

汇丰投资信托基金— 汇丰亚洲债券基金

2026 年中期报告



汇丰投资管理
HSBC Asset Management

汇丰亚洲债券基金
(汇丰投资信托基金之子基金)

2026 年中期报告

目录

	页数
1.汇丰投资信托基金	
1.1 汇丰亚洲债券基金	
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	36
金融衍生工具明细表	37
业绩表现记录	43
收益分配表	51
证券借贷安排和抵押品持有明细表	54
2.行政	102

财务状况表

汇丰亚洲债券基金

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	2,525,791,349	3,044,100,329
应收利息	32,102,661	38,041,304
应收申购款	2,102,369	1,814,556
应收经纪商款项	67,360,386	78,462,261
现金和现金等价物	6,542,505	335,054
	<u>2,633,899,270</u>	<u>3,162,753,504</u>
负债		
以公允价值计入损益账的金融负债	16,912,766	26,162,192
应付赎回款	36,280,631	32,336,859
应付经纪商款项	65,371,614	47,045,986
应付税项	29,748	28,737
应付分配	4,181,007	5,199,327
其他应付款	2,266,172	2,977,611
银行透支	-	1,992,100
	<u>125,041,938</u>	<u>115,742,812</u>
基金份额持有人应占资产净值	<u>2,508,857,332</u>	<u>3,047,010,692</u>
相当于： 金融负债	<u>2,508,857,332</u>	<u>3,047,010,692</u>
	份额	份额
已发行份额总数		
- AC类 - 美元	225,316	88,113
- AM2类 - 港元	168,586,995	158,923,437
- AM2类 - 美元	60,709,982	59,532,992
- AM3H类 - 澳元	9,304,157	9,746,650
- AM3H类 - 欧元	1,083,033	1,313,635
- AM3H类 - 英镑	242,584	57,737
- AM3H类 - 人民币	14,837,595	13,910,563
- BC类 - 港元	307,449	283,120
- BC类 - 人民币	843,438,853	1,282,559,184
- BC类 - 美元	3,106,058	3,259,084
- BCH类 - 人民币	222,813,947	204,351,535
- BM2类 - 港元	1,389,455	1,284,705

财务状况表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)		
- BM2 类 - 人民币	60,737,049	85,148,085
- BM2 类 - 美元	2,377,483	2,649,866
- BM3H 类 - 澳元	295,249	273,254
- BM3H 类 - 人民币	10,557,487	16,694,836
- IC 类 - 美元	318,188	973,669
- ID2 类 - 美元	360,941	348,297
- IM2 类 - 美元	26,068,463	25,630,535
- ZD2 类 - 美元	2,043,186	1,550,747
	美元	美元
份额净值		
- AC 类 - 美元	14.485	14.043
- AM2 类 - 港元	0.976	0.974
- AM2 类 - 美元	6.855	6.840
- AM3H 类 - 澳元	5.010	4.595
- AM3H 类 - 欧元	8.377	8.048
- AM3H 类 - 英镑	13.665	13.152
- AM3H 类 - 人民币	1.044	1.005
- BC 类 - 港元	1.300	1.260
- BC 类 - 人民币	1.421	1.378
- BC 类 - 美元	10.178	9.868
- BCH 类 - 人民币	1.344	1.274
- BM2 类 - 港元	0.974	0.972
- BM2 类 - 人民币	1.069	1.067
- BM2 类 - 美元	7.603	7.585
- BM3H 类 - 澳元	5.247	4.812
- BM3H 类 - 人民币	1.078	1.038
- IC 类 - 美元	15.313	14.811
- ID2 类 - 美元	9.005	8.711
- IM2 类 - 美元	7.514	7.479
- ZD2 类 - 美元	9.257	8.929

注：中期报告执行与本子基金年度报告相同的会计政策和计算方法。

全面收益表

汇丰亚洲债券基金

截至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	63,886	110,926
股息收入	27,587	163,685
以公允价值计入损益账的金融工具的收益净值	123,187,349	11,412,044
证券借贷收入	538,286	-
外汇(亏损)/收入净值	(84,384)	542,501
其他收入	479,278	354,927
收入总额	124,212,002	12,584,083
管理费 ^{附注2}	13,769,731	8,250,119
交易费用 ^{附注1}	111,852	76,577
受托人费用 ^{附注1}	1,002,169	615,767
基金注册登记机构费用 ^{附注1}	86,873	77,846
审计师酬金	10,413	7,497
律师费及专业人员费用 ^{附注1}	17,046	1,455
保管费、银行手续费及杂费 ^{附注1}	5,957,522	2,340,849
总经营开支	20,955,606	11,370,110
税前经营净利润	103,256,396	1,213,973
税项	-	-
收益分配前经营净利润	103,256,396	1,213,973
向基金份额持有人的收益分配	(27,945,290)	(28,864,922)
本月份额持有人应占资产净值增加/(减少)	75,311,106	(27,650,949)

全面收益表(续)

汇丰亚洲债券基金

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
交易成本	28,324	21,624
律师费及专业人员费用	-	1,455
保管费、银行手续费及杂费	107,777	62,429

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/关联人士支付任何其他款项。

份额持有人应占资产净值变动表

汇丰亚洲债券基金

截至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	3,047,010,692	1,188,530,195
本期份额持有人应占资产净值和全面收益总额增加/(减少)	75,311,106	(27,650,949)
份额认/申购(不含均衡)		
- AC类 - 美元	1,984,074	87,702
- AM2类 - 港元	103,429,280	41,677,726
- AM2类 - 美元	100,783,554	57,721,890
- AM3H类 - 澳元	19,886,173	14,229,719
- AM3H类 - 欧元	1,838,868	3,775,325
- AM3H类 - 英镑	4,272,286	877,717
- AM3H类 - 人民币	4,302,256	3,381,973
- BC类 - 港元	72,135	25,157
- BC类 - 人民币	105,735,479	1,340,174,947
- BC类 - 美元	6,261,507	22,646,926
- BCH类 - 人民币	103,853,803	173,978,471
- BM2类 - 港元	250,570	522,575
- BM2类 - 人民币	6,609,859	66,554,726
- BM2类 - 美元	2,967,488	10,994,582
- BM3H类 - 澳元	226,754	467,626
- BM3H类 - 人民币	263,566	15,386,326
- ID2类 - 美元	110,737	82,737
- IM2类 - 美元	5,612,672	5,389,455
- ZD2类 - 美元	4,677,341	7,069,208
份额赎回(不含均衡)		
- AC类 - 美元	(44,178)	(126,875)
- AM2类 - 港元	(93,605,101)	(54,989,246)
- AM2类 - 美元	(92,392,213)	(66,491,404)
- AM3H类 - 澳元	(22,219,487)	(12,930,267)
- AM3H类 - 加元	-	(238,354)
- AM3H类 - 欧元	(3,763,896)	(2,017,189)
- AM3H类 - 英镑	(1,706,320)	(132,776)
- AM3H类 - 人民币	(3,363,190)	(3,744,001)
- BC类 - 港元	(40,481)	(24,711)
- BC类 - 人民币	(761,381,185)	(59,226,215)
- BC类 - 美元	(7,768,024)	(3,229,413)
- BCH类 - 人民币	(94,681,463)	(22,984,648)

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲债券基金

截至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
- BM2 类 - 港元	(146,369)	(86,743)
- BM2 类 - 人民币	(32,389,203)	(25,531,506)
- BM2 类 - 美元	(5,065,708)	(1,726,429)
- BM3H 类 - 澳元	(118,402)	(1,143)
- BM3H 类 - 人民币	(6,756,547)	(6,541,624)
- IC 类 - 美元	(9,864,340)	(14,593,418)
- ID2 类 - 美元	-	(604,940)
- IM2 类 - 美元	(2,297,520)	-
- ZD2 类 - 美元	(226,314)	(13,802,504)
认购和赎回均衡	51,227,073	472,752,986
	<u>(613,464,466)</u>	<u>1,948,774,368</u>
期末余额	<u>2,508,857,332</u>	<u>3,109,653,614</u>
	份额	份额
AC 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	88,113	83,756
期间发行份额数	140,312	6,809
期间赎回份额数	(3,109)	(9,677)
结转后期已发行份额数	<u>225,316</u>	<u>80,888</u>
AM2 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	158,923,437	166,787,173
期间发行份额数	104,034,106	41,949,391
期间赎回份额数	(94,370,548)	(55,774,958)
结转后期已发行份额数	<u>168,586,995</u>	<u>152,961,606</u>

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲债券基金

截至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
AM2 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	59,532,992	64,121,253
期间发行份额数	14,477,957	8,376,309
期间赎回份额数	(13,300,967)	(9,745,139)
结转后期已发行份额数	<u>60,709,982</u>	<u>62,752,423</u>
AM3H 类 - 澳元份额		
结转前期已发行份额数	9,746,650	10,074,149
期间发行份额数	4,184,034	2,919,171
期间赎回份额数	(4,626,527)	(2,713,905)
结转后期已发行份额数	<u>9,304,157</u>	<u>10,279,415</u>
AM3H 类 - 加元份额		
结转前期已发行份额数	-	15,307
期间发行份额数	-	-
期间赎回份额数	-	(15,307)
结转后期已发行份额数	<u>-</u>	<u>-</u>
AM3H 类 - 欧元份额		
结转前期已发行份额数	1,313,635	923,313
期间发行份额数	223,108	492,030
期间赎回份额数	(453,710)	(278,085)
结转后期已发行份额数	<u>1,083,033</u>	<u>1,137,258</u>

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲债券基金

截至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 - 英镑份额		
结转前期已发行份额数	57,737	11,298
期间发行份额数	305,161	65,651
期间赎回份额数	(120,314)	(9,777)
结转后期已发行份额数	<u>242,584</u>	<u>67,172</u>
AM3H 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	13,910,563	12,768,592
期间发行份额数	4,182,794	3,317,459
期间赎回份额数	(3,255,762)	(3,787,728)
结转后期已发行份额数	<u>14,837,595</u>	<u>12,298,323</u>
BC 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	283,120	315,129
期间发行份额数	56,208	21,406
期间赎回份额数	(31,879)	(20,375)
结转后期已发行份额数	<u>307,449</u>	<u>316,160</u>
BC 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	1,282,559,184	143,150,834
期间发行份额数	68,664,347	1,450,857,475
期间赎回份额数	(507,784,678)	(61,027,423)
结转后期已发行份额数	<u>843,438,853</u>	<u>1,532,980,886</u>

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲债券基金

截至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 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	3,259,084	523,064
期间发行份额数	621,274	2,586,682
期间赎回份额数	(774,300)	(371,388)
结转后期已发行份额数	<u>3,106,058</u>	<u>2,738,358</u>
BCH 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	204,351,535	1,795,157
期间发行份额数	75,830,788	61,831,066
期间赎回份额数	(57,368,376)	(7,707,535)
结转后期已发行份额数	<u>222,813,947</u>	<u>55,918,688</u>
BM2 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	1,284,705	906,197
期间发行份额数	253,677	467,644
期间赎回份额数	(148,927)	(81,173)
结转后期已发行份额数	<u>1,389,455</u>	<u>1,292,668</u>
BM2 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	85,148,085	53,373,011
期间发行份额数	6,200,681	50,214,558
期间赎回份额数	(30,611,717)	(20,356,726)
结转后期已发行份额数	<u>60,737,049</u>	<u>83,230,843</u>

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲债券基金

截至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	2,649,866	1,517,221
期间发行份额数	388,587	1,310,358
期间赎回份额数	(660,970)	(210,809)
结转后期已发行份额数	<u>2,377,483</u>	<u>2,616,770</u>
BM3H 类 - 澳元份额		
结转前期已发行份额数	273,254	187,243
期间发行份额数	45,389	89,264
期间赎回份额数	(23,394)	(212)
结转后期已发行份额数	<u>295,249</u>	<u>276,295</u>
BM3H 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	16,694,836	11,836,086
期间发行份额数	249,436	13,276,224
期间赎回份额数	(6,386,785)	(5,993,066)
结转后期已发行份额数	<u>10,557,487</u>	<u>19,119,244</u>
IC 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	973,669	2,024,614
期间发行份额数	-	-
期间赎回份额数	(655,481)	(1,050,945)
结转后期已发行份额数	<u>318,188</u>	<u>973,669</u>

份额持有人应占资产净值变动表(续)

汇丰亚洲债券基金

截至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
ID2 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	348,297	408,726
期间发行份额数	12,644	9,571
期间赎回份额数	-	(70,000)
结转后期已发行份额数	<u>360,941</u>	<u>348,297</u>
IM2 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	25,630,535	24,402,275
期间发行份额数	739,479	704,893
期间赎回份额数	(301,551)	-
结转后期已发行份额数	<u>26,068,463</u>	<u>25,107,168</u>
ZD2 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	1,550,747	1,804,517
期间发行份额数	517,363	796,184
期间赎回份额数	(24,924)	(1,583,036)
结转后期已发行份额数	<u>2,043,186</u>	<u>1,017,665</u>

