

汇丰投资信托基金一 汇丰亚洲高收益债券基金

2026 年中期报告



汇丰投资管理
HSBC Asset Management

汇丰亚洲高收益债券基金
(汇丰投资信托基金之子基金)

2026 年中期报告

目录

	页数
1.汇丰亚洲高收益债券基金	
财务状况表	1
全面收益表	3
份额持有人应占资产净值变动表	5
现金流量表	12
投资组合报表	13
投资组合变动表	27
金融衍生工具明细表	28
业绩表现记录	33
收益分配表	42
证券借贷安排和抵押品持有明细表	46
2.行政	81

财务状况表

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

	2026年1月31日 美元	2025年7月31日 美元
资产		
以公允价值计入损益账的金融资产	793,107,357	1,037,833,659
应收利息	16,595,610	19,677,838
应收申购款	1,426,998	2,176,384
应收经纪商款项	38,472,541	46,202,051
其他应收款	180	253,399
现金及现金等价物	4,654,900	18,369,597
	<u>854,257,586</u>	<u>1,124,512,928</u>
负债		
以公允价值计入损益账的金融负债	5,342,364	8,083,961
应付赎回款	18,205,573	8,709,665
应付经纪商款项	34,150,060	62,522,623
应付税项	29,748	28,737
应付分配	3,975,061	4,979,368
其他应付款	964,513	1,138,548
	<u>62,667,319</u>	<u>85,462,902</u>
基金份额持有人应占资产净值	<u>791,590,267</u>	<u>1,039,050,026</u>
相当于： 金融负债	<u>791,590,267</u>	<u>1,039,050,026</u>
	份额	份额
已发行份额总数		
- AC类 - 港元	782,227	593,377
- AC类 - 新加坡元	304,149	389,052
- AC类 - 美元	2,619,561	3,055,488
- AM2类 - 港元	244,513,566	268,951,604
- AM2类 - 新加坡元	3,030,113	3,136,897
- AM2类 - 美元	74,377,423	83,758,240
- AM3H类 - 澳元	7,713,273	8,455,849
- AM3H类 - 欧元	1,496,198	1,800,782
- AM3H类 - 人民币	33,094,317	37,320,593
- AM3H类 - 新加坡元	4,785,114	5,697,976
- BC类 - 港元	199,644	204,961
- BC类 - 人民币	46,623,222	59,179,121
- BC类 - 美元	1,485,665	1,747,254

财务状况表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

	2026年1月31日 份额	2025年7月31日 份额
已发行份额总数(续)		
- BCH 类 - 人民币	4,210,306	4,775,513
- BM2 类 - 港元	2,600,136	2,889,245
- BM2 类 - 人民币	37,283,858	54,831,506
- BM2 类 - 美元	5,542,875	6,890,420
- BM3H 类 - 澳元	605,336	635,809
- BM3H 类 - 人民币	22,345,877	28,029,561
- IC 类 - 美元	216,447	16,206,898
- IM2 类 - 港元	187,685	187,685
- IM2 类 - 美元	646,828	1,792,289
- ZD2 类 - 美元	573,361	464,199
份额净值	美元	美元
- AC 类 - 港元	1.730	1.639
- AC 类 - 新加坡元	5.796	5.491
- AC 类 - 美元	13.450	12.741
- AM2 类 - 港元	0.618	0.608
- AM2 类 - 新加坡元	3.682	3.627
- AM2 类 - 美元	4.796	4.724
- AM3H 类 - 澳元	3.230	2.925
- AM3H 类 - 欧元	5.379	5.102
- AM3H 类 - 人民币	0.672	0.639
- AM3H 类 - 新加坡元	3.828	3.693
- BC 类 - 港元	1.111	1.053
- BC 类 - 人民币	1.211	1.147
- BC 类 - 美元	8.636	8.181
- BCH 类 - 人民币	1.195	1.106
- BM2 类 - 港元	0.676	0.666
- BM2 类 - 人民币	0.736	0.725
- BM2 类 - 美元	5.229	5.149
- BM3H 类 - 澳元	3.619	3.278
- BM3H 类 - 人民币	0.742	0.705
- IC 类 - 美元	9.734	9.196
- IM2 类 - 港元	1.297	1.275
- IM2 类 - 美元	5.017	4.931
- ZD2 类 - 美元	6.412	6.037

注：中期报告执行与本子基金年度报告相同的会计政策和计算方法。

全面收益表

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2026 年 1 月 31 日止期间

	2025 年 8 月 1 日至 2026 年 1 月 31 日 美元	2024 年 8 月 1 日至 2025 年 1 月 31 日 美元
利息收入	46,729	90,782
股息收入	239,464	645,219
以公允价值计入损益账的金融工具的收益净值	63,813,038	9,005,885
净汇兑收益/(亏损)	218,065	(175,286)
证券借贷收入	191,884	-
其他收入	155,770	287,072
收入总额	64,664,950	9,853,672
管理费 ^{附注 2}	5,883,980	6,754,138
交易费用 ^{附注 1}	60,415	39,261
受托人费用 ^{附注 1}	347,318	396,811
基金注册登记机构费用 ^{附注 1}	111,187	123,874
审计师酬金	11,923	5,997
律师费及专业人员费用 ^{附注 1}	13,429	2,952
保管费、银行手续费及杂费 ^{附注 1}	2,053,617	2,510,504
总经营开支	8,481,869	9,833,537
税前经营净利润	56,183,081	20,135
税项	-	-
收益分配前经营净利润	56,183,081	20,135
向基金份额持有人的收益分配	(27,040,107)	(36,866,552)
本期份额持有人应占资产净值和全面收益总额增加/(减少)	29,142,974	(36,846,417)

全面收益表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2026 年 1 月 31 日止期间

附注 1 在分别截至2026年和2025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：

	2025年8月1日至 2026年1月31日 美元	2024年8月1日至 2025年1月31日 美元
交易费用	15,462	17,421
律师费及专业人员费用	13,429	2,952
保管费、银行手续费及杂费	40,071	43,215

附注 2 在分别截至2026年和2025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/管理人的关联人士支付任何其他款项。

份额持有人应占资产净值变动表

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2026 年 1 月 31 日止期间

	2025 年 8 月 1 日至 2026 年 1 月 31 日 美元	2024 年 8 月 1 日至 2025 年 1 月 31 日 美元
期初余额	1,039,050,026	1,142,148,827
本期份额持有人应占资产净值和全面收益总额增加/(减少)	29,142,974	(36,846,417)
份额认/申购(不含均衡)		
- AC 类 - 港元	315,290	17,511
- AC 类 - 新加坡元	24,862	1,767
- AC 类 - 美元	1,193,329	1,275,998
- AM2 类 - 港元	25,425,245	32,115,865
- AM2 类 - 新加坡元	174,695	91,722
- AM2 类 - 美元	56,065,548	208,760,489
- AM3H 类 - 澳元	785,468	3,274,967
- AM3H 类 - 欧元	1,310,360	507,026
- AM3H 类 - 人民币	294,909	3,068,062
- AM3H 类 - 新加坡元	1,071,077	480,202
- BC 类 - 港元	43,957	21,331
- BC 类 - 人民币	433,892	29,399,066
- BC 类 - 美元	14,927	1,690,077
- BCH 类 - 人民币	386,141	9,357,429
- BM2 类 - 港元	50,028	136,609
- BM2 类 - 人民币	1,671,773	24,657,953
- BM2 类 - 美元	268,482	8,197,932
- BM3H 类 - 澳元	10,568	82,723
- BM3H 类 - 人民币	44,441	6,659,910
- IC 类 - 美元	979,878	427,652
- IM2 类 - 港元	80,988	-
- IM2 类 - 美元	867,173	-
- ZD2 类 - 美元	-	663,665
份额赎回(不含均衡)		
- AC 类 - 港元	(102)	(475,660)
- AC 类 - 新加坡元	(494,985)	(33,740)
- AC 类 - 美元	(6,840,153)	(7,228,983)
- AM2 类 - 港元	(40,641,408)	(31,617,191)
- AM2 类 - 新加坡元	(567,540)	(594,818)
- AM2 类 - 美元	(101,041,565)	(235,553,911)
- AM3H 类 - 澳元	(3,034,857)	(7,687,883)
- AM3H 类 - 欧元	(2,889,060)	(2,749,887)

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2026 年 1 月 31 日止期间

	2025 年 8 月 1 日至 2026 年 1 月 31 日 美元	2024 年 8 月 1 日至 2025 年 1 月 31 日 美元
份额赎回(不含均衡)		
- AM3H 类 - 人民币	(3,083,412)	(5,953,699)
- AM3H 类 - 新加坡元	(4,518,950)	(4,355,988)
- BC 类 - 港元	(50,043)	(14,041)
- BC 类 - 人民币	(15,372,848)	(8,129,768)
- BC 类 - 美元	(2,195,924)	(910,765)
- BCH 类 - 人民币	(1,037,882)	(7,661,972)
- BM2 类 - 港元	(247,110)	(449,971)
- BM2 类 - 人民币	(14,355,066)	(1,120,221)
- BM2 类 - 美元	(7,320,633)	(2,798,522)
- BM3H 类 - 澳元	(115,283)	(30,379)
- BM3H 类 - 人民币	(4,166,643)	(1,691,982)
- IC 类 - 美元	(156,746,752)	(702,552)
- IM2 类 - 美元	(5,905,705)	(5,019,256)
- IM3H 类 - 新加坡元	-	(75,530)
- ZD2 类 - 美元	(194,705)	(295,857)
认购和赎回均衡	2,704,862	1,471,237
	<u>(276,602,733)</u>	<u>7,206,617</u>
期末余额	<u>791,590,267</u>	<u>1,112,509,027</u>
	份额	份额
AC 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	593,377	886,136
期间发行份额数	188,911	11,023
期间赎回份额数	(61)	(292,250)
结转后期已发行份额数	<u>782,227</u>	<u>604,909</u>
AC 类 - 新加坡元份额		
结转前期已发行份额数	389,052	426,461
期间发行份额数	4,418	335
期间赎回份额数	(89,321)	(6,514)
结转后期已发行份额数	<u>304,149</u>	<u>420,282</u>

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2026 年 1 月 31 日止期间

	2025 年 8 月 1 日至 2026 年 1 月 31 日 份额	2024 年 8 月 1 日至 2025 年 1 月 31 日 份额
AC 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	3,055,488	3,927,043
期间发行份额数	91,688	103,659
期间赎回份额数	(527,615)	(588,242)
结转后期已发行份额数	<u>2,619,561</u>	<u>3,442,460</u>
AM2 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	268,951,604	288,673,671
期间发行份额数	40,902,292	49,493,387
期间赎回份额数	(65,340,330)	(48,833,746)
结转后期已发行份额数	<u>244,513,566</u>	<u>289,333,312</u>
AM2 类 - 新加坡元份额		
结转前期已发行份额数	3,136,897	3,322,181
期间发行份额数	47,327	22,985
期间赎回份额数	(154,111)	(155,292)
结转后期已发行份额数	<u>3,030,113</u>	<u>3,189,874</u>
AM2 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	83,758,240	104,682,894
期间发行份额数	11,661,837	41,607,046
期间赎回份额数	(21,042,654)	(47,005,264)
结转后期已发行份额数	<u>74,377,423</u>	<u>99,284,676</u>
AM3H 类 - 澳元份额		
结转前期已发行份额数	8,455,849	10,635,035
期间发行份额数	257,485	1,019,598
期间赎回份额数	(1,000,061)	(2,391,841)
结转后期已发行份额数	<u>7,713,273</u>	<u>9,262,792</u>

