

汇丰集合投资信托一 汇丰亚洲高入息债券基金

2025年中期报告



汇丰投资管理
HSBC Asset Management

汇丰亚洲高入息债券基金

中期报告
截至 2025 年 9 月 30 日止期间

目录	页码
1.汇丰亚洲高入息债券基金	
资产负债表(未经审计)	1 - 3
全面收益表(未经审计)	4 - 5
份额持有人应占资产净值变动表(未经审计)	6 - 9
现金流量表(未经审计)	10
投资组合报表(未经审计)	11 - 34
投资组合变动表(未经审计)	35 - 36
金融衍生工具详情(未经审计)	37 - 40
业绩表现记录(未经审计)	41 - 47
分派披露(未经审计)	48 - 53
证券借贷安排和抵押资产持有量详情	54 - 87
2.行政	88 - 89

资产负债表

2025 年 9 月 30 日

	2025 年 9 月 30 日	2025 年 3 月 31 日
	美元	美元
资产		
以公允价值计量且其变动计入损益账的金融资产	780,687,067	1,019,844,357
应收利息	11,412,310	14,178,450
应收申购款	1,097,644	7,742,196
应收经纪商款项	2,421,954	37,994,908
其他应收账款	25,289	20,843
金融衍生工具应收现金抵押资产	2,960,000	610,000
现金及现金等价物	6,243,195	11,554,727
	<u>804,847,459</u>	<u>1,091,945,481</u>
负债		
以公允价值计量且其变动计入损益账的金融负债	146,550	3,967,054
应付赎回款	3,498,029	5,163,170
应付经纪商款项	13,509,411	59,485,034
应付分派	1,959,956	2,333,346
其他应付账款	883,556	1,255,767
	<u>19,997,502</u>	<u>72,204,371</u>
份额持有人应占资产净值	<u>784,849,957</u>	<u>1,019,741,110</u>
相当于：		
金融负债	<u>784,849,957</u>	<u>1,019,741,110</u>

资产负债表(续)

2024 年 9 月 30 日

	2025 年 9 月 30 日	2025 年 3 月 31 日
	美元	美元
已发行份额总数		
- AC 类 - 美元	134,509	139,449
- AM2 类 - 美元	16,673,779	20,970,033
- AM2 类 - 人民币	1,308,586	1,343,551
- AM2 类 - 加元	199,520	199,520
- AM2 类 - 澳元	824,605	875,706
- AM2 类 - 欧元	149,427	151,990
- AM3O 类 - 澳元	4,649,901	5,277,945
- AM3O 类 - 欧元	180,786	192,446
- AM3O 类 - 人民币	18,652,094	20,606,225
- AM3O 类 - 加元	1,755,190	2,042,108
- AM3O 类 - 英镑	1,090,032	1,837,389
- AM3O 类 - 新加坡元	419,429	468,424
- AM2 类 - 港元	117,397,590	128,112,212
- BC 类 - 美元	901,752	855,147
- BM2 类 - 美元	2,483,880	2,550,559
- BC 类 - 人民币	186,102,578	373,199,298
- BM2 类 - 人民币	112,220,655	104,900,528
- BM3O 类 - 人民币	7,534,829	8,189,820
- BC 类 - 港元	703,997	992,156
- BM2 类 - 港元	1,602,173	1,143,238
- BCO 类 - 人民币	76,113,283	48,174,899
- BM3O 类 - 澳元	257,031	302,677
- IM2 类 - 美元	243,279	243,279
- IC 类 - 美元	498,256	498,256

资产负债表(续)

2024 年 9 月 30 日

	2025 年 9 月 30 日	2025 年 3 月 31 日
	美元	美元
基金份额资产净值		
- AC 类 - 美元	9.794	9.719
- AM2 类 - 美元	6.349	6.370
- AM2 类 - 人民币	0.938	0.929
- AM2 类 - 港元	0.828	0.821
- AM2 类 - 加元	4.887	4.839
- AM2 类 - 澳元	4.916	4.868
- AM2 类 - 欧元	6.803	6.737
- AM3O 类 - 澳元	4.147	3.869
- AM3O 类 - 人民币	0.881	0.858
- AM3O 类 - 加元	4.516	4.324
- AM3O 类 - 英镑	8.397	7.982
- AM3O 类 - 新加坡元	4.868	4.627
- AM3O 类 - 欧元	7.276	6.628
- BC 类 - 美元	9.855	9.460
- BM2 类 - 美元	6.974	6.905
- BC 类 - 人民币	1.394	1.338
- BM2 类 - 人民币	0.991	0.981
- BM3O 类 - 人民币	0.974	0.947
- BC 类 - 港元	1.271	1.220
- BM2 类 - 港元	0.900	0.891
- BCO 类 - 人民币	1.343	1.284
- BM3O 类 - 澳元	4.576	4.269
- IM2 类 - 美元	6.760	6.675
- IC 类 - 美元	9.099	8.709

注：中期报告采用了与本基金年度报告相同的会计政策和计算方法。

全面收益表

截至 2025 年 9 月 30 日止期间

	2025 年 4 月 1 日 至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日
	美元	美元
现金及现金等价物的利息收入	56,245	24,310
以公允价值计量且其变动计入损益账的金融资产和负 债的利息收入	21,462,265	9,722,861
股息收入	406,944	171,126
以公允价值计量且其变动计入损益账的金融资产和负 债的收益净值	14,761,811	14,106,642
汇兑收益净值	2,413,060	2,570,050
证券借贷收入	167,305	-
其他收入	118,147	17,537
收入总额	39,385,777	26,612,526
	-----	-----
管理费 ^{注 2}	4,888,496	2,225,221
交易费用 ^{注 1}	74,845	15,209
受托人费用 ^{注 1}	298,536	136,520
审计师酬金	9,231	9,253
过户代办费用 ^{注 1}	109,356	76,474
专业人员费用	2,697	1,506
保管费、银行手续费及杂费 ^{注 1}	1,076,026	604,011
总经营开支	6,459,187	3,068,194
	-----	-----
税前经营净利润	32,926,590	23,544,332
税项支出	(5,868)	(1,614)
收益分配前经营净利润	32,920,722	23,542,718
向份额持有人作出收益分配	(12,771,954)	(12,824,890)
份额持有人应占资产净值增加及期间内全面收益总额	20,148,768	10,717,828
	=====	=====

全面收益表(续)
截至 2025 年 9 月 30 日止期间

注 1 在截至 2025 年 9 月 30 日和 2024 年 9 月 30 日止期间内，除受托人费用和过户代办费用外，支付给受托人/受托人的关联人士的金额分别为：		
	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日
	美元	美元
交易费用	13,211	8,737
保管费、银行手续费及杂费	23,518	19,124
注 2 在截至 2025 年 9 月 30 日和 2024 年 9 月 30 日止期间内，除支付给管理人的管理费外，没有向管理人/管理人的关联人士支付任何款项。		

份额持有人应占资产净值变动表 截至 2025 年 9 月 30 日止期间

	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日
	美元	美元
期初余额	1,019,741,110	381,381,265
	-----	-----
份额持有人应占资产净值增加及期间内全面收益 总额	20,148,768	10,717,828
	-----	-----
份额认购		
- AC 类 - 美元	147,772	152
- AM2 类 - 美元	11,877,130	27,328,348
- AM2 类 - 人民币	1,401	108,776
- AM2 类 - 港元	22,684,025	20,050,448
- IM2 类 - 美元	-	262,704
- AM3O 类 - 澳元	3,375,030	2,561,448
- AM3O 类 - 欧元	70,325	257,374
- AM3O 类 - 人民币	2,205,367	4,528,592
- AM3O 类 - 加元	1,129,289	6,121,162
- AM3O 类 - 英镑	297,086	3,505,799
- AM3O 类 - 新加坡元	117,981	9,194
- BC 类 - 美元	2,148,432	2,424,878
- BM2 类 - 美元	2,582,104	4,949,850
- BC 类 - 人民币	21,758,952	81,403,340
- BM2 类 - 人民币	28,246,742	10,974,523
- BM3O 类 - 人民币	948,391	2,084,710
- BC 类 - 港元	105,592	165,987
- BM2 类 - 港元	519,778	394,706
- BCO 类 - 人民币	54,791,048	26,431,428
- BM3O 类 - 澳元	207,288	146,481
	-----	-----
	153,213,733	193,709,900
	-----	-----

份额持有人应占资产净值变动表(续) 截至 2025 年 9 月 30 日止期间

	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日
	美元	美元
份额赎回		
- AC 类 - 美元	(193,470)	(218,651)
- AM2 类 - 美元	(39,140,354)	(34,680,767)
- AM2 类 - 人民币	(33,605)	(957,548)
- AM2 类 - 港元	(31,388,914)	(21,507,300)
- AM2 类 - 加元	-	(118,967)
- AM2 类 - 澳元	-	(74,302)
- AM2 类 - 欧元	-	(51,889)
- AM3O 类 - 澳元	(5,938,211)	(4,271,798)
- AM3O 类 - 欧元	(150,705)	(31,213)
- AM3O 类 - 人民币	(3,854,012)	(5,033,839)
- AM3O 类 - 加元	(2,409,087)	(3,836,535)
- AM3O 类 - 英镑	(6,398,845)	(3,264,481)
- AM3O 类 - 新加坡元	(365,011)	(1,255,547)
- BC 类 - 美元	(1,702,470)	(296,221)
- BM2 类 - 美元	(3,075,714)	(384,188)
- BC 类 - 人民币	(270,061,545)	(2,860,640)
- BM2 类 - 人民币	(21,624,239)	(135,728)
- BM3O 类 - 人民币	(1,585,977)	(203,769)
- BC 类 - 港元	(457,678)	-
- BM2 类 - 港元	(108,451)	(11,838)
- BCO 类 - 人民币	(19,092,670)	(217,497)
- BM3O 类 - 澳元	(407,145)	(1,310)
- AM 类 - 欧元	(17,112)	-
- AM 类 - 澳元	(248,439)	-
	(408,253,654)	(79,414,028)
与份额持有人的交易价值总额	(255,039,921)	114,295,872
期末余额	784,849,957	506,394,965

份额持有人应占资产净值变动表(续)
截至 2025 年 9 月 30 日止期间

	AC 类 - 美元份额		AM2 类 - 美元份额		AM2 类 - 人民币份额		AM3O 类 - 人民币份额		AM2 类 - 港元份额		AM2 类 - 欧元份额		AM3O 类 - 欧元份额		AM2 类 - 澳元份额	
	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日
4 月 1 日的已发行份额数目	139,449	242,808	20,970,033	24,980,068	1,343,551	2,274,531	20,606,225	24,583,955	128,112,212	143,682,305	151,990	159,621	192,446	168,624	875,706	908,695
期间内已申购份额	14,707	16	1,868,831	4,217,062	1,496	117,969	2,558,169	5,180,055	27,558,410	24,071,919	-	-	10,323	37,691	-	-
期间内已赎回份额	(19,647)	(23,933)	(6,165,085)	(5,407,435)	(36,461)	(1,022,126)	(4,512,300)	(5,769,768)	(38,273,032)	(26,023,275)	(2,563)	(7,631)	(21,983)	(4,682)	(51,101)	(15,119)
9 月 30 日的已发行份额数目	134,509	218,891	16,673,779	23,789,695	1,308,586	1,370,374	18,652,094	23,994,242	117,397,590	141,730,949	149,427	151,990	180,786	201,633	824,605	893,576

	AM3O 类 - 澳元份额		AM2 类 - 加元份额		AM3O 类 - 加元份额		AM3O 类 - 英镑份额		AM3O 类 - 新加坡元份额		BC 类 - 港元份额	
	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日
4 月 1 日的已发行份额数目	5,277,945	4,686,813	199,520	222,054	2,042,108	2,390,915	1,837,389	2,175,514	468,424	877,783	992,156	397,472
期间内已申购份额	837,874	613,788	-	-	249,363	1,328,576	35,591	425,881	24,949	1,986	84,862	138,855
期间内已赎回份额	(1,465,918)	(1,032,202)	-	(24,234)	(536,281)	(830,845)	(782,948)	(407,528)	(73,944)	(267,196)	(373,021)	-
9 月 30 日的已发行份额数目	4,649,901	4,268,399	199,520	197,820	1,755,190	2,888,646	1,090,032	2,193,867	419,429	612,573	703,997	536,327

份额持有人应占资产净值变动表(续)
 截至 2025 年 9 月 30 日止期间

	BC 类 - 人民币份额		BC 类 - 美元份额		BCO 类 - 人民币份额		BM2 类 - 港元份额		BM2 类 - 人民币份额		BM2 类 - 美元份额	
	2025 年 4 月 1 日 至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日 至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日 至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日 至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日 至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日 至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日
4 月 1 日的已发行份额数目	373,199,298	456,693	855,147	170,940	48,174,899	343,106	1,143,238	345,973	104,900,528	865,428	2,550,559	672,926
期间内已申购份额	16,264,949	61,860,796	225,007	264,329	42,803,024	20,016,300	581,868	435,094	29,446,024	11,005,845	379,128	706,210
期间内已赎回份额	(203,361,669)	(2,195,191)	(178,402)	(32,665)	(14,864,640)	(171,752)	(122,933)	(13,236)	(22,125,897)	(136,376)	(445,807)	(54,671)
9 月 30 日的已发行份额数目	186,102,578	60,122,298	901,752	402,604	76,113,283	20,187,654	1,602,173	767,831	112,220,655	11,734,897	2,483,880	1,324,465

	BM3O 类 - 澳元份额		BM3O 类 - 人民币份额		IM2 类 - 美元份额		IC 类 - 美元份额		合计	
	2025 年 4 月 1 日 至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日 至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日 至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日 至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日	2025 年 4 月 1 日 至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日
4 月 1 日的已发行份额数目	302,677	246,670	8,189,820	1,231,055	243,279	243,279	498,256	498,256	723,266,855	212,825,484
期间内已申购份额	46,552	31,999	1,009,606	2,120,754	-	39,350	-	-	124,000,733	132,614,475
期间内已赎回份额	(92,198)	(277)	(1,664,597)	(210,729)	-	-	-	-	(295,170,427)	(43,650,871)
9 月 30 日的已发行份额数目	257,031	278,392	7,534,829	3,141,080	243,279	282,629	498,256	498,256	552,097,161	301,789,088

现金流量表

截至 2025 年 9 月 30 日止期间

	2025 年 4 月 1 日至 2025 年 9 月 30 日	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日
	美元	美元
经营活动		
已收利息	24,284,650	8,159,851
已收股息	406,944	171,126
已付管理费	(4,427,018)	(2,145,520)
已付受托人费用	(275,082)	(131,638)
已收证券借贷收入	167,305	-
购买投资的付款	(1,611,313,651)	(446,756,446)
出售投资的所得款项	1,851,457,492	352,089,911
金融衍生工具已付现金抵押资产	(2,350,000)	(3,460,000)
已付税项	(5,868)	(1,050)
其他已收经营收入/(已付经营开支)	(50,450)	1,773,463
经营活动产生的/(使用的)现金	257,894,322	(90,300,303)
融资活动		
份额发行所得款项	159,858,285	183,776,939
份额赎回付款	(409,918,795)	(80,331,719)
已付分配	(13,145,344)	(12,935,585)
融资活动(使用的)/产生的现金	(263,205,854)	90,509,635
现金及现金等价物净增加/(减少)	(5,311,532)	209,332
期初现金及现金等价物	11,554,727	2,875,134
期末现金及现金等价物	6,243,195	3,084,466