现金流量表

汇丰亚洲债券基金

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	60,696	75,423
已收股息	27,587	163,685
已付管理费	(14,269,526)	(7,243,028)
已付受托人费用	(1,037,248)	(547,227)
购买投资的付款	(1,181,846,122)	(3,225,127,820)
出售投资的所得款项(包括已收投资的息票利息)	1,842,547,858	1,436,626,774
存放于经纪商的保证金存款	6,916,656	(5,448,248)
已收证券收入	538,286	-
已付税项	1,011	(140)
其他已付经营开支	(5,967,530)	(1,306,470)
现金抵押品负债增加	-	2,897,604
经营活动产生/(使用)的现金净额	646,971,668	(1,799,909,447)
融资活动		
份额发行所得款项(含均衡)	460,416,730	2,132,986,174
份额赎回付款(含均衡)	(1,070,225,237)	(292,077,618)
已付分配	(28,963,610)	(29,322,289)
融资活动(使用)/产生的现金净额	(638,772,117)	1,811,586,267
现金和现金等价物增加净额	8,199,551	11,676,820
期初现金和现金等价物	(1,657,046)	4,498,392
期末现金和现金等价物	6,542,505	16,175,212

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

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			
澳新银行集团浮息债券 2035年9月30日	11,873,000	11,928,227	0.47
澳新银行集团浮息永续债券 2049年12月29日	1,660,000	1,678,662	0.07
MINERAL RESOURCES LTD 7% 2031年4月1日	1,550,000	1,630,619	0.06
NICKEL INDUSTRIES LTD 9% 2030年9月30日	3,025,000	3,177,971	0.13
QBE INSURANCE GROUP LTD 2035年10月3日	1,720,000	1,787,832	0.07
QBE INSURANCE GROUP LTD 2037年11月10日	3,442,000	3,475,196	0.14
SANTOS FINANCE LTD 3.649% 2031年4月29日	11,850,000	11,140,197	0.44
SANTOS FINANCE LTD 5.25% 2029年3月13日	8,200,000	8,332,971	0.33
SANTOS FINANCE LTD 5.75% 2035年11月13日	3,137,000	3,148,828	0.13
西太平洋银行浮息永续债券 2049年12月29日	6,280,000	6,308,499	0.25
WOODSIDE FINANCE LTD 5.1% 2034年9月12日	3,000,000	2,966,928	0.12
WOODSIDE FINANCE LTD 5.4% 2030年5月19日	3,625,000	3,731,452	0.15
WOODSIDE FINANCE LTD 5.7% 2054年9月12日	5,211,000	4,931,315	0.20
		64,238,697	2.56
英属维尔京群岛			
CAS CAPITAL NO2 LTD 2049年12月31日	27,145,000	27,444,314	1.09
中国宏桥集团 7.05% 2028年1月10日	9,828,000	10,228,702	0.41
CS TREASURY MGMT SERVICE 9% 2049年12月31日	1,534,675	1,558,465	0.06

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)			
英属维尔京群岛(续)			
FORTUNE STAR BVI LTD 5.875% 2030年11月20日	3,855,000	4,534,099	0.18
FORTUNE STAR BVI LTD 6.8% 2029年9月9日	1,699,000	1,686,703	0.07
绿城中国控股 8.45% 2028年2月24日	8,416,000	8,616,844	0.34
HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD 4.75% 2036年 2月3日	3,651,000	3,652,818	0.15
NWD FINANCE (BVI) LTD 浮息债券 2049年12月31 日	2,970,000	2,073,525	0.08
NWD FINANCE (BVI) LTD 浮息债券 2049年12月31 日	800,000	637,662	0.03
NWD MTN LTD 3.75% 2031年1月14日	2,350,000	1,819,237	0.07
SJM INTERNATIONAL LTD 6.5% 2031年1月15日	4,000,000	3,976,108	0.16
		66,228,477	2.64
开曼群岛			
阿里巴巴集团控股 0% 2032年9月15日	11,400,000	12,800,319	0.51
华润置地有限公司 4.125% 2028年11月20日	17,091,000	17,080,737	0.68
EHI CAR SERVICES LTD 12% 2027年9月26日	4,900,000	3,035,523	0.12
富卫集团 5.836% 2035年9月22日	3,752,000	3,801,226	0.15
富卫集团有限公司 5.252% 2030年9月22日	9,100,000	9,158,804	0.37
快手科技 4.75% 2036年1月22日	15,730,000	15,427,088	0.62
快手科技有限公司 4.125% 2031年1月22日	25,849,000	25,693,389	1.02

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)			
开曼群岛(续)			
LINK FINANCE CAYMAN 2009 4.875% 2036 年 2 月 2 日	17,299,000	17,222,149	0.69
龙湖集团控股有限公司 3.85% 2032 年 1 月 13 日	800,000	622,650	0.02
美团 3.1% 2035 年 11 月 5 日	48,350,000	6,853,726	0.27
五矿资本与证券 2049 年 12 月 31 日	7,769,000	7,799,629	0.31
SHUI ON DEVELOPMENT HOLDING 9.75% 2029 年 1 月 26 日	3,950,000	4,008,934	0.16
融创中国控股有限公司 0% 2028 年 6 月 23 日	622,912	148,720	0.01
		<u>123,652,894</u>	<u>4.93</u>
中国内地			
AAC 瑞声声学科技控股 3.75% 2031 年 6 月 2 日	10,881,000	10,369,446	0.41
安徽省交通控股集团(香港) 1.618% 2026 年 8 月 26 日	5,212,000	5,131,610	0.21
国银金融租赁 2035 年 11 月 10 日	8,928,000	8,973,613	0.36
CFAMC IV CO LTD 4.5% 2029 年 5 月 29 日	5,850,000	5,835,176	0.23
中铝香港投资 2.1% 2026 年 7 月 28 日	2,467,000	2,445,855	0.10
CHINA CINDA 2020 I MNGMN 3% 2031 年 1 月 20 日	1,950,000	1,821,865	0.07
CHINA CINDA 2020 I MNGMN 3.125% 2030 年 3 月 18 日	6,700,000	6,379,124	0.25
CHINA CINDA FINANCE 2017 4.75% 2028 年 2 月 8 日	9,100,000	9,202,557	0.37
中国农化(香港)峰桥有限公司 3.7% 2050 年 9 月 22 日	2,300,000	1,751,988	0.07
中国农化(香港)峰桥有限公司 5.125% 2028 年 3 月 14 日	12,882,000	13,130,043	0.52
CNOOC FINANCE 2013 LTD 3.3% 2049 年 9 月 30 日	4,000,000	3,062,284	0.12

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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(续)			
CNOOC FINANCE 2013 LTD 4.25% 2043年5月9日	5,300,000	4,851,421	0.19
时代瑞鼎发展 1.5% 2026年9月9日	600,000	590,709	0.02
广州高新区投资集团 4.5% 2028年7月7日	14,030,000	14,066,569	0.56
普洛斯中国控股有限公司 2.95% 2026年3月29日	5,673,000	5,630,572	0.22
HUARONG FINANCE 2019 3.375% 2030年2月24日	683,000	650,215	0.03
HUARONG FINANCE 2019 3.625% 2030年9月30日	815,000	779,491	0.03
联想集团有限公司 3.421% 2030年11月2日	4,960,000	4,721,746	0.19
联想集团有限公司 6.536% 2032年7月27日	3,200,000	3,505,853	0.14
龙湖集团控股有限公司 3.375% 2027年4月13日	524,000	500,481	0.02
龙湖集团控股有限公司 3.95% 2029年9月16日	3,078,000	2,570,793	0.10
龙湖地产 4.5% 2028年1月16日	9,162,000	8,508,562	0.34
美团 4.5% 2028年4月2日	3,040,000	3,055,305	0.12
美团 S 条例债券系列 3.05% 2030年10月28日	4,198,000	3,929,085	0.16
美团 S 条例债券系列 4.625% 2029年10月2日	1,871,000	1,885,026	0.08
力高地产集团 9.9% 2024年2月17日(可能违约)	3,598,000	-	-
RONGSHI INTERNATIONAL FINANCE LTD 3.75% 2029年5月21日	2,800,000	2,779,713	0.11
SF HOLDING INVESTMENT LTD 2.875% 2030年2月 20日	9,447,000	8,975,651	0.36
深圳高速公路集团股份有限公司 1.75% 2026年7月8 日	792,000	782,908	0.03

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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(续)			
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT (2018) LTD 2.7% 2030年5月13日	9,850,000	9,386,213	0.37
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT (2018) LTD 2.95% 2029年11月12日	9,660,000	9,345,765	0.37
腾讯控股有限公司 3.24% 2050年6月3日	6,854,000	4,928,369	0.20
腾讯控股有限公司 3.29% 2060年6月3日	2,512,000	1,714,043	0.07
腾讯控股有限公司 3.575% 2026年4月11日	5,000,000	4,994,935	0.20
腾讯控股有限公司 3.595% 2028年1月19日	9,660,000	9,612,806	0.38
腾讯控股有限公司 3.68% 2041年4月22日	6,530,000	5,503,631	0.22
腾讯控股有限公司 3.84% 2051年4月22日	4,560,000	3,639,929	0.15
腾讯控股有限公司 3.925% 2038年1月19日	5,595,000	5,188,053	0.21
腾讯控股有限公司 3.975% 2029年4月11日	13,200,000	13,236,168	0.53
腾讯控股有限公司 4.525% 2049年4月11日	2,800,000	2,519,131	0.10
腾讯控股有限公司 S 条例债券 3.94% 2061年4月22 日	2,090,000	1,629,037	0.07
腾讯音乐娱乐集团 2% 2030年9月3日	5,570,000	5,065,352	0.20
XIAOMI BEST TIME INTL S 条例债券系列 2.875% 2031年7月14日	6,490,000	6,003,555	0.24
中升集团 5.98% 2028年1月30日	3,773,000	3,805,516	0.15
		222,460,164	8.87

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)			
中国香港			
友邦保险控股有限公司 4.95% 2035年3月30日	9,660,000	9,699,075	0.39
友邦保险控股有限公司 5.375% 2034年4月5日	8,690,000	8,979,455	0.36
友邦保险控股有限公司 5.4% 2054年9月30日	5,582,000	5,341,787	0.21
香港机场管理局 3.5% 2062年1月12日	8,500,000	6,432,048	0.26
阿里巴巴集团控股 0.5% 2031年6月1日	831,000	1,460,549	0.05
阿里巴巴集团控股 2.7% 2041年2月9日	3,750,000	2,771,743	0.11
阿里巴巴集团控股 3.15% 2051年2月9日	10,169,000	6,923,131	0.28
阿里巴巴集团控股 3.25% 2061年2月9日	9,740,000	6,359,465	0.25
阿里巴巴集团控股 4% 2037年12月6日	1,050,000	965,053	0.04
阿里巴巴集团控股 4.2% 2047年12月6日	5,407,000	4,525,140	0.18
阿里巴巴集团控股 4.4% 2057年12月6日	5,600,000	4,668,672	0.19
阿里巴巴集团控股 5.625% 2054年11月26日	250,000	254,657	0.01
东亚银行有限公司 浮息债券 2027年3月13日	3,750,000	3,758,850	0.15
东亚银行有限公司 浮息债券 2032年4月22日	8,117,000	8,119,687	0.32
东亚银行有限公司 浮息债券 2034年6月27日	3,005,000	3,173,580	0.13
茂欣有限公司 2.2% 2030年10月21日	5,790,000	5,305,939	0.21
CELESTIAL DYNASTY LTD 6.375% 2028年8月22日	7,232,000	7,250,638	0.29
CFAMC III CO LTD 4.75% 2027年4月27日	4,830,000	4,852,998	0.19
CFAMC III CO. LTD 4.25% 2027年11月7日	9,984,000	9,954,772	0.40
CHARMING LIGHT INVST LTD 4.375% 2027年12月 21日	2,865,000	2,876,310	0.11

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)			
中国香港(续)			
CHINA CINDA 2020 I MNGMN 5.5% 2030年1月23日	5,800,000	6,014,159	0.24
CHINA CINDA 2020 I MNGMN 5.75% 2029年5月28日	8,360,000	8,748,953	0.35
中国蒙牛乳业有限公司 2% 2030年7月30日	105,040,000	14,840,389	0.59
中国蒙牛乳业有限公司 2.3% 2035年7月30日	43,360,000	6,013,609	0.24
CHINA OVERSEAS FIN.VI 6.45% 2034年6月11日	10,101,000	10,943,156	0.44
CHINA OVERSEAS FINANCE (CAYMAN) VIII LTD 3.05% 2029年11月27日	800,000	757,980	0.03
华润置地有限公司 4.125% 2029年2月26日	250,000	248,474	0.01
CK HUTCHISON INTERNATIONAL (20) LTD 3.125% 2041年4月15日	7,730,000	6,000,737	0.24
CK HUTCHISON INTERNATIONAL (24) LTD 5.5% 2034年4月26日	22,370,000	23,305,894	0.93
CK HUTCHISON INTERNATIONAL 4.75% 2034年9月13日	14,043,000	13,934,012	0.56
中华电力有限公司 浮息永续债券 2049年12月31日	17,960,000	18,694,115	0.75
CN OVERSEAS FIN KY VIII 2.75% 2030年3月2日	730,000	680,684	0.03
CN OVERSEAS FIN KY VIII 3.45% 2029年7月15日	200,000	193,346	0.01
ELECT GLOBAL INVESTMENT LTD 2049年12月31日	20,406,000	21,598,873	0.86
远东宏信有限公司 5.875% 2028年3月5日	13,080,000	13,316,284	0.53
远东宏信有限公司 6% 2028年10月1日	1,933,000	1,992,856	0.08
远东宏信有限公司 6.625% 2027年4月16日	4,956,000	5,065,812	0.20
FEC FINANCE LTD 2049年12月31日	3,950,000	2,970,075	0.12