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2026 年 1 月 31 日止期间

	2025 年 8 月 1 日至 2026 年 1 月 31 日 份额	2024 年 8 月 1 日至 2025 年 1 月 31 日 份额
AM3H 类 - 欧元份额		
结转前期已发行份额数	1,800,782	2,412,278
期间发行份额数	245,426	101,823
期间赎回份额数	(550,010)	(536,919)
结转后期已发行份额数	<u>1,496,198</u>	<u>1,977,182</u>
AM3H 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	37,320,593	50,477,664
期间发行份额数	452,555	4,508,829
期间赎回份额数	(4,678,831)	(8,866,165)
结转后期已发行份额数	<u>33,094,317</u>	<u>46,120,328</u>
AM3H 类 - 新加坡元份额		
结转前期已发行份额数	5,697,976	7,458,968
期间发行份额数	283,295	123,641
期间赎回份额数	(1,196,157)	(1,117,086)
结转后期已发行份额数	<u>4,785,114</u>	<u>6,465,523</u>
BC 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	204,961	250,430
期间发行份额数	41,434	21,115
期间赎回份额数	(46,751)	(13,975)
结转后期已发行份额数	<u>199,644</u>	<u>257,570</u>

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2026 年 1 月 31 日止期间

	2025 年 8 月 1 日至 2026 年 1 月 31 日 份额	2024 年 8 月 1 日至 2025 年 1 月 31 日 份额
BC 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	59,179,121	6,451,037
期间发行份额数	366,402	28,546,107
期间赎回份额数	(12,922,301)	(7,999,162)
结转后期已发行份额数	<u>46,623,222</u>	<u>26,997,982</u>
BC 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	1,747,254	1,838,110
期间发行份额数	1,768	213,408
期间赎回份额数	(263,357)	(115,382)
结转后期已发行份额数	<u>1,485,665</u>	<u>1,936,136</u>
BCH 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	4,775,513	4,384,883
期间发行份额数	339,209	8,631,568
期间赎回份额数	(904,416)	(7,302,256)
结转后期已发行份额数	<u>4,210,306</u>	<u>5,714,195</u>
BM2 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	2,889,245	3,389,667
期间发行份额数	74,378	193,250
期间赎回份额数	(363,487)	(635,213)
结转后期已发行份额数	<u>2,600,136</u>	<u>2,947,704</u>
BM2 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	54,831,506	20,276,966
期间发行份额数	2,309,913	30,735,373
期间赎回份额数	(19,857,561)	(1,400,229)
结转后期已发行份额数	<u>37,283,858</u>	<u>49,612,110</u>

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2026 年 1 月 31 日止期间

	2025 年 8 月 1 日至 2026 年 1 月 31 日 份额	2024 年 8 月 1 日至 2025 年 1 月 31 日 份额
BM2 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	6,890,420	6,433,348
期间发行份额数	51,366	1,484,867
期间赎回份额数	(1,398,911)	(511,786)
结转后期已发行份额数	<u>5,542,875</u>	<u>7,406,429</u>
BM3H 类 - 澳元份额		
结转前期已发行份额数	635,809	631,092
期间发行份额数	3,093	23,267
期间赎回份额数	(33,566)	(8,294)
结转后期已发行份额数	<u>605,336</u>	<u>646,065</u>
BM3H 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	28,029,561	24,868,995
期间发行份额数	61,138	8,702,133
期间赎回份额数	(5,744,822)	(2,269,237)
结转后期已发行份额数	<u>22,345,877</u>	<u>31,301,891</u>
IC 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	16,206,898	16,316,285
期间发行份额数	89,267	47,293
期间赎回份额数	(16,079,718)	(80,354)
结转后期已发行份额数	<u>216,447</u>	<u>16,283,224</u>
IM2 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	187,685	187,685
期间发行份额数	-	-
期间赎回份额数	-	-
结转后期已发行份额数	<u>187,685</u>	<u>187,685</u>

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2026 年 1 月 31 日止期间

	2025 年 8 月 1 日至 2026 年 1 月 31 日 份额	2024 年 8 月 1 日至 2025 年 1 月 31 日 份额
IM2 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	1,792,289	2,851,152
期间发行份额数	15,928	-
期间赎回份额数	(1,161,389)	(968,365)
结转后期已发行份额数	<u>646,828</u>	<u>1,882,787</u>
IM3H 类 - 新加坡元份额		
结转前期已发行份额数	-	79,774
期间发行份额数	-	-
期间赎回份额数	-	(9,890)
结转后期已发行份额数	<u>-</u>	<u>69,884</u>
ZD2 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	464,199	359,778
期间发行份额数	140,728	108,239
期间赎回份额数	(31,566)	(48,357)
结转后期已发行份额数	<u>573,361</u>	<u>419,660</u>

现金流量表

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2026 年 1 月 31 日止期间

	2025 年 8 月 1 日至 2026 年 1 月 31 日 美元	2024 年 8 月 1 日至 2025 年 1 月 31 日 美元
经营活动		
已收利息	50,291	92,979
已收股息	239,464	645,219
已收证券借贷收入	191,884	-
已付管理费	(6,046,900)	(6,965,120)
已付受托人费用	(357,778)	(409,146)
购买投资的付款	(1,398,372,631)	(2,306,719,230)
出售投资的所得款项(包括已收投资的息票利息)	1,685,187,163	2,354,907,448
存放于经纪商的保证金存款	(427,778)	6,921,424
存放于经纪商的抵押品	2,100,000	(5,770,000)
应付现金抵押品	-	(193,354)
已付税项	1,011	(148)
其他已付经营开支	(1,877,569)	(2,585,040)
经营活动产生的现金净额	280,687,157	39,925,032
融资活动		
份额发行所得款项(含均衡)	91,908,521	324,447,860
份额赎回付款(含均衡)	(358,265,961)	(323,537,592)
已付分配	(28,044,414)	(37,647,590)
融资活动使用的现金净额	(294,401,854)	(36,737,322)
现金和现金等价物(减少)/增加净额	(13,714,697)	3,187,710
期初现金和现金等价物	18,369,597	8,089,723
期末现金和现金等价物	4,654,900	11,277,433

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

	持仓量	市场 价值 美元	占资产 净值 百分比
金融资产			
债务证券			
债券			
上市投资			
澳大利亚			
MINERAL RESOURCES LTD 7% 2031年4月1日	3,031,000	3,188,648	0.40
NICKEL INDUSTRIES LTD 9% 2030年9月30日	9,393,000	9,867,995	1.25
		<hr/>	<hr/>
		13,056,643	1.65
		<hr/>	<hr/>
百慕大			
利丰有限公司高级欧洲中期票据 5.25% 永续债券 2049年12月29日	3,867,000	2,325,028	0.29
		<hr/>	<hr/>
英属维尔京群岛			
CAS CAPITAL NO2 LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	8,239,000	8,329,847	1.05
中国宏桥集团 7.05% 2028年1月10日	1,326,000	1,380,063	0.18
中国宏桥集团有限公司 6.925% 2028年11月29日	1,317,000	1,377,603	0.17
CS TREASURY MGMT SERVICE 9% 永续债券 2049年12月31日	7,407,724	7,522,555	0.95
FORTUNE STAR BVI LTD 5.875% 2030年11月20日	2,783,000	3,273,255	0.41
FORTUNE STAR BVI LTD 6.8% 2029年9月9日	5,152,000	5,114,710	0.65
绿城中国控股 8.45% 2028年2月24日	6,986,000	7,152,717	0.90
NWD FINANCE (BVI) LTD 6.25% 永续债券 2049年12月31日	1,000,000	640,770	0.08
NWD MTN LTD 8.625% 2028年2月8日	3,800,000	3,716,820	0.47
SJM INTERNATIONAL LTD 6.5% 2031年1月15日	1,600,000	1,590,444	0.20
		<hr/>	<hr/>
		40,098,784	5.06
		<hr/>	<hr/>

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

债券	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值 百分比
上市投资(续)			
开曼群岛			
阿里巴巴集团控股 0% 可转债 2032年9月15日	3,505,000	3,935,537	0.50
富卫集团有限公司 5.836% 2035年9月22日	3,561,000	3,607,720	0.46
富卫集团有限公司 5.252% 2030年9月22日	333,000	335,152	0.04
佳兆业集团控股有限公司 0% 可转债 2026年12月31日	99,180	744	-
佳兆业集团控股有限公司 0% 可转债 2027年12月31日	123,662	433	-
佳兆业集团控股有限公司 0% 可转债 2028年12月31日	198,361	1,041	-
佳兆业集团控股有限公司 0% 可转债 2029年12月31日	198,361	535	-
佳兆业集团控股有限公司 0% 可转债 2030年12月31日	247,952	1,860	-
佳兆业集团控股有限公司 0% 可转债 2031年12月31日	247,952	1,860	-
佳兆业集团控股有限公司 0% 可转债 2032年12月31日	462,987	3,195	-
LINK FINANCE CAYMAN 2009 4.875% 2036年2月2日	6,653,000	6,623,444	0.84
MELCO RESORTS FI 6.5% 2033年9月24日	2,500,000	2,496,590	0.31
新世界中国地产有限公司 4.75% 2027年1月23日	2,710,000	2,612,703	0.33
SHUI ON DEVELOPMENT HLDG 9.75% 2029年1月26日	4,500,000	4,567,140	0.58
融创中国控股有限公司 0% 可转债 2028年6月23日	8,270,473	1,974,575	0.25
永利澳门有限公司 6.75% 2034年2月15日	7,500,000	7,608,465	0.96
		<u>33,770,994</u>	<u>4.27</u>

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

	持仓量	市场 价值 美元	占资产 净值 百分比
债券			
上市投资(续)			
中国内地			
一嗨汽车租赁有限公司 12% 2027年9月26日	6,641,000	4,114,063	0.52
一嗨汽车租赁有限公司 7% 2026年9月21日	9,405,000	6,966,522	0.88
HUARONG FINANCE 2019 3.875% 2029年11月13日	300,000	293,208	0.04
龙湖集团控股有限公司 3.375% 2027年4月13日	4,833,000	4,616,078	0.58
龙湖集团控股有限公司 3.85% 2032年1月13日	2,000,000	1,556,625	0.20
龙湖集团控股有限公司 3.95% 2029年9月16日	8,154,000	6,810,347	0.86
龙湖地产 4.5% 2028年1月16日	4,500,000	4,179,058	0.53
当代置业(中国)有限公司 9% 2024年12月28日	1,281,679	5,216	-
当代置业(中国)有限公司 9% 2026年12月30日	6,595,721	48,676	0.01
当代置业(中国)有限公司浮息债券 2024年12月30日	2,926,074	19,107	-
当代置业(中国)有限公司浮息债券 2025年12月30日	4,946,789	27,554	-
当代置业(中国)有限公司浮息债券 2027年12月30日	9,626,086	73,158	0.01
弘阳地产集团 9.5% 2023年9月20日	5,183,000	-	-
力高集团 9.9% 2024年2月17日	5,120,000	-	-
万科地产(香港)有限公司 3.975% 2027年11月9日	4,000,000	1,303,472	0.16
		<u>30,013,084</u>	<u>3.79</u>

