1,187,374	0.04
阿里巴巴集团控股有限公司 5.25% 2035年5月26日	15,000,000	14,681,587	0.47
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD 2.875% 2025年2月 15日	2,500,000	2,498,150	0.08
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD 6.375% 2028年5月 4日	10,535,000	10,874,053	0.35
CCBL (CAYMAN) 1 CORPORATION LTD 1.99% 2025 年7月21日	4,595,000	4,533,036	0.15
中国宏桥集团有限公司 7.05% 2028年1月10日	15,177,000	15,372,465	0.49
中国蒙牛乳业有限公司 1.875% 2025年6月17日	5,000,000	4,943,855	0.16
中国现代牧业控股有限公司 2.125% 2026年7月14日	9,858,000	9,418,289	0.30

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>开曼群岛(续)</b>			
CHINA OVERSEA FIN III 6.375% 2043年10月29日	1,388,000	1,409,117	0.05
CHINA OVERSEAS FIN 4.75% 2028年4月26日	2,000,000	1,968,618	0.06
CHINA OVERSEAS FIN. VI 6.45% 2034年6月11日	5,801,000	6,101,759	0.20
CHINA OVERSEAS FINANCE (CAYMAN) VIII LTD 3.05% 2029年11月27日	800,000	721,716	0.02
CHINA OVERSEAS FINANCE 5.35% 2042年11月15 日	500,000	453,353	0.01
CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS FINANCE 2.45% 2026年2月9日	10,231,000	9,775,920	0.31
华润置地有限公司 4.125% 2029年2月26日	2,400,000	2,287,586	0.07
CK HUTCHISON INTERNATIONAL (20) LTD 3.125% 2041年4月15日	8,000,000	6,057,008	0.20
CK HUTCHISON INTERNATIONAL 4.75% 2034年9 月13日	18,015,000	17,232,915	0.55
CK HUTCHISON INTL 4.375% 2030年3月13日	7,045,000	6,906,523	0.22
CN OVERSEAS FIN KY VIII 2.75% 2030年3月2日	1,330,000	1,176,235	0.04
CN OVERSEAS FIN KY VIII 3.125% 2035年3月2日	7,770,000	6,184,702	0.20
CN OVERSEAS FIN KY VIII 3.45% 2029年7月15日	1,200,000	1,109,533	0.04
一嗨信息技术服务有限公司 7% 2026年9月21日	10,147,000	7,303,050	0.24
富卫集团控股有限公司 7.635% 2031年7月2日	24,320,000	25,862,642	0.83
富卫集团控股有限公司 7.784% 2033年12月6日	5,000,000	5,561,022	0.18
富卫集团控股有限公司 8.4% 2029年4月5日	17,815,000	18,720,875	0.60
绿城中国控股有限公司 5.65% 2025年7月13日	3,730,000	3,688,010	0.12
绿城中国控股有限公司 4.7% 2025年4月29日	3,040,000	3,010,368	0.10
健合(H&H)国际控股有限公司 9.125% 2028年7月24 日	7,791,000	7,879,552	0.25

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>开曼群岛(续)</b>			
HPHT FINANCE 21 II LTD (BR) 1.5% 2026年9月17日	8,000,000	7,579,076	0.24
HUTCHISON WHAMPOA INTERNATIONAL LIMITED 7.45% 2033年11月24日到期 (S 条例债券系列)	3,200,000	3,674,146	0.12
龙湖集团控股有限公司 3.375% 2027年4月13日	14,420,000	11,950,243	0.38
龙湖集团控股有限公司 3.95% 2029年9月16日	4,913,000	3,654,685	0.12
龙湖地产有限公司 4.5% 2028年1月16日	4,713,000	3,867,525	0.12
美团 0% 可转换 2028年4月27日	9,200,000	8,799,800	0.28
美团 4.5% 2028年4月2日	31,000,000	30,475,015	0.98
美团高级 S 条例债券 3.05% 2030年10月28日	31,600,000	28,203,474	0.91
美团高级 S 条例债券 4.625% 2029年10月2日	9,102,000	8,877,062	0.29
MELCO RESORTS FINANCE 4.875% 2025年6月6日	9,940,000	9,912,039	0.32
MELCO RESORTS FINANCE 5.25% 2026年4月26日	1,650,000	1,639,893	0.05
MELCO RESORTS FINANCE 7.625% 2032年4月17日	6,615,000	6,613,545	0.21
美高梅中国控股有限公司 4.75% 2027年2月1日	525,000	515,390	0.02
美高梅中国控股有限公司 5.25% 2025年6月18日	4,644,000	4,626,752	0.15
力高地产集团 11% 2023年8月6日	1,189,108	5,710	0.00
力高地产集团 9.9% 2024年2月17日 (可能违约)	3,598,000	36,484	0.00
金沙中国有限公司 2.55% 2027年3月8日	16,038,000	15,110,980	0.49
金沙中国有限公司 3.1% 2029年3月8日	11,000,000	9,871,092	0.32
金沙中国有限公司 3.75% 2031年8月8日	5,450,000	4,681,109	0.15
金沙中国有限公司 5.125% 2025年8月8日	8,000,000	8,001,096	0.26
金沙中国有限公司 WI 4.375% 2030年6月18日	9,700,000	9,056,182	0.29
金沙中国有限公司 WI 5.4% 2028年8月8日 WI	20,831,000	20,752,280	0.67

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>开曼群岛(续)</b>			
新城控股集团股份有限公司 4.45% 2025年7月13日	1,254,000	1,183,462	0.04
融创中国控股有限公司浮息票据 2027年9月30日	204,724	18,067	0.00
融创中国控股有限公司浮息票据 2028年9月30日	3,398,058	317,548	0.01
腾迅控股有限公司 2.39% 2030年6月3日	3,373,000	2,971,753	0.10
腾迅控股有限公司 3.24% 2050年6月3日	8,564,000	5,660,115	0.18
腾迅控股有限公司 3.29% 2060年6月3日	5,612,000	3,516,678	0.11
腾迅控股有限公司 3.575% 2026年4月11日	5,000,000	4,936,985	0.16
腾迅控股有限公司 3.595% 2028年1月19日	10,000,000	9,704,985	0.31
腾迅控股有限公司 3.68% 2041年4月22日	3,000,000	2,337,820	0.08
腾迅控股有限公司 3.84% 2051年4月22日	13,000,000	9,531,834	0.31
腾迅控股有限公司 3.925% 2038年1月19日	3,400,000	2,897,101	0.09
腾迅控股有限公司 3.975% 2029年4月11日	13,200,000	12,792,853	0.41
腾迅控股有限公司 4.525% 2049年4月11日	5,700,000	4,761,900	0.15
腾讯控股有限公司 S 条例债券 3.94% 2061年4月22日	6,000,000	4,309,026	0.14
腾讯音乐娱乐集团 2% 2030年9月3日	920,000	780,268	0.02
永利澳门有限公司 5.5% 2027年10月1日	800,000	783,530	0.03
永利澳门有限公司 5.5% 2026年1月15日	2,000,000	1,995,196	0.06
中升集团控股有限公司 3% 2026年1月13日	9,590,000	9,338,881	0.30
中升集团控股有限公司 5.98% 2028年1月30日	2,000,000	1,980,365	0.06
		<u>506,438,136</u>	<u>16.28</u>

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>智利</b>			
SOCIEDAD QUIMICA Y MINER 5.5% 2034年9月10日	13,810,000	13,150,573	0.42
<b>中国内地</b>			
国银金融租赁股份有限公司浮息债券 2030年9月28日	11,000,000	10,835,715	0.35
中国建设银行股份有限公司 2.45% 2030年6月24日	16,550,000	16,390,301	0.53
中国工商银行股份有限公司 4.875% 2025年9月21日	14,500,000	14,482,353	0.47
深圳高速公路集团股份有限公司 1.75% 2026年7月8日	792,000	756,603	0.02
温氏食品集团股份有限公司 2.349% 2025年10月29日	2,349,000	2,284,365	0.07
		44,749,337	1.44
<b>法国</b>			
BPCE SA 浮息债券 2030年1月18日	3,000,000	3,028,974	0.10
法国兴业银行高级浮息债券 2028年1月19日	5,000,000	4,768,438	0.15
法国兴业银行浮息债券 2028年1月19日	5,000,000	5,021,595	0.16
		12,819,007	0.41
<b>香港</b>			
友邦保险控股有限公司 5.375% 2034年4月5日	4,000,000	3,990,988	0.13
友邦保险控股有限公司 5.4% 2054年9月30日	5,582,000	5,193,462	0.17
香港机场管理局 3.5% 2062年1月12日	8,500,000	6,224,486	0.20
香港机场管理局 4.75% 2028年7月15日	15,000,000	15,032,835	0.48



## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>香港(续)</b>			
安徽省交通控股集团(香港)有限公司 1.618% 2026年8月26日	5,212,000	4,954,287	0.16
东亚银行有限公司欧元中期票据浮息债券 2030年5月29日	2,200,000	2,185,281	0.07
东亚银行有限公司浮息债券 2027年3月13日	2,000,000	2,017,738	0.07
东亚银行有限公司浮息债券 2032年4月22日	3,000,000	2,883,288	0.09
东亚银行有限公司浮息债券 2034年6月27日	18,505,000	18,344,728	0.59
茂欣有限公司 2.2% 2030年10月21日	6,000,000	5,242,833	0.17
中华电力有限公司浮息永续债券 2049年12月31日	32,000,000	32,256,000	1.04
中国农化(香港)峰桥有限公司 3% 2030年9月22日	2,700,000	2,409,645	0.08
中国农化(香港)峰桥有限公司 4.875% 2025年3月14日	9,200,000	9,199,227	0.30
中国农化(香港)峰桥有限公司 5.125% 2028年3月14日	9,922,000	9,926,465	0.32
远东宏信有限公司 4.25% 2026年10月26日	3,000,000	2,918,769	0.09
远东宏信有限公司 5.875% 2028年3月5日	2,280,000	2,253,826	0.07
远东宏信有限公司 6.625% 2027年4月16日	11,282,000	11,412,956	0.37
普洛斯中国控股有限公司 2.95% 2026年3月29日	20,850,000	18,491,094	0.59
联想集团有限公司 3.421% 2030年11月2日	10,000,000	9,003,285	0.29
联想集团有限公司 5.831% 2028年1月27日	2,200,000	2,235,591	0.07
联想集团有限公司 6.536% 2032年7月27日	5,000,000	5,233,678	0.17
MN MINING/ENERGY RESOURC 12.5% 2026年9月13日	8,153,000	8,912,925	0.29
南洋商业银行浮息债券 2034年8月6日	12,073,000	12,029,911	0.39
PINGAN REAL ESTATE CAP 3.45% 2026年7月29日	390,000	356,353	0.01

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>香港(续)</b>			
上海商业银行有限公司浮息债券 2033年2月28日	300,000	302,762	0.01
港华燃气(融资)有限公司 4% 2027年4月26日	4,900,000	4,780,322	0.15
XIAOMI BEST TIME INTL 0% 可转换 2027年12月 17日	2,200,000	2,619,802	0.08
XIAOMI BEST TIME INTL 4.1% 2051年7月14日	5,965,000	4,496,921	0.14
XIAOMI BEST TIME INTL 高级 S 条例债券 2.875% 2031年7月14日	6,900,000	5,998,073	0.19
阳光城嘉世国际有限公司 8.25% 2023年11月25日	1,000,000	4,180	0.00
阳光城嘉世国际有限公司 9.25% 2023年4月15日	2,500,000	-	-
		210,911,711	6.78
<b>印度</b>			
10 RENEW POWER SUBSIDIAR 4.5% 2028年7月14日	400,000	373,673	0.01
AXIS BANK GIFT CITY 浮息永续债券 2049年12月31 日	2,000,000	1,921,314	0.06
CONTINUUM GRN SPV CO-ISS 7.5% 2033年6月26日	2,040,000	2,056,514	0.07
印度进出口银行 5.5% 2035年1月13日	71,875,000	71,664,370	2.30
GMR HYDERABAD INTERNATIO 4.75% 2026年2月2 日	5,000,000	4,942,707	0.16
HDFC BANK LTD 5.18% 2029年2月15日	2,400,000	2,406,685	0.08
HDFC BANK LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	15,000,000	14,355,750	0.46
HPCL-MITTAL ENERGY LTD 5.25% 2027年4月28日	1,500,000	1,476,549	0.05
HPCL-MITTAL ENERGY LTD 5.45% 2026年10月22日	3,042,000	3,016,645	0.10
IRB INFRASTRUCTURE DEVE 7.11% 2032年3月11日	19,411,000	19,639,817	0.63
JSW INFRASTRUCTURE 4.95% 2029年1月21日	2,760,000	2,665,562	0.09

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>印度(续)</b>			
MANAPPURAM FINANCE LTD 7.375% 2028年5月12日	6,870,000	6,900,520	0.22
MUTHOOT FINANCE LTD 6.375% 2029年4月23日	7,200,000	7,108,913	0.23
MUTHOOT FINANCE LTD 7.125% 2028年2月14日	11,692,000	11,912,371	0.38
PIRAMAL CAPITAL & HOUSING 7.8% 2028年1月29日	1,743,000	1,731,045	0.06
POWER FINANCE CORP LTD 3.9% 2029年9月16日	7,000,000	6,598,179	0.21
POWER FINANCE CORP LTD 3.95% 2030年4月23日	7,000,000	6,545,672	0.21
POWER FINANCE CORP LTD 全球中期票据 3.35% 2031年5月16日	10,000,000	8,898,360	0.29
REC LIMITED 2.75% 2027年1月13日	8,087,000	7,738,103	0.25
REC LIMITED 4.75% 2029年9月27日	24,337,000	23,886,157	0.77
RELIANCE INDUSTRIES LTD 2.875% 2032年1月12日	28,959,000	24,721,545	0.79
RELIANCE INDUSTRIES LTD 3.625% 2052年1月12日	2,600,000	1,790,126	0.06
RELIANCE INDUSTRIES LTD 3.75% 2062年1月12日	1,150,000	775,140	0.02
RELIANCE INDUSTRIES LTD 4.875% 2045年2月10日	1,100,000	974,065	0.03
RELIANCE INDUSTRIES LTD 6.25% 2040年10月19日	1,000,000	1,051,190	0.03
RENEW POWER PVT LTD 5.875% 2027年3月5日	400,000	393,330	0.01
SAEL LTD GROUP ISSUERS 7.8% 2031年7月31日	5,448,000	5,484,663	0.18
SAMMAAN CAPITAL LTD 9.7% 2027年7月3日	7,028,000	7,067,181	0.23
SHRIRAM FINANCE LTD 6.15% 2028年4月3日	4,200,000	4,151,820	0.13
SHRIRAM FINANCE LTD 6.625% 2027年4月22日	8,442,000	8,499,194	0.27
SHRIRAM TRANSPORT FIN 4.15% 2025年7月18日	1,000,000	994,627	0.03
TATA CAPITAL LTD 5.389% 2028年7月21日	21,700,000	21,766,977	0.70
		<u>283,508,764</u>	<u>9.11</u>

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>印度尼西亚</b>			
BANK BUKOPIN PT 5.658% 2027年10月30日	33,320,000	33,070,233	1.06
BANK MANDIRI (PERSERO) TBK PT 2% 2026年4月19日	1,785,000	1,722,736	0.06
印度尼西亚国家银行 3.75% 2026年3月30日	2,200,000	2,153,761	0.07
印度尼西亚国家银行 5.28% 2029年4月5日	2,000,000	1,999,596	0.06
印度尼西亚国家银行浮息永续债券 2049年12月31日	5,000,000	4,771,257	0.15
FREEPORT INDONESIA PT 6.2% 2052年4月14日	10,436,000	10,321,079	0.33
FREEPORT INDONESIA PT S 条例债券 5.315% 2032年4月14日	23,000,000	22,644,880	0.73
INDIKA INTI ENERGI PT 8.75% 2029年5月7日	21,154,000	21,847,629	0.70
INDOFOOD CBP SUKSES MAKM 3.398% 2031年6月9日	13,000,000	11,583,845	0.37
INDOFOOD CBP SUKSES MAKM 4.745% 2051年6月9日	1,650,000	1,345,072	0.04
印度尼西亚(共和国) 5.1% 2054年2月10日	6,783,000	6,241,554	0.20
印度尼西亚(共和国) 5.15% 2054年9月10日	2,300,000	2,118,880	0.07
印度尼西亚(共和国) 5.65% 2053年1月11日	11,500,000	11,376,438	0.37
印度尼西亚 5.15% 2054年9月10日	6,700,000	6,172,388	0.20
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM (PERSERO) PT 5.8% 2050年5月15日	6,663,000	6,175,595	0.20
INDONESIA ASAHANALUMINI 6.757% 2048年11月15日	5,000,000	5,196,950	0.17
印度尼西亚共和国(政府) 3.05% 2051年3月12日	7,800,000	5,092,437	0.16
印度尼西亚共和国(政府) 3.2% 2061年9月23日	29,383,000	18,255,482	0.59
印度尼西亚共和国(政府) 3.55% 2051年6月9日	27,082,000	19,165,390	0.62
印度尼西亚共和国(政府) 3.7% 2049年10月30日	17,950,000	13,296,139	0.43

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>印度尼西亚(续)</b>			
印度尼西亚共和国(政府) 4.2% 2050年10月15日	15,880,000	12,894,044	0.41
印度尼西亚共和国(政府) 4.7% 2034年2月10日	11,800,000	11,161,101	0.36
印度尼西亚共和国(政府) 4.75% 2047年7月18日	6,800,000	6,117,406	0.20
印度尼西亚共和国(政府) 5.5% 2054年7月2日	2,400,000	2,316,982	0.07
JAPFA COMFEED TBK PT 5.375% 2026年3月23日	6,270,000	6,176,301	0.20
KRAKATAU POSCO PT 6.375% 2027年6月11日	6,615,000	6,645,750	0.21
KRAKATAU POSCO PT 6.375% 2029年6月11日	10,480,000	10,486,477	0.34
PERTAMINA (PERSERO) PT 2.3% 2031年2月9日	5,806,000	4,917,850	0.16
PERTAMINA (PERSERO) PT 4.175% 2050年1月21日	1,900,000	1,440,057	0.05
PERTAMINA (PERSERO) PT 6.5% 2048年11月7日	4,700,000	4,883,046	0.16
PERTAMINA 6.5% 2041年5月27日	9,000,000	9,357,795	0.30
PERTAMINA PERSERO 6.45% 2044年5月30日	5,300,000	5,409,238	0.17
PERTAMINA PERSERO 6% 2042年5月3日	1,123,000	1,098,079	0.04
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 4% 2050年6月30日	17,630,000	12,249,394	0.39
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 4.375% 2050年2月5日	2,000,000	1,496,232	0.05
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 5.45% 2028年5月21日	16,000,000	16,151,952	0.52
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 6.25% 2049年1月25日	860,000	841,697	0.03
PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 5.25% 2042年10月24日	3,423,000	3,022,293	0.10