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)			
中国香港(续)			
FORTUNE STAR BVI LTD 5.05% 2027年1月27日	9,180,000	9,024,179	0.36
FORTUNE STAR BVI LTD 8.5% 2028年5月19日	968,000	1,001,195	0.04
FRANSHION BRILLIANT LTD 3.2% 2026年4月9日	23,436,000	23,356,142	0.93
富卫集团 7.635% 2031年7月2日	4,621,000	5,139,864	0.20
普洛斯中国控股有限公司 7.75% 2029年4月30日	12,000,000	11,715,384	0.47
GREAT WALL INTERNATIONAL V LTD 2.375% 2030年8月18日	5,531,000	5,053,036	0.20
HKT CAPITAL NO 6 LTD 3% 2032年1月18日	8,371,000	7,735,788	0.31
香港特别行政区 3.625% 2028年11月12日	3,771,000	3,786,009	0.15
香港按揭证券有限公司 3.88% 2055年11月25日	161,000,000	20,568,365	0.82
HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD 2.25% 2030年6月9日	6,637,000	6,140,240	0.24
HUTCHISON WHAMPOA INTERNATIONAL LIMITED 7.45% 2033年11月24日到期 (S 条例债券系列)	2,800,000	3,265,982	0.13
JINKAI INVESTMENT HOLDING 0% 2031年2月5日	3,900,000	3,924,375	0.16
JOY TRSR ASSETS HOLDING 5.75% 2029年6月6日	12,094,000	12,610,190	0.50
LI & FUNG LTD 8.375% 2029年2月5日	3,471,000	3,628,170	0.14
香港铁路有限公司 5.25% 2055年4月1日	13,626,000	13,632,786	0.54
NAN FUNG TREASURY LTD 3.625% 2030年8月27日	4,941,000	4,661,698	0.19
NAN FUNG TREASURY LTD 3.875% 2027年10月3日	6,430,000	6,365,796	0.25
NAN FUNG TREASURY LTD 5% 2028年9月5日	14,013,000	14,122,778	0.56
南洋商业银行浮息债券 2034年8月6日	14,323,000	14,849,793	0.59
NWD FINANCE (BVI) LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	10,840,000	8,431,693	0.34
NWD MTN LTD 4.125% 2029年7月18日	9,917,000	8,321,464	0.33
NWD MTN LTD 4.5% 2030年5月19日	1,918,000	1,585,372	0.06

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)			
中国香港(续)			
STUDIO CITY FINANCE LTD 5% 2029年1月15日	3,600,000	3,490,492	0.14
SWIRE PACIFIC MTN FINANCE 4.625% 2032年8月 28日	2,471,000	2,520,286	0.10
港华燃气(融资)有限公司 4% 2027年4月26日	3,750,000	3,742,468	0.15
		457,666,502	18.24
印度			
印度进出口银行 5.75% 2056年1月12日	5,574,000	5,646,557	0.23
HDFC BANK LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	2,840,000	2,820,140	0.11
HPCL-MITTAL ENERGY LTD 5.25% 2027年4月28日	1,500,000	1,500,107	0.06
IRB INFRASTRUCTURE DEVE 7.11% 2032年3月11 日	3,780,000	3,950,073	0.16
MUTHOOT FINANCE LTD 5.75% 2030年8月4日	8,022,000	8,020,396	0.32
MUTHOOT FINANCE LTD 6.375% 2030年3月2日	6,305,000	6,471,717	0.26
OIL & NATURAL GAS CORPORATION 3.375% 2029年 12月5日	345,000	332,527	0.01
PIRAMAL CAPITAL & HOUSING 7.8% 2028年1月29 日	3,343,000	3,446,523	0.14
REC LIMITED 4.75% 2029年9月27日	15,221,000	15,396,757	0.61
RELIANCE INDUSTRIES LTD 2.875% 2032年1月12 日	21,369,000	19,463,633	0.78
RELIANCE INDUSTRIES LTD 3.625% 2052年1月12 日	6,244,000	4,551,739	0.18
RELIANCE INDUSTRIES LTD 6.25% 2040年10月19 日	1,000,000	1,105,494	0.04
SAMMAAN CAPITAL LTD 7.5% 2030年10月16日	10,115,000	10,215,214	0.41
SAMMAAN CAPITAL LTD 8.95% 2028年8月28日	17,078,000	17,909,459	0.71

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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(续)			
SHRIRAM FINANCE LTD 6.625% 2027年4月22日	20,982,000	21,451,661	0.85
TATA CAPITAL LTD 5.389% 2028年7月21日	18,650,000	19,030,423	0.76
TML HOLDINGS PTE LTD 4.35% 2026年6月9日	1,145,000	1,144,028	0.05
UPL CORP LTD 4.5% 2028年3月8日	7,180,000	7,036,364	0.28
UPL CORP LTD 4.625% 2030年6月16日	8,335,000	7,965,934	0.32
VARANASI AURA NH-2 TOLL 5.9% 2034年2月28日	6,605,000	6,901,655	0.27
		164,360,401	6.55
印度尼西亚			
BANK BUKOPIN PT 5.658% 2027年10月30日	22,310,000	22,582,193	0.90
BANK MANDIRI (PERSERO) TBK PT 2% 2026年4月 19日	1,785,000	1,776,288	0.07
BANK NEGARA INDONESIA 浮息永续债券 2049年 12月31日	3,000,000	2,945,955	0.12
CIKARANG LISTRINDO 5.65% 2035年3月12日	1,250,000	1,273,933	0.05
FREEPORT INDONESIA PT 6.2% 2052年4月14日	12,476,000	12,721,815	0.51
FREEPORT INDONESIA PT S 条例债券 5.315% 2032年 4月14日	13,290,000	13,549,461	0.54
GARUDA INDONESIA 6.5% 2031年12月28日	8,790,000	9,455,967	0.38
INDOFOOD CBP SUKSES MAKM 3.398% 2031年6月 9日	10,960,000	10,272,523	0.41
印度尼西亚(共和国) 4.3% 2052年3月31日	4,090,000	3,317,718	0.13
印度尼西亚(共和国) 4.45% 2070年4月15日	4,580,000	3,587,663	0.14
印度尼西亚(共和国) 5.2% 2035年7月23日	12,254,000	12,384,199	0.49
印度尼西亚(共和国) 5.65% 2053年1月11日	16,420,000	16,261,481	0.65
印度尼西亚(共和国) 5.95% 2046年1月8日	4,090,000	4,281,821	0.17
印度尼西亚(共和国) 6.625% 2037年2月17日	7,190,000	8,093,582	0.32

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)			
印度尼西亚(共和国) 7.75% 2038年1月17日	7,190,000	8,891,456	0.35
印度尼西亚(共和国) 8.5% 2035年10月12日	7,190,000	9,122,880	0.36
印度尼西亚 5.15% 2054年9月10日	12,300,000	11,601,483	0.47
印度尼西亚共和国(政府) 3.05% 2051年3月12日	26,070,000	16,849,784	0.67
印度尼西亚共和国(政府) 3.2% 2061年9月23日	5,633,000	3,489,322	0.14
印度尼西亚共和国(政府) 3.55% 2051年6月9日	11,672,000	8,338,185	0.33
印度尼西亚共和国(政府) 3.7% 2049年10月30日	17,340,000	12,849,183	0.51
印度尼西亚共和国(政府) 4.2% 2050年10月15日	15,340,000	12,290,799	0.49
印度尼西亚共和国(政府) 4.7% 2034年2月10日	11,400,000	11,275,717	0.45
印度尼西亚共和国(政府) 4.75% 2047年7月18日	6,570,000	6,010,105	0.24
印度尼西亚共和国(政府) 5.5% 2054年7月2日	9,310,000	9,169,214	0.37
JABABEKA INTERNATIONAL STP 2027年12月15日	11,970,000	11,999,925	0.48
JAPFA COMFEED TBK PT 5.375% 2026年3月23日	4,260,000	4,262,773	0.17
KRAKATAU POSCO PT 6.375% 2027年6月11日	7,615,000	7,756,254	0.31
LLPL CAPITAL PTE LTD 6.875% 2039年2月4日	28,296,000	20,655,924	0.82
MAJAPAHIT HOLDING BV S 条例债券 7.875% 2037 年6月29日	5,000,000	5,995,420	0.24
MINEJESA CAPITAL BV 5.625% 2037年8月10日	12,039,000	11,898,457	0.47
PERTAMINA (PERSERO) 5.625% 2043年5月20日	350,000	335,322	0.01
PERTAMINA (PERSERO) PT 2.3% 2031年2月9日	5,606,000	4,975,432	0.20
PERTAMINA (PERSERO) PT 4.175% 2050年1月21日	4,900,000	3,743,551	0.15

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)			
PERTAMINA (PERSERO) PT 4.7% 2049年7月30日	950,000	787,736	0.03
PERTAMINA (PERSERO) PT 6.5% 2048年11月7日	13,230,000	13,891,103	0.55
PERTAMINA 6.5% 2041年5月27日	8,290,000	8,798,873	0.35
PERTAMINA PERSERO 6.45% 2044年5月30日	7,620,000	8,005,343	0.32
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 4% 2050年6月30日	6,790,000	4,931,516	0.20
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 4.875% 2049年7月 17日	3,900,000	3,278,633	0.13
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 5.25% 2047年5月15 日	5,880,000	5,250,170	0.21
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 6.15% 2048年5月21 日	5,790,000	5,761,038	0.23
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 6.25% 2049年1月25 日	2,730,000	2,761,193	0.11
PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 5.25% 2042年10月 24日	5,673,000	5,185,752	0.21
PERUSAHAAN PENERBIT SBSN 5.65% 2054年11月 25日	10,790,000	10,728,497	0.43
PT INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM AND PT MINERAL INDUSTRI INDONESIA (PERSERO) 5.45% 2030年5月15日	6,540,000	6,753,243	0.27
PT PAKUWON JATI 4.875% 2028年4月29日	13,381,000	13,105,445	0.52
		393,254,327	15.67
日本			
第一生命控股浮息永续债券 2049年12月31日	15,213,000	15,790,729	0.63
富国生命保险相互会社 2049年12月31日	7,611,000	8,211,911	0.33
明治安田生命保险浮息债券 2055年6月11日	692,000	712,608	0.03
明治安田生命保险浮息债券 2054年9月11日	5,227,000	5,292,620	0.21
NTT FINANCE CORPORATION 5.502% 2035年7月16 日	14,755,000	15,247,625	0.61

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)			
日本(续)			
软银集团 2061年4月29日	9,037,000	8,413,275	0.33
三井住友信托银行浮息债券 2036年9月11日	2,945,000	2,958,044	0.12
三井住友金融集团浮息永续债券 2049年12月31日	1,982,000	2,048,268	0.08
		<u>58,675,080</u>	<u>2.34</u>
泽西岛			
中国西部水泥有限公司 9.9% 2028年12月4日	2,900,000	2,901,177	0.12
卢森堡			
MC BRAZIL DWNSTRM 7.25% 2031年6月30日	1,424,000	1,146,132	0.05
MONGOLIAN MINING CORPORATION 8.44% 2030年 4月3日	8,250,000	8,534,398	0.34
		<u>9,680,530</u>	<u>0.39</u>
中国澳门			
MELCO RESORTS FINANCE 5.75% 2028年7月21日	1,800,000	1,801,375	0.07
MELCO RESORTS FINANCE 7.625% 2032年4月17日	301,000	315,864	0.01
金沙中国有限公司 3.1% 2029年3月8日	7,770,000	7,411,974	0.30
金沙中国有限公司 3.25% 2031年8月8日	1,640,000	1,519,136	0.06
金沙中国有限公司预发行 4.375% 2030年6月18日	16,140,000	15,888,103	0.63
金沙中国有限公司预发行 5.4% 2028年8月8日预发行	5,921,000	6,038,609	0.24
		<u>32,975,061</u>	<u>1.31</u>