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

债券	持仓量	市场 价值 美元	占资产 净值 百分比
上市投资(续)			
中国香港			
阿里巴巴集团控股 0.5% 2031年6月1日	1,400,000	2,460,612	0.32
CELESTIAL DYNASTY LTD 4.25% 2029年6月27日	4,558,000	4,292,253	0.54
CHAMPION PATH HOLDINGS 4.85% 2028年1月27日	1,100,000	1,071,014	0.14
FEC FINANCE LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	9,414,000	7,078,554	0.89
FORTUNE STAR BVI LTD 5.05% 2027年1月27日	3,459,000	3,400,287	0.43
FORTUNE STAR BVI LTD 8.5% 2028年5月19日	9,145,000	9,458,605	1.20
FRANSHION BRILLIANT LTD 4.25% 2029年7月23日	7,730,000	7,159,487	0.90
FRANSHION BRILLIANT LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	914,000	913,606	0.12
普洛斯中国控股有限公司 7.75% 2029年4月30日	7,400,000	7,224,487	0.91
利丰有限公司 8.375% 2029年2月5日	6,671,000	6,973,070	0.88
NWD FINANCE (BVI) LTD 4.125% 永续债券 2049年12月31日	2,301,000	1,834,076	0.23
NWD FINANCE (BVI) LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	4,027,000	2,811,476	0.36
NWD FINANCE (BVI) LTD 浮息永续债券 2049年12月31日(XS2132986741)	7,368,000	5,731,062	0.72
NWD MTN LTD 4.125% 2029年7月18日	3,791,000	3,181,070	0.40
NWD MTN LTD 4.5% 2030年5月19日	5,610,000	4,637,089	0.59
PCPD CAPITAL 5.125% 2026年6月18日	3,133,000	3,093,750	0.39
STUDIO CITY FINANCE LTD 5% 2029年1月15日	6,735,000	6,530,128	0.82
STUDIO CITY FINANCE LTD 6.5% 2028年1月15日	8,906,000	8,916,589	1.13
		<u>86,767,215</u>	<u>10.97</u>

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

债券 上市投资(续)	持仓量	市场 价值 美元	占资产 净值 百分比
印度			
10 RENEW POWER SUBSIDIARY 4.5% 2028年7月14日	3,525,000	3,407,974	0.43
CONTINUUM GRN SPV CO-ISS 7.5% 2033年6月26日	2,293,000	2,262,233	0.29
IIFL FINANCE LTD 8.75% 2028年7月24日	1,300,000	1,356,090	0.17
INDIABULLS HOUSING FIN 9.7% 2027年7月3日	2,060,000	2,152,159	0.27
IRB INFRASTRUCTURE DEVE 7.11% 2032年3月11日	10,732,000	11,214,865	1.42
JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125% 2031年5月18日	3,870,000	2,537,049	0.32
JSW INFRASTRUCTURE 4.95% 2029年1月21日	500,000	502,344	0.05
JSW STEEL LTD 5.05% 2032年4月5日	3,700,000	3,695,223	0.47
MUTHOOT FINANCE LTD 5.75% 2030年8月4日	3,209,000	3,208,358	0.40
MUTHOOT FINANCE LTD 6.375% 2030年3月2日	10,305,000	10,577,485	1.34
PIRAMAL CAPITAL & HOUS 7.8% 2028年1月29日	5,350,000	5,515,673	0.70
SAEL LTD GROUP ISSUERS 7.8% 2031年7月31日	1,500,000	1,463,771	0.18
SAMMAAN CAPITAL LTD 7.5% 2030年10月16日	8,697,000	8,783,166	1.11
SAMMAAN CAPITAL LTD 8.95% 2028年8月28日	3,700,000	3,880,138	0.49
SHRIRAM FINANCE LTD 6.15% 2028年4月3日	3,467,000	3,572,535	0.45
UPL CORP LTD 4.5% 2028年3月8日	3,900,000	3,821,981	0.48
UPL CORP LTD 4.625% 2030年6月16日	10,000,000	9,557,210	1.21
VARANASI AURA NH-2 TOLL 5.9% 2034年2月28日	1,050,000	1,097,159	0.14
		78,605,413	9.92
印度尼西亚			
印度尼西亚国家银行浮息永续债券 2049年12月31日	2,500,000	2,454,962	0.31
FREEPOR INDONESIA PT 6.2% 2052年4月14日	1,264,000	1,288,905	0.16
GARUDA INDONESIA TBK PT 6.5% 2031年12月28日	12,266,375	13,195,727	1.67

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

	持仓量	市场 价值 美元	占资产 净值 百分比
债券			
上市投资(续)			
印度尼西亚			
INDIKA INTI ENERGI PT 8.75% 2029年5月7日	1,500,000	1,504,484	0.19
印度尼西亚(共和国) 4.2% 2050年10月15日	8,500,000	6,810,417	0.86
印度尼西亚(共和国) 1.3% 2034年3月23日	2,500,000	2,433,497	0.31
印度尼西亚(共和国) 3.05% 2051年3月12日	3,000,000	1,938,985	0.24
印度尼西亚(共和国) 4.9% 2036年4月16日	5,000,000	4,918,130	0.62
印度尼西亚(共和国) 5.2% 2035年7月23日	1,182,000	1,194,559	0.15
印度尼西亚(共和国) 8.5% 2035年10月12日	5,000,000	6,344,145	0.80
印度尼西亚(共和国) 3.8% 2050年6月23日	2,500,000	1,878,125	0.24
印度尼西亚(共和国) 3.2% 2061年9月23日	5,900,000	3,654,714	0.46
印度尼西亚(共和国) 4.3% 2052年3月31日	3,600,000	2,920,241	0.37
印度尼西亚(共和国) 5.65% 2053年1月11日	8,500,000	8,417,941	1.06
LLPL CAPITAL PTE LTD 6.875% 2039年2月4日	9,100,000	6,642,950	0.84
MAJAPAHIT HOLDING BV 7.875% 2037年6月29日	2,216,000	2,657,170	0.34
MEDCO CYPRESS TREE PTE S 条例债券系列 8.625% 2030年5月19日	500,000	530,244	0.07
MINEJESA CAPITAL BV 5.625% 2037年8月10日	4,000,000	3,953,304	0.50
PERTAMINA PERSERO 6.45% 2044年5月30日	4,925,000	5,174,057	0.65
PERTAMINA PERSERO PT 6.5% 2048年11月7日	5,100,000	5,354,847	0.68
PERTAMINA PERSERO 6% 2042年5月3日	7,000,000	6,983,900	0.88
PERTAMINA PERSERO 5.625% 2043年5月20日	5,000,000	4,790,312	0.61
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 4.875% 2049年7月 17日	2,000,000	1,681,350	0.21
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 6.15% 2048年5月21 日	2,108,000	2,097,456	0.27
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 4% 2050年6月30日	7,500,000	5,447,182	0.69

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

	持仓量	市场 价值 美元	占资产 净值 百分比
债券			
上市投资(续)			
印度尼西亚(续)			
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 4.375% 2050年2月5日	5,000,000	3,892,730	0.49
PT PAKUWON JATI 4.875% 2028年4月29日	1,877,000	1,838,347	0.23
		<u>109,998,681</u>	<u>13.90</u>
日本			
乐天集团浮息永续债券 2049年12月31日	4,200,000	4,916,733	0.62
软银集团浮息债券 2061年4月29日	3,150,000	2,932,590	0.37
		<u>7,849,323</u>	<u>0.99</u>
泽西岛			
中国西部水泥有限公司 19.9% 2028年12月4日	4,200,000	4,201,705	0.53
卢森堡			
MONGOLIAN MINING CORP S 条例债券系列 8.44% 2030年4月3日	13,168,000	13,621,934	1.72
中国澳门			
MELCO RESORTS FINANCE 5.375% 2029年12月4日	7,057,000	6,989,796	0.88
美高梅中国控股有限公司 7.125% 2031年6月26日	7,194,000	7,642,424	0.97
永利澳门有限公司 5.125% 2029年12月15日	3,993,000	3,975,886	0.50
永利澳门有限公司 5.5% 2027年10月1日	2,778,000	2,778,725	0.35
永利澳门有限公司 5.625% 2028年8月26日	11,200,000	11,186,638	1.41
		<u>32,573,469</u>	<u>4.11</u>

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

	持仓量	市场 价值 美元	占资产 净值 百分比
债券			
上市投资(续)			
毛里求斯			
GREENKO POWER II LTD 4.3% 2028年12月13日	7,261,000	5,290,104	0.66
GREENKO WIND PROJECTS MU S 条例债券系列 7.25% 2028年9月27日	8,715,000	8,914,721	1.13
INDIA GREEN POWER HOLDING 4% 2027年2月22日	2,046,000	1,741,967	0.22
		<u>15,946,792</u>	<u>2.01</u>
蒙古			
蒙古开发银行 8.5% 2028年7月3日	2,000,000	2,079,255	0.26
GOLOMT BANK OF MONGOLIA 11% 2027年5月20日	7,852,000	8,175,306	1.03
MONGOLIAN MORTGAGE CO 11.5% 2027年1月18日	1,300,000	1,332,872	0.17
STATE BANK JSC 8.9% 2028年9月25日	5,000,000	5,023,355	0.63
TRAD & DEV BANK MONGOLIA 8.5% 2027年12月23日	2,165,000	2,175,398	0.28
		<u>18,786,186</u>	<u>2.37</u>
巴基斯坦			
巴基斯坦伊斯兰共和国 7.875% 2036年3月31日	5,933,000	5,943,578	0.75
巴基斯坦(共和国) 7.375% 2031年4月8日	4,333,000	4,363,446	0.55
巴基斯坦(共和国) 7.95% 2029年1月31日	4,000,000	4,161,256	0.53
		<u>14,468,280</u>	<u>1.83</u>

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

	持仓量	市场 价值 美元	占资产 净值 百分比
债券			
上市投资(续)			
菲律宾			
PETRON CORP 浮息永续债券 2049年12月31日	4,129,000	4,236,490	0.53
菲律宾(共和国) 2.95% 2045年5月5日	6,800,000	4,711,927	0.60
菲律宾(共和国) 3.625% 2032年2月4日	5,000,000	5,992,666	0.76
菲律宾(共和国) 5.175% 2049年9月5日	2,500,000	2,358,076	0.30
菲律宾(共和国) 5.6% 2049年5月14日	3,000,000	2,993,955	0.38
菲律宾共和国 2.65% 2045年12月10日	6,500,000	4,249,115	0.54
菲律宾共和国 5.9% 2050年2月4日	3,000,000	3,126,474	0.40
SAN MIGUEL GLOBAL POWER 浮息永续债券 2049年12月31日	2,300,000	2,336,436	0.29
SAN MIGUEL GLOBAL POWER 浮息永续债券 2049年12月31日(XS2883979705)	7,300,000	7,545,061	0.95
SAN MIGUEL GLOBAL POWER 浮息永续债券 2049年12月31日(XS2943809900)	5,000,000	5,076,638	0.64
SAN MIGUEL GLOBAL POWER 浮息永续债券 2049年12月31日(XS3121131125)	4,500,000	4,686,462	0.59
		<hr/>	<hr/>
		47,313,300	5.98
		<hr/>	<hr/>
新加坡			
普洛斯集团 9.75% 2028年5月20日	6,017,000	6,158,697	0.78
普洛斯集团浮息永续债券 2049年12月31日(XS2340147813)	11,554,000	8,559,862	1.08
普洛斯集团浮息永续债券 2049年12月31日(XS2357239057)	2,000,000	1,409,534	0.18
MEDCO LAUREL TREE 6.95% 2028年11月12日	1,500,000	1,509,484	0.19
MEDCO MAPLE TREE PTE LTD 8.96% 2029年4月27日	7,300,000	7,632,873	0.96
仁恒地产(香港)有限公司 5.125% 2026年5月20日	2,034,000	2,036,311	0.26
		<hr/>	<hr/>
		27,306,761	3.45
		<hr/>	<hr/>