投资组合报表(未经审计)

2025 年 9 月 30 日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券			
上市投资			
澳大利亚			
AUST & NZ BANKING GROUP SER 可变债券 2034 年 9 月 18 日	400,000	413,645	0.05
CIMIC FINANCE USA PTY LT 7% 2034 年 3 月 25 日	1,688,000	1,840,635	0.23
MINERAL RESOURCES LTD SER REGS 7% 2031 年 4 月 1 日	3,175,000	3,218,072	0.41
NBN CO LTD 4.15% 2030 年 9 月 16 日	2,182,000	2,170,857	0.28
NICKEL INDUSTRIES LTD 9% 2030 年 9 月 30 日	6,147,000	6,241,104	0.79
PERENTI FINANCE PTY LTD SER 7.5% 2029 年 4 月 26 日	2,223,000	2,327,125	0.30
SANTOS FINANCE LTD SER 欧元中期票据 5.25% 2029 年 3 月 13 日	4,000,000	4,058,624	0.52
WESTPAC BANKING CORP 可变债券 2049 年 12 月 29 日	2,000,000	2,005,366	0.26
WOODSIDE FINANCE LTD 5.5% 2030 年 5 月 19 日	4,027,000	4,136,011	0.53
		26,411,439	3.37
百慕大			
LI & FUNG LTD 8.375% 2029 年 2 月 5 日	5,742,000	6,008,607	0.76
LI & FUNG LTD SER 欧元中期票据 5.25% 2049 年 12 月 29 日	1,428,000	859,545	0.11
STAR ENERGY CO ISSUE 4.85% 2038 年 10 月 14 日	950,000	910,140	0.12
		7,778,292	0.99
英属维尔京群岛			
CAS CAPITAL NO1 LTD 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	1,669,000	1,652,816	0.21

投资组合报表(未经审计)(续) 2025 年 9 月 30 日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券			
上市投资			
英属维尔京群岛(续)			
CENTRAL PLAZA DEV LTD 6.8% 2029 年 4 月 7 日	2,039,000	2,082,789	0.27
CENTRAL PLAZA DEV LTD 7.15% 2028 年 3 月 21 日	1,566,000	1,606,564	0.20
CHARMING LIGHT INVST LTD 欧元中期票据 4.375% 2027 年 12 月 21 日	455,000	454,033	0.06
CHINA CINDA 2020 I MNGMN SER 欧元中期票据 2.5% 2028 年 1 月 20 日	2,000,000	1,919,653	0.24
CHINA CINDA 2020 I MNGMN SER 欧元中期票据 3% 2031 年 1 月 20 日	1,150,000	1,071,608	0.14
CHINA CINDA 2020 I MNGMN SER 欧元中期票据 5.5% 2030 年 1 月 23 日	1,500,000	1,558,023	0.20
CHINA CINDA 2020 I MNGMN SER 欧元中期票据 5.75% 2029 年 5 月 28 日	2,030,000	2,111,396	0.27
CHINA CINDA FINANCE 2017 SER 欧元中期票据 4.75% 2028 年 2 月 8 日	810,000	817,280	0.10
CHINA GREATWALL VI 可变债券 2049 年 12 月 31 日	1,550,000	1,625,558	0.21
CNOOC FINANCE 2011 LTD 5.75% 2041 年 1 月 26 日	4,000,000	4,389,530	0.56
CNOOC FINANCE 2012 LTD 5% 2042 年 5 月 2 日	1,700,000	1,728,239	0.22
CNOOC FINANCE 2013 LTD 3.3% 2049 年 9 月 30 日	1,500,000	1,169,563	0.15
CNOOC FINANCE 2013 LTD 4.25% 2043 年 5 月 9 日	700,000	652,832	0.08
FORTUNE STAR BVI LTD 5.05% 2027 年 1 月 27 日	1,800,000	1,779,565	0.23
FORTUNE STAR BVI LTD 6.8% 2029 年 9 月 9 日	3,869,000	3,879,156	0.49
FORTUNE STAR BVI LTD 8.5% 2028 年 5 月 19 日	5,400,000	5,670,597	0.72
FRANSHION BRILLIANT LTD 3.2% 2026 年 4 月 9 日	3,120,000	3,087,299	0.39
FRANSHION BRILLIANT LTD 4.25% 2029 年 7 月 23 日	3,661,000	3,374,523	0.43

投资组合报表(未经审计)(续) 2025 年 9 月 30 日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券			
上市投资			
英属维尔京群岛(续)			
FRANSHION BRILLIANT LTD SER 可变债券 2049 年 12 月 31 日	200,000	199,999	0.03
HKT CAPITAL NO 6 LTD 3% 2032 年 1 月 18 日	1,946,000	1,769,775	0.23
HUARONG FINANCE 2017 CO 4.75% 2027 年 4 月 27 日	1,900,000	1,908,565	0.24
HUARONG FINANCE 2017 CO 欧元中期票据 4.25% 2027 年 11 月 7 日	4,300,000	4,273,211	0.54
HUARONG FINANCE 2019 欧元中期票据 4.5% 2029 年 5 月 29 日	4,450,000	4,431,399	0.56
HUARONG FINANCE II CO LTD 4.625 2026 年 6 月 3 日	700,000	701,764	0.09
HYSAN MTN LTD SER 欧元中期票据 2.82% 2029 年 9 月 4 日	3,042,000	2,824,111	0.36
HYSAN MTN LTD SER 欧元中期票据 2.875% 2027 年 6 月 2 日	1,027,000	998,325	0.13
JOY TRSR ASSETS HLD SER 欧元中期票据 5.5% 2027 年 2 月 1 日	1,000,000	1,010,533	0.13
NAN FUNG TREASURY LTD SER 欧元中期票 据 5% 2028 年 9 月 5 日	1,330,000	1,334,459	0.17
NWD MTN LTD SER 欧元中期票据 4.5% 2030 年 5 月 19 日	275,000	181,540	0.02
SINOPEC GRP DEV 2018 3.1% 2051 年 1 月 8 日	750,000	561,155	0.07
SINOPEC GRP DEV 2018 3.35% 2050 年 5 月 13 日	750,000	589,963	0.08
SINOPEC GRP DEV 2018 3.44% 2049 年 11 月 12 日	750,000	601,365	0.08
SINOPEC GRP DEV 2018 4.6% 2048 年 9 月 12 日	750,000	724,945	0.09
SINOPEC GRP OVERSEAS DEV 4% 2047 年 9 月 13 日	750,000	662,380	0.08
SINOPEC GRP OVERSEAS DEV SER 4.25% 2046 年 5 月 3 日	1,950,000	1,798,989	0.23
STUDIO CITY CO LTD 7% 2027 年 2 月 15 日	750,000	756,050	0.10

投资组合报表(未经审计)(续) 2025 年 9 月 30 日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券			
上市投资			
英属维尔京群岛(续)			
STUDIO CITY FINANCE LTD 5% 2029 年 1 月 15 日	2,850,000	2,748,184	0.35
		68,707,736	8.75
加拿大			
PTTEP CANADA INTERNATIONAL 6.35% 2042 年 6 月 12 日	500,000	545,403	0.07
		545,403	0.07
开曼群岛			
阿里巴巴集团控股 0.5% 2031 年 6 月 1 日	550,000	1,010,407	0.12
阿里巴巴集团控股 0.5% 可转换债券 2032 年 9 月 15 日	1,280,000	1,462,858	0.19
阿里巴巴集团控股 2.125% 2031 年 2 月 9 日	2,000,000	1,804,238	0.23
阿里巴巴集团控股 3.15% 2051 年 2 月 9 日	3,500,000	2,453,542	0.31
阿里巴巴集团控股 4.4% 2057 年 12 月 6 日	3,000,000	2,580,248	0.33
阿里巴巴集团控股 4.875% 2030 年 5 月 26 日	4,000,000	4,126,808	0.53
阿里巴巴集团控股 5.25% 2035 年 5 月 26 日	4,500,000	4,713,550	0.60
阿里巴巴集团控股 SER 5.625% 2054 年 11 月 26 日	3,000,000	3,139,443	0.40
CCBL CAYMAN 1 CORP 1.6% 2026 年 9 月 15 日	1,094,000	1,067,375	0.14
中国宏桥集团 6.925% 2028 年 11 月 29 日	766,000	795,825	0.10
中国宏桥集团 7.05% 2028 年 1 月 10 日	913,000	947,488	0.12
中国现代牧业控股 2.125% 2026 年 7 月 14 日	2,665,000	2,614,685	0.33

投资组合报表(未经审计)(续) 2025 年 9 月 30 日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券			
上市投资			
开曼群岛(续)			
CHINA OVERSEA FIN III 6.375% 2043 年 10 月 29 日	200,000	214,758	0.03
CHINA OVERSEAS FIN 4.75% 2028 年 4 月 26 日	300,000	302,456	0.04
CHINA OVERSEAS FIN. VI 6.45% 2034 年 6 月 11 日	2,800,000	3,088,798	0.39
CHINA OVERSEAS FINANCE 5.35% 2042 年 11 月 15 日	200,000	191,124	0.02
CK HUTCHISON INTL 4.375% 2030 年 3 月 13 日	1,773,000	1,781,150	0.23
CK HUTCHISON INTL 20 LTD 3.375% 2050 年 5 月 8 日	2,000,000	1,480,098	0.19
CK HUTCHISON INTL 23 4.875% 2033 年 4 月 21 日	4,000,000	4,050,126	0.52
CK HUTCHISON INTL 24 5.375% 2029 年 4 月 26 日	2,000,000	2,076,195	0.26
CK HUTCHISON INTL 24 SER 5.5% 2034 年 4 月 26 日	4,000,000	4,199,718	0.53
CK HUTCHISON INTL 4.25% 2030 年 9 月 26 日	2,666,000	2,660,548	0.34
EH CAR SERVICES LTD 7% 2026 年 9 月 21 日	1,301,000	1,041,052	0.13
EH CARVICS LTD 12% 2027 年 9 月 26 日	1,367,000	945,806	0.12
富卫集团有限公司 5.252% 2030 年 9 月 22 日	1,293,000	1,298,365	0.16
富卫集团有限公司 5.836% 2035 年 9 月 22 日	5,650,000	5,744,931	0.73
富卫集团有限公司 SER 欧元中期票据 7.635% 2031 年 7 月 2 日	910,000	1,014,999	0.13
绿城中国控股 8.45% 2028 年 2 月 24 日	4,152,000	4,325,516	0.55
HONGKONG LAND FINANCE SER 欧元中期票据 2.25% 2031 年 7 月 15 日	1,300,000	1,160,157	0.15
HUTCHISON WHAMPOA INTERNATIONAL LIMITED 7.45% 2033 年 11 月 24 日到期	1,600,000	1,891,270	0.24

投资组合报表(未经审计)(续) 2025 年 9 月 30 日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券			
上市投资			
开曼群岛(续)			
LINK FINANCE CAYMAN 2009 2.75% 2032 年 1 月 19 日	1,500,000	1,352,591	0.17
龙湖集团控股有限公司 3.375% 2027 年 4 月 13 日	2,000,000	1,885,295	0.24
龙湖集团控股有限公司 3.95% 2029 年 9 月 16 日	1,954,000	1,700,129	0.22
龙湖地产 4.5% 2028 年 1 月 16 日	2,000,000	1,868,868	0.24
MELCO RESORTS FINANCE 5.375% 2029 年 12 月 4 日	3,400,000	3,349,639	0.43
MELCO RESORTS FINANCE 6.5% 2033 年 9 月 24 日	2,000,000	2,006,580	0.25
MELCO RESORTS FINANCE SER 7.625% 2032 年 4 月 17 日	2,000,000	2,098,182	0.27
美高梅中国控股有限公司 SER 7.125% 2031 年 6 月 26 日	985,000	1,039,856	0.13
MONGOLIAN MINING CORP 8.44% 2030 年 4 月 3 日	6,990,000	7,091,516	0.90
MTR CORP CI LTD SER 欧元中期票据 可变债 券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	3,000,000	3,126,423	0.40
PCPD CAPITAL 5.125% 2026 年 6 月 18 日	1,935,000	1,885,290	0.24
SHUI ON DEVELOPMENT HLDG 5.5% 2026 年 6 月 29 日	1,065,000	1,062,409	0.13
融创中国控股有限公司 浮息票据 2025 年 9 月 30 日	39,419	5,987	0.00
融创中国控股有限公司 浮息票据 2028 年 9 月 30 日	894,306	136,098	0.02
融创中国控股有限公司 浮息票据 2029 年 9 月 30 日	831,259	126,329	0.02
融创中国控股有限公司 浮息票据 2030 年 9 月 30 日	448,409	67,849	0.01
腾讯控股有限公司 2.88% 2031 年 4 月 22 日	5,000,000	4,705,227	0.60
腾讯控股有限公司 3.68% 2041 年 4 月 22 日	3,269,000	2,811,427	0.36

投资组合报表(未经审计)(续) 2025 年 9 月 30 日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券			
上市投资			
开曼群岛(续)			
腾讯控股有限公司 SER 3.84% 2051 年 4 月 22 日	3,000,000	2,429,086	0.31
腾讯控股有限公司 SER REGS (S 条例债券) 3.29% 2060 年 6 月 3 日	2,000,000	1,398,547	0.18
永利澳门有限公司 5.125% 2029 年 12 月 15 日	2,450,000	2,405,655	0.31
永利澳门有限公司 5.625% 2028 年 8 月 26 日	3,034,000	3,032,950	0.39
永利澳门有限公司 6.75% 2034 年 2 月 15 日	2,000,000	2,028,844	0.26
		111,798,311	14.24
香港			
友邦保险控股有限公司 5.375% 2034 年 4 月 5 日	3,200,000	3,324,357	0.42
友邦保险控股有限公司 SER 5.4% 2054 年 9 月 30 日	9,951,000	9,793,904	1.25
友邦保险控股有限公司 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	655,000	648,557	0.08
香港机场管理局 3.25% 2052 年 1 月 12 日	4,000,000	3,044,490	0.39
香港机场管理局 5.125% 2035 年 1 月 15 日	3,000,000	3,173,780	0.40
香港机场管理局 SER REGS 4.75% 2028 年 7 月 15 日	5,000,000	5,115,862	0.65
香港机场管理局 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	2,033,000	1,945,928	0.25
中华电力有限公司 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	4,900,000	5,085,465	0.65
中国农化(香港)峰桥有限公司 3% 2030 年 9 月 22 日	440,000	413,507	0.05
中国农化(香港)峰桥有限公司 3.7% 2050 年 9 月 22 日	600,000	460,919	0.06

投资组合报表(未经审计)(续)