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)			
马来西亚			
AFFIN BANK 5.112% 2030年6月4日	8,626,000	8,819,175	0.35
GOHL CAPITAL LTD 4.25% 2027年1月24日	26,458,000	26,348,967	1.05
PETRONAS CAPITAL LTD 3.404% 2061年4月28日	9,124,000	6,151,072	0.24
PETRONAS CAPITAL LTD 4.5% 2045年3月18日	4,900,000	4,343,517	0.17
PETRONAS CAPITAL LTD 4.55% 2050年4月21日	21,630,000	18,971,327	0.76
PETRONAS CAPITAL LTD 4.8% 2060年4月21日	3,800,000	3,417,680	0.14
		<u>68,051,738</u>	<u>2.71</u>
墨西哥			
墨西哥(合众国) 4.4% 2052年2月12日	9,600,000	6,970,080	0.28
墨西哥(合众国) 6.338% 2053年5月4日	9,600,000	9,125,280	0.36
ORBIA ADVANCE CORP 7.5% 2035年5月13日	4,330,000	4,336,789	0.17
		<u>20,432,149</u>	<u>0.81</u>
蒙古			
蒙古国乌兰巴托市 7.75% 2027年8月21日	7,590,000	7,810,581	0.31
GOLOMT BANK OF MONGOLIA 11% 2027年5月20日	11,858,000	12,346,253	0.49
		<u>20,156,834</u>	<u>0.80</u>

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)			
荷兰			
MINEJESA CAPITAL BV 4.625% 2030年8月10日	4,150,000	2,984,868	0.12
PROSUS NV 4.987% 2052年1月19日	15,510,000	12,454,414	0.50
STAR ENERGY CO ISSUE 4.85% 2038年10月14日	18,980,000	18,418,078	0.73
		<u>33,857,360</u>	<u>1.35</u>
新西兰			
ASB BANK LIMITED 4.155% 2030年10月29日	7,949,000	7,927,629	0.32
巴基斯坦			
巴基斯坦伊斯兰共和国 6.875% 2027年12月5日	6,152,000	6,254,997	0.25
巴基斯坦伊斯兰共和国 7.875% 2036年3月31日	300,000	300,535	0.01
巴基斯坦(共和国) 6% 2026年4月8日	7,966,000	7,962,550	0.32
巴基斯坦(共和国) 7.375% 2031年4月8日	4,300,000	4,330,214	0.17
		<u>18,848,296</u>	<u>0.75</u>
菲律宾			
BDO UNIBANK INC 4.375% 2030年12月3日	6,995,000	7,027,153	0.28
菲律宾开发银行 2.375% 2031年3月11日	2,855,000	2,608,626	0.10
GLOBE TELECOM INC 浮息永续债券 2049年12月 31日	6,170,000	6,137,287	0.24
PETRON CORP 2049年12月31日	3,769,000	3,867,118	0.15
菲律宾(共和国) 3.2% 2046年7月6日	12,560,000	8,907,853	0.36
菲律宾(共和国) 4.2% 2047年3月29日	26,370,000	21,746,601	0.87

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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(续)			
菲律宾(共和国) 5.175% 2049年9月5日	22,210,000	20,949,149	0.84
菲律宾(共和国) 5.6% 2049年5月14日	5,790,000	5,778,333	0.23
菲律宾(共和国) 2.65% 2045年12月10日	13,180,000	8,615,898	0.34
菲律宾共和国(政府) 2.95% 2045年5月5日	46,006,000	31,878,961	1.27
菲律宾共和国 5.9% 2050年2月4日	17,480,000	18,216,922	0.73
SAN MIGUEL GLOBAL POWER 2049年12月31日	1,300,000	1,320,594	0.05
SAN MIGUEL GLOBAL POWER 浮息永续债券 2049年12月31日	19,502,000	19,800,917	0.79
		<u>156,855,412</u>	<u>6.25</u>
沙特阿拉伯			
沙特阿拉伯国家石油公司 3.25% 2050年11月24日	2,931,000	1,910,518	0.08
沙特阿拉伯国家石油公司 4.375% 2049年4月16日	1,900,000	1,552,300	0.06
		<u>3,462,818</u>	<u>0.14</u>
新加坡			
中银航空租赁有限公司 3.5% 2027年9月18日	3,500,000	3,477,488	0.14
CLEAN RENEWABLE POWER 4.25% 2027年3月25日	1,530,000	1,160,280	0.05
FUBON LIFE SINGA 5.45% 2035年12月10日	23,599,000	23,815,957	0.95
GLP PTE LTD 2049年12月31日	2,046,000	1,441,953	0.06
GLP PTE LTD 9.75% 2028年5月20日	6,300,000	6,448,362	0.26
GLP PTE LTD 浮息永续债券 2049年12月31日	1,900,000	1,407,628	0.06

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)			
新加坡(续)			
HPHT FINANCE 21 II LTD (BR) 1.5% 2026年9月17日	8,000,000	7,882,456	0.31
HPHT FINANCE LTD 5% 2030年2月21日	12,435,000	12,646,476	0.50
MEDCO MAPLE TREE PTE LTD 8.96% 2029年4月27日	12,423,000	12,989,476	0.52
MINOR INTERNATIONAL PCL 2.7% 永续债券 2049年12月31日	650,000	642,999	0.02
NANSHAN LIFE PTE LTD 2041年3月17日	2,372,000	2,378,746	0.09
华侨银行有限公司 2035年9月8日	26,134,000	26,018,161	1.04
SMPHI SG HOLDING 4.75% 2030年9月16日	4,176,000	4,188,399	0.17
TEMASEK FINANCIAL (I) LTD 2.55% 2055年7月30日	18,730,000	2,564,130	0.10
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.05% 2035年7月30日	44,910,000	6,290,563	0.25
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.25% 2051年4月6日	3,600,000	2,191,468	0.09
		115,544,542	4.61
韩国			
佳施加德士株式会社 4.25% 2030年10月28日	7,521,000	7,451,829	0.30
韩亚银行 3.25% 2027年3月30日	10,423,000	10,342,514	0.41
韩华生命保险浮息债券 2032年2月4日	12,200,000	12,050,861	0.48
HYUNDAI ASSAN OTOMOTIV 1.625% 2026年7月12日	8,500,000	8,401,561	0.34
国民银行 2.5% 2030年11月4日	1,910,000	1,739,754	0.07
国民银行 4.375% 2028年5月8日	4,798,000	4,848,816	0.19
国民银行 4.625% 2030年5月8日	4,575,000	4,672,720	0.19
韩国石油公社 2.125% 2027年4月18日	7,424,000	7,261,422	0.29

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)			
韩国(续)			
大韩航空 4% 2030年9月30日	11,469,000	11,355,778	0.45
KT CORP 2.5% 2026年7月18日	2,000,000	1,986,109	0.08
LG CHEM LTD 2.375% 2031年7月7日	4,000,000	3,566,600	0.14
LG 新能源 5.875% 2035年4月2日	4,700,000	4,871,005	0.19
LG 新能源 5.5% 2034年7月2日	854,000	879,094	0.04
LG 新能源 5.75% 2028年9月25日	6,770,000	7,015,236	0.28
LG 新能源 5.375% 2030年4月2日	2,750,000	2,836,402	0.11
大韩民国 3.625% 2030年10月29日	7,824,000	7,745,185	0.31
新韩银行 4% 2029年4月23日	3,004,000	2,975,555	0.12
新韩银行 4.375% 2032年4月13日	5,000,000	4,951,620	0.20
新韩金融集团 2049年12月31日	3,150,000	3,132,979	0.12
SK 海力士 6.5% 2033年1月17日	26,420,000	29,234,681	1.17
友利银行 2049年12月31日	27,844,000	28,956,201	1.15
		<u>166,275,922</u>	<u>6.63</u>
斯里兰卡			
斯里兰卡共和国 2038年2月15日	100,000	99,141	-
斯里兰卡共和国 2030年1月15日	490,840	484,843	0.02
斯里兰卡共和国 2035年6月15日	6,264,984	5,144,404	0.21
斯里兰卡共和国 4% 2028年4月15日	6,291,242	4,492,391	0.18
斯里兰卡共和国 STP 2033年3月15日	825,073	758,135	0.03
斯里兰卡共和国 STP 2036年5月15日	2,560,000	2,531,459	0.10
		<u>13,510,373</u>	<u>0.54</u>

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)			
瑞士			
CHUBB INA HOLDINGS LLC 3.05% 2055年8月6日	79,510,000	11,137,617	0.44
中国台湾			
CATHAYLIFE SINGAPORE 浮息债券 2039年9月5日	2,327,000	2,354,111	0.09
NANSHAN LIFE PTE LTD 5.45% 2034年9月11日	13,400,000	13,245,639	0.53
SHIN KONG LIFE SINGAPORE PTE 6.95% 2035年6月26日	1,410,000	1,507,171	0.06
TSMC ARIZONA CORP 1.75% 2026年10月25日	3,369,000	3,316,898	0.13
TSMC ARIZONA CORP 4.5% 2052年4月22日	3,200,000	3,018,382	0.12
		<u>23,442,201</u>	<u>0.93</u>
泰国			
盘谷银行香港分行浮息债券 2040年3月25日	7,653,000	7,835,861	0.31
盘古银行大众有限公司(香港分行) 3.733% 2034年9月25日	9,700,000	9,263,063	0.37
GC TREASURY CENTRE 2049年12月31日	7,507,000	7,587,430	0.30
GC TREASURY CENTRE CO LTD 2.98% 2031年3月18日	3,600,000	3,278,988	0.13
GC TREASURY CENTRE CO LTD 2049年12月31日	1,986,000	2,039,304	0.08
KRUNG THAI BANK/CAYMAN 4.4% 永续债券 2049年12月31日	2,648,000	2,647,206	0.11
MUANGTHAI CAPITAL PCL 6.875% 2028年9月30日	7,368,000	7,507,462	0.30
THAIOIL TRSRY CENTER 2.5% 2030年6月18日	4,000,000	3,642,948	0.14

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)			
泰国(续)			
THAIOIL TRSRY CENTER 3.75% 2050年6月18日	1,900,000	1,402,752	0.06
THAIOIL TRSRY CENTER LTD 2049年12月31日	5,773,000	5,799,114	0.23
		<u>51,004,128</u>	<u>2.03</u>
阿拉伯联合酋长国			
FIRST ABU DHABI BANK LTD 2049年12月31日	17,980,000	18,181,700	0.72
英国			
BIOCON BIOLOGICS GLOBAL 6.67% 2029年10月9日	5,424,000	5,511,364	0.22
VEDANTA RESOURCES 10.25% 2028年6月3日	5,094,000	5,289,999	0.21
VEDANTA RESOURCES 10.875% 2029年9月17日	325,000	348,321	0.01
VEDANTA RESOURCES 9.125% 2032年10月15日	18,131,000	19,006,437	0.76
		<u>30,156,121</u>	<u>1.20</u>
美国			
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 1.8% 2028年1月10日	8,660,000	8,287,962	0.33
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 2.1% 2028年9月15日	7,854,000	7,453,383	0.30
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 4.75% 2031年9月26日	8,000,000	8,048,848	0.32
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.3% 2030年1月8日	5,000,000	5,155,338	0.20
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.35% 2029年3月19日	14,490,000	14,937,944	0.60

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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)			
美国(续)			
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.4% 2031年6月24日	5,000,000	5,183,538	0.21
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.7% 2030年6月26日	5,000,000	5,242,173	0.21
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 6.2% 2030年9月21日	6,000,000	6,417,915	0.26
拉斯维加斯金沙集团 3.9% 2029年8月8日	3,295,000	3,213,076	0.13
拉斯维加斯金沙集团 6% 2029年8月15日	6,390,000	6,663,677	0.27
拉斯维加斯金沙集团 6.2% 2034年8月15日	3,500,000	3,643,748	0.14
MOMENTIVE PERFORMANCE MATERIALS INC 4.125% 2028年10月22日	15,320,000	15,287,705	0.61
		<u>89,535,307</u>	<u>3.58</u>
未上市但有报价的投资			
印度			
MUTHOOT FINANCE LTD 6.375% 2029年4月23日	1,838,000	1,881,772	0.07
MUTHOOT FINANCE LTD 7.125% 2028年2月14日	14,572,000	14,934,041	0.60
		<u>16,815,813</u>	<u>0.67</u>
债务证券(合计)		<u>2,461,289,270</u>	<u>98.10</u>

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

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			
卢森堡			
HSBC INVESTMENT FUNDS LUXEMBOURG SA/LUXEMBOURG-HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS-RMB FIXED INCOME	255,294	3,258,320	0.13
HSBC INVESTMENT FUNDS LUXEMBOURG SA/LUXEMBOURG-HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS	2,104,676	16,885,814	0.68
HSBC INVESTMENT FUNDS LUXEMBOURG SA/LUXEMBOURG-HSBC-ASIAN CURRENCIES BD-ZD*	3,525,295	27,148,300	1.08
		<u>47,292,434</u>	<u>1.89</u>
未上市但有报价的投资			
中国香港			
汇丰全方位中国债券基金 ZC-美元	1,216,531	15,314,903	0.61
		<u>62,607,337</u>	<u>2.50</u>
单位信托(合计)			
衍生资产			
外币远期合同		1,255,057	0.05
期货合同		639,685	0.03
		<u>2,525,791,349</u>	<u>100.68</u>
金融资产合计			