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>印度尼西亚(续)</b>			
PERUSAHAAN PENERBIT SBSN 5.65% 2054年11月 25日	30,000,000	29,310,360	0.94
PT INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM AND PT MINERAL INDUSTRI INDONESIA (PERSERO) 5.45% 2030年5月15日	10,000,000	10,028,560	0.32
PT PAKUWON JATI 4.875% 2028年4月29日	2,105,000	2,028,711	0.06
		<u>362,584,666</u>	<u>11.66</u>
<b>爱尔兰</b>			
SMBC AVIATION CAPITAL FI 高级 S 条例债券 (S 条例) 5.7% 2033年7月25日	5,000,000	<u>5,063,138</u>	<u>0.16</u>
<b>日本</b>			
第一生命控股株式会社浮息永续债券 2049年12月31 日	35,113,000	35,686,957	1.15
富国生命保险相互会社 2049年12月31日	18,751,000	19,823,970	0.64
明治安田生命保险浮息债券 2054年9月11日	12,137,000	11,999,160	0.38
三菱日联金融集团浮息债券 2035年4月17日	10,000,000	10,002,020	0.32
乐天集团 2049年12月31日	20,275,000	20,106,271	0.65
积水住宅株式会社 5.1% 2034年10月23日	3,930,000	3,813,519	0.12
软银集团 7% 2031年7月8日	7,040,000	7,154,604	0.23
住友生命保险 2049年12月31日	3,961,000	3,919,706	0.13
三井住友金融集团浮息永续债券 2049年12月31日	8,062,000	8,162,864	0.26
三井住友信托银行 4.85% 2034年9月10日	3,214,000	3,105,841	0.10
		<u>123,774,912</u>	<u>3.98</u>

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>泽西岛</b>			
WEST CHINA CEMENT LTD 4.95% 2026年7月8日	5,301,000	3,951,681	0.13
<b>卢森堡</b>			
MC BRAZIL DWNSTRM 7.25% 2031年6月30日	2,224,000	1,733,415	0.06
<b>马来西亚</b>			
GOHL CAPITAL LTD 4.25% 2027年1月24日			
PETRONAS CAPITAL LTD 3.404% 2061年4月28日			
PETRONAS CAPITAL LTD 4.55% 2050年4月21日	27,150,000	26,469,309	0.85
	4,444,000	2,926,958	0.10
	18,400,000	15,589,492	0.50
		44,985,759	1.45
<b>毛里求斯</b>			
CLEAN RENEWABLE POWER 4.25% 2027年3月25日	1,530,000	1,234,594	0.04
DIAMOND II LTD 7.95% 2026年7月28日	1,285,000	1,307,099	0.04
GREENKO POWER II LTD 4.3% 2028年12月13日	5,000,000	3,915,106	0.12
NETWORK I2I LTD 5.65% 永续债券 2049年12月31日	5,520,000	5,536,560	0.18
UPL CORP LTD 4.5% 2028年3月8日	6,960,000	6,450,424	0.21
UPL CORP LTD 4.625% 2030年6月16日	6,960,000	6,115,724	0.20
		24,559,507	0.79

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>墨西哥</b>			
MEXICO CITY ARPT TRUST 5.5% 2047年7月31日	7,520,000	6,031,544	0.19
<b>蒙古</b>			
蒙古乌兰巴托市 7.75% 2027年8月21日	9,740,000	9,971,325	0.32
GOLOMT BANK OF MONGOLIA 11% 2027年5月20日	3,628,000	3,805,331	0.12
蒙古国际债券 3.5% 2027年7月7日	1,800,000	1,685,369	0.06
蒙古国际债券 5.125% 2026年4月7日	1,920,000	1,896,134	0.06
蒙古国际债券 S 条例债券 4.45% 2031年7月7日	1,700,000	1,487,917	0.05
		<u>18,846,076</u>	<u>0.61</u>
<b>荷兰</b>			
GREENKO DUTCH BV 3.85% 2026年3月29日	6,000,000	5,235,146	0.17
JABABEKA INTERNATIONAL STP 2027年12月15日	12,500,000	12,449,050	0.40
MINEJESA CAPITAL BV 4.625% 2030年8月10日	14,000,000	11,803,544	0.38
MINEJESA CAPITAL BV 5.625% 2037年8月10日	13,589,000	12,858,768	0.41
PROSUS NV 4.987% 2052年1月19日	11,910,000	9,044,752	0.29
SMRC AUTOMOTIVE HOLDINGS 5.625% 2029年7月11日	9,788,000	9,808,251	0.32
		<u>61,199,511</u>	<u>1.97</u>
<b>巴基斯坦</b>			
巴基斯坦伊斯兰共和国 6.875% 2027年12月5日	5,500,000	5,123,577	0.17



## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>巴基斯坦(续)</b>			
巴基斯坦伊斯兰共和国 7.875% 2036年3月31日	820,000	665,740	0.02
巴基斯坦(共和国) 6% 2026年4月8日	9,928,000	9,617,477	0.31
巴基斯坦(共和国) 7.375% 2031年4月8日	10,000,000	8,675,490	0.28
巴基斯坦(共和国) 8.875% 2051年4月8日	2,390,000	1,941,229	0.06
		26,023,513	0.84
<b>菲律宾</b>			
菲律宾开发银行 2.375% 2031年3月11日	2,855,000	2,531,164	0.08
GLOBE TELECOM INC 浮息永续债券 2049年12月31日	6,170,000	6,061,704	0.20
PETRON CORP 浮息永续债券 2049年12月31日	680,000	677,518	0.02
菲律宾(共和国) 3.2% 2046年7月6日	5,000,000	3,443,590	0.11
菲律宾(共和国) 4.2% 2047年3月29日	27,300,000	21,819,184	0.70
菲律宾(共和国) 5.175% 2049年9月5日	6,000,000	5,536,422	0.18
菲律宾(共和国) 2.65% 2045年12月10日	33,000,000	20,726,920	0.67
菲律宾共和国(政府) 2.95% 2045年5月5日	37,636,000	25,139,907	0.81
菲律宾共和国 5.9% 2050年2月4日	19,266,000	19,388,724	0.62
SAN MIGUEL GLOBAL POWER (REG)浮息永续债券 2049年12月31日	984,000	1,026,644	0.03
SAN MIGUEL GLOBAL POWER 浮息永续债券 2049年 12月31日	25,802,000	26,165,576	0.84
SMC GLOBAL POWER HLDGS 浮息永续债券 2049年 12月31日	1,560,000	1,507,189	0.05
		134,024,542	4.31

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>沙特阿拉伯</b>			
沙特阿拉伯石油公司 3.25% 2050年11月24日	3,331,000	2,155,907	0.07
沙特阿拉伯石油公司 4.375% 2049年4月16日	1,900,000	1,518,495	0.05
沙特阿拉伯石油公司 5.75% 2054年7月17日	12,000,000	11,249,550	0.36
		14,923,952	0.48
<b>新加坡</b>			
中银航空租赁有限公司 3.25% 2025年4月29日	6,000,000	5,978,247	0.19
中银航空租赁有限公司 3.5% 2027年9月18日	3,500,000	3,396,225	0.11
CATHAYLIFE SINGAPORE 浮息债券 2039年9月5日	6,027,000	5,925,499	0.19
CLIFFORD CAPITAL PTE LTD 4.781% 2030年1月14日	5,714,000	5,793,345	0.19
CONTINUUM ENERGY AURA 9.5% 2027年2月24日	751,000	786,037	0.02
星展集团控股有限公司 3.3% 永续债券 2049年12月31日	15,527,000	15,503,360	0.50
GLP PTE LTD 3.875% 2025年6月4日	13,824,000	13,276,404	0.43
GLP PTE LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	11,373,000	6,252,364	0.20
LLPL CAPITAL PTE LTD 6.875% 2039年2月4日	39,126,000	29,968,784	0.96
MEDCO LAUREL TREE 6.95% 2028年11月12日	5,500,000	5,540,232	0.18
MEDCO MAPLE TREE PTE LTD 8.96% 2029年4月27日	19,378,000	20,574,533	0.66
NANSHAN LIFE PTE LTD 5.45% 2034年9月11日	5,000,000	4,828,948	0.15
华侨银行 1.832% 2030年9月10日	10,313,000	10,129,532	0.33
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.25% 2051年4月6日	600,000	366,901	0.01