2025 年 9 月 30 日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券			
上市投资			
香港(续)			
中国农化(香港)峰桥有限公司 4.75% 2049 年 6 月 19 日	520,000	475,520	0.06
远东宏信有限公司 SER 欧元中期票据 4.25% 2026 年 10 月 26 日	1,300,000	1,291,329	0.17
远东宏信有限公司 SER 欧元中期票据 6.625% 2027 年 4 月 16 日	475,000	486,358	0.06
FEC FINANCE LTD 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	5,553,000	2,256,670	0.29
普洛斯中国控股有限公司 欧元中期票据 2.95% 2026 年 3 月 29 日	2,000,000	1,970,774	0.25
香港特别行政区(政府) 4.25% 24 JUL 2027	5,000,000	5,051,520	0.64
香港特别行政区(政府) 5.25% 2053 年 1 月 11 日	3,000,000	3,225,697	0.41
香港 SER REGS 4.125% 2030 年 6 月 10 日	4,286,000	4,359,584	0.56
香港铁路有限公司 4.875% 2035 年 4 月 1 日	3,000,000	3,130,471	0.40
SWIRE PACIFIC MTN FINANCE 4.625% 2032 年 8 月 28 日	4,065,000	4,153,231	0.53
万科地产(香港)有限公司 3.975% 2027 年 11 月 9 日	2,100,000	1,554,998	0.20
万科地产(香港)有限公司 SER 欧元中期票 据 3.5% 2029 年 11 月 12 日	1,000,000	679,385	0.09
XIAOMI BEST TIME INTL 3.375% 2030 年 4 月 29 日	1,500,000	1,442,751	0.18
		63,085,057	8.04
印度			
10 RENEW POWER SUBSIDIARY 4.5% 2028 年 7 月 14 日	200,000	193,195	0.03
AXIS BANK GIFT CITY 可变债券 永续债 券 2049 年 12 月 31 日	980,000	966,894	0.12
CONTINUUM GRN SPV CO-ISS SER 7.5% 2033 年 6 月 26 日	2,397,000	2,448,674	0.31

投资组合报表(未经审计)(续)

2025 年 9 月 30 日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券			
上市投资			
印度(续)			
德里国际机场 6.45% 2029 年 6 月 4 日	420,000	437,904	0.06
印度进出口银行 5.5% 2035 年 1 月 13 日	4,000,000	4,188,046	0.53
HDFC BANK LTD 可变债券 永续债券 2049 年 12 月 31 日	2,200,000	2,164,987	0.28
HPCL-MITTAL ENERGY LTD 5.25% 2027 年 4 月 28 日	740,000	739,600	0.09
HPCL-MITTAL ENERGY LTD 5.45% 2026 年 10 月 22 日	1,308,000	1,308,000	0.17
MANAPPURAM FINANCE LTD SER 欧元 中期票据 7.375% 2028 年 5 月 12 日	949,000	972,111	0.12
MUTHOOT FINANCE LTD 6.375% 2030 年 3 月 2 日	6,808,000	6,923,440	0.88
MUTHOOT FINANCE LTD 6.375% 2029 年 4 月 23 日	1,588,000	1,611,061	0.21
MUTHOOT FINANCE LTD SER REGS 7.125% 2028 年 2 月 14 日	1,887,000	1,945,862	0.25
PIRAMAL CAPITAL & HOUS SER 欧元中 期票据 7.8% 2028 年 1 月 29 日	1,081,000	1,107,534	0.14
RELIANCE INDUSTRIES LTD 2.875% 2032 年 1 月 12 日	2,000,000	1,817,718	0.23
SHRIRAM FINANCE LTD 6.15% 2028 年 4 月 3 日	1,100,000	1,120,865	0.14
STATE BANK INDIA/LONDON 欧元中期 票据 5.125% 2029 年 11 月 25 日	4,000,000	4,103,808	0.52
TATA CAPITAL LTD SER 欧元中期票据 5.389% 2028 年 7 月 21 日	4,000,000	4,083,726	0.52
VARANASI AURA NH-2 TOLL 5.9% 2034 年 2 月 28 日	2,000,000	2,086,506	0.27
		38,219,931	4.87
印度尼西亚			
印度尼西亚国家银行 SER 欧元中期票据 5.28% 2029 年 4 月 5 日	3,000,000	3,078,187	0.39

投资组合报表(未经审计)(续)

2025 年 9 月 30 日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券			
上市投资			
印度尼西亚(续)			
BANK NEGARA INDONESIA 可变债券 永 续债券 2049 年 12 月 31 日	1,500,000	1,456,950	0.19
FREEPORT INDONESIA PT 4.763% 2027 年 4 月 14 日	2,000,000	2,014,160	0.26
FREEPORT INDONESIA PT SER 6.2% 2032 年 4 月 14 日	4,500,000	4,556,898	0.58
GARUDA INDONESIA TBK PT 6.5% 2031 年 12 月 28 日	1,793,844	1,825,858	0.23
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR 3.398% 2031 年 6 月 9 日	3,000,000	2,793,143	0.36
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR 4.745% 2051 年 6 月 9 日	3,000,000	2,596,056	0.33
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR 4.805% 2052 年 4 月 27 日	3,000,000	2,620,566	0.33
印度尼西亚(共和国) (REG) 4.75% 2034 年 9 月 10 日	3,000,000	2,997,310	0.38
印度尼西亚(共和国) 5.2% 2035 年 7 月 23 日	1,864,000	1,906,358	0.24
PERTAMINA HULU ENERGI 5.25% 2030 年 5 月 21 日	3,000,000	3,067,650	0.39
PERTAMINA PERSERO SER REGS (REG) 6% 2042 年 5 月 3 日	2,000,000	2,054,426	0.26
PERUSAHAAN PENERBIT SBSN (BR) 5.25% 2034 年 11 月 25 日	2,500,000	2,564,035	0.33
PT INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM AND PT MINERAL INDUSTRIES INDONESIA (PERSERO) 6.53% 2028 年 11 月 15 日	2,000,000	2,146,348	0.27
PT PERTAMINA (PERSERO) 4.175% 2050 年 1 月 21 日	2,500,000	1,964,603	0.25
印度尼西亚共和国 5.25% 2030 年 1 月 15 日	10,500,000	10,941,845	1.40
印度尼西亚共和国 5.6% 2035 年 1 月 15 日	4,500,000	4,768,065	0.61
		53,352,458	6.80

投资组合报表(未经审计)(续)

2025 年 9 月 30 日

	持有量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资			
马恩岛			
GOHL CAPITAL LTD 4.25% 2027 年 1 月 24 日	3,000,000	2,991,702	0.38
		2,991,702	0.38
日本			
三菱地所 4.352% 2030 年 10 月 2 日	1,377,000	1,380,567	0.17
日产自动车株式会社 SER REGS 8.125% 2035 年 7 月 17 日	4,567,000	4,905,506	0.62
NTT FINANCE CORP 5.502% 2035 年 7 月 16 日	2,637,000	2,728,853	0.35
NTT FINANCE CORP SER REGS 4.876% 2030 年 7 月 16 日	2,751,000	2,796,078	0.36
软银集团 7.25% 2032 年 7 月 10 日	1,500,000	1,546,170	0.20
三井住友信托银行 可变债券 2036 年 9 月 11 日	1,665,000	1,684,095	0.21
三井住友信托银行株式会社 SER 4.85% 2034 年 9 月 10 日	919,000	922,504	0.12
		15,963,773	2.03
泽西岛(海峡群岛)			
中国西部水泥有限公司 4.95% 2026 年 7 月 8 日	5,400,000	5,314,726	0.68
		5,314,726	0.68

投资组合报表(未经审计)(续)

2025 年 9 月 30 日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券			
上市投资			
马来西亚			
PETRONAS CAPITAL LTD 2.48% 2032 年 1 月 28 日	4,000,000	3,607,000	0.46
PETRONAS CAPITAL LTD 4.5% 2045 年 3 月 18 日	2,600,000	2,342,672	0.30
PETRONAS CAPITAL LTD 5.8488% 2055 年 4 月 3 日	6,500,000	6,883,240	0.87
		<u>12,832,912</u>	<u>1.63</u>
毛里求斯			
CA MAGNUM HOLDINGS 5.375% 2026 年 10 月 31 日	1,300,000	1,297,554	0.17
CLEAN RENEWABLE POWER 4.25% 2027 年 3 月 25 日	1,431,000	1,083,234	0.14
UPL CORP LTD 4.5% 2028 年 3 月 8 日	3,900,000	3,801,860	0.48
UPL CORP LTD 4.625% 2030 年 6 月 16 日	1,500,000	1,396,377	0.18
		<u>7,579,025</u>	<u>0.97</u>
蒙古			
DEVT BANK OF MONGOLIA 8.5% 2028 年 7 月 3 日	3,500,000	3,573,969	0.45
GOLOMT BANK OF MONGOLIA 11% 2027 年 5 月 20 日	5,300,000	5,491,012	0.70
蒙古国际债券 3.5% 2027 年 7 月 7 日	1,355,000	1,305,960	0.17
蒙古国际债券 6.625% 2030 年 2 月 25 日	1,000,000	1,017,875	0.13
蒙古国际债券 8.65% 2028 年 1 月 19 日	503,000	535,706	0.07
TRAD & DEV BANK MONGOLIA 8.5% 2027 年 12 月 23 日	900,000	888,639	0.11
		<u>12,813,161</u>	<u>1.63</u>

投资组合报表(未经审计)(续)

2025年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券			
上市投资			
荷兰			
ICTSI TREASURY BV 3.5% 2031年11月16日	1,319,000	1,243,370	0.16
JABABEKA INTERNATIONAL STP 2027年12月15日	1,535,000	1,528,768	0.19
MONG DUONG FIN HLDGS BV 5.125% 2029年5月7日	700,000	469,721	0.06
		<u>3,241,859</u>	<u>0.41</u>
巴基斯坦			
巴基斯坦伊斯兰共和国 SER 6.875% 2027年12月5日	2,995,000	3,006,255	0.38
巴基斯坦(共和国) SER 6% 2026年4月8日	5,241,000	5,232,169	0.67
巴基斯坦(共和国) SER 7.375% 2031年4月8日	1,500,000	1,473,298	0.19
		<u>9,711,722</u>	<u>1.24</u>
菲律宾			
BANK OF PHILIPPINE ISLAN SER 欧元中期票据 5.0% 2030年4月7日	2,261,000	2,336,547	0.30
DEV BANK PHILIPPINES 2.375% 2031年3月11日	1,470,000	1,341,613	0.17
GLOBE TELECOM INC 3% 2035年7月23日	200,000	169,361	0.02
PETRON CORP 可变债券 永续债券 2049年12月31日	1,151,000	1,188,373	0.15
菲律宾(共和国) 4.375% 2030年3月5日	8,500,000	8,627,122	1.10
菲律宾(共和国) 4.75% 2035年3月5日	5,000,000	5,044,890	0.64
菲律宾共和国 5.5% 2035年2月4日	10,000,000	10,652,810	1.36
菲律宾共和国 5.9% 2050年2月4日	4,000,000	4,266,316	0.54

投资组合报表(未经审计)(续)

2025年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券			
上市投资			
菲律宾(续)			
SAN MIGUEL GLOBAL POWER 可变债券 2049年12月31日	3,115,000	3,215,707	0.41
SAN MIGUEL GLOBAL POWER 可变债券 永续债券 2049年12月31日	1,050,000	1,068,188	0.14
SMC GLOBAL POWER HOLDINGS 可变债 券 2049年12月31日	400,000	394,149	0.05
		38,305,076	4.88
新加坡			
CATHAYLIFE SINGAPORE 5.95% 2034年7 月5日	4,000,000	4,257,158	0.54
CATHAYLIFE SINGAPORE 可变债券 2039 年9月5日	500,000	509,165	0.06
CLIFFORD CAPITAL PTE LTD SER 欧元中 期票据 4.781% 2030年1月14日	786,000	812,477	0.10
CONTINUUM ENERGY AURA SER 9.5% 2027年2月24日	452,000	466,897	0.06
星展集团控股有限公司 4.403% 2028年3月 21日	2,000,000	2,027,805	0.26
FUBON LIFE SINGA 5.45% 2035年12月10 日	5,586,000	5,690,880	0.73
GLP PTE LTD 9.75% 2028年5月20日	4,500,000	4,679,617	0.60
GLP PTE LTD 可变债券 永续债券 2049年 12月31日	3,404,000	2,315,077	0.29
大东方人寿保险 SER 2049年12月31日	2,000,000	2,022,024	0.26
JOLLIBEE WORLDWIDE PTE L 5.332% 2030年4月2日	2,571,000	2,657,540	0.34
MEDCO CYPRESS TREE PTE SER REGS 8.625% 2030年5月19日	6,000,000	6,328,560	0.81
NANSHAN LIFE PTE LTD 2041年3月17 日	2,553,000	2,593,175	0.33
NANSHAN LIFE PTE LTD 5.45% 2034年9 月11日	2,500,000	2,484,548	0.32
华侨银行有限公司 可变债券 2035年9月8 日	3,253,000	3,254,361	0.41

投资组合报表(未经审计)(续)

2025 年 9 月 30 日

	持有量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资			
新加坡(续)			
SMPHI SG HOLDING 4.75% 2030 年 9 月 16 日	2,395,000	2,402,044	0.31
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.375% 2041 年 8 月 2 日	1,000,000	747,483	0.10
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.5% 2070 年 10 月 6 日	1,000,000	585,125	0.07
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.75% 2061 年 8 月 2 日	1,000,000	654,201	0.08
TEMASEK FINANCIAL I LTD SER 2.25% 2051 年 4 月 6 日	1,250,000	788,025	0.10
大华银行有限公司 4.401% 2028 年 4 月 2 日	3,258,000	3,296,259	0.42
		48,572,421	6.19
韩国			
韩国进出口银行 2.5% 2041 年 6 月 29 日	1,000,000	733,668	0.09
韩国进出口银行 4.875% 2030 年 1 月 14 日	6,500,000	6,727,786	0.86
GENERGY SOLUTION 5.375% 2030 年 4 月 2 日	2,500,000	2,559,859	0.33
韩亚银行 3.25% 2027 年 3 月 30 日	1,302,000	1,287,220	0.16
韩华生命保险 可变债券 2032 年 2 月 4 日	800,000	786,428	0.10
韩华生命保险 可变债券 2055 年 6 月 24 日	4,000,000	4,192,804	0.53
国民银行 2.5% 2030 年 11 月 4 日	1,033,000	934,445	0.12
国民银行 4.375% 2028 年 5 月 8 日	3,346,000	3,374,061	0.43
国民银行 4.625% 2030 年 5 月 8 日	2,960,000	3,026,699	0.39
韩国产业银行 4.625% 2028 年 2 月 3 日	5,000,000	5,081,460	0.65

投资组合报表(未经审计)(续)