投资组合报表(续)

汇丰亚洲债券基金

2026年1月31日

	持仓量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
金融负债			
衍生负债			
外币远期合同		(1,326,870)	(0.05)
期货合同		(903,736)	(0.04)
互换		(14,682,160)	(0.59)
金融负债合计		<u>(16,912,766)</u>	<u>(0.68)</u>
净投资总额			
(投资成本合计: 2,498,183,676 美元)		2,508,878,583	100.00
其他负债净值		<u>(21,251)</u>	<u>(0.00)</u>
资产净值总额		<u>2,508,857,332</u>	<u>100.00</u>

* 投资基金未在香港获得认可，不向香港公众发行。

投资组合变动表

汇丰亚洲债券基金

2025年8月1日起至2026年1月31日止期间

	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	97.43	96.30
未上市但有报价的投资	0.67	2.55
债务证券(合计)	<u>98.10</u>	<u>98.85</u>
单位信托		
上市投资	1.89	0.79
未上市但有报价的投资	0.61	0.21
单位信托(合计)	<u>2.50</u>	<u>1.00</u>
衍生资产		
外币远期合同	0.05	0.03
期货合同	0.03	0.02
	<u>0.08</u>	<u>0.05</u>
金融负债		
衍生负债		
外币远期合同	(0.05)	(0.11)
期货合同	(0.04)	(0.12)
信用违约互换	(0.59)	(0.62)
	<u>(0.68)</u>	<u>(0.85)</u>
投资总额	100.00	99.05
其他(负债)/资产净值	<u>(0.00)</u>	<u>0.95</u>
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：				
66,840,799 澳元	46,304,030 美元	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	518,153
2,221,440 澳元	1,538,905 美元	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	17,221
100,638 澳元	70,237 美元	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	262
49,550 澳元	34,513 美元	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	198
7,652,972 欧元	9,110,174 美元	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	4,625
2,385,285 英镑	3,267,078 美元	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	6,032
162,503 美元	1,127,293 离岸人民币	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	116
160,289 美元	1,111,934 离岸人民币	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	115
140,190 美元	972,508 离岸人民币	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	100
66,460 美元	461,067 离岸人民币	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	43
28,068 美元	194,638 离岸人民币	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	30
21,964 美元	152,308 离岸人民币	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	24

金融衍生工具明细表(续)

汇丰亚洲债券基金

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):				
27,479美元	190,636 离岸人民币	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	18
153,000,000 离岸人民币	21,861,557美元	2026年3月31日	摩根大通证券 伦敦分公司	224,096
32,000,000 离岸人民币	4,614,516美元	2026年3月31日	瑞银集团 伦敦分行	4,960
2,000,000 离岸人民币	288,423美元	2026年3月31日	摩根大通证券 伦敦分公司	294
19,220,000 欧元	22,448,652美元	2026年3月31日	瑞银集团 伦敦分行	478,770
				1,255,057
金融负债:				
81,309,947 离岸人民币	11,716,789美元	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	(4,066)
109,027,356 离岸人民币	15,710,877美元	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	(5,452)
2,085,581,075 离岸人民币	300,526,831美元	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	(98,252)
25,102美元	174,286 离岸人民币	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	(4)
40,029美元	277,928 离岸人民币	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	(6)

金融衍生工具明细表(续)

汇丰亚洲债券基金

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):				
101,275美元	144,722澳元	2026年2月27日	汇丰市场 财资服务香港	(107)
250,000,000 离岸人民币	36,104,191美元	2026年3月31日	道富银行和信托 公司香港分行	(14,216)
18,392,446美元	129,000,000 离岸人民币	2026年3月31日	汇丰市场 财资服务香港	(229,246)
27,194,194美元	23,060,000欧元	2026年3月31日	摩根大通证券 伦敦分公司	(316,407)
58,670,677美元	411,000,000 离岸人民币	2026年3月31日	汇丰市场 财资服务香港	(659,114)
				<u>(1,326,870)</u>

金融衍生工具明细表(续)

汇丰亚洲债券基金

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 10YR ULTRA FUT 20/03/2026	US 10YR NOTE	1000	(28,539,063)	多头	汇丰银行	318,125
US ULTRA BOND CBT 20/03/2026	US ULTRA BOND	1000	(8,220,625)	多头	汇丰银行	65,625
US ULTRA BOND CBT 20/03/2026	US ULTRA BOND	1000	(8,220,625)	多头	汇丰银行	70,000
US 2YR NOTE (CBT) 31/03/2026	US 2YR NOTE	2000	72,972,266	多头	汇丰银行	32,812
US 2YR NOTE (CBT) 31/03/2026	US 2YR NOTE	2000	145,944,532	多头	汇丰银行	153,123
						639,685
金融负债：						
US 10YR NOTE (CBT) 20/03/2026	US 10YR NOTE	1000	23,819,391	空头	汇丰银行	(159,751)
US 10YR NOTE (CBT) 20/03/2026	US 10YR NOTE	1000	5,032,266	空头	汇丰银行	(21,797)
US 10YR ULTRA FUT 20/03/2026	US 10YR NOTE	1000	28,539,063	空头	汇丰银行	(318,125)
US LONG BOND(CBT) 20/03/2026	US LONG BOND	1000	(17,268,750)	空头	汇丰银行	(79,688)
US LONG BOND(CBT) 20/03/2026	US LONG BOND	1000	(40,869,375)	空头	汇丰银行	(232,969)

金融衍生工具明细表(续)

汇丰亚洲债券基金

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
金融负债(续):						
US ULTRA BOND CBT 20/03/2026	US ULTRA BOND	1000	(10,334,500)	空头	汇丰银行	-
US 2YR NOTE (CBT) 31/03/2026	US 2YR NOTE	2000	145,944,532	空头	汇丰银行	(5,468)
US 2YR NOTE (CBT) 31/03/2026	US 2YR NOTE	2000	125,095,313	空头	汇丰银行	(42,187)
US 2YR NOTE (CBT) 31/03/2026	US 2YR NOTE	2000	145,944,532	空头	汇丰银行	(43,751)
						(903,736)

金融衍生工具明细表(续)

汇丰亚洲债券基金

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
(D) CREDIT DEFAULT SWAP~602~ 116 241,750,000.00 USD 31/10/2025 20/12/2030	巴克莱银行	(14,682,160)
		<u>(14,682,160)</u>

业绩表现记录

汇丰亚洲债券基金

(a) 价格记录(交易份额净值)

年份	AC 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2016	11.925	12.874	12.294	13.272
2017	12.416	13.028	13.028	13.420
2018	12.724	13.193	13.118	13.601
2019	12.699	14.007	12.730	14.007
2020	12.991	15.093	12.991	15.093
2021	14.913	15.364	14.913	15.364
2022	12.549	15.257	12.549	15.257
2023	11.654	12.851	11.654	12.851
2024	12.093	13.355	12.093	13.355
2025	13.282	14.059	13.282	14.059
2025年8月1日至2026年1月31日	14.115	14.555	14.115	14.555

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	9.990	10.502	10.300	10.828
2017	10.000	10.560	10.300	10.886
2018	9.762	10.413	10.060	10.734
2019	9.565	10.234	9.587	10.234
2020	9.493	10.591	9.493	10.591
2021	10.159	10.548	10.159	10.548
2022	8.195	10.306	8.195	10.306
2023	7.473	8.329	7.473	8.329
2024	7.324	7.814	7.324	7.814
2025	7.283	7.856	7.283	7.856
2025年8月1日至2026年1月31日	7.611	7.770	7.611	7.770

业绩表现记录(续)

(a) 价格记录(交易份额净值)(续)

年份	AM2 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2016	9.049	9.508	9.329	9.802
2017	9.049	9.566	9.263	9.862
2018	8.738	9.362	9.008	9.652
2019	8.585	9.187	8.601	9.187
2020	8.599	9.575	8.599	9.575
2021	9.189	9.562	9.189	9.562
2022	7.330	9.294	7.330	9.294
2023	6.685	7.453	6.685	7.453
2024	6.571	7.019	6.571	7.019
2025	6.595	7.087	6.595	7.087
2025年8月1日至2026年1月31日	6.854	7.020	6.854	7.020

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	9.564	10.035	9.860	10.344
2017	9.546	10.095	9.793	10.407
2018	9.229	9.890	9.514	10.195
2019	9.067	9.687	9.082	9.687
2020	9.048	10.100	9.048	10.100
2021	9.663	10.063	9.663	10.063
2022	7.695	9.769	7.695	9.769
2023	7.012	7.823	7.012	7.823
2024	6.886	7.338	6.886	7.338
2025	6.883	7.404	6.883	7.404
2025年8月1日至2026年1月31日	7.184	7.208	7.184	7.208

年份	AM3H 类 - 加元份额			
	买入		卖出	
	最低 加元	最高 加元	最低 加元	最高 加元
2024	9.590	22.628	9.590	22.628
2025	22.079	23.230	22.079	23.230

业绩表现记录(续)

(a) 价格记录(交易份额净值)(续)

年份	AM3H 类 - 欧元份额			
	买入		卖出	
	最低 欧元	最高 欧元	最低 欧元	最高 欧元
2016	9.567	10.026	9.864	10.336
2017	9.512	10.080	9.724	10.392
2018	9.116	9.807	9.398	10.111
2019	8.958	9.567	8.969	9.567
2020	8.927	9.975	8.927	9.975
2021	9.544	9.935	9.544	9.935
2022	7.600	9.656	7.600	9.656
2023	6.933	7.735	6.933	7.735
2024	6.807	7.225	6.807	7.225
2025	6.778	7.287	6.778	7.287
2025年8月1日至2026年1月31日	7.067	7.169	7.067	7.169

年份	AM3H 类 - 英镑份额			
	买入		卖出	
	最低 英镑	最高 英镑	最低 英镑	最高 英镑
2024	9.744	10.134	9.744	10.134
2025	9.586	10.311	9.586	10.311
2025年8月1日至2026年1月31日	10.072	10.143	10.072	10.143

年份	AM3H 类 - 人民币份额			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2021	9.808	10.231	9.808	10.231
2022	7.807	9.920	7.807	9.920
2023	7.110	7.934	7.110	7.934
2024	6.987	7.427	6.987	7.427
2025	6.982	7.492	6.982	7.492
2025年8月1日至2026年1月31日	7.278	7.288	7.278	7.288

年份	BC 类 - 港元份额			
	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2020	9.974	10.500	9.974	10.500
2021	10.393	10.692	10.393	10.692
2022	8.839	10.655	8.839	10.655
2023	8.209	9.044	8.209	9.044
2024	8.549	9.261	8.549	9.261
2025	9.244	9.902	9.244	9.902
2025年8月1日至2026年1月31日	9.942	10.146	9.942	10.146

业绩表现记录(续)

(a) 价格记录(交易份额净值)(续)

年份	BC 类 - 人民币份额			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020	9.999	10.404	9.999	10.404
2021	9.416	10.406	9.416	10.406
2022	8.217	9.726	8.217	9.726
2023	8.162	9.026	8.162	9.026
2024	8.684	9.560	8.684	9.560
2025	9.424	9.934	9.424	9.934
2025年8月1日至2026年1月31日	9.963	10.133	9.963	10.133

年份	BC 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2020	9.951	10.607	9.951	10.607
2021	10.480	10.798	10.480	10.798
2022	8.819	10.722	8.819	10.722
2023	8.190	9.032	8.190	9.032
2024	8.526	9.421	8.526	9.421
2025	9.333	9.878	9.333	9.878
2025年8月1日至2026年1月31日	9.918	10.227	9.918	10.227

年份	BCH 类 - 人民币份额			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020	10.000	10.642	10.000	10.642
2021	10.568	11.016	10.568	11.016
2022	9.244	11.033	9.244	11.033
2023	8.570	9.442	8.570	9.442
2024	8.673	9.145	8.673	9.145
2025	8.768	9.230	8.768	9.230
2025年8月1日至2026年1月31日	9.230	9.349	9.230	9.349

年份	BM2 类 - 港元份额			
	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2020	9.985	10.483	9.985	10.483
2021	10.141	10.531	10.141	10.531
2022	8.176	10.287	8.176	10.287
2023	7.456	8.312	7.456	8.312
2024	7.354	7.793	7.354	7.793
2025	7.267	7.835	7.267	7.835
2025年8月1日至2026年1月31日	7.594	7.749	7.594	7.749

业绩表现记录(续)

(a) 价格记录(交易份额净值)(续)

年份	BM2 类 - 人民币份额			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020	10.000	10.395	10.000	10.395
2021	9.159	10.367	9.159	10.367
2022	7.701	9.408	7.701	9.408
2023	7.437	7.973	7.437	7.973
2024	7.538	7.881	7.538	7.881
2025	7.517	7.866	7.517	7.866
2025年8月1日至2026年1月31日	7.435	7.771	7.435	7.771