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

	持仓量	市场 价值 美元	占资产 净值 百分比
债券			
上市投资(续)			
斯里兰卡			
斯里兰卡共和国 2038年2月15日	9,402,694	9,321,963	1.18
斯里兰卡共和国 4% 2028年4月15日	1,675,156	1,196,180	0.15
斯里兰卡共和国 STP 2033年3月15日	13,425,768	12,336,535	1.56
斯里兰卡共和国 STP 2036年5月15日	5,350,000	5,290,353	0.67
		<u>28,145,031</u>	<u>3.56</u>
瑞士			
CHUBB INA HOLDINGS LLC 3.05% 2055年8月6日	5,820,000	815,255	0.10
泰国			
曼谷盘谷银行有限公司/香港分行浮息债券 2034年9月25日	3,000,000	2,864,865	0.36
GC TREASURY CENTRE CO S 条例债券系列 浮息永续债券 2049年12月31日	6,924,000	7,109,840	0.90
GC TREASURY CENTRE 浮息永续债券 2049年12月31日	3,188,000	3,222,156	0.41
MUANGTHAI CAPITAL PCL 6.875% 2028年9月30日	3,941,000	4,015,595	0.51
MUANGTHAI CAPITAL PCL 7.55% 2030年7月21日	9,250,000	9,603,304	1.21
THAIOIL TRSRY CENTER 浮息永续债券 2049年12月31日	2,494,000	2,505,282	0.31
		<u>29,321,042</u>	<u>3.70</u>
英国			
BIOCON BIOLOGICS GLOBAL 6.67% 2029年10月9日	8,457,000	8,593,217	1.09
渣打集团浮息永续债券 2049年12月31日	9,000,000	9,628,713	1.22
渣打集团浮息永续债券 2049年12月31日 (USG84228EV68)	10,442,000	10,050,801	1.26

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

	持仓量	市场 价值 美元	占资产 净值 百分比
债券			
上市投资(续)			
英国(续)			
渣打集团浮息永续债券 2049年12月31日 (USG84228FJ22)	4,850,000	5,054,825	0.64
渣打集团浮息永续债券 2049年12月31日 (USG84228GE26)	7,027,000	7,507,858	0.95
渣打集团浮息永续债券 2049年12月31日 (USG84228HA94)	8,649,000	8,907,259	1.12
VEDANTA RESOURCES 10.25% 2028年6月3日	2,100,000	2,180,801	0.27
VEDANTA RESOURCES 10.875% 2029年9月17日	14,668,000	15,720,532	1.99
VEDANTA RESOURCES 11.25% 2031年12月3日	8,733,000	9,685,617	1.22
VEDANTA RESOURCES 9.475% 2030年7月24日	2,500,000	2,639,160	0.33
VEDANTA RESOURCES 9.125% 2032年10月15日	6,412,000	6,721,597	0.85
VEDANTA RESOURCES 9.85% 2033年4月24日	4,000,000	4,314,312	0.55
		<u>91,004,692</u>	<u>11.49</u>
美国			
RESORTS WORLD/RWLV CAP 4.625% 2029年4月16日	2,200,000	<u>2,008,761</u>	<u>0.26</u>
未上市但有报价的投资			
中国香港			
FLOURISH CENTURY HOLDINGS 6.6% 2049年2月4日	8,000,000	-	-

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

	持仓量	市场 价值 美元	占资产 净值 百分比
债券			
未上市但有报价的投资(续)			
印度			
MUTHOOT FINANCE LTD 6.375% 2029年4月23日	4,141,000	4,239,618	0.54
MUTHOOT FINANCE LTD 7.125% 2028年2月14日	4,000,000	4,099,380	0.52
		<u>8,338,998</u>	<u>1.06</u>
印度尼西亚			
JABABEKA INTERNATIONAL S 条例债券系列 (REG S) STP 2027年12月15日	3,928,000	3,937,820	0.50
MODERNLAND OVERSEAS PTE 6% 2027年4月30日	4,488,802	1,496,383	0.19
		<u>5,434,203</u>	<u>0.69</u>
中国澳门			
MELCO RESORTS FINANCE S 条例债券系列(REG S) 5.75% 2028年7月21日	7,820,000	7,825,974	0.99
MELCO RESORTS FINANCE 7.625% 2032年4月17日	4,900,000	5,141,977	0.65
		<u>12,967,951</u>	<u>1.64</u>
英国			
INDIA CLEAN ENERGY HOLDINGS 4.5% 2027年4月18日	8,588,000	8,437,452	1.07
		<u>763,176,977</u>	<u>96.41</u>
债务证券(合计)			

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

	持仓量	市场 价值 美元	占资产 净值 百分比
单位信托			
上市投资			
爱尔兰			
汇丰环球流动性基金 PL *	3,010,826	<u>3,010,826</u>	<u>0.38</u>
卢森堡			
HSBC INVESTMENT FUNDS LUXEMBOURG SA/LUXEMBOURG-HSBC-ASIAN CURRENCIES BD- ZD	2,257,889	17,388,007	2.20
HSBC INVESTMENT FUNDS LUXEMBOURG SA/LUXEMBOURG-HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS	597,340	4,792,458	0.60
HSBC INVESTMENT FUNDS LUXEMBOURG SA/LUXEMBOURG - HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS - RMB FIXED INCOME	81,905	<u>1,045,360</u>	<u>0.13</u>
		<u>23,225,825</u>	<u>2.93</u>
未上市但有报价的投资			
香港			
汇丰全方位中国债券基金 ZC-美元	251,176	<u>3,162,055</u>	<u>0.40</u>
单位信托(合计)		<u>29,398,706</u>	<u>3.71</u>

投资组合报表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

	市场 价值 美元	占资产 净值 百分比
衍生资产		
外币远期合同	528,393	0.07
期货合同	3,281	-
金融资产合计	<u>793,107,357</u>	<u>100.19</u>
金融负债		
衍生负债		
外币远期合同	(597,525)	(0.08)
信用违约互换	(4,647,494)	(0.59)
期货合同	(97,345)	(0.01)
金融负债合计	<u>(5,342,364)</u>	<u>(0.68)</u>
总投资		
<i>(投资成本合计: 799,548,731 美元)</i>	<u>787,764,993</u>	<u>99.51</u>
其他资产净值	<u>3,825,274</u>	<u>0.49</u>
资产净值总额	<u>791,590,267</u>	<u>100.00</u>

投资组合变动表

汇丰亚洲高收益债券基金

2025年8月1日至2026年1月31日期间

	占资产 净值 百分比 2026年1月31日	占资产 净值 百分比 2025年7月31日
金融资产		
债务证券		
债券		
上市投资	91.95	90.62
未上市但有报价的投资	4.46	7.48
债务证券(合计)	<u>96.41</u>	<u>98.10</u>
单位信托		
上市投资	3.31	1.53
未上市但有报价的投资	0.40	0.20
单位信托(合计)	<u>3.71</u>	<u>1.73</u>
衍生资产		
外币远期合同	0.07	0.04
期货合同	-	0.01
	<u>0.07</u>	<u>0.05</u>
金融负债		
衍生负债		
外币远期合同	(0.08)	(0.14)
期货合同	(0.01)	-
信用违约互换	(0.59)	(0.64)
	<u>(0.68)</u>	<u>(0.78)</u>
总投资	99.51	99.10
其他资产净值	0.49	0.90
资产净值总额	<u>100.00</u>	<u>100.00</u>

金融衍生工具明细表

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

外币远期合同

2026年1月31日，本基金持有的未平仓外币远期合同如下：

货币/ 买入金额	货币/ 卖出金额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
金融资产：				
78,000,000离岸人民币	11,219,152美元	2026年2月12日	摩根大通证券 伦敦分公司	8,706
5,000,000欧元	5,814,148美元	2026年2月12日	汇丰市场财资 服务香港	136,902
3,000,000欧元	3,494,303美元	2026年2月12日	巴黎银行 巴黎分行	76,334
86,982美元	603,187 离岸人民币	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	93
59,825美元	415,011 离岸人民币	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	43
47,687美元	330,830 离岸人民币	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	31
18,653美元	129,354离岸人 民币	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	20
4,035美元	27,995 离岸人民币	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	3
130美元	899离岸人民币	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	-
373美元	2,583 离岸人民币	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	-
737,303美元	933,192 新加坡元	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	671
37,378美元	47,159新加坡元	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	153
76,000美元	96,125新加坡元	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	122

金融衍生工具明细表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

外币远期合同(续)

2026年1月31日，本基金持有的未平仓外币远期合同如下：

货币/ 买入金额	货币/ 卖出金额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
金融资产(续):				
35,713,754澳元	24,740,739美元	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	276,855
3,142,917澳元	2,177,259美元	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	24,364
1,985澳元	1,385美元	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	5
463,69离岸人民币	6,679美元	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	1
6,769,112欧元	8,058,018美元	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	4,090
				528,393
金融负债:				
9,369,928美元	8,000,000欧元	2026年2月12日	西太平洋银行 悉尼分行	(151,934)
13,391美元	19,300澳元	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	(129)
28,170美元	40,255澳元	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	(29)
7,257美元	10,371澳元	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	(8)
81,895美元	568,610 离岸人民币	2026年2月27日	汇丰市场财资 服务香港	(13)

金融衍生工具明细表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

外币远期合同(续)

2026年1月31日，本基金持有的未平仓外币远期合同如下：

货币/ 买入金额	货币/ 卖出金额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
金融负债(续):				
	5,095		汇丰市场财资	
734美元	离岸人民币	2026年2月27日	服务香港	-
155,632,986			汇丰市场财资	
离岸人民币	22,426,763美元	2026年2月27日	服务香港	(7,783)
116,198,587			汇丰市场财资	
离岸人民币	16,744,253美元	2026年2月27日	服务香港	(5,811)
35,647,563			汇丰市场财资	
离岸人民币	5,136,825美元	2026年2月27日	服务香港	(1,783)
			汇丰市场财资	
15,000离岸人民币	2,162美元	2026年2月27日	服务香港	(2)
			汇丰市场财资	
24,330,569新加坡元	19,239,780美元	2026年2月27日	服务香港	(33,923)
			汇丰市场财资	
16,746,674美元	14,370,000欧元	2026年3月31日	服务香港	(396,110)
				<u>(597,525)</u>

金融衍生工具明细表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

期货

2026年1月31日，本基金持有的期货合同详情如下：

描述	标的资产	合同规模	名义 市场价值	状态	交易对手	公允价值 美元
金融资产						
US ULTRA BOND CBT 20/03/2026	US ULTRA BOND	1,000	(4,110,313)	多头	汇丰银行	3,281
						<u>3,281</u>
金融负债：						
US ULTRA BOND CBT 20/03/2026	US ULTRA BOND	1,000	(4,110,313)	空头	汇丰银行	(3,281)
US ULTRA BOND CBT 20/03/2026	US ULTRA BOND	1,000	(3,523,125)	空头	汇丰银行	(2,813)
US ULTRA BOND CBT 20/03/2026	US ULTRA BOND	1,000	(4,110,313)	空头	汇丰银行	(2,188)
US 5YR NOTE (CBT) 31/03/2026	US 5YR NOTE	1,000	62,089,924	空头	汇丰银行	(89,063)
						<u>(97,345)</u>

金融衍生工具明细表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2026年1月31日

信用违约互换

2026年1月31日，本基金持有的信用违约互换详情如下：

标的资产	交易对手	公允价值 美元
金融负债：		
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 129 85,150,000.00 USD 31/10/2025 20/12/2030	巴克莱银行	(4,647,494)
		<hr/>
		(4,647,494)
		<hr/>

业绩表现记录

汇丰亚洲高收益债券基金

(a) 价格纪录(交易份额净值)