2025年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资			
韩国(续)			
KOREA HOUSING FINANCE CO 5.125% 2030年1月21日	3,763,000	3,915,138	0.50
KOREA HOUSING FINANCE CO SER 3.875% 2030年9月17日	3,405,000	3,369,360	0.43
KOREA HYDRO & NUCLEAR PO 4.625% 2029年7月29日	2,200,000	2,234,963	0.28
KOREA NATIONAL OIL CORP 4.625% 2028年3月31日	4,545,000	4,598,247	0.59
KOREA WATER RESOURCES SER (欧元中期票据) 4.375% 2027年5月 21日	2,412,000	2,427,313	0.31
大韩航空 4% 2030年9月30日	1,996,000	1,978,591	0.25
KT CORP 4.375% 2029年1月3日	2,689,000	2,701,224	0.34
LG CHEM LTD SER REGS 2.375% 2031年7月7日	2,000,000	1,768,751	0.23
NONGHYUP BANK 4.375% 2030年7 月21日	2,000,000	2,024,977	0.26
POSCO HOLDINGS INC 5.125% 2030 年5月7日	3,000,000	3,073,182	0.39
新韩银行 4.625% 2030年5月13日	4,000,000	4,084,844	0.52
新韩金融集团 可变债券 永续债券 2049 年12月31日	3,000,000	2,960,918	0.38
SK海力士 2.375% 2031年1月19日	5,000,000	4,487,610	0.57
SK海力士 5.5% 2027年1月16日	3,000,000	3,049,593	0.39
SK海力士 5.5% 2029年1月16日	3,000,000	3,099,830	0.39
TONGYANGLIFEINSURANCECO 可 变债券 2035年5月7日	4,000,000	4,185,876	0.53
友利银行 可变债券 永续债券 2049年 12月31日	3,000,000	3,126,351	0.40
		81,791,198	10.42

投资组合报表(未经审计)(续)

2025年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券			
上市投资			
斯里兰卡			
斯里兰卡共和国 2038年2月15日	3,400,000	3,038,067	0.39
斯里兰卡共和国 2030年1月15日	4,000,447	3,755,420	0.48
斯里兰卡共和国 4.0% 2028年4月15日	3,098,593	2,169,797	0.28
斯里兰卡共和国 STP 2035年6月15日	3,105,109	2,276,414	0.29
斯里兰卡共和国 STP 2033年3月15日	4,598,594	3,952,701	0.50
斯里兰卡共和国 STP 2036年5月15日	2,000,000	1,774,806	0.22
		16,967,205	2.16
泰国			
盘谷银行 可变债券 2036年9月23日	3,000,000	2,730,599	0.35
盘谷银行 可变债券 2034年9月25日	3,000,000	2,840,781	0.36
泰国进出口银行 3.902% 2027年6月2日	1,781,000	1,772,484	0.23
GC TREASURY CENTRE CO 2.98% 2031年3月18日	3,500,000	3,188,719	0.41
GC TREASURY CENTRE CO 2049年 12月31日	2,055,000	2,126,245	0.27
Gc Treasury Centre 可变债券 永续债券 2049年12月31日	5,123,000	5,199,358	0.66
开泰银行香港分行 可变债券 2031年 10月2日	1,040,000	1,019,463	0.13
开泰银行香港分行 可变债券 2049年 12月31日	1,000,000	985,983	0.12
MUANGTHAI CAPITAL PCL 6.875000% 2028年9月30日	2,571,000	2,606,847	0.33
MUANGTHAI CAPITAL PCL 7.55% 2030年7月21日	5,584,000	5,800,017	0.74

投资组合报表(未经审计)(续)

2025年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产净 值百分比
债券			
上市投资			
泰国(续)			
PTT PCL 4.5% 2042年10月25日	353,000	313,276	0.04
PTT TREASURY CENTRE 3.7% 2070 年7月16日	1,000,000	699,701	0.09
PTT TREASURY CENTRE 4.5% 2042 年10月25日	940,000	835,500	0.11
PTTEP TREASURY CENTER CO 2.993% 2030年1月15日	1,000,000	948,200	0.12
PTTEP TREASURY CENTER CO 3.903% 2059年12月6日	500,000	378,412	0.05
THAIOIL TRSRY CENTER SER REGS (S 条例债券) 2.5% 2030年6月18日	3,500,000	3,165,008	0.40
		34,610,593	4.41
英国			
BIOCON BIOLOGICS GLOBAL 6.67% 2029年10月9日	1,800,000	1,749,348	0.22
PRUDENTIAL FUNDING (ASIA) PLC 可变债券 2033年11月3日	3,112,000	2,969,298	0.38
SING TECH ENGINEERING SER 欧元 中期票据 4.25% 2030年5月8日	1,841,000	1,856,850	0.24
渣打银行 可变债券 2032年6月29日	1,350,000	1,208,064	0.15
渣打银行 2036年1月21日	2,500,000	2,705,796	0.34
渣打银行 SER 6.296% 2034年7月6日	2,500,000	2,712,567	0.35
渣打银行 可变债券 2035年1月11日	2,500,000	2,687,752	0.34
渣打银行 可变债券 2035年5月14日	2,500,000	2,641,100	0.34
渣打银行 可变债券 2030年10月15日	5,000,000	5,089,983	0.65

投资组合报表(未经审计)(续)

2025年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资			
英国(续)			
渣打银行 可变债券 永续债券 2049年 12月31日	13,552,000	13,787,102	1.76
VEDANTA RESOURCES 10.25% 2028 年6月3日	6,950,000	7,190,147	0.92
VEDANTA RESOURCES 10.875000% 2029年9月17日	3,850,000	4,039,439	0.51
		48,637,446	6.20
美国			
BOC AVIATION USA CORP 5.25% 2030年1月14日	2,500,000	2,597,863	0.33
HANWHA ENERGY USA HOLDN SER REGS 4.375% 2028年7月2日	1,791,000	1,803,453	0.23
TSMC ARIZONA CORP 3.125% 2041 年10月25日	3,000,000	2,437,548	0.31
TSMC ARIZONA CORP 3.25% 2051年 10月25日	3,000,000	2,300,426	0.30
TSMC ARIZONA CORP 4.25% 2032年 4月22日	1,500,000	1,507,757	0.19
		10,647,047	1.36
未上市但有报价的投资			
英属维尔京群岛			
NAN FUNG TREASURY LTD 3.625% 2030年8月27日	450,000	421,468	0.05
NWD FINANCE (BVI) LTD 可变债券 永续债券 2049年12月31日	6,000,000	2,567,349	0.32
STAR ENERGY GEOTHERMAL 6.75% 2033年4月24日	2,950,000	2,093,493	0.27

投资组合报表(未经审计)(续)

2025年9月30日

	持有量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
未上市但有报价的投资			
英属维尔京群岛(续)			
STATE GRID OVERSEAS INV 4.85%			
2044年5月7日	749,000	755,692	0.11
		5,838,002	0.75
开曼群岛			
MELCO RESORTS FINANCE 5.75%			
2028年7月21日	600,000	599,452	0.08
美高梅中国控股有限公司 4.75% 2027			
年2月1日	1,750,000	1,747,144	0.22
当代置业(中国)有限公司 9% 2024年			
12月28日	1,132,514	4,454	0.00
当代置业(中国)有限公司 9% 2026年			
12月30日	1,775,234	7,882	0.00
当代置业(中国)有限公司 可变债券			
2025年12月30日	1,331,425	5,499	0.00
当代置业(中国)有限公司 可变债券			
2027年12月30日	2,590,854	12,307	0.00
金沙中国有限公司 3.75% 2031年8月			
8日	252,000	232,450	0.03
金沙中国有限公司 5.4% 2028年8月8			
日	789,000	807,720	0.10
金沙中国有限公司 SER WI 3.1% 2029			
年3月8日	200,000	188,288	0.03
腾讯控股有限公司 2.39% 2030年6月			
3日	3,709,000	3,446,212	0.44
腾讯控股有限公司 3.24% 2050年6月			
3日	2,000,000	1,466,794	0.19
		8,518,202	1.09

投资组合报表(未经审计)(续)

2025 年 9 月 30 日

	持有量	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			
中国内地			
温氏食品集团 3.258% 2030 年 10 月 29 日	700,000	619,500	0.08
		619,500	0.08
香港			
XIAOMI BEST TIME INTL 2.875% 2031 年 7 月 14 日	2,000,000	1,845,166	0.23
XIAOMI BEST TIME INTL 4.1% 2051 年 7 月 14 日	2,000,000	1,638,227	0.21
		3,483,393	0.44
印度			
IRB INFRASTRUCTURE DEVE 7.11% 2032 年 3 月 11 日	2,000,000	2,078,906	0.26
JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125% 2031 年 5 月 18 日	900,000	605,830	0.08
JSW INFRASTRUCTURE 4.95% 2029 年 1 月 21 日	1,483,000	1,490,214	0.19
RELIANCE INDUSTRIES 6.25% 2040 年 10 月 19 日	250,000	277,106	0.04
RELIANCE INDUSTRIES LTD 3.625% 2052 年 1 月 12 日	1,100,000	815,734	0.10
RELIANCE INDUSTRIES LTD 4.875% 2045 年 2 月 10 日	250,000	233,955	0.03
RELIANCE INDUSTRIES LTD SER 3.75% 2062 年 1 月 12 日	500,000	362,265	0.05
RENEW POWER PVT LTD 5.875% 2027 年 3 月 5 日	400,000	400,072	0.05
SHRIRAM FINANCE LTD 6.625% 2027 年 4 月 22 日	3,222,000	3,297,114	0.42
		9,561,196	1.22

投资组合报表(未经审计)(续)

2025 年 9 月 30 日

	持有量	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			
印度尼西亚			
PT INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM AND PT MINERAL INDUSTRI INDONESIA (PERSERO) 5.45% 2030 年 5 月 15 日	200,000	206,525	0.03
PT PAKUWON JATI 4.875% 2028 年 4 月 29 日	2,475,000	2,438,326	0.31
PT PERTAMINA (PERSERO) 2.3% 2031 年 2 月 9 日	3,983,000	3,534,803	0.45
		6,179,654	0.79
毛里求斯			
INDIA GREEN POWER HOLD 4% 2027 年 2 月 22 日	500,000	425,170	0.05
		425,170	0.05
新加坡			
TML HOLDINGS PTE LTD 4.35% 2026 年 6 月 9 日	1,200,000	1,196,381	0.15
		1,196,381	0.15
韩国			
新韩银行 4.375% 2032 年 4 月 13 日	2,705,000	2,650,616	0.34
SHINHAN CARD CO LTD 2.5% 2027 年 1 月 27 日	3,544,000	3,461,159	0.44
SK 海力士 6.5% 2033 年 1 月 17 日	2,000,000	2,207,579	0.28
		8,319,354	1.06

投资组合报表(未经审计)(续)

2025 年 9 月 30 日

	持有量	市场价值	占资产 净值百 分比
		美元	
债券			
未上市但有报价的投资			
美国			
PERIAMA HOLDINGS LLC/DE 5.95% 2026 年 4 月 19 日	581,000	583,276	0.07
		583,276	0.07
债券(总计)		764,602,621	97.42
单位信托			
上市投资			
香港			
HSBC INVESTMENT FUNDS HONG KONG LTD-HSBC ALL CHINA BOND ZC-USD	150,000	1,827,900	0.23
爱尔兰			
HSBC GLOBAL LIQUIDITY FUNDS - HSBC GLOBAL LIQUIDITY FUNDS PL*	12,515,390	12,515,390	1.60
卢森堡			
HSBC INVESTMENT FUNDS LUXEMBOURG SA/LUXEMBOURG-HSBC-ASIAN CURRENCIES BD-ZD*	586,054	4,552,466	0.58
单位信托(总计)		18,895,756	2.41

投资组合报表(未经审计)(续)

2025 年 9 月 30 日

	持有 量	市场价值 美元	占资产净值百 分比
债券期货			
US 10YR ULTRA CBT 19/12/2025	(203)	223,360	0.03
US 2YR NOTE (CBT) 31/12/2025	398	(105,718)	(0.01)
US 5YR NOTE (CBT) 31/12/2025	(183)	95,789	0.01
US ULTRA BOND CBT19/12/2025	(152)	(5,875)	0.00
		207,556	0.03
外币远期合同		89,683	0.00
掉期		(3,255,099)	(0.41)
投资总额(投资成本合计： 768,498,698 美元)		780,540,517	99.45
其他净资产		4,309,440	0.55
2025 年 9 月 30 日的资产净值总额		784,849,957	100.00

*投资基金在香港未获认可，不面向香港公众发行。

投资组合变动表(未经审计)

2025 年 4 月 1 日起至 2025 年 9 月 30 日止期间

	占资产净值百分 比 2025 年 9 月 30 日	占资产净值 百分比 2025 年 3 月 31 日
金融资产		
债务证券		
上市债券		
开曼群岛	14.24	15.11
韩国	10.42	5.64
英属维尔京群岛	8.75	12.20
香港	8.04	10.61
印度尼西亚	6.80	3.49
英国	6.20	6.54
新加坡	6.19	2.15
菲律宾	4.88	6.54
印度	4.87	8.03
泰国	4.41	1.59
澳大利亚	3.37	0.90
斯里兰卡	2.16	3.08
日本	2.03	1.67
蒙古	1.63	1.09
马来西亚	1.63	0.74
美国	1.36	4.31
巴基斯坦	1.24	1.59
百慕大	0.99	0.36
毛里求斯	0.97	2.12
泽西岛(海峡群岛)	0.68	0.07
荷兰	0.41	0.70
马恩岛	0.38	0.42
加拿大	0.07	0.05
中国内地	0.00	1.04
	91.73	90.04
未上市但有报价的债券		
印度	1.22	1.55
开曼群岛	1.09	0.06
韩国	1.06	0.84
印度尼西亚	0.79	0.58

投资组合变动表(未经审计)(续)

2025 年 4 月 1 日起至 2025 年 9 月 30 日止期间

	占资产净值百 分比 2025 年 9 月 30 日	占资产净值 百分比 2025 年 3 月 31 日
金融资产		
债务证券(续)		
未上市但有报价的债券(续)		
英属维尔京群岛	0.75	0.53
香港	0.44	0.59
新加坡	0.15	0.16
中国内地	0.08	0.58
美国	0.07	0.27
毛里求斯	0.05	1.00
土耳其	0.00	0.41
	5.69	6.57
单位信托		
上市投资		
爱尔兰	1.60	0.17
卢森堡	0.58	0.00
香港	0.23	2.99
美国	0.00	0.20
	2.41	3.36
债券期货	0.03	0.01
掉期	(0.41)	(0.33)
外币远期合同	0.00	(0.04)
投资总额	99.45	99.61
其他净资产	(0.55)	0.39
净资产合计	100.00	100.00

金融衍生工具详情(未经审计)

2025 年 4 月 1 日起至 2025 年 9 月 30 日止期间

外币远期合同

截至 2025 年 9 月 30 日，本基金持有未平仓的外汇远期合同如下：

货币/ 卖出金额	货币/ 买入金额	结算日	交易对手	公允价值 美元
金融资产：				
19,361,114 美元	29,331,110 澳元	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	86,714
102,740,029 美元	730,789,829 离岸 人民币	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	14,280
9,180,518 美元	6,824,451 英镑	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	8,440
1,175,387 美元	1,780,653 澳元	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	5,247
16,580,070 美元	117,931,683 离岸 人民币	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	1,931
7,377,456 美元	52,474,797 离岸 人民币	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	832
1,320,835 美元	1,122,263 欧元	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	297
184,566 美元	256,624 加元	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	241
251 美元	323 新加坡元	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	6
				117,988

金融衍生工具详情(未经审计)(续)

2025 年 4 月 1 日起至 2025 年 9 月 30 日止期间

外币远期合同(续)