年份	BM2 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2020	9.951	10.558	9.951	10.558
2021	10.192	10.606	10.192	10.606
2022	8.130	10.308	8.130	10.308
2023	7.414	8.266	7.414	8.266
2024	7.312	7.743	7.312	7.743
2025	7.314	7.860	7.314	7.860
2025年8月1日至2026年1月31日	7.601	7.786	7.601	7.786

年份	BM3H 类 - 澳元份额			
	买入		卖出	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2020	10.000	10.504	10.000	10.504
2021	10.141	10.550	10.141	10.550
2022	8.079	10.259	8.079	10.259
2023	7.357	8.213	7.357	8.213
2024	7.291	7.673	7.291	7.673
2025	7.208	7.755	7.208	7.755
2025年8月1日至2026年1月31日	7.524	7.548	7.524	7.548

年份	BM3H 类 - 人民币份额			
	买入		卖出	
	最低 人民币	最高 人民币	最低 人民币	最高 人民币
2020	9.977	10.515	9.977	10.515
2021	10.130	10.549	10.130	10.549
2022	8.075	10.253	8.075	10.253
2023	7.352	8.204	7.352	8.204
2024	7.252	7.680	7.252	7.680
2025	7.215	7.740	7.215	7.740
2025年8月1日至2026年1月31日	7.519	7.524	7.519	7.524

业绩表现记录(续)

(a) 价格记录(交易份额净值)(续)

年份	IC 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2016	12.030	13.038	12.030	13.038
2017	12.596	13.255	12.596	13.255
2018	12.991	13.429	12.991	13.429
2019	12.994	14.379	12.994	14.379
2020	13.302	15.564	13.302	15.564
2021	15.419	15.879	15.419	15.879
2022	13.056	15.813	13.056	15.813
2023	12.141	13.404	12.141	13.404
2024	12.664	14.021	12.664	14.021
2025	13.989	14.827	13.989	14.827
2025年8月1日至2026年1月31日	14.887	15.368	14.887	15.368

年份	ID2 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2016	9.903	10.759	9.903	10.759
2017	10.057	10.573	10.057	10.573
2018	9.648	10.296	9.648	10.296
2019	9.578	10.594	9.578	10.594
2020	9.805	11.024	9.805	11.024
2021	10.366	10.840	10.366	10.840
2022	8.472	10.456	8.472	10.456
2023	7.739	8.651	7.739	8.651
2024	8.109	8.249	8.109	8.249
2025	8.558	9.071	8.558	9.071
2025年8月1日至2026年1月31日	8.755	9.038	8.755	9.038

年份	IM2 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2021	9.856	10.229	9.856	10.229
2022	7.907	9.985	7.907	9.985
2023	7.220	8.040	7.220	8.040
2024	7.252	7.543	7.252	7.543
2025	7.201	7.721	7.201	7.721
2025年8月1日至2026年1月31日	7.511	7.685	7.511	7.685

业绩表现记录(续)

(a) 价格记录(交易份额净值)(续)

年份	ZD2 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2016	10.152	11.060	10.156	11.060
2017	10.386	10.957	10.386	10.957
2018	9.986	10.678	9.986	10.678
2019	9.928	11.026	9.928	11.026
2020	10.173	11.469	10.173	11.469
2021	10.726	11.260	10.726	11.260
2022	8.765	10.827	8.765	10.827
2023	8.018	8.864	8.018	8.864
2024	8.155	8.827	8.155	8.827
2025	8.782	9.324	8.782	9.324
2025年8月1日至2026年1月31日	8.975	9.277	8.975	9.277

(b) 总资产净值(按《香港财务报告准则》计算)

	2026年1月31日 美元	2025	2024 美元	2023 美元
总资产净值	<u>2,508,857,332</u>	<u>3,047,010,692</u>	<u>1,188,530,195</u>	<u>1,341,206,208</u>

业绩表现记录(续)

(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 - 美元	美元	14.485	14.043	13.407	12.643
- AM2 类 - 港元	港元	7.622	7.646	7.695	7.713
- AM2 类 - 美元	美元	6.855	6.840	6.921	6.949
- AM3H 类 - 澳元	澳元	7.152	7.137	7.237	7.281
- AM3H 类 - 加元	加元	-	-	11.898	-
- AM3H 类 - 欧元	欧元	7.042	7.032	7.128	7.172
- AM3H 类 - 英镑	英镑	9.958	9.938	10.074	-
- AM3H 类 - 人民币	人民币	7.257	7.246	7.350	7.379
- BC 类 - 港元	港元	10.153	9.891	9.398	8.847
- BC 类 - 人民币	人民币	9.878	9.936	9.504	8.849
- BC 类 - 美元	美元	10.178	9.868	9.422	8.884
- BCH 类 - 人民币	人民币	9.343	9.186	9.020	9.137
- BM2 类 - 港元	港元	7.607	7.630	7.679	7.700
- BM2 类 - 人民币	人民币	7.431	7.693	7.806	7.744
- BM2 类 - 美元	美元	7.603	7.585	7.676	7.707
- BM3H 类 - 澳元	澳元	7.490	7.474	7.580	7.627
- BM3H 类 - 人民币	人民币	7.494	7.484	7.589	7.622
- IC 类 - 美元	美元	15.313	14.811	14.077	13.214
- ID2 类 - 美元	美元	9.005	8.711	8.612	8.290
- IM2 类 - 美元	美元	7.514	7.479	7.534	7.531
- ZD2 类 - 美元	美元	9.257	8.929	8.803	8.472

收益分配表

汇丰亚洲债券基金

AM2 类 - 港元份 额	除息日期	付款日期	每份额 分配 港元	分配 总额 港元
第 1 次分配	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0374	6,553,308.85
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0374	6,846,338.78
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0374	7,017,034.11
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0372	6,576,566.99
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0369	6,218,767.66
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0339	5,871,387.80
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	0.0335	1,991,419.72
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0337	2,045,704.24
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0338	2,172,489.08
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0336	2,208,588.81
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0333	2,095,864.77
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0305	1,857,646.14
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	0.0313	342,537.58
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0310	325,248.49
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0318	354,527.91
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0323	353,716.33
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0342	343,629.60
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0311	289,359.29
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	0.0209	26,372.83
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0201	24,851.87
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0213	26,127.25
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0231	28,319.34
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0239	24,309.28
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0209	22,635.39

收益分配表(续)

汇丰亚洲债券基金

AM3H 类 - 英镑 份额	除息日期	付款日期	每份额 分配 英镑	分配 总额 英镑
第 1 次分配	2025年8月29日	2025年9月9日	0.0460	3,726.32
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0460	4,485.32
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0472	8,987.91
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0485	11,807.17
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0490	8,632.38
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0449	10,704.07
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	0.0177	258,493.97
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0172	246,820.71
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0189	280,348.42
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0211	315,499.93
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0225	341,237.90
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0194	287,849.35
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9日	0.0373	44,865.64
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0373	43,749.85
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0373	45,174.58
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0371	48,113.34
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0369	51,297.43
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0338	46,963.57
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	0.0375	3,057,747.80
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0375	2,896,534.29
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0376	2,896,324.14
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0372	2,739,590.72
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0367	2,570,487.41
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0331	2,026,255.49

收益分配表(续)

汇丰亚洲债券基金

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	0.0371	95,424.07
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0374	92,776.15
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0375	92,434.93
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0373	86,818.97
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0370	90,395.67
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0338	80,419.94
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	0.0328	8,893.91
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0324	8,870.56
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0333	8,989.63
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0338	9,124.61
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0358	10,787.88
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0326	9,625.11
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	0.0183	284,015.81
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0178	262,886.37
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0195	270,731.44
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0218	296,853.43
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0232	271,982.07
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0200	211,740.57
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	0.0366	942,479.78
第 2 次分配	2025年9月30日	2025年10月10日	0.0369	943,570.43
第 3 次分配	2025年10月31日	2025年11月10日	0.0370	950,676.78
第 4 次分配	2025年11月28日	2025年12月9日	0.0368	950,108.27
第 5 次分配	2025年12月31日	2026年1月12日	0.0365	946,940.23
第 6 次分配	2026年1月30日	2026年2月10日	0.0334	870,686.65

证券借贷安排和抵押品持有明细表

汇丰亚洲债券基金

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	21,979,704	21,979,704
德意志银行	A1	固定收益证券	82,065,464	82,065,464
汇丰银行	Aa3	固定收益证券	8,635,503	8,635,503
Jefferies International Limited (母公司)	Baa1	固定收益证券	7,865,174	7,865,174
美林国际	A+	固定收益证券	34,686,541	34,686,541
摩根士丹利国际公司	Aa3	固定收益证券	39,703,144	39,703,144
野村国际	Baa1	固定收益证券	25,107,274	25,107,274
多伦多道明银行伦敦分行	A2	固定收益证券	2,519,111	2,519,111
				222,561,915

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

¹ 惠誉评级公司赋予的信用评级

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	2,169,033
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	4,176,143
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	4,172,299
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	1,010,123
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	4,100,875
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	4,097,981
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	85
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	-
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	-
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	37,770
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	2,082,667
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	38,052
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	20,357
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	74,319
德意志银行	政府债券	穆迪	未评级	15,463,649
德意志银行	政府债券	穆迪	Aaa	4,504,987
德意志银行	政府债券	穆迪	未评级	1,201,110
德意志银行	政府债券	穆迪	Aaa	140,881
德意志银行	政府债券	穆迪	Aaa	12,239,182
德意志银行	政府债券	穆迪	未评级	941,158
德意志银行	政府债券	穆迪	未评级	13,639,791
德意志银行	政府债券	穆迪	未评级	9,385,777
德意志银行	政府债券	穆迪	Aa3	84,866
德意志银行	政府债券	穆迪	Aa3	3,902,236
德意志银行	政府债券	穆迪	Aa3	-
德意志银行	政府债券	穆迪	Aa3	117,387
德意志银行	政府债券	穆迪	Aa3	15,215,139
德意志银行	政府债券	穆迪	未评级	33,863
德意志银行	政府债券	穆迪	未评级	10,074
德意志银行	政府债券	穆迪	Aa1	1,298
德意志银行	政府债券	穆迪	Aa1	27,335
德意志银行	政府债券	穆迪	未评级	505
德意志银行	政府债券	穆迪	未评级	5,156,226
汇丰银行	政府债券	穆迪	未评级	24,277
汇丰银行	GIL	穆迪	未评级	27,460
汇丰银行	政府债券	穆迪	Aa3	1,599,095
汇丰银行	政府债券	穆迪	Aa3	1,621,143
汇丰银行	GIL	穆迪	Aa3	8,896
汇丰银行	政府债券	穆迪	未评级	209,489
汇丰银行	政府债券	穆迪	Aaa	1,629,501
汇丰银行	政府债券	穆迪	未评级	1,621,185
汇丰银行	政府债券	穆迪	Aaa	1,428,936
汇丰银行	政府债券	穆迪	Aaa	465,521
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	1,464,269
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1	931,905
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1	673,681

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
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1	372,709
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	484,413
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1	25,696
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	450
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	125,626
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	9
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	211
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	75
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	694,655
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1	295,178
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	415,946
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	47,426
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	6,421
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	335,635
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	50
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	791,561
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	2,096
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	A1	549,059
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1	595
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1	647,508
美林国际	政府债券	穆迪	Aaa	4,426,317
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	771,663
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	61,704
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	1,105,345
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	70,768
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	2,527,123
美林国际	政府债券	穆迪	Aa3	145
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	70,377
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	110,205
美林国际	政府债券	穆迪	Aa3	1
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	1,021,593
美林国际	政府债券	穆迪	A1	862,769
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	29,819
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	58
美林国际	政府债券	穆迪	Aa1	1,179,683
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	472,520
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	823,757
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	87
美林国际	政府债券	穆迪	Aa1	1,261,532
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	72,337
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	797
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	5,476,475
美林国际	政府债券	穆迪	Aa1	6,590,412

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
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	2,940
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	7,178
美林国际	政府债券	穆迪	Aa1	6,590,114
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	1,150,316
美林国际	政府债券	穆迪	未评级	305
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	未评级	7,543,407
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	未评级	7,543,342
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	A1	7,543,553
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	未评级	1,992,217
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	A1	7,543,518
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aa1	7,537,107
野村国际	政府债券	穆迪	未评级	4,770,381
野村国际	政府债券	穆迪	Aa3	835,463
野村国际	政府债券	穆迪	Aa3	22,535
野村国际	政府债券	穆迪	Aa3	62,863
野村国际	政府债券	穆迪	Aa3	4,770,382
野村国际	政府债券	穆迪	未评级	789,215
野村国际	政府债券	穆迪	Aa3	4,770,382
野村国际	政府债券	穆迪	未评级	2,777,418
野村国际	政府债券	穆迪	Aa3	123
野村国际	政府债券	穆迪	未评级	45,090
野村国际	政府债券	穆迪	Aa3	16,314
野村国际	政府债券	穆迪	Aa3	62
野村国际	政府债券	穆迪	Aa3	380,706
野村国际	政府债券	穆迪	未评级	45,622
野村国际	政府债券	穆迪	未评级	-
野村国际	政府债券	穆迪	Aa3	43,237
野村国际	政府债券	穆迪	未评级	1,007,707
野村国际	政府债券	穆迪	A1	4,769,774
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	90,831
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	1,244
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	358
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	4,417
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	474
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	478,443
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	478,473
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	6,212
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	18,210
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	764
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	100,884
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	1,727
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	8,451
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	275,763
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	113,552
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	1,819
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	1