年份	AC 类 - 港元份额			
	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2016	12.188	13.968	12.863	14.742
2017	13.684	15.013	14.592	15.848
2018	14.112	14.999	14.897	15.829
2019	14.059	15.891	14.059	15.891
2020	13.860	17.050	13.860	17.050
2021	16.880	17.875	16.880	17.875
2022	11.155	17.472	11.155	17.472
2023	10.189	12.756	10.189	12.756
2024	10.782	12.359	10.782	12.359
2025	11.921	12.866	11.921	12.866
2025年8月1日至2026年1月31日	12.866	13.511	12.866	13.511

年份	AC 类 - 新加坡元份额			
	买入		卖出	
	最低 新加坡元	最高 新加坡元	最低 新加坡元	最高 新加坡元
2016	13.388	14.895	14.130	15.270
2017	14.652	16.149	15.426	17.044
2018	15.418	15.854	16.271	16.733
2019	-	-	-	-
2020	8.773	10.163	8.773	10.163
2021	9.977	10.381	9.977	10.381
2022	6.627	10.219	6.627	10.219
2023	6.078	7.198	6.078	7.198
2024	6.262	7.125	6.262	7.125
2025	6.846	7.362	6.846	7.362
2025年8月1日至2026年1月31日	7.085	7.355	7.085	7.355

业绩表现记录(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

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
2016	12.217	13.993	12.894	14.768
2017	13.706	14.952	14.465	15.780
2018	13.980	14.903	14.755	15.729
2019	13.957	15.790	13.957	15.790
2020	13.927	17.156	13.927	17.156
2021	16.931	17.927	16.931	17.927
2022	11.057	17.466	11.057	17.466
2023	10.094	12.645	10.094	12.645
2024	10.554	12.377	10.554	12.377
2025	11.950	12.772	11.950	12.772
2025年8月1日至2026年1月31日	12.743	13.450	12.743	13.450

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
2016	9.445	10.304	9.968	10.875
2017	9.943	10.382	10.260	10.957
2018	9.450	10.378	9.976	10.956
2019	9.209	9.952	9.209	10.213
2020	8.361	10.150	8.361	10.150
2021	9.388	10.173	9.388	10.173
2022	5.566	9.585	5.566	9.585
2023	4.883	5.986	4.883	5.986
2024	4.600	5.032	4.600	5.032
2025	4.545	5.067	4.545	5.067
2025年8月1日至2026年1月31日	4.773	4.872	4.773	4.872

年份	AM2 类 - 新加坡元份额			
	买入		卖出	
	最低 新加坡元	最高 新加坡元	最低 新加坡元	最高 新加坡元
2020	9.995	10.616	9.995	10.616
2021	9.748	10.653	9.748	10.653
2022	5.891	9.984	5.891	9.984
2023	5.092	6.213	5.092	6.213
2024	4.868	5.197	4.868	5.197
2025	4.604	5.129	4.604	5.129
2025年8月1日至2026年1月31日	4.680	4.841	4.680	4.841

业绩表现记录(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

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
2016	9.449	10.327	9.973	10.899
2017	9.964	10.405	10.204	10.982
2018	9.354	10.329	9.872	10.901
2019	9.139	9.885	9.139	10.113
2020	8.381	10.121	8.381	10.121
2021	9.386	10.200	9.386	10.200
2022	5.517	9.570	5.517	9.570
2023	4.834	5.949	4.834	5.949
2024	4.576	5.004	4.576	5.004
2025	4.550	5.066	4.550	5.066
2025年8月1日至2026年1月31日	4.724	4.873	4.724	4.873

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
2016	9.176	10.052	9.684	10.609
2017	9.690	10.123	9.953	10.684
2018	9.131	10.075	9.637	10.634
2019	8.917	9.634	8.917	9.872
2020	8.131	9.871	8.131	9.871
2021	9.110	9.897	9.110	9.897
2022	5.342	9.288	5.342	9.288
2023	4.676	5.746	4.676	5.746
2024	4.415	4.824	4.415	4.824
2025	4.377	4.883	4.377	4.883
2025年8月1日至2026年1月31日	4.544	4.627	4.544	4.627

业绩表现记录(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

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
2016	9.117	9.918	9.622	10.468
2017	9.544	9.993	9.736	10.547
2018	8.884	9.849	9.376	10.394
2019	8.668	9.417	8.668	9.601
2020	8.000	9.646	8.000	9.646
2021	8.966	9.722	8.966	9.722
2022	5.252	9.139	5.252	9.139
2023	4.603	7.546	4.603	7.546
2024	4.335	4.727	4.335	4.727
2025	4.291	4.783	4.291	4.783
2025年8月1日至2026年1月31日	4.458	4.540	4.458	4.540

年份	AM3H 类 - 人民币份额			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020	8.324	10.000	8.324	10.000
2021	9.257	10.094	9.257	10.094
2022	5.438	9.448	5.438	9.448
2023	4.754	5.818	4.754	5.818
2024	4.483	4.885	4.483	4.885
2025	4.436	4.928	4.436	4.928
2025年8月1日至2026年1月31日	4.604	4.693	4.604	4.693

年份	AM3H 类 - 新加坡元份额			
	买入		卖出	
	最低 新加坡元	最高 新加坡元	最低 新加坡元	最高 新加坡元
2020	10.000	10.312	10.000	10.312
2021	9.621	10.455	9.621	10.455
2022	5.630	9.809	5.630	9.809
2023	4.931	6.059	4.931	6.059
2024	4.691	5.071	4.691	5.071
2025	4.614	5.140	4.614	5.140
2025年8月1日至2026年1月31日	4.812	4.866	4.812	4.866

业绩表现记录(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

年份	BC 类 - 港元份额			
	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2020	10.000	10.979	10.000	10.979
2021	10.835	11.478	10.835	11.478
2022	7.166	11.218	7.166	11.218
2023	6.542	8.191	6.542	8.191
2024	6.954	7.837	6.954	7.837
2025	7.658	8.264	7.658	8.264
2025年8月1日至2026年1月31日	8.265	8.679	8.265	8.679

年份	BC 类 - 人民币份额			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020	10.000	10.830	10.000	10.830
2021	9.964	10.858	9.964	10.858
2022	6.720	10.189	6.720	10.189
2023	6.554	7.727	6.554	7.727
2024	6.960	8.097	6.960	8.097
2025	7.901	8.341	7.901	8.341
2025年8月1日至2026年1月31日	8.256	8.420	8.256	8.420

年份	BC 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2020	10.000	11.015	10.000	11.015
2021	10.871	11.511	10.871	11.511
2022	7.099	11.215	7.099	11.215
2023	6.481	8.119	6.481	8.119
2024	6.802	7.930	6.802	7.930
2025	7.658	8.264	7.658	8.264
2025年8月1日至2026年1月31日	8.182	8.636	8.182	8.636

年份	BCH 类 - 人民币份额			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020	10.000	11.106	10.000	11.106
2021	10.967	11.788	10.967	11.788
2022	7.479	11.566	7.479	11.566
2023	6.814	8.468	6.814	8.468
2024	6.962	7.975	6.962	7.975
2025	7.553	8.166	7.553	8.166
2025年8月1日至2026年1月31日	7.978	8.307	7.978	8.307

业绩表现记录(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

年份	BM2 类 - 港元份额			
	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2020	10.000	10.981	10.000	10.981
2021	10.286	11.152	10.286	11.152
2022	6.109	10.507	6.109	10.507
2023	5.352	6.565	5.352	6.565
2024	5.049	5.511	5.049	5.511
2025	4.977	5.533	4.977	5.533
2025年8月1日至2026年1月31日	5.231	5.340	5.231	5.340

年份	BM2 类 - 人民币份额			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020	10.000	10.835	10.000	10.835
2021	9.300	10.803	9.300	10.803
2022	5.708	9.510	5.708	9.510
2023	5.348	6.181	5.348	6.181
2024	5.153	5.598	5.153	5.598
2025	5.124	5.564	5.124	5.564
2025年8月1日至2026年1月31日	5.214	5.305	5.214	5.305

年份	BM2 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2020	10.000	10.952	10.000	10.952
2021	10.232	11.120	10.232	11.120
2022	6.015	10.432	6.015	10.432
2023	5.271	6.485	5.271	6.485
2024	4.988	5.456	4.988	5.456
2025	4.960	5.522	4.960	5.522
2025年8月1日至2026年1月31日	5.150	5.312	5.150	5.312

年份	BM3H 类 - 澳元份额			
	买入		卖出	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2020	9.885	10.918	9.885	10.918
2021	10.220	11.087	10.220	11.087
2022	5.992	10.419	5.992	10.419
2023	5.244	6.443	5.244	6.443
2024	5.012	5.375	5.012	5.375
2025	4.905	5.475	4.905	5.475
2025年8月1日至2026年1月31日	5.093	5.185	5.093	5.185

业绩表现记录(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

年份	BM3H 类 - 人民币份额			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020	9.985	10.956	9.985	10.956
2021	10.199	11.117	10.199	11.117
2022	5.998	10.416	5.998	10.416
2023	5.250	6.427	5.250	6.427
2024	4.948	5.395	4.948	5.395
2025	4.894	5.450	4.894	5.450
2025年8月1日至2026年1月31日	5.083	5.175	5.083	5.175

年份	IC 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2017	9.799	10.728	10.425	11.322
2018	10.019	10.728	10.574	11.322
2019	10.071	10.378	10.629	10.953
2020	9.840	12.136	9.840	12.136
2021	11.985	12.711	11.985	12.711
2022	7.883	12.409	7.883	12.409
2023	7.205	9.035	7.205	9.035
2024	7.730	8.710	7.730	8.710
2025	8.614	9.196	8.614	9.196
2025年8月1日至2026年1月31日	9.197	9.734	9.197	9.734

年份	IM2 类 - 港元份额			
	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2021	9.543	10.121	9.543	10.121
2022	5.683	9.748	5.683	9.748
2023	4.993	6.119	4.993	6.119
2024	5.095	10.172	5.095	10.172
2025	9.517	10.592	9.517	10.592
2025年8月1日至2026年1月31日	10.009	10.232	10.009	10.232

业绩表现记录(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

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	9.638	10.454	9.638	10.454
2022	5.687	9.830	5.687	9.830
2023	4.990	6.145	4.990	6.145
2024	4.780	5.203	4.780	5.203
2025	4.744	5.271	4.744	5.271
2025年8月1日至2026年1月31日	4.932	5.092	4.932	5.092

年份	IM3H 类 - 新加坡元份额			
	买入		卖出	
	最低 新加坡元	最高 新加坡元	最低 新加坡元	最高 新加坡元
2023	9.935	10.159	9.935	10.159
2024	9.554	9.786	9.554	9.786
2025	9.603	10.145	9.603	10.145
2025年8月1日至2026年1月31日	-	-	-	-

年份	ZD2 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2017	9.711	10.684	10.388	11.276
2018	9.629	10.720	10.163	11.314
2019	9.382	10.703	9.382	10.703
2020	8.975	11.096	8.975	11.096
2021	9.969	11.023	9.969	11.023
2022	6.266	10.185	6.266	10.185
2023	5.530	6.950	5.530	6.950
2024	5.552	6.310	5.552	6.310
2025	5.962	6.381	5.962	6.381
2025年8月1日至2026年1月31日	6.038	6.412	6.038	6.412

业绩表现记录(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

(b) 总资产净值(按《香港财务报告准则》计算)

	2026年1月31日	2025 美元	2024 美元	2023 美元
总资产净值	791,590,267	1,039,050,026	1,142,148,827	1,450,175,365

(c) 份额净值(按《香港财务报告准则》计算)