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>新加坡(续)</b>			
TML HOLDINGS PTE LTD 4.35% 2026年6月9日	1,145,000	1,129,044	0.04
		<u>129,449,455</u>	<u>4.16</u>
<b>韩国</b>			
韩国进出口银行 4.625% 2028年1月14日	15,500,000	15,507,455	0.50
韩亚银行 3.25% 2027年3月30日	10,423,000	10,130,531	0.33
韩亚银行浮息永续债券 2049年12月31日	3,300,000	3,188,942	0.10
韩华生命保险株式会社浮息债券 2032年2月4日	12,950,000	12,478,685	0.40
HYUNDAI CAPITAL SERVICES 5.125% 2029年2月5日	4,025,000	4,023,770	0.13
HYUNDAI CAPITAL SERVICES 5.25% 2028年1月22日	20,125,000	20,246,112	0.65
KB KOOKMIN CARD CO LTD 1.5% 2026年5月13日	2,100,000	2,006,861	0.07
国民银行 2.5% 2030年11月4日	6,900,000	5,930,371	0.19
国民银行 4.5% 2029年2月1日	3,314,000	3,216,681	0.10
KOREA NATIONAL OIL CORP 2.125% 2027年4月18日	7,424,000	7,029,266	0.23
KT CORP 2.5% 2026年7月18日	2,000,000	1,934,897	0.06
KT CORP S 条例债券 4% 2025年8月8日	2,579,000	2,567,727	0.08
LG ENERGY SOLUTION 5.75% 2028年9月25日	11,000,000	11,176,638	0.36
LOTTE PROPERTY & DEVELOP 4.5% 2025年8月1日	3,236,000	3,225,082	0.10
POSCO 4.375% 2025年8月4日	13,823,000	13,787,115	0.44
新韩银行 3.75% 2027年9月20日	3,000,000	2,902,410	0.09
新韩银行 3.875% 2026年3月24日	3,000,000	2,960,273	0.10
新韩银行 4% 2029年4月23日	3,004,000	2,849,880	0.09
新韩银行 4.375% 2032年4月13日	5,000,000	4,655,070	0.15
新韩银行 4.5% 2028年3月26日	3,000,000	2,937,741	0.10
新韩银行 5.75% 2034年4月15日	2,600,000	2,608,754	0.08
SHINHAN CARD CO LTD 2.5% 2027年1月27日	11,410,000	10,895,209	0.35

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>韩国(续)</b>			
新韩金融集团 3.34% 2030年2月5日	16,110,000	16,154,077	0.52
新韩金融集团 2049年12月31日	3,350,000	3,233,288	0.11
SK海力士 2.375% 2031年1月19日	12,000,000	10,175,106	0.33
SK海力士 5.5% 2029年1月16日	5,000,000	5,057,415	0.16
SK海力士 6.5% 2033年1月17日	18,280,000	19,359,827	0.62
友利银行 2049年12月31日	24,014,000	24,367,534	0.78
		<u>224,606,717</u>	<u>7.22</u>
<b>斯里兰卡</b>			
斯里兰卡共和国 2038年2月15日	1,520,575	1,258,276	0.04
斯里兰卡共和国 2030年1月15日	890,840	780,598	0.03
斯里兰卡共和国 2035年6月15日	1,114,984	794,426	0.03
斯里兰卡共和国 4% 2028年4月15日	20,458,242	17,884,595	0.57
斯里兰卡共和国 STP 2033年3月15日	1,625,073	1,295,996	0.04
斯里兰卡共和国 STP 2036年5月15日	835,020	681,385	0.02
		<u>22,695,276</u>	<u>0.73</u>
<b>泰国</b>			
曼谷盘谷银行有限公司浮息债券 2036年9月23日	5,700,000	4,935,613	0.16
盘古银行大众有限公司(香港分行) 3.733% 2034年9月25日	10,250,000	9,356,405	0.30
盘古银行大众有限公司(香港分行) 5% 永续债券 2049年12月31日	12,800,000	12,757,363	0.41
GC TREASURY CENTRE CO 4.3% 2051年3月18日	342,000	252,423	0.01

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>泰国(续)</b>			
开泰银行大众有限公司香港浮息债券 2031年10月2日	5,000,000	4,807,683	0.16
泰京银行/开曼 4.4% 永续债券 2049年12月31日	548,000	537,081	0.02
MINOR INTERNATIONAL PCL 2.7% 永续债券 2049年12月31日	650,000	629,783	0.02
MUANGTHAI CAPITAL PCL 6.875% 2028年9月30日	10,868,000	10,981,304	0.35
THAIOIL TRSRY CENTER 2.5% 2030年6月18日	9,700,000	8,222,147	0.26
		<u>52,479,802</u>	<u>1.69</u>
<b>土耳其</b>			
HYUNDAI ASSAN OTOMOTIV 1.625% 2026年7月12日	8,500,000	8,103,322	0.26
<b>英国</b>			
巴克莱 4.836% 2028年5月9日	5,000,000	4,944,265	0.16
BIOCON BIOLOGICS GLOBAL 6.67% 2029年10月9日	10,442,000	10,189,679	0.33
LIQUID TELECOM FINANCE 5.5% 2026年9月4日	682,000	593,371	0.02
PRUDENTIAL PLC 浮息债券 2033年11月3日	5,869,000	5,370,367	0.17
ROTHESAY LIFE 浮息债券 2034年9月11日	6,050,000	6,329,253	0.20
渣打集团浮息债券 2030年2月12日	7,620,000	7,616,876	0.25
渣打集团浮息永续债券 2049年12月31日	27,000,000	27,123,633	0.87
VEDANTA RESOURCES 10.25% 2028年6月3日	9,600,000	9,843,384	0.32
VEDANTA RESOURCES 10.875% 2029年9月17日	11,310,000	11,780,009	0.38
VEDANTA RESOURCES 11.25% 2031年12月3日	4,590,000	4,884,701	0.16
VEDANTA RESOURCES 9.475% 2030年7月24日	10,375,000	10,378,434	0.33

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>英国(续)</b>			
VEDANTA RESOURCES 9.85% 2033年4月24日	7,513,000	7,584,926	0.24
		<hr/>	<hr/>
		106,638,898	3.43
		<hr/>	<hr/>
<b>美国</b>			
BOC AVIATION USA CORP 4.75% 2028年1月14日	15,000,000	15,021,097	0.48
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 1.8% 2028年1月10日	10,000,000	9,127,515	0.30
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 2.1% 2028年9月15日	7,854,000	7,099,305	0.23
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 4.75% 2031年9月26日	8,000,000	7,741,748	0.25
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.3% 2030年1月8日	5,000,000	5,014,185	0.16
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.4% 2031年6月24日	5,000,000	5,022,208	0.16
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.7% 2030年6月26日	5,000,000	5,079,247	0.16
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 6.2% 2030年9月21日	1,500,000	1,565,049	0.05
拉斯维加斯金沙 6.2% 2034年8月15日	3,500,000	3,524,623	0.11
PERIAMA HOLDINGS LLC/DE 5.95% 2026年4月19日	4,730,000	4,727,635	0.15
RESORTS WORLD/RWLV CAP 4.625% 2031年4月6日	6,000,000	5,119,758	0.17
RESORTS WORLD/RWLV CAP 4.625% 2029年4月16日	17,900,000	15,931,931	0.51
RESORTS WORLD/RWLV CAP 8.45% 2030年7月27日	7,200,000	7,468,351	0.24
SASOL FINANCING USA LLC 5.5% 2031年3月18日	5,000,000	4,217,010	0.14

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>债券</b>			
上市投资(续)			
<b>美国(续)</b>			
TSMC ARIZONA CORP 1.75% 2026年10月25日	3,369,000	3,207,357	0.10
TSMC ARIZONA CORP 4.5% 2052年4月22日	3,200,000	2,925,784	0.10
		<u>102,792,803</u>	<u>3.31</u>
<b>债券</b>			
未上市但有报价的投资			
<b>印度尼西亚</b>			
PERTAMINA (PERSERO) PT 4.15% 2060年2月25日	3,275,000	<u>2,337,188</u>	<u>0.08</u>
<b>毛里求斯</b>			
GREENKO WIND PROJECTS (MAURITIUS) LTD 5.5% 2025年4月6日	17,041,000	17,016,631	0.55
INDIA CLEAN ENERGY HLDG 高级 S 条例债券 (REG) (S 条例) 4.5% 2027年4月18日	4,600,000	4,387,250	0.14
		<u>21,403,881</u>	<u>0.69</u>
<b>债务证券(合计)</b>		<u>3,020,325,199</u>	<u>97.13</u>
<b>单位信托</b>			
上市投资			
<b>卢森堡</b>			
HSBC INVESTMENT FUNDS LUXEMBOURG SA/LUXEMBOURG-HSBC-ASIAN CURRENCIES BD-ZD*	659,401	<u>4,820,221</u>	<u>0.16</u>