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	Aa3	6,417
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	60
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	25,238
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	6,606
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	6,321
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	2,078
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	74,153
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	76
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	77
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	98,911
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	96,571
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	23,876
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	50
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	130
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	127
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	24,384
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	14,845
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	99,792
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	18,859
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	1,289
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	99,153
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	14,962
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	15,176
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	94
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	408
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	1,408
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	101
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	227,920
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	1,814
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	48,471
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	100
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	1,804
多伦多道明银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	26,217
				222,561,915

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(B) 固定收益抵押品信用评级

2025年1月31日

抵押品提供方	资产类别	评级机构	抵押品信用评级	抵押品公允价值 美元
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1u	2,804,078
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	191,145
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3	1
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaau	3,049,705
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	4,047,529
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	3,049,705
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	-
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa1	9,316
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	969,935
巴黎银行伦敦分行	债券	穆迪	未评级	1,331,213
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	1,017,265
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aa3u	3,799,990
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	A1	8,308
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	未评级	1,017,739
巴黎银行伦敦分行	政府债券	穆迪	Aaa	6,856
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1u	1,277,365
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1u	112,246
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa1u	2,843,452
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	1,444,291
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	231,924
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	1,283,272
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	47
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	462,335
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	1
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3	28,973
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	812
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	95
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	1,284,811
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	9,066,375
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	322,602
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	691
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	1,402,509
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	301
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	11
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	94,374
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaau	32,098
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	584,309
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	24,295
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	1,903,323
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	105,084
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	315,512
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	4,111,086
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	519,763
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	1,292
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	2

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(B) 固定收益抵押品信用评级(续)

2025年1月31日

抵押品提供方	资产类别	评级机构	抵押品信用评级	抵押品公允价值 美元
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	961
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	2,534
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aa3u	140
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	2,074,248
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	77,016
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	未评级	143,477
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	63
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	2,316,524
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	34,601
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	1,062
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	83
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	1,828,066
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	89,967
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	1,678,638
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	9,066,358
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	1,882,040
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	260,564
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	穆迪	Aaa	808,173
摩根士丹利国际公司	GIL	穆迪	未评级	33,647
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	未评级	1,297,459
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	未评级	1,292,604
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	未评级	1,293,144
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	A1	340,617
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	88
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	90
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	1,280,815
摩根士丹利国际公司	政府债券	穆迪	Aaa	1,297,359
				75,856,374

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	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	62,663,175
巴黎银行伦敦分行	政府债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	3,435,413
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	235,134,751
德意志银行(母公司)	政府债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	37,768,971
美林国际(母公司)	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	150,461,050
美林国际(母公司)	政府债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	5,654,663
Jefferies International Limited (母公司)	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	54,546,758
Jefferies International Limited (母公司)	政府债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	29,305,908
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	75,311,727
摩根士丹利国际公司(母公司)	政府债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	8,061,557
野村国际(母公司)	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	76,123,334
野村国际(母公司)	政府债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	21,130,943
汇丰银行(母公司)	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	2,690,471
多伦多道明银行伦敦分行	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	2,061,870
						764,350,591

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表

证券借贷交易

截至 2025 年 1 月 31 日止期间

交易对手	抵押品类型	货币	剩余期限 ²	抵押品提供方 所在地	结算/清算	借出证券 公允价值 美元
Jefferies International Limited (母公司)	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	452,002,070
Jefferies International Limited (母公司)	政府债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	14,048,968
巴黎银行伦敦分行	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	165,350,718
巴黎银行伦敦分行	政府债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	8,456,340
摩根士丹利国际公司	公司债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	33,225,018
摩根士丹利国际公司	政府债	美元	无固定期限	伦敦	三方抵押品	4,673,535
						677,756,649

² 在截至2026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 代理人与非现金抵 押品所在地	现金抵押品 占比	非现金 抵押品 剩余期限	三方抵押品 结算/清算	占资产净值 百分比	借出证券公平 价值 ³ 美元
友邦保险控股有限公司 4.95% 2035年3月30日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.01%	345,391
友邦保险控股有限公司 4.95% 2035年3月30日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.10%	2,610,517
阿里巴巴集团控股 2.7% 2041年2月9日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.10%	2,586,960
阿里巴巴集团控股 3.25% 2061年2月9日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	914,091
阿里巴巴集团控股 3.25% 2061年2月9日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.01%	225,258
阿里巴巴集团控股 3.25% 2061年2月9日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.05%	1,371,137
阿里巴巴集团控股 4% 2037年12月6日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	见下表	三方抵押品	0.02%	551,459
阿里巴巴集团控股 4.2% 2047年12月6日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.05%	1,339,046
阿里巴巴集团控股 4.2% 2047年12月6日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.01%	214,247
阿里巴巴集团控股 4.4% 2057年12月6日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	583,584
阿里巴巴集团控股 4.4% 2057年12月6日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.10%	2,417,705
阿里巴巴集团控股 4.4% 2057年12月6日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.06%	1,396,433
ASB BANK LIMITED 4.155% 2030年10月29日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	498,656

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	占资产净 值百分比	借出证券 公允价值 ³ 美元
ASB BANK LIMITED 4.155% 2030年10月29日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.16%	3,939,380
ASB BANK LIMITED 4.155% 2030年10月29日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.03%	801,838
澳新银行集团浮息 债券 2035年9月 30日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.03%	703,256
澳新银行集团浮息 永续债券 2049年 12月29日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.01%	280,114
CATHAYLIFE SINGAPORE 浮 息债券 2039年9 月5日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.03%	657,573
CATHAYLIFE SINGAPORE 浮 息债券 2039年9 月5日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.02%	505,825
CHINA CINDA 2020 I MNGMN 5.5% 2030年1月 23日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	见下表 三方抵押品	0.05%	1,244,309
CIKARANG LISTRINDO 5.65% 2035年3月 12日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.05%	1,199,535
CK HUTCHISON INTERNATIONA L (20) LTD 3.125% 2041年4 月15日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.01%	155,258
CK HUTCHISON INTERNATIONA L 4.75% 2034年9 月13日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.03%	694,567
CK HUTCHISON INTERNATIONA L 4.75% 2034年9 月13日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.03%	793,791

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
FIRST ABU DHABI BANK LTD 2049年12月 31日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	505,609
FRANSHION BRILLIANT LTD 3.2% 2026年4月9 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	896,933
FREEPORT INDONESIA PT 6.2% 2052年4月 14日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	708,694
FREEPORT INDONESIA PT 6.2% 2052年4月 14日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.13%	3,365,020
富卫集团 5.836% 2035年9月22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	见下表	三方抵押品	0.03%	810,496
GC TREASURY CENTRE CO LTD 2049年12月 31日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	748,566
GLP PTE LTD 2049 年12月31日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	651,909
GLP PTE LTD 2049 年12月31日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.01%	190,287
绿城中国控股 8.45% 2028年2月 24日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	614,319
香港特别行政区 3.625% 2028年11 月12日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	1,003,980
HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD 2.25% 2030年6月 9日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	647,607

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
HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD 2.25% 2030年6月9 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	462,576
HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD 2.25% 2030年6月9 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	1,017,668
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.35% 2029年3月19日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.07%	1,855,645
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	0.16%	4,060,419
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%	见下表	三方抵押品	0.20%	4,975,498
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	0.10%	2,574,900
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	0.11%	2,688,789
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	0.02%	495,173
印度尼西亚(共和 国) 7.75% 2038年1 月17日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.11%	2,850,460
印度尼西亚共和国 (政府) 3.7% 2049年 10月30日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.19%	4,835,857
印度尼西亚共和国 (政府) 4.2% 2050年 10月15日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.06%	1,602,451

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
印度尼西亚共和国 (政府) 4.2% 2050 年10月15日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	400,613
KRAKATAU POSCO PT 6.375% 2027年6 月11日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.10%	2,546,374
KRAKATAU POSCO PT 6.375% 2027年6 月11日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	1,018,549
快手科技有限公司 4.125% 2031年1 月22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	见下表	三方抵押品	0.06%	1,391,572
联想集团有限公司 6.536% 2032年7 月27日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.08%	2,004,910
联想集团有限公司 6.536% 2032年7 月27日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.01%	326,483
LG新能源 5.875% 2035年4月2日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.08%	1,917,310
LG新能源 5.5% 2034年7月2日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	834,830
LG新能源 5.375% 2030年4月2日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.11%	2,694,066
美国 S 条例债券系 列 3.05% 2030年 10月28日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.01%	280,783
美国 S 条例债券系 列 3.05% 2030年 10月28日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	842,348
美国 S 条例债券系 列 3.05% 2030年 10月28日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	748,754

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	占资产净值 百分比	借出证券 公允价值 ³ 美元
美团 S 条例债券系列 3.05% 2030年10月28 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.01%	280,783
MINEJESA CAPITAL BV 4.625% 2030年8 月10日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.02%	618,551
MOMENTIVE PERFORMANCE MATERIALS INC 4.125% 2028年10月 22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.01%	156,669
MOMENTIVE PERFORMANCE MATERIALS INC 4.125% 2028年10月 22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.05%	1,197,470
MOMENTIVE PERFORMANCE MATERIALS INC 4.125% 2028年10月 22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.16%	3,991,568
MOMENTIVE PERFORMANCE MATERIALS INC 4.125% 2028年10月 22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	见下表	0.17%	4,188,153
MOMENTIVE PERFORMANCE MATERIALS INC 4.125% 2028年10月 22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.20%	4,989,460
MONGOLIAN MINING CORPORATION 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	0.09%	2,172,392
MONGOLIAN MINING CORPORATION 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	0.03%	724,131
MONGOLIAN MINING CORPORATION 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	0.04%	989,990

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 代理人与非现金抵押 所在地	现金抵押品 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
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	0.06%	1,547,488
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	0.03%	735,398
NTT FINANCE CORPORATION 5.502% 2035年7月16日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	516,693
NTT FINANCE CORPORATION 5.502% 2035年7月16日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.10%	2,583,467
NTT FINANCE CORPORATION 5.502% 2035年7月16日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		见下表	0.08%	2,066,774
ORBIA ADVANCE CORP 7.5% 2035年5月13日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	500,784
ORBIA ADVANCE CORP 7.5% 2035年5月13日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.07%	1,702,665
ORBIA ADVANCE CORP 7.5% 2035年5月13日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	801,254
ORBIA ADVANCE CORP 7.5% 2035年5月13日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	1,114,745
PERTAMINA (PERSERO) PT 4.175% 2050年1月21日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.14%	3,514,354
PERTAMINA 6.5% 2041年5月27日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	1,061,384
PERTAMINA 6.5% 2041年5月27日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.01%	318,415
PERTAMINA 6.5% 2041年5月27日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.05%	1,379,799
PERTAMINA 6.5% 2041年5月27日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.06%	1,539,007

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
PERTAMINA 6.5% 2041 年5月27日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押 品	0.05%	1,273,661
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	0.10%	2,606,093
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 6.25% 2049年1月25日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押 品	0.07%	1,820,567
PERUSAHAAN PENERBIT SBSN 5.65% 2054年11月25日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押 品	0.07%	1,660,481
PERUSAHAAN PENERBIT SBSN 5.65% 2054年11月25日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	见下表	三方抵押 品	0.02%	497,150
PERUSAHAAN PENERBIT SBSN 5.65% 2054年11月25日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押 品	0.01%	198,860
PERUSAHAAN PENERBIT SBSN 5.65% 2054年11月25日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押 品	0.09%	2,187,460
PETRONAS CAPITAL LTD 4.55% 2050年4月 21日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押 品	0.26%	6,578,130
菲律宾(共和国) 3.2% 2046年7月6日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押 品	0.02%	460,996
菲律宾(共和国) 3.2% 2046年7月6日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押 品	0.06%	1,506,392
PIRAMAL CAPITAL & HOUSING 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	0.13%	3,273,321
PROSUS NV 4.987% 2052年1月19日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押 品	0.05%	1,213,322
PROSUS NV 4.987% 2052年1月19日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押 品	0.04%	1,043,890
PROSUS NV 4.987% 2052年1月19日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押 品	0.06%	1,605,182
QBE INSURANCE GROUP LTD 2035年10 月3日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押 品	0.01%	311,831
RELIANCE INDUSTRIES LTD 3.625% 2052年1月12日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押 品	0.04%	1,038,794