	计价货币	2026年1月 31日	2025	2024	2023
份额净值					
- AC 类 - 港元	港元	13.511	12.866	12.437	11.394
- AC 类 - 新加坡元	新加坡元	7.355	7.124	7.133	6.497
- AC 类 - 美元	美元	13.450	12.741	12.375	11.361
- AM2 类 - 港元	港元	4.826	4.773	5.007	5.054
- AM2 类 - 新加坡元	新加坡元	4.672	4.705	5.114	5.131
- AM2 类 - 美元	美元	4.796	4.724	4.978	5.035
- AM3H 类 - 澳元	澳元	4.611	4.543	4.802	4.863
- AM3H 类 - 欧元	欧元	6.399	4.458	4.706	4.773
- AM3H 类 - 人民币	人民币	4.671	4.607	4.864	4.936
- AM3H 类 - 新加坡元	新加坡元	4.858	4.791	5.059	5.127
- BC 类 - 港元	港元	8.677	8.266	7.987	7.317
- BC 类 - 人民币	人民币	8.418	8.270	8.057	7.309
- BC 类 - 美元	美元	8.636	8.181	7.945	7.294
- BCH 类 - 人民币	人民币	8.714	7.974	7.973	7.500
- BM2 类 - 港元	港元	5.279	5.228	5.484	5.538
- BM2 类 - 人民币	人民币	5.116	5.227	5.521	5.521
- BM2 类 - 美元	美元	5.229	5.149	5.426	5.488
- BM3H 类 - 澳元	澳元	5.166	5.091	5.385	5.456
- BM3H 类 - 人民币	人民币	5.411	5.083	5.369	5.444
- IC 类 - 美元	美元	9.734	9.196	8.895	8.134
- IM2 类 - 港元	港元	10.129	10.009	10.304	5.178
- IM2 类 - 美元	美元	5.017	4.931	5.176	5.212
- IM3H 类 - 新加坡元	新加坡元	-	-	9.976	10.071
- ZD2 类 - 美元	美元	6.412	6.037	6.121	5.908

收益分配表

汇丰亚洲高收益债券基金

AM2 类 - 港元份 额	除息日期	付款日期	每份额 分配 港元	分配 总额 港元
第 1 次分配	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0317	8,570,371
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0317	8,115,064
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0318	8,163,886
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0317	8,083,327
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0314	7,958,871
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0286	7,706,160

AM2 类 - 新加坡 元份额	除息日期	付款日期	每份额 分配 新加坡元	分配 总额 新加坡元
第 1 次分配	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0308	94,822
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0312	96,359
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0317	96,134
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0316	96,042
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0311	94,690
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0282	85,449

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	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0314	2,581,067
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0317	2,558,973
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0317	2,522,914
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0317	2,467,760
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0314	2,382,042
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0285	2,120,593

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	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0279	231,197
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0278	229,069
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0283	223,791
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0287	223,374
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0297	230,603
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0270	208,418

收益分配表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

AM3H 类 - 欧元份 额	除息日期	付款日期	每份额 分配 欧元	分配 总额 欧元
第 1 次分配	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0212	37,990
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0208	41,085
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0216	41,586
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0227	43,101
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0231	42,593
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0204	30,522
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	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0195	714,610
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0193	699,458
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0203	717,041
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0218	762,731
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0225	776,521
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0197	653,311
AM3H 类 - 新加坡 元份额	除息日期	付款日期	每份额 分配 新加坡元	分配 总额 新加坡元
第 1 次分配	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0214	119,373
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0198	108,983
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0209	114,727
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0216	117,710
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0221	119,776
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0191	91,396
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	2025年8月29日	2025年9月10日	0.0348	101,420
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0348	101,356
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0348	98,525
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0347	96,599
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0344	93,372
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0314	81,644

收益分配表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

BM2 类 - 人民币份 额	除息日期	付款日期	每份额 分配 人民币	分配 总额 人民币
第 1 次分配	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0346	1,708,938
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0346	1,693,299
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0348	1,645,723
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0345	1,551,925
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0339	1,321,661
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0305	1,144,008
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	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0342	229,424
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0345	227,127
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0346	218,064
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0346	211,064
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0342	200,610
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0311	173,681
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	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0313	19,736
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0311	19,560
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0318	19,844
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0321	20,029
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0333	20,583
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0303	18,340
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	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0215	586,867
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0213	562,683
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0224	582,297
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0240	587,406
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0248	586,484
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0217	485,102

收益分配表(续)

汇丰亚洲高收益债券基金

IM2 类 - 港元份额	除息日期	付款日期	每份额 分配 港元	分配 总额 港元
第 1 次分配	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0666	12,500
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0666	12,500
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0668	12,537
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0666	12,500
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0660	12,387
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0602	11,299

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	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0328	58,033
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0331	57,580
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0332	58,051
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0331	24,609
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0328	21,019
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0298	19,275

证券借贷安排和抵押品持有明细表

汇丰亚洲高收益债券基金

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

2026年1月31日

抵押品提供方	抵押品提供方信用评级 ¹	抵押品性质	非现金抵押品 盯市价值(如适用) 美元	抵押品公允价值 美元
巴黎银行伦敦分行	Aa3	固定收益证券	1,053,604	1,053,604
德意志银行	A1	固定收益证券	59,072,622	59,072,622
汇丰银行	Aa3	固定收益证券	213,902	213,902
Jefferies International Limited (母公司)	Baa1	固定收益证券	6,065,808	6,065,808
美林国际	A+	固定收益证券	13,730,096	13,730,096
摩根士丹利国际公司	Aa3	固定收益证券	9,741,137	9,741,137
野村国际	Baa1	固定收益证券	2,857,304	2,857,304
多伦多道明银行伦敦分行	A2	固定收益证券	1,513,200	1,513,200
				94,247,673

2025年1月31日

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

¹ 惠誉评级赋予的信用评级

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(B) 固定收益抵押品信用评级

2026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	未评级	2,464
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	199,306
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	45,183
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	199,908
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	199,909
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	2,542
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	199,909
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	199,909
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	3,870
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	604
德意志银行	政府债券	穆迪	Aa3	10,286,857
德意志银行	政府债券	穆迪	未评级	1
德意志银行	政府债券	穆迪	Aaa	7,282,244
德意志银行	政府债券	穆迪	Aaa	10,285,680
德意志银行	政府债券	穆迪	未评级	2,246,659
德意志银行	政府债券	穆迪	未评级	10,285,907
德意志银行	政府债券	穆迪	Aa3	143,866
德意志银行	政府债券	穆迪	Aa3	3,316,776
德意志银行	政府债券	穆迪	Aa3	10,286,857
德意志银行	政府债券	穆迪	Aa3	4,931,269
德意志银行	政府债券	穆迪	Aa3	6,506
汇丰银行	GIL	穆迪	未评级	40,497
汇丰银行	GIL	穆迪	未评级	40,537
汇丰银行	GIL	穆迪	未评级	40,654
汇丰银行	GIL	穆迪	未评级	10,607
汇丰银行	政府债券	穆迪	未评级	40,546
汇丰银行	政府债券	穆迪	Aaa	4,809
汇丰银行	政府债券	穆迪	Aaa	36,252
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1	644,163
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1	651,343
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1	614,742
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	621,736
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1	980,472
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	103,450
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	2,528
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	913
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	454,027
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	427

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)

2026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	Aa3	53,358
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	1,320
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	13,710
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	21,816
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	5,674
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	3
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	244
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	601,298
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	947
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	1
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	505,768
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	A1	649
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	A1	53,134
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1	194
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1	2,082
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1	600,897
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1	63,724
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	100
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1	67,088
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	1,366
美林国际	政府债券	穆迪	Aaa	474
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	132,995
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	49,951
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	1,445,211
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	1
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	4,764
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	2,608,716
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	322,194
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	259
美林国际	政府债券	穆迪	Aa3	1
美林国际	政府债券	穆迪	Aa3	133
美林国际	政府债券	穆迪	Aa1	411,552
美林国际	政府债券	穆迪	Aa1	2,608,650

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)

2026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
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	1,029,081
美林国际	政府债券	穆迪	Aa1	100,159
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	4,471
美林国际	政府债券	穆迪	Aa1	97
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	1,970
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	201
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	95,937
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	110,221
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	102
美林国际	政府债券	穆迪	Aa1	55,385
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	2,236
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	10,239
美林国际	政府债券	穆迪	Aa1	2,608,688
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	96,556
美林国际	政府债券	穆迪	Aa1	1,933
美林国际	政府债券	穆迪	Aa1	6,323
美林国际	政府债券	穆迪	Aa1	75,452
美林国际	政府债券	穆迪	Aa1	1,944,778
摩根士丹利国际公司	GIL	穆迪	Aa3	1,850,785
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	未评级	1,850,720
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	未评级	1,850,632
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	A1	1,039,442
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	未评级	1,298,780
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aa1	1,850,778
野村国际	政府债券	穆迪	未评级	542,888
野村国际	政府债券	穆迪	Aa3	542,887
野村国际	政府债券	穆迪	Aa3	369,534
野村国际	政府债券	穆迪	未评级	645
野村国际	政府债券	穆迪	A1	2,920
野村国际	政府债券	穆迪	A1	540,086
野村国际	政府债券	穆迪	A1	539,727
野村国际	政府债券	穆迪	未评级	318,617
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	1,148
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	2,487
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	4,659
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	47,661
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	813
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	6,909

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)

2026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
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	5,071
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	2
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	7,033
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	2,219
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	36
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	105,158
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	1,034
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	11,741
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	5,865
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	79
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	286,639
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	4,000
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	15,143
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	1,020
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	282,555
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	79,439
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	257,707
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	161
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	2,176
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	68,941
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	84,432
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	204,003
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	197
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	24,566
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	206
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	100
				94,247,673

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
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	Aaa	1
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	1,508,873
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	36,405
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	1,508,873
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	4,658
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	27
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3u	1,499,480
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	1,496,405
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	6,799
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	42
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	A1	3,857
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	1,492,727
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	412,944
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	6,856
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1u	4,058
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1u	1,002
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	499,982
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	361,350
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	7,130
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	1
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	906
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	9,841
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	140,638
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	4,342
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	256
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	361,076
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	641,159
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	12,730
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	1,703
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	1,047
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	360,613
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	8,310
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	137
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	790,128
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	398,394
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	27,243
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	259,640
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	133,342
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	786
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	162
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	709,853
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	309,573
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	132,724

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	Aaa	90,397
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	27,091
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	1,724
摩根士丹利国际公司	GIL	穆迪	Aa3u	3,099,744
摩根士丹利国际公司	GIL	穆迪	未评级	42,874
摩根士丹利国际公司	GIL	穆迪	未评级	4,303
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	未评级	3,094,908
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	63
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	815,234
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	88
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	3,065,133
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	3,095,888
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	3,096,207
				29,589,728

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表

证券借贷交易

截至 2026 年 1 月 31 日止期间

交易对手	抵押品类型	货币	剩余期限 ²	抵押品提供方所在地	结算/清算	借出证券 公允价值 美元
巴黎银行伦敦分行(母公司)	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	4,995,860
德意志银行(母公司)	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	89,511,915
德意志银行(母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	8,787,947
汇丰银行(母公司)	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	12,010,024
Jefferies International Limited (母公司)	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	20,093,679
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	1,019,133
美林国际(母公司)	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	38,536,177
美林国际(母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	1,568,024
摩根士丹利国际公司(母公 司)	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	30,756,928
野村国际(母公司)	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	17,437,759
野村国际(母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	12,443,649
						<u>237,161,095</u>