货币/ 卖出金额	货币/ 买入金额	结算日	交易对手	公允价 值 美元
金融负债：				
7,809,306 美元	10,813,507 加元	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	(25,655)
2,051,431 美元	2,636,355 新加坡元	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	(1,439)
125,976 澳元	82,881 美元	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	(647)
432,334 离岸人民币	60,644 美元	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	(146)
2,390,289 离岸人民币	335,971 美元	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	(121)
140 美元	998 离岸人民币	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	(50)
45,985 离岸人民币	6,451 美元	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	(15)
321 美元	490 澳元	2025 年 10 月 31 日	HSBC MKTS TREASURY SERVICES HK - CUR	(14)
				(28,087)

金融衍生工具详情(未经审计)(续)

2025 年 4 月 1 日起至 2025 年 9 月 30 日止期间

期货合同

截至 2025 年 9 月 30 日，本基金持有的期货合同如下：

说明	标的资产	交易对手	公允价值 美元
金融资产：			
US 10YR NOTE (CBT) 19/12/2025	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	12,797
US 10YR NOTE (CBT) 19/12/2025	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	111,563
US 10YR NOTE (CBT) 19/12/2025	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	99,000
US 5YR NOTE (CBT) 31/12/2025	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	95,789
US ULTRA BOND CBT 19/12/2025	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	6,938
		S	326,087
金融负债：			
US 2YR NOTE (CBT) 31/12/2025	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	(105,718)
US ULTRA BOND CBT 19/12/2025	US Treasury Note	HSBC BANK PLC	(12,813)
			118,530

金融衍生工具详情(未经审计)(续)

2025 年 4 月 1 日起至 2025 年 9 月 30 日止期间

信用违约掉期

截至 2025 年 9 月 30 日，本基金持有的信用违约掉期如下：

说明	标的资产	交易对手	公允价值 美元
金融负债：			
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 103 45,750,000.00 USD 15/04/2025 20/06/2030	BNP PARIBAS SA PARIS	BNP PARIBAS SA PARIS	(2,848,199)
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 104 1,500,000.00 USD 16/04/2025 20/06/2030	BNP PARIBAS SA PARIS	BNP PARIBAS SA PARIS	(121,308)
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 105 1,500,000.00 USD 16/04/2025 20/06/2030	BARCLAYS BANK PLC	BARCLAYS BANK PLC	(121,308)
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 106 4,500,000.00 USD 15/04/2025 20/06/2030	BARCLAYS BANK PLC	BARCLAYS BANK PLC	(363,924)
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 107 5,000,000.00 USD 27/08/2025 20/06/2030	MERRILL LYNCH INTERNATIONAL	MERRILL LYNCH INTERNATIONAL	(404,360)
			(3,859,099)

业绩表现记录(未经审计)

(a) 总资产净值(按《香港财务报告准则》计算)

	2025 年 9 月 30 日 美元	2025 年 3 月 31 日 美元	2024 年 3 月 31 日 美元	2023 年 3 月 31 日 美元
总资产净值	784,849,957	1,019,741,110	381,381,265	563,501,459

(b) 每份额资产净值(按《香港财务报告准则》计算)

	计价货币	2025 年 9 月 30 日	2025 年 3 月 31 日	2024 年 3 月 31 日	2023 年 3 月 31 日
每份额资产净值					
- AC 类 - 美元	美元	9.794	9.719	9.149	8.879
- AM2 类 - 美元	美元	6.349	6.370	6.426	6.739
- AM2 类 - 人民币	人民币	6.686	6.750	6.810	6.751
- AM3O 类 - 人民币	人民币	6.279	6.234	6.302	6.627
- AM2 类 - 港元	港元	6.442	6.388	6.488	6.822
- AM2 类 - 欧元	欧元	5.790	6.237	6.296	6.566
- AM3O 类 - 欧元	欧元	6.192	6.136	6.203	6.544
- AM2 类 - 澳元	澳元	7.418	7.812	7.531	7.691
- AM3O 类 - 澳元	澳元	6.257	6.209	6.266	6.588
- AM2 类 - 加元	加元	6.800	6.965	6.608	6.932
- AM3O 类 - 加元	加元	6.284	6.223	6.296	6.603
- AM3O 类 - 英镑	英镑	6.237	6.184	6.246	6.553
- AM3O 类 - 新加坡元	新加坡元	6.276	6.219	6.289	6.604
- BC 类 - 美元	美元	9.855	9.460	8.905	8.641
- BC 类 - 人民币	人民币	9.933	9.721	9.154	8.394
- BCO 类 - 人民币	人民币	9.571	9.329	8.999	8.961
- BC 类 - 港元	港元	9.890	9.494	8.990	8.750
- BM2 类 - 美元	美元	6.974	6.905	6.967	7.306
- BM2 类 - 人民币	人民币	7.063	7.129	7.174	7.120
- BM3O 类 - 人民币	人民币	6.941	6.879	6.945	7.289
- BM2 类 - 港元	港元	6.998	6.930	7.034	7.397
- BM3O 类 - 澳元	澳元	6.905	6.851	6.919	7.267
- IM2 类 - 美元	美元	6.760	6.675	6.696	6.981
- IC 类 - 美元	美元	9.099	8.709	8.151	7.865

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(每份额交易资产净值)

截至下列日期止的财务期间/年度	AC 类 - 美元			
	买入价		卖出价	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2025 年 9 月 30 日	9.437	10.130	9.437	10.130
2025 年 3 月 31 日	8.993	9.772	8.993	9.772
2024 年 3 月 31 日	8.351	9.148	8.351	9.148
截至下列日期止的财务期间/年度	AM2 类 - 美元			
	买入价		卖出价	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2025 年 9 月 30 日	6.185	6.469	6.185	6.469
2025 年 3 月 31 日	6.206	7.969	6.206	7.969
2024 年 3 月 31 日	6.076	6.827	6.076	6.827
截至下列日期止的财务期间/年度	AM2 类 - 人民币			
	买入价		卖出价	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2025 年 9 月 30 日	6.657	6.709	6.657	6.709
2025 年 3 月 31 日	6.651	6.694	6.651	6.694
2024 年 3 月 31 日	6.512	6.994	6.512	6.994
截至下列日期止的财务期间/年度	AM30 类 - 人民币			
	买入价		卖出价	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2025 年 9 月 30 日	-	-	-	-
2025 年 3 月 31 日	6.191	6.415	6.191	6.415
2024 年 3 月 31 日	5.969	6.708	5.969	6.708

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(每份额交易资产净值)(续)

截至下列日期止的财务期间/年度	AM2 类 - 港元			
	买入价		卖出价	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2025 年 9 月 30 日	6.182	6.481	6.182	6.481
2025 年 3 月 31 日	6.335	6.583	6.335	6.583
2024 年 3 月 31 日	6.127	6.900	6.127	6.900
截至下列日期止的财务期间/年度	AM2 类 - 欧元			
	买入价		卖出价	
	最低 欧元	最高 欧元	最低 欧元	最高 欧元
2025 年 9 月 30 日	5.772	5.927	5.772	5.927
2025 年 3 月 31 日	6.217	6.218	6.217	6.218
2024 年 3 月 31 日	6.432	6.615	6.432	6.615
截至下列日期止的财务期间/年度	AM30 类 - 欧元			
	买入价		卖出价	
	最低 欧元	最高 欧元	最低 欧元	最高 欧元
2025 年 9 月 30 日	5.983	6.219	5.983	6.219
2025 年 3 月 31 日	6.088	6.330	6.088	6.330
2024 年 3 月 31 日	5.874	6.627	5.874	6.627
截至下列日期止的财务期间/年度	AM2 类 - 澳元			
	买入价		卖出价	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2025 年 9 月 30 日	7.405	7.882	7.405	7.882
2025 年 3 月 31 日	7.246	7.397	7.246	7.397
2024 年 3 月 31 日	7.191	7.825	7.191	7.825

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(每份额交易资产净值)(续)

截至下列日期止的财务期间/年度	AM30 类 - 澳元			
	买入价		卖出价	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2025 年 9 月 30 日	6.019	6.290	6.019	6.290
2025 年 3 月 31 日	6.160	6.398	6.160	6.398
2024 年 3 月 31 日	5.934	6.676	5.934	6.676
截至下列日期止的财务期间/年度	AM2 类 - 加元			
	买入价		卖出价	
	最低 加元	最高 加元	最低 加元	最高 加元
2025 年 9 月 30 日	6.674	6.757	6.674	6.757
2025 年 3 月 31 日	6.560	6.730	6.560	6.730
2024 年 3 月 31 日	7.191	7.825	7.191	7.825
截至下列日期止的财务期间/年度	AM30 类 - 加元			
	买入价		卖出价	
	最低 加元	最高 加元	最低 加元	最高 加元
2025 年 9 月 30 日	6.039	6.313	6.039	6.313
2025 年 3 月 31 日	6.194	6.425	6.194	6.425
2024 年 3 月 31 日	5.951	6.687	5.951	6.687
截至下列日期止的财务期间/年度	AM30 类 - 英镑			
	买入价		卖出价	
	最低 英镑	最高 英镑	最低 英镑	最高 英镑
2025 年 9 月 30 日	6.000	6.270	6.000	6.270
2025 年 3 月 31 日	6.138	6.380	6.138	6.380
2024 年 3 月 31 日	5.909	6.638	5.909	6.638

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(每份额交易资产净值)(续)

截至下列日期止的财务期间/年度	AM30 类 - 新加坡元			
	买入价		卖出价	
	最低	最高	最低	最高
	新加坡元	新加坡元	新加坡元	新加坡元
2025 年 9 月 30 日	6.034	6.301	6.034	6.301
2025 年 3 月 31 日	6.170	6.412	6.170	6.412
2024 年 3 月 31 日	6.312	6.690	6.312	6.690
截至下列日期止的财务期间/年度	BC 类 - 港元			
	买入价		卖出价	
	最低	最高	最低	最高
	港元	港元	港元	港元
2025 年 9 月 30 日	9.190	9.895	9.190	9.895
2025 年 3 月 31 日	8.838	9.541	8.838	9.541
2024 年 3 月 31 日	8.203	8.990	8.203	8.990
截至下列日期止的财务期间/年度	BC 类 - 人民币			
	买入价		卖出价	
	最低	最高	最低	最高
	人民币	人民币	人民币	人民币
2025 年 9 月 30 日	9.589	9.910	9.589	9.910
2025 年 3 月 31 日	8.994	9.816	8.994	9.816
2024 年 3 月 31 日	8.416	9.153	8.416	9.153
截至下列日期止的财务期间/年度	BC 类 - 美元			
	买入价		卖出价	
	最低	最高	最低	最高
	美元	美元	美元	美元
2025 年 9 月 30 日	9.186	9.860	9.186	9.860
2025 年 3 月 31 日	8.752	9.511	8.752	9.511
2024 年 3 月 31 日	8.127	8.904	8.127	8.904

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(每份额交易资产净值)(续)

BCO 类 - 人民币				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入价		卖出价	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2025 年 9 月 30 日	9.049	9.580	9.049	9.580
2025 年 3 月 31 日	8.842	9.371	8.842	9.371
2024 年 3 月 31 日	8.308	9.075	8.308	9.075
BM2 类 - 港元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入价		卖出价	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2025 年 9 月 30 日	6.708	7.038	6.708	7.038
2025 年 3 月 31 日	6.873	7.140	6.873	7.140
2024 年 3 月 31 日	6.648	7.493	6.648	7.493
BM2 类 - 人民币				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入价		卖出价	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2025 年 9 月 30 日	7.032	7.081	7.032	7.081
2025 年 3 月 31 日	7.008	7.050	7.008	7.050
2024 年 3 月 31 日	6.863	7.367	6.863	7.367
BM2 类 - 美元				
截至下列日期止的财务期间/年度	买入价		卖出价	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2025 年 9 月 30 日	6.705	7.013	6.705	7.013
2025 年 3 月 31 日	6.813	7.123	6.813	7.123
2024 年 3 月 31 日	6.587	7.401	6.587	7.401

业绩表现记录(未经审计)(续)

(c) 价格记录(每份额交易资产净值)(续)

截至下列日期止的财务期间/年度	BM30 类 - 澳元			
	买入价		卖出价	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2025 年 9 月 30 日	6.642	6.966	6.642	6.940
2025 年 3 月 31 日	6.798	7.064	6.798	7.064
2024 年 3 月 31 日	6.548	7.362	6.548	7.362
截至下列日期止的财务期间/年度	BM30 类 - 人民币			
	买入价		卖出价	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2025 年 9 月 30 日	6.672	6.966	6.672	6.966
2025 年 3 月 31 日	6.827	7.073	6.827	7.073
2024 年 3 月 31 日	6.583	7.382	6.583	7.382
截至下列日期止的财务期间/年度	IM2 类 - 美元			
	买入价		卖出价	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2025 年 9 月 30 日	-	-	-	-
2025 年 3 月 31 日	6.551	6.865	6.551	6.865
2024 年 3 月 31 日	6.316	7.072	6.316	7.072
截至下列日期止的财务期间/年度	IC 类 - 美元			
	买入价		卖出价	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2025 年 9 月 30 日	8.458	9.102	8.458	9.102
2025 年 3 月 31 日	8.015	8.753	8.015	8.753
2024 年 3 月 31 日	7.421	8.150	7.421	8.150

分派披露

AM2 类 - 美元

	除息日期	支付日期	每单位分派 金额 美元	总分派金额 美元
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0323	545,720.57
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0321	553,795.68
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0317	587,137.95
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0341	647,538.54
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0341	652,519.76
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0335	673,431.74

AM2 类 - 港元

	除息日期	支付日期	每单位分派金 额 港元	总分派金额 港元
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0324	3,808,476.21
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0325	4,217,716.54
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0321	3,953,528.71
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0345	4,362,928.27
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0341	4,288,138.69
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0335	4,151,313.74

AM2类 - 人民币

	除息日期	支付日期	每单位分派金 额 人民币	总分派金额 人民币
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0335	43,837.64
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0337	44,099.36
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0332	43,395.39
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0357	46,663.11
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0358	46,793.82
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0356	47,830.43

分派披露(续)

AM2类 - 加元

	除息日期	支付日期	每单位分派金 额 加元	总分派金额 加元
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0340	6,783.68
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0336	6,703.87
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0330	6,584.16
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0352	7,023.10
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0362	7,222.62
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0353	7,043.06

AM2类 - 澳元

	除息日期	支付日期	每单位分派金 额 澳元	总分派金额 澳元
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0371	30,592.85
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0375	30,922.69
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0369	30,647.21
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0401	34,269.83
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0404	35,302.91
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0410	35,903.95

AM2类 - 欧元

	除息日期	支付日期	每单位分派金 额 欧元	总分派金额 欧元
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0291	4,348.33
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0290	4,333.38
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0287	4,288.55
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0312	4,662.12
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0323	4,826.49
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0312	4,742.09

分派披露(续)

AM30类 - 澳元

	除息日期	支付日期	每单位分派金 额 澳元	总分派金额 澳元
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0278	129,267.27
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0282	135,887.60
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0277	134,327.72
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0305	145,746.44
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0315	164,832.32
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0311	160,295.96

AM30类 - 欧元

	除息日期	支付日期	每单位分派金 额 欧元	总分派金额 欧元
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0185	3,344.54
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0193	3,488.50
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0175	3,162.54
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0209	3,776.25
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0221	3,992.28
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0222	4,419.65