## 投资组合报表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

2025年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>单位信托</b>			
未上市但有报价的投资			
<b>香港</b>			
汇丰全方位中国债券基金 ZC-美元	150,000	1,758,900	0.05
<b>爱尔兰</b>			
汇丰环球流动性基金 PL *	20,550,965	20,550,965	0.66
<b>单位信托(合计)</b>		27,130,086	0.87
<b>衍生资产</b>			
外币远期合同		3,784,184	0.12
期货合同		24,859	0.00
<b>金融资产合计</b>		3,051,264,328	98.12
<b>金融负债</b>			
<b>衍生负债</b>			
外币远期合同		(4,512,760)	(0.15)
期货合同		(680,600)	(0.02)
信用违约互换		(6,545,520)	(0.21)
<b>金融负债合计</b>		(11,738,880)	(0.38)
<b>净投资总额</b>			
(投资成本合计: 3,090,717,072 美元)		3,039,525,448	97.74
<b>其他资产净值</b>		70,128,166	2.26
<b>资产净值总额</b>		3,109,653,614	100.00

\* 投资基金未在香港获得认可，不向香港公众发行。



# 投资组合变动表

## 汇丰亚洲债券基金

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
<b>金融资产</b>		
<b>债务证券</b>		
<b>债券</b>		
上市投资	96.36	98.32
未上市但有报价的投资	0.77	0.40
<b>债务证券(合计)</b>	<u>97.13</u>	<u>98.72</u>
<b>单位信托</b>		
上市投资	0.16	0.39
未上市但有报价的投资	0.71	0.14
<b>单位信托(合计)</b>	<u>0.87</u>	<u>0.53</u>
<b>衍生资产</b>		
外币远期合同	0.12	0.04
期货合同	0.00	0.11
	<u>0.12</u>	<u>0.15</u>
<b>衍生负债</b>		
外币远期合同	(0.15)	(0.06)
期货合同	(0.02)	-
信用违约互换	(0.21)	(0.40)
	<u>(0.38)</u>	<u>(0.46)</u>
<b>总投资</b>	97.74	98.94
<b>其他资产净值</b>	<u>2.26</u>	<u>1.06</u>
<b>资产净值总额</b>	<u>100.00</u>	<u>100.00</u>

## 金融衍生工具明细表

### 汇丰亚洲债券基金

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
<b>金融资产：</b>				
2,038,302 澳元	1,270,244美元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	1,245
74,806,860 澳元	46,618,662美元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	45,703
7,922,149 欧元	8,213,494美元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	30,935
662,293 英镑	810,986美元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	11,845
2,367美元	3,782澳元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	7
7,382美元	11,793澳元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	25
5,158美元	37,446元离岸 人民币	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	17
15,980美元	116,008元离岸 人民币	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	53
237,497美元	341,307加元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	1,587
64,174美元	467,143元离岸 人民币	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	42
81,475美元	592,215元离岸 人民币	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	170
84,634美元	616,392元离岸 人民币	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	12

## 金融衍生工具明细表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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
<b>金融资产(续):</b>				
134,364美元	974,941元离岸 人民币	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	512
1,204,133 美元	1,919,698澳元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	6,590
1,748,638 美元	12,660,562元离岸 人民币	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	10,389
19,000,000 元离 岸人民币	2,606,155美元	2025年3月31日	法国东方汇理 银行	6,311
199,000,000 元离 岸人民币	27,174,069美元	2025年3月31日	瑞银集团伦敦 分行	187,216
235,000,000 元离 岸人民币	32,191,507美元	2025年3月31日	汇丰市场财资 服务香港	120,273
1,330,000,000 元离 岸人民币	181,045,737美元	2025年3月31日	法国东方汇理 银行	1,817,121
9,760,000欧元	10,172,747美元	2025年3月31日	道富银行和信托 公司香港分行	392
1,850,000,000日元	11,902,117美元	2025年3月31日	巴黎银行巴黎 分行	120,675
128,000,000泰铢	3,725,197美元	2025年3月31日	美林国际	88,032
298,000,000泰铢	8,624,806美元	2025年3月31日	汇丰市场财资 服务香港	252,529

## 金融衍生工具明细表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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
<b>金融资产(续):</b>				
306,000,000泰铢	8,905,875美元	2025年3月31日	巴黎银行巴黎分行	210,127
1,474,830美元	1,400,000欧元	2025年3月31日	法国东方汇理银行	15,502
413,603 美元	3,000,000元离岸人民币	2025年3月31日	法国东方汇理银行	1,097
1,055,145 美元	7,650,000元离岸人民币	2025年3月31日	法国东方汇理银行	3,253
1,172,332 美元	8,500,000元离岸人民币	2025年3月31日	西太平洋银行悉尼分行	3,563
1,379,088 美元	10,000,000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	4,066
1,666,833美元	12,050,000元离岸人民币	2025年3月31日	瑞银集团伦敦分行	9,911
2,071,317美元	15,000,000元离岸人民币	2025年3月31日	摩根大通证券伦敦分公司	8,773
3,184,663美元	23,000,000元离岸人民币	2025年3月31日	摩根大通证券伦敦分公司	22,058
27,332,740美元	26,220,000欧元	2025年3月31日	法国东方汇理银行	2,836
8,769,857美元	63,600,000元离岸人民币	2025年3月31日	汇丰市场财资服务香港	24,719
8,968,482 美元	65,000,000元离岸人民币	2025年3月31日	汇丰市场财资服务香港	30,819

## 金融衍生工具明细表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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
<b>金融资产(续):</b>				
11,337,395美元	1,690,000,000日元	2025年3月31日	汇丰市场财资 服务香港	353,355
9,200,348 美元	13,000,000,000韩元	2025年3月31日	汇丰市场财资 服务香港	230,606
9,821,115 美元	14,000,000,000韩元	2025年3月31日	美林国际	161,818
				<hr/> <hr/> 3,784,184

## 金融衍生工具明细表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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
<b>金融负债：</b>				
10,780 澳元	6,762美元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	(37)
339,919 加元	235,980美元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	(1,031)
1,387 加元	965美元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	(6)
473,737,411 元离 岸人民币	65,144,029美元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	(106,629)
143,153,134 元离 岸人民币	19,684,712美元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	(31,827)
90,490,040元离岸 人民币	12,443,112美元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	(20,119)
35,451,044元离岸 人民币	4,886,136美元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	(19,174)
2,512,579元离岸人 民币	345,011美元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	(72)
411,800元离岸人 民币	56,727美元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	(192)

## 金融衍生工具明细表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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
<b>金融负债(续):</b>				
43,948 元离岸人民币	6,046美元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	(13)
9,900 元离岸人民币	1,369美元	2025年2月28日	汇丰市场财资 服务香港	(10)
147,000,000,000 印尼盾	9,243,673美元	2025年3月27日	西太平洋银行 悉尼分行	(240,893)
8,948,137 美元	147,000,000,000 印尼盾	2025年3月27日	澳新银行墨尔本 分行	(52,522)
277,000,000元离岸人民币	38,139,944美元	2025年3月31日	汇丰市场财资 服务香港	(51,917)
68,833,115元离岸人民币	9,500,000美元	2025年3月31日	法国东方汇理 银行	(35,158)
14,515,886元离岸人民币	2,000,000美元	2025年3月31日	法国东方汇理 银行	(4,029)
11,192,000欧元	11,884,203美元	2025年3月31日	西太平洋银行 悉尼分行	(216,905)
8,500,000欧元	8,973,823美元	2025年3月31日	法国东方汇理 银行	(113,214)
3,500,000欧元	3,678,807美元	2025年3月31日	巴黎银行巴黎 分行	(30,436)
2,800,000,000日元	18,942,738美元	2025年3月31日	瑞银集团伦敦 分行	(739,531)
41,142,000,000韩元	28,428,664美元	2025年3月31日	瑞银集团伦敦 分行	(44,766)
178,642,048美元	1,310,000,000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	(1,477,667)

## 金融衍生工具明细表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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
<b>金融负债(续):</b>				
2,557,404美元	3,710,000,000韩元	2025年3月31日	美林国际	(2,089)
1,770,165美元	2,600,000,000韩元	2025年3月31日	美林国际	(23,442)
1,457,533美元	1,400,000欧元	2025年3月31日	法国东方汇理银行	(1,722)
1,237,437美元	1,800,000,000韩元	2025年3月31日	美林国际	(4,350)
968,691美元	150,000,000日元	2025年3月31日	西太平洋银行悉尼分行	(6,195)
823,429美元	6,000,000元离岸人民币	2025年3月31日	摩根大通证券伦敦分公司	(1,568)
547,048美元	4,000,000元离岸人民币	2025年3月31日	法国东方汇理银行	(2,943)
503,557美元	732,000,000韩元	2025年3月31日	法国东方汇理银行	(1,438)
436,373美元	422,000欧元	2025年3月31日	摩根大通证券伦敦分公司	(3,476)
				<u>(4,512,760)</u>