截至 2025 年 1 月 31 日止期间

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

² 在分别截至2026年1月31日和2025年1月31日止的期间，当期借出但尚未归还的证券详见下表的披露。

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易

2026年1月31日

借出证券	抵押品类型	货币	剩余期限	证券借贷 代理人 所在地	现金抵押品 与非现金抵 押品占比	非现金抵 押品剩余 期限	结算/清算	占资产净值 百分比	借出证券 公允价值 ³ 美元
BIOCON BIOLOGICS GLOBAL 6.67% 2029年 10月9日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.18%	1,409,340
CAS CAPITAL NO2 LTD 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	0.28%	2,224,258
CELESTIAL DYNASTY LTD 4.25% 2029年6月27 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.09%	705,331
中国宏桥集团 有限公司 6.925% 2028 年11月29日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.15%	1,150,618
CS TREASURY MGMT SERVICE 9% 永续债券 2049年12月31 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	详见下表	三方抵押品	0.51%	4,062,006
FORTUNE STAR BVI LTD 6.8% 2029年9月9日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.29%	2,283,353
FORTUNE STAR BVI LTD 6.8% 2029年9月9日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.16%	1,290,591
GC TREASURY CENTRE CO S条例债券系 列 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	0.26%	2,053,680
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	0.17%	1,311,415

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

2026年1月31日

借出证券	抵押品类型	货币	剩余期限	证券借贷 代理人 所在地	现金抵押品 与非现金抵 押品占比	非现金抵 押品剩余 期限	结算/清算	占资产净值 百分比	借出证券 公允价值 ³ 美元
GREENKO WIND PROJECTS MUS 条例债 券系列 7.25% 2028年9月27 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	1.06%	8,387,919
INDIA GREEN POWER HOLDING 4% 2027年2月 22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.20%	1,617,662
INDIABULLS HOUSING FIN 9.7% 2027年7月3日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.11%	835,790
印度尼西亚(共 和国) 3.2% 2061年9月23 日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	222,999
印度尼西亚(共 和国) 5.65% 2053年1月11 日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%	详见下表	三方抵押品	0.31%	2,475,865
印度尼西亚(共 和国) 5.65% 2053年1月11 日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.60%	4,728,902
IRB INFRASTRU CTURE DEVE 7.11% 2032年3月11 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.47%	3,761,975
JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125% 2031年5月18 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	202,571
JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125% 2031年5月18 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.16%	1,245,580

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

2026年1月31日

借出证券	抵押品类型	货币	剩余期限	证券借贷 代理人 所在地	现金抵押品 与非现金抵 押品占比	非现金抵 押品剩余 期限	结算/清算	占资产净值 百分比	借出证券 公允价值 ³ 美元
JSW STEEL LTD 5.05% 2032年4月5日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.05%	379,509
JSW STEEL LTD 5.05% 2032年4月5日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.19%	1,498,063
利丰有限公司 8.375% 2029 年2月5日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.26%	2,090,562
利丰有限公司 8.375% 2029 年2月5日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.07%	522,641
MEDCO MAPLE TREE PTE LTD 8.96% 2029年4月27 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.15%	1,150,159
MELCO RESORTS FINANCE 5.375% 2029 年12月4日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	详见下表	三方抵押品	0.35%	2,794,136
MELCO RESORTS FINANCE 7.625% 2032 年4月17日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.14%	1,122,840
MELCO RESORTS FINANCE 7.625% 2032 年4月17日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.13%	1,049,383
美高梅中国控 股有限公司 7.125% 2031 年6月26日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.18%	1,433,087
美高梅中国控 股有限公司 7.125% 2031 年6月26日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.20%	1,593,500

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

2026年1月31日

借出证券	抵押品类型	货币	剩余期限	证券借贷 代理人 所在地	现金抵押品 与非现金抵 押品占比	非现金抵 押品剩余 期限	结算/清算	占资产净值 百分比	借出证券 公允价值 ³ 美元
美高梅中国控 股有限公司 7.125% 2031 年6月26日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.13%	1,062,333
MONGOLIAN MINING CORP S条例 债券系列 8.44% 2030年 4月3日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.13%	1,034,473
NICKEL INDUSTRIES LTD 9% 2030 年9月30日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	1.62%	12,856,864
NWD FINANCE (BVI) LTD 浮 息永续债券 2049年12月31 日 (XS213298674 1)	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.29%	2,333,494
							详见下表		
NWD MTN LTD 4.5% 2030年5月19 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.06%	476,934
PERTAMINA PERSERO 6% 2042年5月3日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	199,540
PERTAMINA PERSERO PT 6.5% 2048年 11月7日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.27%	2,099,940
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 4% 2050年6月30 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.39%	3,123,051
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 4.875% 2049 年7月17日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.20%	1,597,283
PIRAMAL CAPITAL & HOUS 7.8% 2028年1月29 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.45%	3,531,062

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

2026年1月31日

借出证券	抵押品类型	货币	剩余期限	证券借贷 代理人 所在地	现金抵押品 与非现金抵 押品占比	非现金抵 押品剩余 期限	结算/清算	占资产净值 百分比	借出证券 公允价值 ³ 美元
SAN MIGUEL GLOBAL POWER 浮息 永续债券 2049年12月31 日 (XS288397970 5)	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.12%	930,213
SAN MIGUEL GLOBAL POWER 浮息 永续债券 2049年12月31 日 (XS294380990 0)	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	203,066
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%	详见下表	三方抵押品	0.04%	320,957
TRAD & DEV BANK MONGOLIA 8.5% 2027年 12月23日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	200,961
UPL CORP LTD 4.5% 2028年3月8日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	195,999
UPL CORP LTD 4.5% 2028年3月8日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.16%	1,273,994
永利澳门有限 公司 5.5% 2027年10月1 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.16%	1,299,339
								10.91%	86,343,238

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

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易

2025年1月31日

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

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

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易抵押品

2026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%	2033年2月20日	三方抵押品	0.00%	2,464
巴黎银行 伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2027年6月10日	三方抵押品	0.03%	199,306
巴黎银行 伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年11月15日	三方抵押品	0.01%	45,183
巴黎银行 伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2054年8月15日	三方抵押品	0.03%	199,908
巴黎银行 伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2034年8月15日	三方抵押品	0.03%	199,909
巴黎银行 伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2038年5月25日	三方抵押品	0.00%	2,542
巴黎银行 伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2033年11月25日	三方抵押品	0.03%	199,909
巴黎银行 伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年11月25日	三方抵押品	0.03%	199,909
巴黎银行 伦敦分行	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2026年12月20日	三方抵押品	0.00%	3,870
巴黎银行 伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2031年1月15日	三方抵押品	0.00%	604
德意志银行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年10月22日	三方抵押品	1.30%	10,286,857
德意志银行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2036年6月22日	三方抵押品	0.00%	1
德意志银行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2027年3月11日	三方抵押品	0.92%	7,282,244
德意志银行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2027年9月16日	三方抵押品	1.30%	10,285,680
德意志银行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年9月15日	三方抵押品	0.28%	2,246,659
德意志银行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2041年4月15日	三方抵押品	1.29%	10,285,907
德意志银行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2038年10月25日	三方抵押品	0.02%	143,866

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

2026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
德意志银行	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	0.42%	3,316,776
德意志银行	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	1.29%	10,286,857
德意志银行	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	0.62%	4,931,269
德意志银行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2040年5月25日	三方抵押品	0.00%	6,506
汇丰银行	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2062年3月22日	三方抵押品	0.01%	40,497
汇丰银行	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2068年3月22日	三方抵押品	0.01%	40,537
汇丰银行	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2036年11月22日	三方抵押品	0.01%	40,654
汇丰银行	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2037年9月7日	三方抵押品	0.00%	10,607
汇丰银行	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2045年3月20日	三方抵押品	0.01%	40,546
汇丰银行	政府债券	挪威克朗	无固定期限	伦敦	0%	2031年9月17日	三方抵押品	0.00%	4,809
汇丰银行	政府债券	挪威克朗	无固定期限	伦敦	0%	2033年8月15日	三方抵押品	0.00%	36,252
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	0.08%	644,163
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	0.08%	651,343
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年2月20日	三方抵押品	0.08%	614,742
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	0.08%	621,736
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2034年2月20日	三方抵押品	0.12%	980,472
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年2月20日	三方抵押品	0.01%	103,450

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

2026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%	2032年3月28日	三方抵押品	0.00%	2,528
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2034年6月22日	三方抵押品	0.00%	913
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2027年6月22日	三方抵押品	0.06%	454,027
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年6月22日	三方抵押品	0.00%	427
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	0.01%	53,358
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2036年6月22日	三方抵押品	0.00%	1,320
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年9月15日	三方抵押品	0.00%	13,710
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年4月25日	三方抵押品	0.00%	21,816
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%	5,674
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年11月25日	三方抵押品	0.00%	3
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	0.00%	244
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2054年5月25日	三方抵押品	0.08%	601,298

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

2026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%	2033年11月25日	三方抵押品	0.00%	947
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%	1
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2031年2月25日	三方抵押品	0.06%	505,768
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2026年11月1日	三方抵押品	0.00%	649
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2027年5月1日	三方抵押品	0.01%	53,134
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	0.00%	194
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%	2,082
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	0.08%	600,897
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	0.01%	63,724
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2030年3月31日	三方抵押品	0.00%	100
Jefferies International Limited (母公司)	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	0.01%	67,088
美林国际	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2031年6月1日	三方抵押品	0.00%	1,366
美林国际	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2053年12月1日	三方抵押品	0.00%	474
美林国际	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2035年12月1日	三方抵押品	0.02%	132,995

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

2026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
美林国际	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2031年3月1日	三方抵押品	0.01%	49,951
美林国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2046年8月15日	三方抵押品	0.18%	1,445,211
美林国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年4月12日	三方抵押品	0.00%	1
美林国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年10月10日	三方抵押品	0.00%	4,764
美林国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年8月15日	三方抵押品	0.33%	2,608,716
美林国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年3月1日	三方抵押品	0.04%	322,194
美林国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2034年5月25日	三方抵押品	0.00%	259
美林国际	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%	1
美林国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年5月25日	三方抵押品	0.00%	133
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2042年8月15日	三方抵押品	0.05%	411,552
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2041年11月15日	三方抵押品	0.33%	2,608,650
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2053年5月15日	三方抵押品	0.13%	1,029,081
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2043年8月15日	三方抵押品	0.01%	100,159
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2044年8月15日	三方抵押品	0.00%	4,471
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2029年3月31日	三方抵押品	0.00%	97
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2029年6月30日	三方抵押品	0.00%	1,970
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2027年8月31日	三方抵押品	0.00%	201
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2033年5月15日	三方抵押品	0.01%	95,937
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2030年12月31日	三方抵押品	0.01%	110,221
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2034年5月15日	三方抵押品	0.00%	102

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

2026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
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2034年8月15日	三方抵押品	0.01%	55,385
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2027年8月15日	三方抵押品	0.00%	2,236
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2031年11月30日	三方抵押品	0.00%	10,239
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2035年1月15日	三方抵押品	0.33%	2,608,688
美林国际	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	0.01%	96,556
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028年3月15日	三方抵押品	0.00%	1,933
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2032年3月31日	三方抵押品	0.00%	6,323
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028年6月15日	三方抵押品	0.01%	75,452
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2027年6月30日	三方抵押品	0.25%	1,944,778
摩根士丹利国际公司	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2041年10月22日	三方抵押品	0.23%	1,850,785
摩根士丹利国际公司	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2034年6月20日	三方抵押品	0.23%	1,850,720
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9月20日	三方抵押品	0.23%	1,850,632
摩根士丹利国际公司	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2065年3月20日	三方抵押品	0.13%	1,039,442
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2049年2月15日	三方抵押品	0.16%	1,298,780