AM30类 - 人民币

	除息日期	支付日期	每单位分派金 人民币	总分派金额 人民币
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0158	295,263.73
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0163	312,956.71
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0155	298,020.97
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0176	332,853.46
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0183	349,878.79
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0187	350,424.80

分派披露(续)

AM30类 - 加元

	除息日期	支付日期	每单位分派金 额 加元	总分派金额 加元
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0222	38,965.23
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0224	38,639.78
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0209	39,577.32
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0235	43,901.34
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0240	45,062.89
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0232	44,619.08

AM30类 - 英镑

	除息日期	支付日期	每单位分派金 额 英镑	总分派金额 英镑
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0294	32,046.95
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0295	32,383.95
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0299	33,657.67
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0321	36,232.80
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0326	37,877.80
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0328	58,913.15

AM30类 - 新加坡元

	除息日期	支付日期	每单位分派金 额 新加坡元	总分派金额 新加坡元
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0155	6,501.16
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0177	8,731.21
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0176	8,680.39
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0216	10,651.35
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0230	11,339.72
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0239	11,205.60

分派披露(续)

BM2类 - 美元

	除息日期	支付日期	每单位分派金 额 美元	总分派金额 美元
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0350	86,879.55
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0349	88,208.29
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0344	91,057.76
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0370	99,854.36
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0370	99,491.74
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0363	97,849.77

BM2类 - 人民币

	除息日期	支付日期	每单位分派金 额 人民币	总分派金额 人民币
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0354	3,956,005.42
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0355	4,045,577.71
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0351	4,038,341.51
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0377	4,388,457.41
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0379	4,398,975.54
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0376	4,320,084.23

BM30类 - 人民币

	除息日期	支付日期	每单位分派金 额 人民币	总分派金额 人民币
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0175	131,859.50
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0180	139,324.94
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0171	135,056.99
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0194	165,665.94
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0202	175,339.43
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0206	177,831.20

分派披露(续)

BM2类 - 港元	除息日期	支付日期	每单位分派 金额 港元	总分派金额 港元
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0351	56,236.26
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0353	55,258.19
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0349	42,224.11
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0374	45,797.13
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0372	42,779.66
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0363	40,821.34

BM30类 - 澳元	除息日期	支付日期	每单位分派 金额 澳元	总分派金额 澳元
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0306	7,865.15
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0311	7,420.71
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0306	7,004.62
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0337	10,483.78
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0347	10,782.35
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0343	10,502.97

IM2类 - 美元	除息日期	支付日期	每单位分派 金额 美元	总分派金额 美元
2025年9月派息	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0339	8,247.14
2025年8月派息	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0338	8,222.82
2025年7月派息	2025年7月31日	2025年8月11日	0.0333	8,101.18
2025年6月派息	2025年6月30日	2025年7月10日	0.0358	8,709.37
2025年5月派息	2025年5月30日	2025年6月10日	0.0358	8,709.37
2025年4月派息	2025年4月30日	2025年5月13日	0.0351	8,539.08

证券借贷安排和抵押资产持有量详情

汇丰亚洲高入息债券基金

以下部分系根据香港证券及期货事务监察委员会发布的《单位信托及互惠基金守则》之规定进行披露。

(A) 抵押资产持有量

2025 年 9 月 30 日

抵押资产提供方	抵押资产提供方信用评级 ¹	抵押资产的性质	非现金抵押资产的逐日盯市价值(如有) 美元	抵押资产的公允价值 美元
Bnp Paribas London	AA-	固定收益证券	18,838,970	18,838,970
Morgan Stanley & Co International Plc	AA-	固定收益证券	36,087,246	36,087,246
Jefferies International Limited (Parent)	BBB+	固定收益证券	4,811,540	4,811,540
Merrill Lynch International	A+	固定收益证券	11,976,029	11,976,029
Deutsche Bank Ag	A-	固定收益证券	32,111,209	32,111,209
Hsbc Bank Plc	AA-	固定收益证券	1,210,281	1,210,281
Nomura International Plc	NR	固定收益证券	6,736,154	6,736,154
The Toronto-Dominion Bank London Branch	AA-	固定收益证券	1,454,054	1,454,054
				113,225,483

2024 年 9 月 30 日

无

¹ 穆迪授予的信用评级

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(B) 固定收益抵押资产的信用评级

2025 年 9 月 30 日

抵押资产提供方	资产类别	评级机构	抵押资产的信用评级	抵押资产的公允价值 美元
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aa1	2,104
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aa3	29
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	1,440
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	725
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	1,414
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	312
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	177
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	3,473,941
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	2,863,257
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	1
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	-
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	88,942
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	2,615
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aa3	1
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aa3	557,298
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aa3	1
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aa3	1
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	A1	36,274
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	4,810
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	22
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	3,477,334
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	3,477,372
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	1,707,493
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	穆迪	Aaa	3,143,407
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	穆迪	Aa3	16,164
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	穆迪	Aa3	85,425
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	穆迪	Aa3	71,011
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	穆迪	Aa3	545,215
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	穆迪	Aa3	223,776
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	穆迪	Aa1	6,101,127
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	穆迪	Aa1	6,101,064
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	穆迪	Aa1	6,101,068
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	穆迪	Aa1	5,380,285
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	穆迪	Aa1	6,101,060
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	穆迪	Aa1	1,385,014
HSBC BANK PLC	政府债券	穆迪	Aa3	166,355
HSBC BANK PLC	GIL	穆迪	Aa3	174
HSBC BANK PLC	GIL	穆迪	Aa3	263
HSBC BANK PLC	GIL	穆迪	Aa3	71,162
HSBC BANK PLC	GIL	穆迪	Aa3	51,295

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(B) 固定收益抵押资产的信用评级(续)

2025 年 9 月 30 日

抵押资产提供方	资产类别	评级机构	抵押资产的信用评级	抵押资产的公允价值 美元
HSBC BANK PLC	政府债券	穆迪	A1	1,378
HSBC BANK PLC	政府债券	穆迪	Aaa	229,938
HSBC BANK PLC	政府债券	穆迪	Aaa	229,901
HSBC BANK PLC	政府债券	穆迪	Aaa	229,898
HSBC BANK PLC	政府债券	穆迪	Aaa	229,917
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa1	913,088
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa1	107,085
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa3	18,055
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa3	914,192
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa3	187
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa3	2,524
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa3	148
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aaa	615,992
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa3	16,187
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa3	914,191
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa3	107,391
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa3	914,191
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa3	830
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa3	47,902
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa3	2
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa3	2
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa3	821
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa3	930
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aaa	145
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aaa	357
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa1	161,715
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa1	1,169

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(B) 固定收益抵押资产的信用评级(续)

2025 年 9 月 30 日

抵押资产提供方	资产类别	评级机构	抵押资产的信用评级	抵押资产的公允价值 美元
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa1	50,494
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	穆迪	Aa1	23,942
MERRILL LYNCH INTERNATIONAL	政府债券	穆迪	Aaa	2,275,034
MERRILL LYNCH INTERNATIONAL	政府债券	穆迪	Aa1	2,275,244
MERRILL LYNCH INTERNATIONAL	政府债券	穆迪	Aa1	2,275,436
MERRILL LYNCH INTERNATIONAL	政府债券	穆迪	Aa1	72,317
MERRILL LYNCH INTERNATIONAL	政府债券	穆迪	Aa1	2,275,430
MERRILL LYNCH INTERNATIONAL	政府债券	穆迪	Aa1	2,243,674
MERRILL LYNCH INTERNATIONAL	政府债券	穆迪	Aa1	98
MERRILL LYNCH INTERNATIONAL	政府债券	穆迪	Aa1	558,796
MORGAN STANLEY & CO INTERNATIONAL PLC	GIL	穆迪	Aa3	6,856,501
MORGAN STANLEY & CO INTERNATIONAL PLC	GIL	穆迪	Aa3	6,747,632
MORGAN STANLEY & CO INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	A1	6,856,294
MORGAN STANLEY & CO INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa1	6,856,519
MORGAN STANLEY & CO INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa1	1,807,930
MORGAN STANLEY & CO INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa1	105,801
MORGAN STANLEY & CO INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa1	6,856,569
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa1	31,259
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa3	864,132
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa3	2,420
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa3	194,736
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa3	703
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa3	29,124
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa3	864,132
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa3	864,132

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(B) 固定收益抵押资产的信用评级(续)

2025 年 9 月 30 日

抵押资产提供方	资产类别	评级机构	抵押资产的信用评级	抵押资产的公允价值 美元
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa3	864,132
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aaa	655,505
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	A1	863,783
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	A1	772
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa1	71
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa1	1,279,836
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa1	192,125
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	穆迪	Aa1	29,292
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aaa	121,200
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aaa	798
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aaa	173,785
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aaa	136,031
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aaa	128,511
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aaa	84,863
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aa3	12,660
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aa3	20,024
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aa3	276,265
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aa3	3,371
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aa3	247,595
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aa3	9
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aa3	1
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aaa	15,732
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aa1	11,261
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aa1	234
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aa1	627

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(B) 固定收益抵押资产的信用评级(续)

2025 年 9 月 30 日

抵押资产提供方	资产类别	评级机构	抵押资产的信用评级	抵押资产的公允价值 美元
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aa1	59,971
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aa1	83
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aa1	51,275
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aa1	547
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aa1	109,211
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	穆迪	Aa1	
				113,225,483

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(C) 证券借贷及回购交易明细

证券借贷交易

截至 2025 年 9 月 30 日止期间

交易对手	抵押资产类型	货币	期限 ²	抵押资产提供方所在地	结算/清算	借出证券的公允价值 美元
Jefferies International Limited (Parent)	公司债务	美元	无固定期限	伦敦	第三方抵押资产	5,514,469
Jefferies International Limited (Parent)	政府债务	美元	无固定期限	伦敦	第三方抵押资产	298,400
Bnp Paribas London (Parent)	公司债务	美元	无固定期限	伦敦	第三方抵押资产	2,173,032
Bnp Paribas London (Parent)	政府债务	美元	无固定期限	伦敦	第三方抵押资产	206,135
Morgan Stanley & Co International Plc	公司债务	美元	无固定期限	伦敦	第三方抵押资产	11,043,697
Morgan Stanley & Co International Plc	政府债务	美元	无固定期限	伦敦	第三方抵押资产	5,533,666
Merrill Lynch International (Parent)	公司债务	美元	无固定期限	伦敦	第三方抵押资产	8,861,766
Merrill Lynch International (Parent)	政府债务	美元	无固定期限	伦敦	第三方抵押资产	-
The Toronto-Dominion Bank London Branch	公司债务	美元	无固定期限	伦敦	第三方抵押资产	-
The Toronto-Dominion Bank London Branch	政府债务	美元	无固定期限	伦敦	第三方抵押资产	4,541,758
Deutsche Bank Ag (Parent)	公司债务	美元	无固定期限	伦敦	第三方抵押资产	11,300,860
Deutsche Bank Ag (Parent)	政府债务	美元	无固定期限	伦敦	第三方抵押资产	939,204
						50,412,987

截至 2024 年 9 月 30 日止期间

无

² 下表披露了在截至2025年9月30日止期间内借出但尚未归还的证券。

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易

2025 年 9 月 30 日

借出的证券	抵押资产类型	货币	期限	证券借贷代理人所在地	现金与非 现金抵押 资产占比	非现金 抵押资 产到期 日	结算/清 算	占资 产净 值百 分比	借出证券 的公允价 值 ³ 美元
香港铁路有限公司 4.875% 2035年4月1日	公司债务	美元	无固定 期限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.11%	834,793
香港铁路有限公司 4.875% 2035年4月1日	公司债务	美元	无固定 期限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.05%	417,396
香港铁路有限公司 4.875% 2035年4月1日	公司债务	美元	无固定 期限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.05%	417,396
香港铁路有限公司 4.875% 2035年4月1日	公司债务	美元	无固定 期限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.05%	375,657
香港铁路有限公司 4.875% 2035年4月1日	公司债务	美元	无固定 期限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.05%	365,222
香港铁路有限公司 4.875% 2035年4月1日	公司债务	美元	无固定 期限	伦敦	0%	见下表	第三方抵 押资产	0.04%	330,787
韩国进出口银行 4.875% 2030年1月14 日	公司债务	美元	无固定 期限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.08%	621,026
印度尼西亚共和国 5.6% 2035年1月15 日	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.04%	317,871
印度尼西亚共和国 5.6% 2035年1月15 日	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.47%	3,682,006
印度尼西亚共和国 5.6% 2035年1月15 日	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.05%	398,398

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易

2025 年 9 月 30 日

借入的证券	抵押资产类型	货币	期限	证券借贷代理人所在地	现金与非 现金抵押 资产占比	非现金抵 押资产到 期日	结算/清算	占资产 净值百 分比	借出证券 的公允价 值 ³ 美元
MUTHOOT FINANCE LTD 6.375% 2030年3月2日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.08%	633,215
BOC AVIATION USA CORP 5.25% 2030年 1月14日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.65%	5,127,495
印度尼西亚 (共和国) 5.2% 2035年7月23 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.09%	718,049
印度尼西亚 (共和国) 5.2% 2035年7月23 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.04%	306,817
菲律宾(共和 国) 4.75% 2035年3月5日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%	见下表	第三方抵 押资产	0.12%	920,452
菲律宾(共和 国) 4.375% 2030年3月5日	政府债券	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.15%	1,160,325
菲律宾(共和 国) 4.375% 2030年3月5日	政府债券	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.36%	2,837,816
菲律宾(共和 国) 4.375% 2030年3月5日	政府债券	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.34%	2,638,884
菲律宾(共和 国) 4.375% 2030年3月5日	政府债券	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.27%	2,093,853
MUTHOOT FINANCE LTD 6.375% 2030年3月2日	政府债券	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.08%	625,213

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易

2025 年 9 月 30 日

借入的证券	抵押资产类型	货币	期限	证券借贷代理人所在地	现金与非 现金抵押 资产占比	非现金抵 押资产到 期日	结算/清算	占资产 净值百 分比	借出证券 的公允价 值 ³ 美元
菲律宾共和国 5.5% 2035年2 月4日 TSMC ARIZONA CORP 3.125% 2041年10月25 日	政府债券	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.27%	2,130,562
TSMC ARIZONA CORP 3.125% 2041年10月25 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.12%	975,019
TSMC ARIZONA CORP 3.125% 2041年10月25 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.17%	1,300,026
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.5% 2070年10月6 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.05%	409,588
腾迅控股有限 公司 2.39% 2030年6月3日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.07%	557,489
腾迅控股有限 公司 3.24% 2050年6月3日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%	见下表	第三方抵 押资产	0.18%	1,393,454
腾迅控股有限 公司 SER 3.84% 2051年 4月22日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.22%	1,701,980
腾迅控股有限 公司 SER 3.84% 2051年 4月22日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.08%	605,652
THAIOIL TRSR CENTER SER REGS (S 条例 债券) 2.5% 2030年6月18 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.27%	2,147,684
THAIOIL TRSR CENTER SER REGS (S 条例 债券) 2.5% 2030年6月18 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.02%	180,858

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(C) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易