## 金融衍生工具明细表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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
<b>金融资产：</b>						
US 10YR NOTE (CBT) 20/03/2025	US 10YR NOTE	1000	4,680,281	多头	汇丰银行	24,859
						24,859
<b>金融负债</b>						
US 10YR NOTE (CBT) 20/03/2025	US 10YR NOTE	1000	95,782,500	空头	汇丰银行	(37,990)
US 10YR NOTE (CBT) 20/03/2025	US 10YR NOTE	1000	3,591,844	空头	汇丰银行	(51,047)
US 10YR NOTE (CBT) 20/03/2025	US 10YR NOTE	1000	6,204,094	空头	汇丰银行	(56,110)
US 10YR NOTE (CBT) 20/03/2025	US 10YR NOTE	1000	5,986,406	空头	汇丰银行	(56,719)
US 10YR NOTE (CBT) 20/03/2025	US 10YR NOTE	1000	14,585,063	空头	汇丰银行	(138,187)
US 10YR NOTE (CBT) 20/03/2025	US 10YR NOTE	1000	104,490,000	空头	汇丰银行	(150,000)
US 5YR NOTE (CBT) 31/03/2025	US 5YR NOTE	1000	9,043,203	空头	汇丰银行	(35,195)
US 5YR NOTE (CBT) 31/03/2025	US 5YR NOTE	1000	21,810,078	空头	汇丰银行	(155,352)
						(680,600)

## 金融衍生工具明细表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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
<b>金融负债：</b>		
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 103 27,000,000.00 USD 04/09/2024 20/06/2029	巴黎银行香港分行	(1,760,048)
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 106 199,000,000.00 EUR 06/12/2024 20/12/2029	美林国际	(4,785,472)
		<u>(6,545,520)</u>

# 业绩表现记录

## 汇丰亚洲债券基金

### (a) 价格纪录(交易份额净值)

年份	AC 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	10.638	11.737	10.967	12.100
2015	10.695	12.224	12.057	12.602
2016	11.925	12.874	12.294	13.272
2017	12.416	13.028	13.028	13.420
2018	12.724	13.193	13.118	13.601
2019	12.699	14.007	12.730	14.007
2020	12.991	15.093	12.991	15.093
2021	14.913	15.364	14.913	15.364
2022	12.549	15.257	12.549	15.257
2023	11.654	12.851	11.654	12.851
2024	12.093	13.355	12.093	13.355
2024年8月1日至2025年1月31日	13.413	13.811	13.413	13.811

  

年份	AM2 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	9.687	10.300	9.987	10.619
2015	10.131	10.418	10.441	10.743
2016	9.990	10.502	10.300	10.828
2017	10.000	10.560	10.300	10.886
2018	9.762	10.413	10.060	10.734
2019	9.565	10.234	9.587	10.234
2020	9.493	10.591	9.493	10.591
2021	10.159	10.548	10.159	10.548
2022	8.195	10.306	8.195	10.306
2023	7.473	8.329	7.473	8.329
2024	7.324	7.814	7.324	7.814
2024年8月1日至2025年1月31日	7.483	7.868	7.483	7.868

## 业绩表现记录(续)

### (a) 价格纪录(交易份额净值)(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	8.770	9.335	9.041	9.624
2015	9.176	9.439	9.460	9.731
2016	9.049	9.508	9.329	9.802
2017	9.049	9.566	9.263	9.862
2018	8.738	9.362	9.008	9.652
2019	8.585	9.187	8.601	9.187
2020	8.599	9.575	8.599	9.575
2021	9.189	9.562	9.189	9.562
2022	7.330	9.294	7.330	9.294
2023	6.685	7.453	6.685	7.453
2024	6.571	7.019	6.571	7.019
2024年8月1日至2025年1月31日	6.757	7.093	6.757	7.093

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	9.194	9.823	9.478	10.127
2015	9.700	10.026	10.000	10.337
2016	9.564	10.035	9.860	10.344
2017	9.546	10.095	9.793	10.407
2018	9.229	9.890	9.514	10.195
2019	9.067	9.687	9.082	9.687
2020	9.048	10.100	9.048	10.100
2021	9.663	10.063	9.663	10.063
2022	7.695	9.769	7.695	9.769
2023	7.012	7.823	7.012	7.823
2024	6.886	7.338	6.886	7.338
2024年8月1日至2025年1月31日	7.058	7.411	7.058	7.411

年份	AM3H 类 - 加元份额			
	买入		卖出	
	最低 加元	最高 加元	最低 加元	最高 加元
2024	9.590	22.628	9.590	22.628
2024年8月1日至2025年1月31日	22.144	23.253	22.144	23.253

## 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	9.295	9.861	9.582	10.166
2015	9.715	10.030	10.016	10.341
2016	9.567	10.026	9.864	10.336
2017	9.512	10.080	9.724	10.392
2018	9.116	9.807	9.398	10.111
2019	8.958	9.567	8.969	9.567
2020	8.927	9.975	8.927	9.975
2021	9.544	9.935	9.544	9.935
2022	7.600	9.656	7.600	9.656
2023	6.933	7.735	6.933	7.735
2024	6.807	7.225	6.807	7.225
2024年8月1日至2025年1月31日	6.947	7.295	6.947	7.295

年份	AM3H 类 - 英镑份额			
	买入		卖出	
	最低 英镑	最高 英镑	最低 英镑	最高 英镑
2024	9.744	10.134	9.744	10.134
2024年8月1日至2025年1月31日	9.829	10.320	9.829	10.320

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
2021	9.808	10.231	9.808	10.231
2022	7.807	9.920	7.807	9.920
2023	7.110	7.934	7.110	7.934
2024	6.987	7.427	6.987	7.427
2024年8月1日至2025年1月31日	7.162	7.510	7.162	7.510

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	9.974	10.500	9.974	10.500
2021	10.393	10.692	10.393	10.692
2022	8.839	10.655	8.839	10.655
2023	8.209	9.044	8.209	9.044
2024	8.549	9.261	8.549	9.261
2024年8月1日至2025年1月31日	9.346	9.651	9.346	9.651

## 业绩表现记录(续)

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	9.999	10.404	9.999	10.404
2021	9.416	10.406	9.416	10.406
2022	8.217	9.726	8.217	9.726
2023	8.162	9.026	8.162	9.026
2024	8.684	9.560	8.684	9.560
2024年8月1日至2025年1月31日	9.424	9.744	9.424	9.744

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	9.951	10.607	9.951	10.607
2021	10.480	10.798	10.480	10.798
2022	8.819	10.722	8.819	10.722
2023	8.190	9.032	8.190	9.032
2024	8.526	9.421	8.526	9.421
2024年8月1日至2025年1月31日	9.426	9.703	9.426	9.703

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	10.642	10.000	10.642
2021	10.568	11.016	10.568	11.016
2022	9.244	11.033	9.244	11.033
2023	8.570	9.442	8.570	9.442
2024	8.673	9.145	8.673	9.145
2024年8月1日至2025年1月31日	8.906	9.251	8.906	9.251

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	9.985	10.483	9.985	10.483
2021	10.141	10.531	10.141	10.531
2022	8.176	10.287	8.176	10.287
2023	7.456	8.312	7.456	8.312
2024	7.354	7.793	7.354	7.793
2024年8月1日至2025年1月31日	7.475	7.851	7.475	7.851

## 业绩表现记录(续)

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	10.395	10.000	10.395
2021	9.159	10.367	9.159	10.367
2022	7.701	9.408	7.701	9.408
2023	7.437	7.973	7.437	7.973
2024	7.538	7.881	7.538	7.881
2024年8月1日至2025年1月31日	7.626	7.866	7.626	7.866

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	9.951	10.558	9.951	10.558
2021	10.192	10.606	10.192	10.606
2022	8.130	10.308	8.130	10.308
2023	7.414	8.266	7.414	8.266
2024	7.312	7.743	7.312	7.743
2024年8月1日至2025年1月31日	7.494	7.867	7.494	7.867

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	10.000	10.504	10.000	10.504
2021	10.141	10.550	10.141	10.550
2022	8.079	10.259	8.079	10.259
2023	7.357	8.213	7.357	8.213
2024	7.291	7.673	7.291	7.673
2024年8月1日至2025年1月31日	7.395	7.763	7.395	7.763

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	9.977	10.515	9.977	10.515
2021	10.130	10.549	10.130	10.549
2022	8.075	10.253	8.075	10.253
2023	7.352	8.204	7.352	8.204
2024	7.252	7.680	7.252	7.680
2024年8月1日至2025年1月31日	7.402	7.761	7.402	7.761

## 业绩表现记录(续)

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
2014	10.623	11.781	10.623	11.781
2015	11.739	12.310	11.739	12.310
2016	12.030	13.038	12.030	13.038
2017	12.596	13.255	12.596	13.255
2018	12.991	13.429	12.991	13.429
2019	12.994	14.379	12.994	14.379
2020	13.302	15.564	13.302	15.564
2021	15.419	15.879	15.419	15.879
2022	13.056	15.813	13.056	15.813
2023	12.141	13.404	12.141	13.404
2024	12.664	14.021	12.664	14.021
2024年8月1日至2025年1月31日	14.112	14.512	14.112	14.512

年份	ID2 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	9.443	10.523	9.443	10.523
2015	10.003	10.541	10.003	10.541
2016	9.903	10.759	9.903	10.759
2017	10.057	10.573	10.057	10.573
2018	9.648	10.296	9.648	10.296
2019	9.578	10.594	9.578	10.594
2020	9.805	11.024	9.805	11.024
2021	10.366	10.840	10.366	10.840
2022	8.472	10.456	8.472	10.456
2023	7.739	8.651	7.739	8.651
2024	8.109	8.249	8.109	8.249
2024年8月1日至2025年1月31日	8.632	8.878	8.632	8.878