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

2026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	美元	无固定期限	伦敦	0%	2052年5月15日	三方抵押品	0.23%	1,850,778
野村国际	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	0.07%	542,888
野村国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2050年6月22日	三方抵押品	0.07%	542,887
野村国际	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	0.05%	369,534
野村国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2042年6月22日	三方抵押品	0.00%	645
野村国际	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2026年7月1日	三方抵押品	0.00%	2,920
野村国际	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2029年3月10日	三方抵押品	0.07%	540,086
野村国际	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2033年3月10日	三方抵押品	0.07%	539,727
野村国际	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2063年3月20日	三方抵押品	0.04%	318,617
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2064年12月1日	三方抵押品	0.00%	1,148
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2048年12月1日	三方抵押品	0.00%	2,487
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2029年3月1日	三方抵押品	0.00%	4,659
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2027年5月1日	三方抵押品	0.01%	47,661
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2029年6月1日	三方抵押品	0.00%	813

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

2026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
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2033年6月1日	三方抵押品	0.00%	6,909
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2037年6月1日	三方抵押品	0.00%	5,071
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年2月15日	三方抵押品	0.00%	2
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2033年2月15日	三方抵押品	0.00%	7,033
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2036年5月25日	三方抵押品	0.00%	2,219
多伦多道明银行伦敦分行	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%	36
多伦多道明银行伦敦分行	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	0.01%	105,158
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年5月25日	三方抵押品	0.00%	1,034
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2044年6月25日	三方抵押品	0.00%	11,741
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2053年5月25日	三方抵押品	0.00%	5,865
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2033年11月25日	三方抵押品	0.00%	79

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

2026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
多伦多道明银行伦敦分行	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	0.04%	286,639
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年5月25日	三方抵押品	0.00%	4,000
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028年4月26日	三方抵押品	0.00%	15,143
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2038年5月15日	三方抵押品	0.00%	1,020
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2039年8月15日	三方抵押品	0.04%	282,555
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2042年8月15日	三方抵押品	0.01%	79,439
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2042年11月15日	三方抵押品	0.03%	257,707
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2044年8月15日	三方抵押品	0.00%	161
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2044年11月15日	三方抵押品	0.00%	2,176
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2045年11月15日	三方抵押品	0.01%	68,941
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2046年8月15日	三方抵押品	0.01%	84,432

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

2026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
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2047年2月15日	三方抵押品	0.03%	204,003
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2027年8月15日	三方抵押品	0.00%	197
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2027年5月15日	三方抵押品	0.00%	24,566
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028年2月15日	三方抵押品	0.00%	206
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028年7月15日	三方抵押品	0.00%	100
								11.91%	94,247,673

2025年1月31日

抵押品提供方	抵押品类型	货币	剩余期限	抵押品提供方所在地	现金抵押品与非现金抵押品占比	非现金抵押品剩余期限	结算/清算	抵押品覆盖的资产净值百分比	抵押品公允价值 美元
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年10月20日	三方抵押品	0.0%	4,058
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2027年4月20日	三方抵押品	0.00%	1,002
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年2月20日	三方抵押品	0.04%	499,982

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%	2032年3月28日	三方抵押品	0.03%	361,350
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2057年6月22日	三方抵押品	0.00%	7,130
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年6月22日	三方抵押品	0.00%	1
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年6月22日	三方抵押品	0.00%	1
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2043年6月22日	三方抵押品	0.00%	906
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2055年6月22日	三方抵押品	0.00%	9,841
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年6月22日	三方抵押品	0.01%	140,638
摩根士丹利国际公司	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2041年10月22日	三方抵押品	0.28%	3,099,744
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2048年8月15日	三方抵押品	0.00%	1
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年2月15日	三方抵押品	0.14%	1,508,873
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年5月15日	三方抵押品	0.00%	4,342
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年11月15日	三方抵押品	0.00%	256
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2034年7月4日	三方抵押品	0.03%	361,076

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%	2040年7月4日	三方抵押品	0.06%	641,159
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2042年7月4日	三方抵押品	0.00%	12,730
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年12月10日	三方抵押品	0.00%	36,405
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年4月18日	三方抵押品	0.14%	1,508,873
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2031年4月15日	三方抵押品	0.00%	4,658
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2034年4月25日	三方抵押品	0.00%	27
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年4月25日	三方抵押品	0.00%	1,703
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2039年6月25日	三方抵押品	0.00%	1,047
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2027年5月25日	三方抵押品	0.03%	360,613
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2048年5月25日	三方抵押品	0.00%	8,310
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年3月1日	三方抵押品	0.13%	1,499,480
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年2月25日	三方抵押品	0.13%	1,496,405
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年3月1日	三方抵押品	0.00%	137
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2036年3月1日	三方抵押品	0.07%	790,128

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	0.04%	398,394
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年5月25日	三方抵押品	0.00%	27,243
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年2月25日	三方抵押品	0.02%	259,640
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年11月25日	三方抵押品	0.00%	6,799
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年9月24日	三方抵押品	0.00%	42
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年9月24日	三方抵押品	0.01%	133,342
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年2月25日	三方抵押品	0.00%	786
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2055年5月25日	三方抵押品	0.00%	162
摩根士丹利国际公司	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2073年10月22日	三方抵押品	0.00%	42,874
摩根士丹利国际公司	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2038年1月29日	三方抵押品	0.00%	4,303
巴黎银行伦敦分行	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2036年12月20日	三方抵押品	0.00%	3,857
摩根士丹利国际公司	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2029年6月20日	三方抵押品	0.28%	3,094,908
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2042年1月15日	三方抵押品	0.06%	709,853

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%	2047年1月15日	三方抵押品	0.03%	309,573
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年1月15日	三方抵押品	0.13%	1,492,727
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2052年1月15日	三方抵押品	0.04%	412,944
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2049年8月15日	三方抵押品	0.00%	63
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2051年2月15日	三方抵押品	0.07%	815,234
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2052年11月15日	三方抵押品	0.00%	88
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2043年8月15日	三方抵押品	0.01%	132,724
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2053年11月15日	三方抵押品	0.28%	3,065,133
巴黎银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2026年7月15日	三方抵押品	0.00%	6,856
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2030年5月15日	三方抵押品	0.28%	3,095,888
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028年3月31日	三方抵押品	0.01%	90,397
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2029年1月31日	三方抵押品	0.28%	3,096,207

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%	2027 年 11 月 30 日	三方抵押品	0.00%	27,091
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2026 年 2 月 15 日	三方抵押品	0.00%	1,724
								2.63%	29,589,728

回购交易

不适用。

(D) 借出的可转让证券

2026 年 1 月 31 日

借出的可转让证券总值 ³	借出证券金额占可借出资产总额的百分比 ³	借出证券金额占本基金管理资产规模的百分比 ³	回购交易的绝对金额
美元	%	%	美元
86,343,238	91.5463	10.9076	不适用

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(D) 借出的可转让证券(续)

2025 年 1 月 31 日

借出的可转让证 券总值 ³	借出证券金额占可 借出资产总额的百 分比 ³	借出证券金额占本基 金管理资产规模的 百分比 ³	回购交易的绝 对金额
美元	%	%	美元
27,856,939	2.7071	2.5040	不适用

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

(E) 使用现金抵押品进行的投资

不适用。截至 2026 年 1 月 31 日和 2025 年 1 月 31 日，本基金并未收到任何现金抵押品。

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

在分别截至 2026 年 1 月 31 日和 2025 年 1 月 31 日止的期间，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 %
2026年1月31日		
巴黎银行伦敦分行	1,053,604	0.1331%
德意志银行	59,072,622	7.4624%
汇丰银行	213,902	0.0270%
Jefferies International Limited (母公司)	6,065,808	0.7663%
美林国际	13,730,096	1.7345%
摩根士丹利国际公司	9,741,137	1.2306%
野村国际	2,857,304	0.3610%
多伦多道明银行伦敦分行	1,513,200	0.1912%
	<u>94,247,673</u>	<u>11.9061%</u>
2025年1月31日		
巴黎银行伦敦分行	7,977,948	0.7171%
Jefferies International Limited (母公司)	5,297,338	0.4762%
摩根士丹利国际公司	16,314,442	1.4665%
	<u>29,589,728</u>	<u>2.6598%</u>

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 %
2026年1月31日		
FRANCE FRGV 1.000 05/25/27	10,392,015	1.3128%
BELGIUM BEGV 2.600 10/22/30	10,286,857	1.2995%
FINLAND FIGV 3.550 04/15/41	10,285,907	1.2994%
GERMANY DEGV 1.900 09/16/27	10,285,680	1.2994%
GERMANY DEGV 2.200 03/11/27	7,282,244	0.9200%
FRANCE FRGV 0.750 05/25/28	4,931,269	0.6230%
FRANCE FRGV 2.500 05/25/30	3,316,776	0.4190%
GERMANY DEGV 2.600 08/15/35	2,608,716	0.3296%
US TREASURY UST 2.125 01/15/35	2,608,688	0.3296%
US TREASURY UST 2.000 11/15/41	2,608,650	0.3295%
	<hr/>	<hr/>
	64,606,802	8.1618%
	<hr/>	<hr/>

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

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

	2026年1月31日 借出证券的 公允价值 ³ 美元	占2026年1月31日 资产净值总额 的百分比 ³ %
巴黎银行伦敦分行	3,646,680	0.4607%
德意志银行	47,767,743	6.0344%
汇丰银行	199,540	0.0252%
Jefferies International Limited (母公司)	4,597,765	0.5808%
美林国际	10,288,085	1.2997%
摩根士丹利国际公司	11,006,319	1.3904%
野村国际	7,427,766	0.9383%
多伦多道明银行伦敦分行	1,409,340	0.1780%
	86,343,238	10.9075%
	2025年1月31日 借出证券的 公允价值 ³ 美元	占2025年1月31日 资产净值总额 的百分比 ³ %
巴黎银行伦敦分行	7,534,343	0.6772%
Jefferies International Limited (母公司)	5,017,053	0.4510%
摩根士丹利国际公司	15,305,543	1.3758%
	27,856,939	2.5040%

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

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(J) 保管人及每家保管人持有的资产金额

公允价值
2026年1月31日
美元

抵押品证券保管人
汇丰银行

94,247,673

94,247,673

公允价值
2026年1月31日
美元

借给借券人的证券保管人^{3,5}

86,343,238

2025年1月31日

公允价值
2025年1月31日
美元

抵押品证券保管人
汇丰银行

29,589,728

29,589,728

公允价值
2025年1月31日
美元

借给借券人的证券保管人^{3,5}

27,856,939

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)

- ³ 有关借出证券的信息基于本基金的会计记录。外币交易按折算日期的现行汇率折算为功能货币，资产和负债按期间终了日的现行汇率折算为功能货币。
- ⁴ 抵押品依据双边抵押品保管安排，通过汇丰银行的独立账户持有。
- ⁵ 所有借给借券人的证券均在独立账户中持有。汇丰银行担任证券借贷代理人，负责安排借券交易并管理抵押品。
- ⁶ 欧洲清算银行和摩根大通担任三方抵押品管理人，证券借贷代理人汇丰银行将某些抵押品管理、保证金计算和抵押品职能委托给三方抵押品管理人。

(K) 本基金通过证券借贷赚得的收入

	截至2026年1月 31日止期间 美元	截至2025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	191,884	2,848
- 管理费	-	380
- HSS收入	-	570
	<u>191,884</u>	<u>3,797</u>

(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2026年1月 31日止期间 美元	截至2025年1月31 日止期间 美元
证券借贷和回购交易收益	191,884	3,797
现金抵押品再投资收益	-	-

行政

管理人

汇丰投资基金(香港)有限公司
香港中环
皇后大道中1号
汇丰总行大厦

管理人董事

刘嘉燕
何慧芬
陈慧雅(2025年11月25日委任)
谭振邦(2025年11月25日辞任)
郭永嘉
Michael CROSS
洪绮婷(2026年2月3日委任)

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