2025 年 9 月 30 日

借出的证券	抵押资产类型	货币	期限	证券借贷代理人所在地	现金与非 现金抵押 资产占比	非现金抵 押资产到 期日	结算/清算	占资产 净值百 分比	借出证券 的公允价 值 ³ 美元
THAIOIL TRSR CENTER SER REGS (S 条例 债券) 2.5% 2030年6月18 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.09%	678,216
阿里巴巴集团 控股 5.25% 2035年5月26 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.15%	1,152,201
阿里巴巴集团 控股 5.25% 2035年5月26 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.16%	1,230,760
阿里巴巴集团 控股 5.25% 2035年5月26 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.27%	2,094,911
BIOCON BIOLOGICS GLOBAL 6.67% 2029年 10月9日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%	见下表	第三方抵 押资产	0.06%	485,930
CK HUTCHISON INTL 23 4.875% 2033 年4月21日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.10%	810,025
CNOOC FINANCE 2012 LTD 5% 2042年5月2日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.04%	304,983
CNOOC FINANCE 2012 LTD 5% 2042年5月2日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.03%	203,322
美高梅中国控 股有限公司 SER 7.125% 2031年6月26 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.13%	987,071
SINOPEC GRP DEV 2018 3.1% 2051年1月8日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.06%	448,924

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易

2025年9月30日

借出的证券	抵押资产类型	货币	期限	证券借贷代理人所在地	现金与非 现金抵押 资产占比	非现金抵 押资产到 期日	结算/清算	占资产 净值百 分比	借出证券 的公允价 值 ³ 美元
渣打银行 可 变债券 永续 债券 2049年 12月31日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.06%	471,182
渣打银行 可 变债券 永续 债券 2049年 12月31日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.12%	948,710
渣打银行 可 变债券 2035 年5月14日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.07%	528,220
STUDIO CITY FINANCE LTD 5% 2029 年1月15日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.09%	674,993
永利澳门有限 公司 6.75% 2034年2月15 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.16%	1,217,306
日产自动车株 式会社 SER REGS 8.125% 2035年7月17 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%	见下表	第三方抵 押资产	0.55%	4,316,888
日产自动车株 式会社 SER REGS 8.125% 2035年7月17 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.03%	214,824
NTT FINANCE CORP 5.502% 2035年7月16 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.04%	283,544
CIMIC FINANCE USA PTY LT 7% 2034年3月 25日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.06%	436,169
印度进出口银 行 5.5% 2035 年1月13日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.11%	837,609

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易

2025 年 9 月 30 日

借出的证券	抵押资产类型	货币	期限	证券借贷代理人所在地	现金与非现金抵押资产占比	非现金抵押资产到期日	结算/清算	占资产净值百分比	借出证券的公允价值 ³ 美元
印度进出口银行 5.5% 2035 年1月13日	公司债务	美元	无固定期限	伦敦	0%		第三方抵押资产	0.07%	575,856
德里国际机场 6.45% 2029年6月4日	公司债务	美元	无固定期限	伦敦	0%		第三方抵押资产	0.04%	312,789
韩华生命保险 可变债券 2055年6月24日	公司债务	美元	无固定期限	伦敦	0%		第三方抵押资产	0.11%	838,561
香港特别行政区(政府) 5.25% 2053年1月11日	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%		第三方抵押资产	0.03%	215,047
香港特别行政区(政府) 4.25% 24 JUL 2027	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%		第三方抵押资产	0.09%	707,213
JSW INFRASTRUCTURE 4.95% 2029年1月21日	公司债务	美元	无固定期限	伦敦	0%	见下表	第三方抵押资产	0.03%	200,973
JSW INFRASTRUCTURE 4.95% 2029年1月21日	公司债务	美元	无固定期限	伦敦	0%		第三方抵押资产	0.03%	200,973
JSW INFRASTRUCTURE 4.95% 2029年1月21日	公司债务	美元	无固定期限	伦敦	0%		第三方抵押资产	0.12%	909,402
KOREA HOUSING FINANCE CO 5.125% 2030 年1月21日	公司债务	美元	无固定期限	伦敦	0%		第三方抵押资产	0.07%	520,215
KOREA HOUSING FINANCE CO SER 3.875% 2030年9月17日	公司债务	美元	无固定期限	伦敦	0%		第三方抵押资产	0.03%	197,907

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易

2025年9月30日

借出的证券	抵押资产类型	货币	期限	证券借贷代理人所在地	现金与非 现金抵押 资产占比	非现金抵 押资产到 期日	结算/清算	占资产 净值百 分比	借出证券 的公允价 值 ³ 美元
KOREA HOUSING FINANCE CO SER 3.875% 2030年9月17 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.06%	494,767
LG CHEM LTD SER REGS 2.375% 2031年7月7日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.03%	265,313
MEDCO CYPRESS TREE PTE SER REGS 8.625% 2030 年5月19日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.27%	2,109,520
蒙古国际债券 6.625% 2030 年2月25日	政府债券	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.06%	508,938
蒙古国际债券 6.625% 2030 年2月25日	政府债券	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.03%	203,575
蒙古国际债券 6.625% 2030 年2月25日	政府债券	美元	无固 定期 限	伦敦	0%	见下表	第三方抵 押资产	0.03%	254,469
PERUSAHAA N PENERBIT SBSN (BR) 5.25% 2034年 11月25日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.21%	1,640,982
PERUSAHAA N PENERBIT SBSN (BR) 5.25% 2034年 11月25日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.10%	794,851
PETRONAS CAPITAL LTD 4.5% 2045年3月18 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.05%	367,619
PETRONAS CAPITAL LTD 4.5% 2045年3月18 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.14%	1,111,868

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易

2025年9月30日

借出的证券	抵押资产类型	货币	期限	证券借贷代理人所在地	现金与非 现金抵押 资产占比	非现金抵 押资产到 期日	结算/清算	占资产 净值百 分比	借出证券 的公允价 值 ³ 美元
PETRONAS CAPITAL LTD 5.8488% 2055年4月3日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.05%	423,584
PETRONAS CAPITAL LTD 2.48% 2032年1月28 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.23%	1,803,500
POSCO HOLDINGS INC 5.125% 2030年5月7日 PT	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.07%	512,197
INDONESIA ASAHA ALUMINIUM AND PT MINERAL INDUSTRIES INDONESIA (PERSERO) 6.53% 2028年 11月15日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%	见下表	第三方抵 押资产	0.21%	1,609,761
新韩金融集团 可变债券 永 续债券 2049 年12月31日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.03%	197,395
新韩金融集团 可变债券 永 续债券 2049 年12月31日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.08%	592,184
SHRIRAM FINANCE LTD 6.15% 2028年4月3日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.04%	286,330
SHRIRAM FINANCE LTD 6.15% 2028年4月3日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.03%	203,794
SK海力士 6.5% 2033年1 月17日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.03%	220,758
SK海力士 6.5% 2033年1 月17日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.11%	883,032

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易

2025 年 9 月 30 日

借出的证券	抵押资产类型	货币	期限	证券借贷代理人所在地	现金与非 现金抵押 资产占比	非现金抵 押资产到 期日	结算/清算	占资产 净值百 分比	借出证券 的公允价 值 ³ 美元
SK海力士 6.5% 2033年 1月17日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.04%	331,137
NAN FUNG TREASURY LTD SER 欧 元中期票据 5% 2028年9 月5日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.05%	401,341
FRANSHION BRILLIANT LTD 4.25% 2029年7月23 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.04%	276,525
HYSAN MTN LTD SER 欧 元中期票据 2.82% 2029 年9月4日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.32%	2,487,112
FRANSHION BRILLIANT LTD 3.2% 2026年4月9 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.03%	197,904
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR 4.745% 2051 年6月9日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%	见下表	第三方抵 押资产	0.22%	1,730,704
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR 4.745% 2051 年6月9日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.09%	735,549
GLP PTE LTD 可变债券 永续债券 2049年12月 31日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.07%	514,701
HONGKONG LAND FINANCE SER 欧元中 期票据 2.25% 2031年7月15 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.13%	981,672
开泰银行香港 分行 可变债 券 2049年12 月31日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.11%	867,665

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易

2025 年 9 月 30 日

借出的证券	抵押资产类型	货币	期限	证券借贷代理人所在地	现金与非 现金抵押 资产占比	非现金抵 押资产到 期日	结算/清算	占资产 净值百 分比	借出证券 的公允价 值 ³ 美元
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR 4.805% 2052 年4月27日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.26%	2,052,777
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR 4.805% 2052 年4月27日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.02%	174,704
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR 4.805% 2052 年4月27日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.03%	262,057
BANK NEGARA INDONESIA SER 欧元中期 票据 5.28% 2029年4月5日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.20%	1,539,094
BANK NEGARA INDONESIA SER 欧元中期 票据 5.28% 2029年4月5日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%	见下表	第三方抵 押资产	0.07%	513,031
CATHAYLIF E SINGAPORE 5.95% 2034年 7月5日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.12%	957,861
SAN MIGUEL GLOBAL POWER 可变 债券 2049年 12月31日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.05%	360,936
TRAD & DEV BANK MONGOLIA 8.5% 2027年 12月23日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.02%	123,422
渣打银行2036 年1月21日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.04%	324,696
渣打银行2036 年1月21日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.04%	305,214

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易

2025 年 9 月 30 日

借入的证券	抵押资产类型	货币	期限	证券借贷代理人所在地	现金与非 现金抵押 资产占比	非现金抵 押资产到 期日	结算/清算	占资产 净值百 分比	借出证券的公 允价值 ³ 美元
渣打银行2036 年1月21日 BANK OF PHILIPPINE ISLAN SER 欧元中期票据 5.0% 2030年4 月7日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.14%	1,074,742
SING TECH ENGINEERIN G SER 欧元中 期票据 4.25% 2030年5月8日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.03%	206,683
TONGYANG LIFEINSURA NCECO 可变 债券 2035年5 月7日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.10%	806,888
TONGYANG LIFEINSURA NCECO 可变 债券 2035年5 月7日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.27%	2,087,706
NANSHAN LIFE PTE LTD 2041年3 月17日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%	见下表	第三方抵 押资产	0.14%	1,115,536
GLP PTE LTD 9.75% 2028年 5月20日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.14%	1,117,310
GLP PTE LTD 9.75% 2028年 5月20日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.20%	1,559,873
软银集团 7.25% 2032年 7月10日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.19%	1,515,156
MUANGTHAI CAPITAL PCL 7.55% 2030年7月21 日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.19%	1,468,862
LI & FUNG LTD 8.375% 2029年2月5日	公司债务	美元	无固 定期 限	伦敦	0%		第三方抵 押资产	0.07%	519,342
								0.39%	3,034,650
								13.46%	104,719,354

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易

2024 年 9 月 30 日

无

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

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细

证券借贷交易的抵押资产

2025 年 9 月 30 日

抵押资产提供方	抵押资产类型	货币	期限	抵押资产提供方所在地	现金与非现金抵押资产占比	非现金抵押资产到期日	结算/清算	抵押资产所覆盖的资产净值百分比	抵押资产的公允价值 美元
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2025年10月20日	第三方抵押资产	0.12%	913,088
BNP PARIBAS LONDON NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年2月20日	第三方抵押资产	0.00%	2,104
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2020年6月30日	第三方抵押资产	0.00%	31,259
MORGAN STANLEY & CO INTERNATIONAL PLC	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2031年2月20日	第三方抵押资产	0.01%	107,085
BNP PARIBAS LONDON NOMURA INTERNATIONAL PLC	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2057年7月22日	第三方抵押资产	0.87%	6,856,501
BNP PARIBAS LONDON NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年3月28日	第三方抵押资产	0.00%	29
BNP PARIBAS LONDON NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年3月28日	第三方抵押资产	0.11%	864,132
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年3月28日	第三方抵押资产	0.00%	2,420
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2041年3月28日	第三方抵押资产	0.02%	194,736
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年3月28日	第三方抵押资产	0.00%	18,055
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年3月28日	第三方抵押资产	0.12%	914,192
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2031年6月22日	第三方抵押资产	0.00%	703
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2057年6月22日	第三方抵押资产	0.00%	16,164
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2057年6月22日	第三方抵押资产	0.00%	29,124
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年6月22日	第三方抵押资产	0.11%	864,132

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(C) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易的抵押资产

2025 年 9 月 30 日

抵押资产提供方	抵押资产类型	货币	期限	抵押资产提供方所在地	现金与非现金抵押资产占比	非现金抵押资产到期日	结算/清算	抵押资产所覆盖的资产净值百分比	抵押资产的公允价值美元
NOMURA INTERNATIONAL PLC JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT) JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT) JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT) JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2040年6月22日	第三方抵押资产	0.11%	864,132
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年6月22日	第三方抵押资产	0.00%	187
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2043年6月22日	第三方抵押资产	0.00%	2,524
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年10月22日	第三方抵押资产	0.00%	148
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年10月22日	第三方抵押资产	0.11%	864,132
HSBC BANK PLC	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2044年7月18日	第三方抵押资产	0.02%	166,355
MORGAN STANLEY & CO INTERNATIONAL PLC	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2054年10月22日	第三方抵押资产	0.86%	6,747,632
HSBC BANK PLC	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2063年10月22日	第三方抵押资产	0.00%	174
HSBC BANK PLC	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2043年10月22日	第三方抵押资产	0.00%	263
HSBC BANK PLC	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2027年3月7日	第三方抵押资产	0.01%	71,162
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2027年6月1日	第三方抵押资产	0.02%	121,200
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2030年3月1日	第三方抵押资产	0.00%	1,440
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2027年2月1日	第三方抵押资产	0.00%	725
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2057年12月1日	第三方抵押资产	0.00%	1,414
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2057年12月1日	第三方抵押资产	0.29%	2,275,034

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易的抵押资产

2025 年 9 月 30 日

抵押资产提供方	抵押资产类型	货币	期限	抵押资产提供方所在地	现金与非 现金抵押 资产占比	非现金抵押资 产到期日	结算/清算	抵押资产所 覆盖的资产 净值百分比	抵押资产的公允价 值 美元
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2027年6月1日	第三方抵押资产	0.00%	798
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2029年6月1日	第三方抵押资产	0.02%	173,785
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2033年6月1日	第三方抵押资产	0.02%	136,031
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2037年6月1日	第三方抵押资产	0.02%	128,511
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2041年6月1日	第三方抵押资产	0.01%	84,863
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2046年8月15日	第三方抵押资产	0.00%	312
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年11月15日	第三方抵押资产	0.00%	177
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2044年7月4日	第三方抵押资产	0.44%	3,473,941
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年4月18日	第三方抵押资产	0.08%	655,505
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年10月10日	第三方抵押资产	0.36%	2,863,257
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2033年2月15日	第三方抵押资产	0.08%	615,992
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	丹麦克朗	无固定期限	伦敦	0%	2025年11月15日	第三方抵押资产	0.00%	1
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	丹麦克朗	无固定期限	伦敦	0%	2027年11月15日	第三方抵押资产	0.00%	-
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	丹麦克朗	无固定期限	伦敦	0%	2031年11月15日	第三方抵押资产	0.01%	88,942
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	丹麦克朗	无固定期限	伦敦	0%	2033年11月15日	第三方抵押资产	0.00%	2,615