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
2021	9.856	10.229	9.856	10.229
2022	7.907	9.985	7.907	9.985
2023	7.220	8.040	7.220	8.040
2024	7.252	7.543	7.252	7.543
2024年8月1日至2025年1月31日	7.371	7.727	7.371	7.727



## 业绩表现记录(续)

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
2014	9.634	10.723	9.634	10.723
2015	10.246	10.789	10.246	10.789
2016	10.152	11.060	10.156	11.060
2017	10.386	10.957	10.386	10.957
2018	9.986	10.678	9.986	10.678
2019	9.928	11.026	9.928	11.026
2020	10.173	11.469	10.173	11.469
2021	10.726	11.260	10.726	11.260
2022	8.765	10.827	8.765	10.827
2023	8.018	8.864	8.018	8.864
2024	8.155	8.827	8.155	8.827
2024年8月1日至2025年1月31日	8.840	9.084	8.840	9.084

### (b) 总资产净值(按《香港财务报告准则》计算)

	2025年1月31日 美元	2024 美元	2023 美元	2022 美元
总资产净值	<u>3,109,653,614</u>	<u>1,188,530,195</u>	<u>1,341,206,208</u>	<u>1,463,756,232</u>

## 业绩表现记录(续)

### (c) 份额净值(按《香港财务报告准则》计算)

		2025年1月31			
	计价货币	日	2024	2023	2022
份额净值					
- AC 类 - 美元	美元	13.517	13.407	12.643	12.773
- AM2 类 - 港元	港元	7.519	7.695	7.713	8.305
- AM2 类 - 美元	美元	6.777	6.921	6.949	7.428
- AM3H 类 - 澳元	澳元	7.081	7.237	7.281	7.799
- AM3H 类 - 加元	加元	9.859	11.898	-	-
- AM3H 类 - 欧元	欧元	6.970	7.128	7.172	7.710
- AM3H 类 - 英镑	英镑	9.859	10.074	-	-
- AM3H 类 - 人民币	人民币	7.182	7.350	7.379	7.908
- BC 类 - 港元	港元	9.451	9.398	8.847	8.998
- BC 类 - 人民币	人民币	9.669	9.504	8.849	8.454
- BC 类 - 美元	美元	9.498	9.422	8.884	8.977
- BCH 类 - 人民币	人民币	8.962	9.020	9.137	9.411
- BM2 类 - 港元	港元	7.503	7.679	7.700	8.286
- BM2 类 - 人民币	人民币	7.707	7.806	7.744	7.810
- BM2 类 - 美元	美元	7.516	7.676	7.707	8.239
- BM3H 类 - 澳元	澳元	7.416	7.580	7.627	8.187
- BM3H 类 - 人民币	人民币	7.416	7.589	7.622	8.178
- IC 类 - 美元	美元	14.224	14.077	13.214	13.291
- ID2 类 - 美元	美元	8.702	8.612	8.290	8.472
- IM2 类 - 美元	美元	7.394	7.534	7.531	8.014
- ZD2 类 - 美元	美元	8.920	8.803	8.472	8.765

# 收益分配表

## 汇丰亚洲债券基金

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	0.0378	6,371,011.63
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0383	6,466,055.56
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0376	6,602,467.17
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0370	6,333,773.51
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0370	6,115,358.70
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0365	5,609,952.21
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	0.0340	2,194,101.60
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0345	2,275,950.89
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月12日	0.0339	2,272,581.14
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0334	2,165,937.09
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0334	2,142,660.79
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0329	2,064,142.40
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	0.0301	297,515.45
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0302	320,549.24
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0318	350,117.21
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0325	360,872.69
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0334	345,022.89
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0328	337,547.27
AM3H 类 - 加元份额	除息日期	付款日期	每份额分配 加元	分配总额 加元
第 1 次分配	2024年8月30日	2024年9月10日	0.0920	1,408.27
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0920	1,408.27
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月12日	0.0929	1,422.05
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0886	1,356.23
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0866	1,325.61
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0854	-

## 收益分配表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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	0.0252	23,013.09
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0252	23,031.09
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0254	31,387.02
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0259	33,784.04
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0258	33,625.53
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0254	28,886.34
AM3H 类 - 英镑份额	除息日期	付款日期	每份额分配 英镑	分配总额 英镑
第 1 次分配	2024年8月30日	2024年9月10日	0.0469	737.02
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0470	753.55
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0496	1,957.54
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0491	2,169.51
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0493	1,909.70
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0485	3,257.84
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	0.0189	250,676.65
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0106	155,380.90
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0126	192,503.90
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0194	297,554.72
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0275	367,669.01
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0272	336,537.98
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	0.0377	48,758.19
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0382	52,234.67
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0375	50,196.74
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0370	47,928.90
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0370	47,828.70
第 6 次分配	2025年1月27日	2025年2月11日	0.0364	-

## 收益分配表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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	0.0380	2,568,117.76
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0382	3,651,784.88
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0376	3,512,873.22
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0378	3,411,538.13
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0380	3,276,004.05
第 6 次分配	2024年1月27日	2025年2月11日	0.0378	-
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	0.0377	73,303.68
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0382	101,363.66
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月12日	0.0377	98,963.00
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0371	95,689.03
第 5 次分配	2024年12月30日	2025年1月10日	0.0371	94,617.34
第 6 次分配	2025年1月27日	2025年2月11日	0.0365	-
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	0.0315	7,933.79
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0316	8,685.06
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0333	9,152.30
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0341	9,372.17
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0350	9,619.53
第 6 次分配	2025年1月27日	2025年2月11日	0.0344	-
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	0.0195	297,132.06
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0109	269,363.83
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月11日	0.0130	313,016.35
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0201	466,555.49
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0284	637,005.64
第 6 次分配	2025年1月27日	2025年2月11日	0.0281	-

## 收益分配表(续)

### 汇丰亚洲债券基金

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	0.0371	909,579.44
第 2 次分配	2024年9月30日	2024年10月10日	0.0376	926,160.14
第 3 次分配	2024年10月31日	2024年11月12日	0.0370	915,772.26
第 4 次分配	2024年11月29日	2024年12月10日	0.0365	907,737.47
第 5 次分配	2024年12月31日	2025年1月10日	0.0365	912,023.32
第 6 次分配	2025年1月28日	2025年2月11日	0.0359	901,347.34

## 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 <sup>1</sup>	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	21,302,785	21,302,785
摩根士丹利国际公司	AA-	固定收益证券	6,835,823	6,835,823
Jefferies International Limited (母公司)	BBB+	固定收益证券	47,717,766	47,717,766
				<hr/>
				75,856,374

2024年1月31日

无

<sup>1</sup> 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	Aa1u	2,804,078
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	191,145
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	3,049,705
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	4,047,529
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	3,049,705
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	-
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	9,316
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	969,935
巴黎银行伦敦分行	债券	穆迪	未评级	1,331,213
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	1,017,265
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3u	3,799,990
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	A1	8,308
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	1,017,739
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	1,277,365
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1u	112,246
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1u	2,843,452
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	1,444,291
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	231,924
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	1,283,272
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	47
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	462,335
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	28,973
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	812
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	95
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	1,284,811
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	9,066,375
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	322,602
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	691
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	1,402,509
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	301
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	11
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	94,374
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	32,098
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	584,309
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	24,295
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	1,903,323
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	105,084
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	315,512
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	4,111,086
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	519,763
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	1,292
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	2



## 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	未评级	961
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	2,534
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	140
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	2,074,248
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	77,016
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	143,477
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	63
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	2,316,524
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	34,601
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	1,062
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	83
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	1,828,066
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	89,967
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	1,678,638
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	9,066,358
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	1,882,040
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	260,564
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	808,173
摩根士丹利国际公司	GIL	穆迪	未评级	33,647
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	未评级	1,297,459
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	未评级	1,292,604
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	未评级	1,293,144
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	A1	340,617
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	90
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	1,280,815
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	1,297,359
				75,856,374

2024年1月31日

无

## 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 <sup>2</sup>	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	452,002,070
Jefferies International Limited (母公司)	政府债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	14,048,968
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	165,350,718
巴黎银行伦敦分行	政府债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	8,456,340
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	33,225,018
摩根士丹利国际公司	政府债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	4,673,535
						677,756,649

截至 2024 年 1 月 31 日止期间

无

<sup>2</sup> 在分别截至2025年和2024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 <sup>3</sup> 美元
CNOOC FINANCE 2013 LTD 4.25% 2043年5月9日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.01%	449,613
印度尼西亚 4.7% 2034年2月10日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	567,514
印度尼西亚(共和国) 5.15% 2054年9月10日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	1,381,878
印度尼西亚(共和国) 5.15% 2054年9月10日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	763,718
印度尼西亚共和国(政府) 3.55% 2051年6月9日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	详见下表	三方抵押品	0.02%	566,144
印度尼西亚共和国(政府) 3.55% 2051年6月9日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.01%	353,840
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 6.25% 2049年1月25日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	505,997
TSMC ARIZONA CORP 4.5% 2052年4月22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.09%	2,742,923