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易的抵押资产

2025 年 9 月 30 日

抵押资产提供方	抵押资产类型	货币	期限	抵押资产提供方所在地	现金与非 现金抵押 资产占比	非现金抵押资产 到期日	结算/清算	抵押资产 所覆盖的 资产净值 百分比	抵押资产 的公允价 值 美元
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年10月25日	第三方抵押资产	0.00%	12,660
DEUTSCHE BANK AG JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2025年10月25日	第三方抵押资产	0.01%	85,425
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年4月25日	第三方抵押资产	0.00%	16,187
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2040年7月25日	第三方抵押资产	0.12%	914,191
BNP PARIBAS LONDON JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2041年4月25日	第三方抵押资产	0.00%	1
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年4月25日	第三方抵押资产	0.01%	107,391
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2027年10月25日	第三方抵押资产	0.12%	914,191
DEUTSCHE BANK AG THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2045年5月25日	第三方抵押资产	0.01%	71,011
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年11月25日	第三方抵押资产	0.00%	20,024
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2047年7月25日	第三方抵押资产	0.00%	830
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2039年6月25日	第三方抵押资产	0.01%	47,902
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2027年5月25日	第三方抵押资产	0.04%	276,265
BNP PARIBAS LONDON THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2048年5月25日	第三方抵押资产	0.07%	557,298
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年5月25日	第三方抵押资产	0.00%	3,371
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年5月25日	第三方抵押资产	0.03%	247,595

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易的抵押资产

2025年9月30日

抵押资产提供方	抵押资产类型	货币	期限	抵押资产提供方所在地	现金与非现金抵押资产占比	非现金抵押资产到期日	结算/清算	抵押资产所覆盖的资产净值百分比	抵押资产的公允价值 美元
BNP PARIBAS LONDON JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2052年5月25日	第三方抵押资产	0.00%	1
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年5月25日	第三方抵押资产	0.00%	2
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年2月25日	第三方抵押资产	0.00%	9
DEUTSCHE BANK AG JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2033年5月25日	第三方抵押资产	0.00%	2
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2034年7月25日	第三方抵押资产	0.07%	545,215
DEUTSCHE BANK AG JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2033年11月25日	第三方抵押资产	0.03%	223,776
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2027年9月24日	第三方抵押资产	0.00%	821
BNP PARIBAS LONDON JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2055年5月25日	第三方抵押资产	0.00%	1
HSBC BANK PLC	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年5月25日	第三方抵押资产	0.00%	1
BNP PARIBAS LONDON NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年9月24日	第三方抵押资产	0.00%	930
HSBC BANK PLC	政府债券	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2027年1月29日	第三方抵押资产	0.01%	51,295
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2026年12月20日	第三方抵押资产	0.00%	36,274
HSBC BANK PLC	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2029年3月10日	第三方抵押资产	0.11%	863,783
NOMURA INTERNATIONAL PLC	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2048年9月20日	第三方抵押资产	0.00%	1,378
	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2049年12月20日	第三方抵押资产	0.00%	772

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易的抵押资产

2025年9月30日

抵押资产提供方	抵押资产类型	货币	期限	抵押资产提供方所在地	现金与非现金抵押资产占比	非现金抵押资产到期日	结算/清算	抵押资产所覆盖的资产净值百分比	抵押资产的公允价值 美元
MORGAN STANLEY & CO INTERNATIONAL PLC JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT) BNP PARIBAS LONDON BNP PARIBAS LONDON JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT) BNP PARIBAS LONDON BNP PARIBAS LONDON HSBC BANK PLC BNP PARIBAS LONDON BNP PARIBAS LONDON HSBC BANK PLC THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2026年4月20日	第三方抵押资产	0.87%	6,856,294
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年7月15日	第三方抵押资产	0.00%	145
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2034年7月15日	第三方抵押资产	0.00%	4,810
BNP PARIBAS LONDON JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT) BNP PARIBAS LONDON	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年7月15日	第三方抵押资产	0.00%	22
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2027年1月15日	第三方抵押资产	0.00%	357
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	挪威克朗	无固定期限	伦敦	0%	2028年4月26日	第三方抵押资产	0.44%	3,477,334
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	挪威克朗	无固定期限	伦敦	0%	2030年8月19日	第三方抵押资产	0.44%	3,477,372
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	挪威克朗	无固定期限	伦敦	0%	2030年8月19日	第三方抵押资产	0.03%	229,938
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	挪威克朗	无固定期限	伦敦	0%	2031年9月17日	第三方抵押资产	0.03%	229,901
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	挪威克朗	无固定期限	伦敦	0%	2032年5月18日	第三方抵押资产	0.22%	1,707,493
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	挪威克朗	无固定期限	伦敦	0%	2032年5月18日	第三方抵押资产	0.03%	229,898
BNP PARIBAS LONDON	政府债券	挪威克朗	无固定期限	伦敦	0%	2033年8月15日	第三方抵押资产	0.40%	3,143,407
HSBC BANK PLC	政府债券	挪威克朗	无固定期限	伦敦	0%	2039年5月31日	第三方抵押资产	0.03%	229,917
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2029年4月30日	第三方抵押资产	0.00%	15,732
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2027年11月15日	第三方抵押资产	0.00%	11,261

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易的抵押资产

2025 年 9 月 30 日

抵押资产提供方	抵押资产类型	货币	期限	抵押资产提供方所在地	现金与非 现金抵押 资产占比	非现金抵押资产 到期日	结算/清算	抵押资产 所覆盖的 资产净值 百分比	抵押资产的公允价 值 美元
THE TORONTO- DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2042年8月15 日	第三方抵 押资产	0.00%	234
THE TORONTO- DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2042年11月15日	第三方抵 押资产	0.00%	627
MORGAN STANLEY & CO INTERNATION AL PLC	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2044年11月15日	第三方抵 押资产	0.87%	6,856,519
MERRILL LYNCH INTERNATION AL	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2041年5月15日	第三方抵 押资产	0.29%	2,275,244
NOMURA INTERNATION AL PLC	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2041年11月15日	第三方抵 押资产	0.00%	71
THE TORONTO- DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2042年5月15日	第三方抵 押资产	0.01%	59,971
MORGAN STANLEY & CO INTERNATION AL PLC	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2042年11月15日	第三方抵 押资产	0.23%	1,807,930
THE TORONTO- DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2053年2月15日	第三方抵 押资产	0.00%	83
THE TORONTO- DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2053年2月15日	第三方抵 押资产	0.01%	105,801
NOMURA INTERNATION AL PLC	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2043年5月15日	第三方抵 押资产	0.16%	1,279,836
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2044年5月15日	第三方抵 押资产	0.78%	6,101,127
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2044年5月15日	第三方抵 押资产	0.02%	192,125
THE TORONTO- DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2026年12月31日	第三方抵 押资产	0.01%	51,275

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易的抵押资产

2025 年 9 月 30 日

抵押资产提供方	抵押资产类型	货币	期限	抵押资产提供方所在地	现金与非 现金抵押 资产占比	非现金抵押资产 到期日	结算/清算	抵押资产 所覆盖的 资产净值 百分比	抵押资产的公允价 值 美元
THE TORONTO- DOMINION BANK LONDON BRANCH	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2030年2月15 日	第三方抵 押资产	0.00%	547
NOMURA INTERNATION AL PLC	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2030年8月15日	第三方抵 押资产	0.00%	29,292
MERRILL LYNCH INTERNATION AL	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2031年2月15日	第三方抵 押资产	0.29%	2,275,436
MERRILL LYNCH INTERNATION AL	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2031年5月15日	第三方抵 押资产	0.01%	72,317
MERRILL LYNCH INTERNATION AL	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2028年5月31日	第三方抵 押资产	0.29%	2,275,430
MERRILL LYNCH INTERNATION AL	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2028年6月30日	第三方抵 押资产	0.29%	2,243,674
MERRILL LYNCH INTERNATION AL	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2026年6月30日	第三方抵 押资产	0.00%	98
MERRILL LYNCH INTERNATION AL	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2026年7月31日	第三方抵 押资产	0.07%	558,796
JEFFERIES INTERNATION AL LIMITED (PARENT)	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2029年1月31日	第三方抵 押资产	0.02%	161,715
JEFFERIES INTERNATION AL LIMITED (PARENT)	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2027年2月28日	第三方抵 押资产	0.00%	1,169
JEFFERIES INTERNATION AL LIMITED (PARENT)	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2030年10月31日	第三方抵 押资产	0.01%	50,494
JEFFERIES INTERNATION AL LIMITED (PARENT)	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2030年12月31日	第三方抵 押资产	0.00%	23,942
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	美元	无固定 期限	伦敦	0%	2027年4月15日	第三方抵 押资产	0.78%	6,101,064

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(c) 证券借贷及回购交易明细(续)

证券借贷交易的抵押资产

2025 年 9 月 30 日

抵押资产提供方	抵押资产类型	货币	期限	抵押资产提供方所在地	现金与非现金抵押资产占比	非现金抵押资产到期日	结算/清算	抵押资产所覆盖的资产净值百分比	抵押资产的公允价值 美元
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2026年4月30日	第三方抵押资产	0.78%	6,101,068
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2029年4月30日	第三方抵押资产	0.69%	5,380,285
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2034年5月15日	第三方抵押资产	0.78%	6,101,060
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2034年5月15日	第三方抵押资产	0.01%	109,211
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2034年5月15日	第三方抵押资产	0.87%	6,856,569
DEUTSCHE BANK AG	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2027年6月15日	第三方抵押资产	0.18%	1,385,014
								8.11%	113,225,483

2024 年 9 月 30 日

无

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(C) 证券借贷及回购交易明细(续)

回购交易

不适用。

(D) 借出的可转让证券

2025年9月30日

借出的可转让证券总价值 ³ 美元	借出的证券金额占 可借出资产总额的 百分比 ³ %	借出的证券金额占 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
--------------------------------	---	---	-----------------

104,719,354	151,423	13.342	不适用
-------------	---------	--------	-----

2024年9月30日

无

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

(E) 使用现金抵押资产进行的投资

不适用。截至2025年9月30日和2024年9月30日，本基金并未收到任何现金抵押资产。

(F) 被再利用或再抵押的已收抵押资产占最大授权金额(如有)的份额，以及有关任何证券类型限制的信息(如适用)

在截至2025年9月30日期间，本基金并未将所收到与借出证券有关的抵押资产再利用或再抵押。

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(G)十大抵押资产发行人

	抵押资产的公允价值 美元	占资产净值总额的百分 比 %
2025年9月30日		
BNP PARIBAS LONDON	18,838,970	2.4003%
MORGAN STANLEY & CO		
INTERNATIONAL PLC	36,087,246	4.5980%
JEFFERIES INTERNATIONAL		
LIMITED (PARENT)	4,811,540	0.6131%
MERRILL LYNCH INTERNATIONAL	11,976,029	1.5259%
DEUTSCHE BANK AG	32,111,209	4.0914%
HSBC BANK PLC	1,210,281	0.1542%
NOMURA INTERNATIONAL PLC	6,736,154	0.8583%
THE TORONTO-DOMINION BANK		
LONDON BRANCH	1,454,054	0.1853%
	113,225,483	14.4265%

2024 年 9 月 30 日

无

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(H) 本基金收到的十大抵押证券持有量

	公允价值 美元	占资产净值总额 的百分比 %
2025年9月30日		
US TREASURY UST 4.875 04/30/26	6,101,068	0.7774%
US TREASURY UST 4.375 05/15/34	13,066,840	1.6649%
UK TREASURY UKT 1T 07/22/57	6,856,501	0.8736%
UK Tresury UKT 158 10/22/54	6,747,632	0.8597%
JAPAN JPGV 04/20/26	6,856,294	0.8736%
NORWAY NOGV 1.375 08/19/30	3,707,310	0.4724%
US TREASURY UST 3.000 11/15/44	6,856,519	0.8736%
US TREASURY UST 4.625 05/15/44	6,293,252	0.8018%
US TREASURY UST 4.500 04/15/27	6,101,064	0.7774%
US TREASURY UST 4.625 04/30/29	5,380,285	0.6855%
	67,966,765	8.6599%

2024年9月30日

无

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(I) 证券借贷及回购交易的十大交易对手

	截至2025年9月 30日的借出证券 公允价值 ³ 美元	截至2025年9月30 日占资产净值总 额的百分比 ³ %
BNP PARIBAS LONDON	14,968,827	1.9072%
MORGAN STANLEY & CO INTERNATIONAL PLC	31,156,991	3.9698%
JEFFERIES INTERNATIONAL LIMITED (PARENT)	4,527,692	0.5769%
MERRILL LYNCH INTERNATIONAL	14,568,915	1.8563%
DEUTSCHE BANK AG	27,335,316	3.4829%
HSBC BANK PLC	1,738,289	0.2215%
NOMURA INTERNATIONAL PLC	4,981,630	0.6347%
THE TORONTO-DOMINION BANK LONDON BRANCH	5,441,694	0.6933%
	104,719,354	13.3426%

2024年9月30日

无

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

(J) 保管人及各保管人持有的资产金额

	公允价值 2025年9月30日 美元
HSBC Bank PLC	63,900,083

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(J) 保管人及各保管人持有的资产金额(续)

公允价值
2025年9月30日
美元

104,719,354

2024年9月30日

无

- ³ 借出证券的信息基于本基金的会计记录。外币交易按折算日的现行汇率折算为本基金的功能货币，资产和负债按期间终了日的现行汇率折算为本基金的功能货币。
- ⁴ 抵押资产依据双边抵押资产保管安排通过HSBC Bank Plc专户持有。
- ⁵ 所有向借券人借出的证券均通过专户持有。HSBC Bank Plc担任证券借贷代理人，负责安排借贷交易并管理抵押资产。
- ⁶ 受证券借贷代理人HSBC Bank Plc的委托，欧洲清算银行(Euroclear)、摩根大通(JP Morgan)和纽约银行(Bank of New York)担任第三方抵押资产管理人，负责履行若干抵押资产管理、保证金管理和保管人职能。

(K) 本基金证券借贷交易产生的收入

	截至2025年9月30日止 期间 美元	截至2024年9月30 日止期间 美元
通过该计划获得的收入	25,289	-
	<u>25,289</u>	<u>-</u>

证券借贷安排和抵押资产持有量详情(续)

汇丰亚洲高入息债券基金

(L) 证券借贷交易及回购交易收益与现金抵押资产再投资收益的划分

	截至2025年9月30日 止期间 美元	截至2024年9月30 日止期间 美元
证券借贷交易及回购交易的收益	25,289	-
现金抵押资产再投资收益	-	-

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

CROSS, Michael
刘嘉燕
何慧芬
谭振邦
GEHRINGER, Edgar

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

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

分投资顾问

汇丰欧洲多元资产入息基金

汇丰环球投资管理(法国)
Immeuble Cœur Défense - Tour A
110 Esplanade du Général de Gaulle
La Défense 4
92400 Cournevoie
France

汇丰亚洲多元资产高入息基金

汇丰环球投资管理(新加坡)有限公司
(2023 年 8 月 29 日委任)
10 Marian Boulevard
Marina Bay Financial Centre
Tower 2 Level 46 - 01
Singapore 018983

行政(续)

人民币合格境外机构投资者计划托管银行

汇丰全方位中国债券基金

交通银行股份有限公司
中华人民共和国上海市银城中路 188 号
邮编 200120

审计师

毕马威
香港中环遮打道 10 号
太子大厦 8 楼

法律顾问

的近律师行
香港中环遮打道 18 号
历山大厦 5 楼