## 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	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 <sup>3</sup> 美元
腾讯控股有限公司 3.84% 2051年4月22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.16%	4,839,239
腾讯控股有限公司 S 条例 债券 3.94% 2061年4月22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	1,149,074
THAIOIL TRSRY CENTER 2.5% 2030年 6月18日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	1,271,466
THAIOIL TRSRY CENTER 2.5% 2030年 6月18日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.01%	365,335
THAIOIL TRSRY CENTER 2.5% 2030年 6月18日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	详见下表	三方抵押品	0.06%	1,864,817
THAIOIL TRSRY CENTER 2.5% 2030年 6月18日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.06%	1,849,559
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	0.01%	301,374
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	0.04%	1,205,495
PROSUS NV 4.987% 2052 年1月19日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	607,540

## 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	与资产净值结算/清算直百分比	借出证券公允价值 <sup>3</sup> 美元
PROSUS NV 4.987% 2052 年1月19日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.09%	2,885,815
PROSUS NV 4.987% 2052 年1月19日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.08%	2,573,691
GREENKO POWER II LTD 4.3% 2028年12月 13日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.01%	405,605
香港机场管理局 3.5% 2062年1月12 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.07%	2,315,509
GOLOMT BANK OF MONGOLIA 11% 2027年5 月20日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	详见下表	三方抵押品 0.06%	1,992,869
HYUNDAI CAPITAL SERVICES 5.25% 2028 年1月22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.17%	5,148,800
联想集团有限 公司 5.831% 2028年1月27 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.07%	2,123,811
LG ENERGY SOLUTION 5.75% 2028 年9月25日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.03%	1,016,058

## 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	占资产净值 结算/清算 值百分比	借出证券公 平价值 <sup>3</sup> 美元
RELIANCE INDUSTRIES LTD 2.875% 2032年1月12日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.03%	768,307
RELIANCE INDUSTRIES LTD 2.875% 2032年1月12日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.08%	2,390,287
SAEL LTD GROUP ISSUERS 7.8% 2031年7月31日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.02%	503,365
NAN FUNG TREASURY LTD 5% 2028年9月5日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.03%	1,087,993
NAN FUNG TREASURY LTD 5% 2028年9月5日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.06%	1,942,845
NAN FUNG TREASURY LTD 5% 2028年9月5日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	详见下表	三方抵押品 0.03%	971,423
NAN FUNG TREASURY LTD 5% 2028年9月5日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.12%	3,885,690
方兴光耀有限公司 4.25% 2029年7月23日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.02%	755,892
FORTUNE STAR BVI LTD 5.05% 2027年1月27日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.03%	1,038,200
普洛斯中国控股有限公司 2.95% 2026年3月29日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.03%	975,549
新城环球有限公司 4.625% 2025年10月15日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.02%	456,036
新城环球有限公司 4.625% 2025年10月15日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.06%	1,732,937
富卫集团控股有限公司 7.784% 2033年12月6日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.04%	1,112,204
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 0.06%	1,808,977

## 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	占资产净值 结算/清算 百分比	借出证券公 平价值 <sup>3</sup> 美元
沙特阿拉伯石油公司 5.75% 2054年7月17日	公司债	美元	无固定 期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.05%	1,406,194
沙特阿拉伯石油公司 5.75% 2054年7月17日	公司债	美元	无固定 期限	伦敦	0%	详见下 表	0.25%	7,874,685
MUANGTHAI CAPITAL PCL 6.8750% 2028年9 月30日	公司债	美元	无固定 期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.08%
FORTUNE STAR BVI LTD 8.50% 2028年5月 19日	公司债	美元	无固定 期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.04%	1,210,229
							2.30%	71,492,476

2024 年 1 月 31 日

无

- <sup>3</sup> 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

#### 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%	2034年5月23日	三方抵押品	0.09%	2,804,078
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	0.04%	1,277,365
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%	112,246
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年2月20日	三方抵押品	0.09%	2,843,452
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	0.05%	1,444,291
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2049年5月23日	三方抵押品	0.01%	231,924
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年3月28日	三方抵押品	0.01%	191,145
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	0.04%	1,283,272
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%	47
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	0.01%	462,335
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2054年6月22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
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%	28,973
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%	812
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年10月22日	三方抵押品	0.00%	95
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	0.04%	1,284,811
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年4月15日	三方抵押品	0.29%	9,066,375
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2025年8月15日	三方抵押品	0.01%	322,602
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	0.10%	3,049,705
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2031年1月4日	三方抵押品	0.00%	691
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	0.05%	1,402,509
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2039年7月4日	三方抵押品	0.00%	301
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	0.00%	11

# 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%	2042年7月4日	三方抵押品	0.00%	94,374
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2044年7月4日	三方抵押品	0.00%	32,098
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	0.13%	4,047,529
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	0.10%	3,049,705
巴黎银行伦敦分行	政府债券	丹麦克朗	无固定期限	伦敦	0%	2031年11月15日	三方抵押品	0.00%	-
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%	9,316
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年5月25日	三方抵押品	0.03%	969,935
巴黎银行伦敦分行	债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2031年1月5日	三方抵押品	0.04%	1,331,213
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年5月25日	三方抵押品	0.03%	1,017,265
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年5月25日	三方抵押品	0.12%	3,799,990
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2047年7月25日	三方抵押品	0.02%	584,309
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%	24,295
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	0.06%	1,903,323
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%	105,084
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2050年5月25日	三方抵押品	0.01%	315,512

## 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%	2027年2月25日	三方抵押品	0.13%	4,111,086
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	0.02%	519,763
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	0.00%	1,292
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2043年5月25日	三方抵押品	0.00%	2
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	0.00%	961
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%	2,534
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%	140
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%	33,647
摩根士丹利国际公司	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2025年3月1日	三方抵押品	0.04%	1,297,459
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%	8,308
摩根士丹利国际公司	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2040年6月20日	三方抵押品	0.04%	1,292,604

# 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	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2040年12月20日	三方抵押品	0.04%	1,293,144
摩根士丹利国际公司	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2039年3月20日	三方抵押品	0.01%	340,617
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年1月15日	三方抵押品	0.07%	2,074,248
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	0.00%	77,016
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	0.00%	143,477
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	0.03%	1,017,739
Jefferies International Limited (母公司)	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%	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	0.07%	2,316,524
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028年8月15日	三方抵押品	0.00%	34,601
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028年11月15日	三方抵押品	0.00%	1,062
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
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2031年2月15日	三方抵押品	0.00%	83
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	0.06%	1,828,066

## 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 8 月 31 日	三方抵押品	0.00%	89,967
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028 年 8 月 31 日	三方抵押品	0.00%	90
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2027 年 2 月 28 日	三方抵押品	0.05%	1,678,638
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	0.29%	9,066,358
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	0.06%	1,882,040
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2030 年 5 月 31 日	三方抵押品	0.01%	260,564
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028 年 12 月 31 日	三方抵押品	0.03%	808,173
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2027 年 9 月 15 日	三方抵押品	0.04%	1,280,815
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2026 年 10 月 31 日	三方抵押品	0.04%	1,297,359
								<u>2.40%</u>	<u>75,856,374</u>

2024 年 1 月 31 日

无

## 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 <sup>3</sup> 美元	借出证券金额占可借出资产总额的百分比 <sup>3</sup> %	借出证券金额占本基金管理资产规模的百分比 <sup>3</sup> %	回购交易的绝对金额 美元
71,492,476	2.4694	2.2990	不适用

2024年1月31日

无

<sup>3</sup> 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年和2024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

在分别截至2025年和2024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	21,302,785	0.6851%
摩根士丹利国际公司	6,835,823	0.2198%
Jefferies International Limited (母公司)	47,717,766	1.5345%
	<hr/>	<hr/>
	75,856,374	2.4394%
	<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		
GERMANY DEGV 0.100 04/15/26	9,066,375	0.2916%
US TREASURY UST 3.875 11/30/27	9,066,358	0.2916%
FRANCE FRGV 02/25/27	4,111,086	0.1322%
GERMANY DEGV 2.000 12/10/26	4,047,529	0.1302%
FRANCE FRGV 2.500 05/25/30	3,799,990	0.1222%
GERMANY DEGV 0.250 02/15/29	3,049,705	0.0981%
GERMANY DEGV 2.400 04/18/30	3,049,705	0.0981%
AUSTRIA ATGV 02/20/30	2,843,452	0.0914%
AUSTRIA ATGV 2.400 05/23/34	2,804,078	0.0902%
US TREASURY UST 4.375 08/15/43	2,316,524	0.0745%
	44,154,802	1.4201%

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 借出证券的公平 价值 <sup>3</sup> 美元	占2025年1月31 日资产净值总额 的百分比 <sup>3</sup> %
巴黎银行伦敦分行	30,071,558	0.9670%
摩根士丹利国际公司	2,664,195	0.0857%
Jefferies International Limited (母公司)	38,756,723	1.2463%
	71,492,476	2.2990%

2024年1月31日

无

<sup>3</sup> 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	75,856,374

## 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<sup>3,5</sup> 71,492,476

---

2024年1月31日

无

<sup>3</sup> 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。

<sup>4</sup> 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。

<sup>5</sup> 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。

<sup>6</sup> 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	8,942	-
- 管理费	1,192	-
- HSS收入	1,788	-
	<hr/> 11,922 <hr/>	<hr/> - <hr/>

## 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 31日止期间 美元	截至2024年1月 31日止期间 美元
证券借贷和回购交易收益	11,922	-
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