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
大韩民国 3.625% 2030 年10月29日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.11%	2,704,479
菲律宾共和国 5.9% 2050年2月4日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.25%	6,252,948
菲律宾共和国 5.9% 2050年2月4日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	1,042,158
金沙中国有限公司 3.1% 2029年3月8日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	763,138
金沙中国有限公司 3.1% 2029年3月8日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.06%	1,430,883
金沙中国有限公司 3.1% 2029年3月8日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.05%	1,217,204
金沙中国有限公司 3.75% 2031年8月8日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.06%	1,387,601
SANTOS FINANCE LTD 5.25% 2029年3月 13日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.19%	4,674,593
SANTOS FINANCE LTD 5.25% 2029年3月 13日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	见下表	三方抵押品	0.03%	812,973
SANTOS FINANCE LTD 5.75% 2035年11 月13日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	1,003,770
SF HOLDING INVESTMENT LTD 2.875% 2030年2月20 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	760,085
SF HOLDING INVESTMENT LTD 2.875% 2030年2月20 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.08%	1,900,212
新韩金融集团 2049年12 月31日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.01%	198,919
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT (2018) LTD 2.7% 2030 年5月13日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	476,458
SK海力士 6.5% 2033年 1月17日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.10%	2,489,706
SK海力士 6.5% 2033年 1月17日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.10%	2,434,379
SK海力士 6.5% 2033年 1月17日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	885,229

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	占资产净值 结算/清算 百分比	借出证券 公允价值 ³ 美元
SK海力士 6.5% 2033年 1月17日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.02%	387,288
SK海力士 6.5% 2033年1 月17日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.01%	304,297
SK海力士 6.5% 2033年1 月17日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.04%	995,882
SK海力士 6.5% 2033年1 月17日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.04%	885,229
三井住友金融集团浮息 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 0.02%	516,717
TATA CAPITAL LTD 5.389% 2028年7月21日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.04%	1,020,398
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.25% 2051年4 月6日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.05%	1,205,307
腾迅控股有限公司 3.24% 2050年6月3日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	见下表	三方抵押品 0.01%	359,525
腾迅控股有限公司 3.24% 2050年6月3日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.17%	4,242,395
腾迅控股有限公司 3.29% 2060年6月3日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.06%	1,621,244
腾迅控股有限公司 3.84% 2051年4月22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.13%	3,366,934
腾迅控股有限公司 3.975% 2029年4月11日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.02%	601,644
腾迅控股有限公司 4.525% 2049年4月11日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.07%	1,646,432
腾迅控股有限公司 4.525% 2049年4月11日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.03%	632,482
腾迅控股有限公司 S条 例债券 3.94% 2061年4 月22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.04%	1,305,568
腾迅控股有限公司 S条 例债券 3.94% 2061年4 月22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.01%	241,627
腾讯音乐娱乐集团 2% 2030年9月3日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品 0.01%	181,880

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
腾讯音乐娱乐集团 2% 2030年9月3日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.09%	2,356,253
THAIOIL TRSRY CENTER 2.5% 2030年 6月18日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	546,442
THAIOIL TRSRY CENTER 2.5% 2030年 6月18日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	见下表	三方抵押品	0.11%	2,844,232
TSMC ARIZONA CORP 4.5% 2052年4月22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.09%	2,169,462
TSMC ARIZONA CORP 4.5% 2052年4月22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	698,001
WOODSIDE FINANCE LTD 5.1% 2034年9月 12日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	494,488
XIAOMI BEST TIME INTL S 条例债券系列 2.875% 2031年7月14 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.07%	1,665,085
XIAOMI BEST TIME INTL S 条例债券系列 2.875% 2031年7月14 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	481,949
								8.20%	205,772,398

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品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易

2025年1月31日

借出证券	抵押品类型	货币	剩余期限	证券借贷代理人所在地	现金抵押品与非现金抵押品占比	非现金抵押品剩余期限	结算/清算	占资产净值百分比	借出证券公允价值 ³ 美元
CNOOC FINANCE 2013 LTD 4.25% 2043年5月9日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.01%	449,613
印度尼西亚 4.7% 2034年2月10日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	567,514
印度尼西亚(共和国) 5.15% 2054年9月10日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	1,381,878
印度尼西亚(共和国) 5.15% 2054年9月10日	政府债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	763,718
印度尼西亚共和国(政府) 3.55% 2051年6月9日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	见下表	三方抵押品	0.02%	566,144
印度尼西亚共和国(政府) 3.55% 2051年6月9日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.01%	353,840
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 6.25% 2049年1月25日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	505,997
TSMC ARIZONA CORP 4.5% 2052年4月22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.09%	2,742,923
腾迅控股有限公司 3.84% 2051年4月22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.16%	4,839,239
腾迅控股有限公司 S条例债券 3.94% 2061年4月22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	1,149,074
THAIOIL TRSRY CENTER 2.5% 2030年6月18日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	1,271,466
THAIOIL TRSRY CENTER 2.5% 2030年6月18日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.01%	365,335

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易

2025年1月31日

借出证券	抵押品 类型	货币	剩余期限	证券借贷 代理人与 所在地	现金抵押品 与非现金抵押品 占比	非现金 抵押品 剩余期限	占资产净 值/清算 百分比	借出证券 公允价值 ³ 美元
THAIOIL TRSRY CENTER 2.5% 2030年6月18日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.06%	1,864,817
THAIOIL TRSRY CENTER 2.5% 2030年6月18日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.06%	1,849,559
渣打银行浮息永续 债券 2049年12 月31日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.01%	301,374
渣打银行浮息永续 债券 2049年12 月31日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.04%	1,205,495
PROSUS NV 4.987% 2052年1 月19日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.02%	607,540
PROSUS NV 4.987% 2052年1 月19日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.09%	2,885,815
PROSUS NV 4.987% 2052年1 月19日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.08%	2,573,691
GREENKO POWER II LTD 4.3% 2028年12 月13日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.01%	405,605
香港机场管理局 3.5% 2062年1月 12日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.07%	2,315,509
GOLOMT BANK OF MONGOLIA 11% 2027年5月 20日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.06%	1,992,869
HYUNDAI CAPITAL SERVICES 5.25% 2028年1 月22日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.17%	5,148,800
联想集团有限公司 5.831% 2028年1 月27日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.07%	2,123,811
LG新能源 5.75% 2028年9月25日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	三方抵押品	0.03%	1,016,058

见下表

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易

2025年1月31日

借出证券	抵押品 类型	货币	剩余期限	证券借贷 代理人 所在地	现金抵押品 与非现金抵 押品占比	非现金 抵押品 剩余期限	结算/清算	占资产净值 百分比	借出证券 公允价值 ³ 美元
RELIANCE INDUSTRIES LTD 2.875% 2032年1月12日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	768,307
RELIANCE INDUSTRIES LTD 2.875% 2032年1月12日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.08%	2,390,287
SAEL LTD集团发行人 7.8% 2031年7月31日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	503,365
NAN FUNG TREASURY LTD 5% 2028年9月5日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	1,087,993
NAN FUNG TREASURY LTD 5% 2028年9月5日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.06%	1,942,845
NAN FUNG TREASURY LTD 5% 2028年9月5日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	971,423
NAN FUNG TREASURY LTD 5% 2028年9月5日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.12%	3,885,690
FRANSHION BRILLIANT LTD 4.25% 2029年7月23日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	见下表	三方抵押品	0.02%	755,892
FORTUNE STAR BVI LTD 5.05% 2027年1月 27日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	1,038,200
普洛斯中国控股有限公 司 2.95% 2026年3月29 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.03%	975,549
新城环球有限公司 4.625% 2025年10月15 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.02%	456,036
新城环球有限公司 4.625% 2025年10月15 日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.06%	1,732,937
富卫集团有限公司 7.784% 2033年12月6日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	1,112,204
软银集团 7% 2031年7月 8日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.06%	1,808,977

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易

2025年1月31日

借出证券	抵押品 类型	货币	剩余期限	证券借贷 代理人 所在地	现金抵押品 与非现金抵 押品占比	非现金 抵押品 剩余期限	结算/清算	占资产净值百 分比	借出证券 公允价值 ³ 美元
沙特阿拉伯国家石油 公司 5.75% 2054年7 月17日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.05%	1,406,194
沙特阿拉伯国家石油 公司 5.75% 2054年7 月17日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.25%	7,874,685
MUANGTHAI CAPITAL PCL 6.8750% 2028年9月 30日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%	见下表	三方抵押品	0.08%	2,323,979
FORTUNE STAR BVI LTD 8.50% 2028年5 月19日	公司债	美元	无固定期限	伦敦	0%		三方抵押品	0.04%	1,210,229
								2.30%	71,492,476

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品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表

证券借贷交易抵押品

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%	2042年6月22日	三方抵押品	0.09%	2,169,033
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	0.17%	4,176,143
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年10月19日	三方抵押品	0.17%	4,172,299
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	0.04%	1,010,123
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2056年8月15日	三方抵押品	0.16%	4,100,875
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	0.16%	4,097,981
巴黎银行伦敦分行	政府债券	丹麦克朗	无固定期限	伦敦	0%	2035年11月15日	三方抵押品	0.00%	85
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2068年5月25日	三方抵押品	0.00%	-
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2069年5月25日	三方抵押品	0.00%	-
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2038年5月25日	三方抵押品	0.00%	37,770
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2056年5月25日	三方抵押品	0.08%	2,082,667
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%	38,052
巴黎银行伦敦分行	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2032年3月20日	三方抵押品	0.00%	20,357
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%	74,319
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	0.63%	15,463,649
德意志银行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2053年8月15日	三方抵押品	0.18%	4,504,987
德意志银行	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	0.05%	1,201,110
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	0.01%	140,881
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	0.50%	12,239,182
德意志银行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年11月15日	三方抵押品	0.04%	941,158
德意志银行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2041年5月15日	三方抵押品	0.55%	13,639,791
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	0.38%	9,385,777
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	0.00%	84,866

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

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%	2028年5月25日	三方抵押品	0.16%	3,902,236
德意志银行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2072年5月25日	三方抵押品	0.00%	-
德意志银行	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%	117,387
德意志银行	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	0.62%	15,215,139
德意志银行	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	0.00%	33,863
德意志银行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年7月15日	三方抵押品	0.00%	10,074
德意志银行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2049年5月15日	三方抵押品	0.00%	1,298
德意志银行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2031年2月15日	三方抵押品	0.00%	27,335
德意志银行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2030年4月30日	三方抵押品	0.00%	505
德意志银行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2027年12月31日	三方抵押品	0.21%	5,156,226
汇丰银行	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	0.00%	24,277
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	0.00%	27,460
汇丰银行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2044年7月4日	三方抵押品	0.06%	1,599,095
汇丰银行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2055年6月5日	三方抵押品	0.06%	1,621,143
汇丰银行	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2054年7月31日	三方抵押品	0.00%	8,896
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%	209,489
汇丰银行	政府债券	挪威克朗	无固定期限	伦敦	0%	2032年5月18日	三方抵押品	0.06%	1,629,501
汇丰银行	政府债券	挪威克朗	无固定期限	伦敦	0%	2042年10月6日	三方抵押品	0.06%	1,621,185
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	0.06%	1,428,936
汇丰银行	政府债券	挪威克朗	无固定期限	伦敦	0%	2039年5月31日	三方抵押品	0.02%	465,521
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年3月15日	三方抵押品	0.06%	1,464,269

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表

证券借贷交易抵押品

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%	2026年10月20日	三方抵押品	0.04%	931,905
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	0.03%	673,681
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	0.01%	372,709
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	0.02%	484,413
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	0.00%	25,696
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%	450
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	0.01%	125,626
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%	9
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年10月22日	三方抵押品	0.00%	211
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%	75
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	0.03%	694,655
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2034年9月15日	三方抵押品	0.01%	295,178

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表

证券借贷交易抵押品

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%	2035年4月25日	三方抵押品	0.02%	415,946
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2036年7月25日	三方抵押品	0.00%	47,426
Jefferies International Limited (母公司)	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%	6,421
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	0.01%	335,635
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%	50
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	0.03%	791,561
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	0.00%	2,096
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	0.02%	549,059
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%	595
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	0.03%	647,508
美林国际	政府债券	加元	无固定期限	伦敦	0%	2032年6月1日	三方抵押品	0.18%	4,426,317
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	0.03%	771,663

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表

证券借贷交易抵押品

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	0.00%	61,704
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	0.04%	1,105,345
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%	70,768
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	0.10%	2,527,123
美林国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年10月25日	三方抵押品	0.00%	145
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	0.00%	70,377
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%	110,205
美林国际	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	0.00%	1
美林国际	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2029年12月20日	三方抵押品	0.04%	1,021,593
美林国际	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2053年12月20日	三方抵押品	0.03%	862,769
美林国际	政府债券	瑞典克朗	无固定期限	伦敦	0%	2036年10月15日	三方抵押品	0.00%	29,819
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2051年8月15日	三方抵押品	0.00%	58
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	0.05%	1,179,683
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	0.02%	472,520
美林国际	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	0.03%	823,757

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表

证券借贷交易抵押品

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	三方抵押品 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%	2031年11月15日	三方抵押品	0.00%	87
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	0.05%	1,261,532
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	0.00%	72,337
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	0.00%	797
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2026年4月30日	三方抵押品	0.22%	5,476,475
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	0.26%	6,590,412
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%	2,940
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028年1月15日	三方抵押品	0.00%	7,178
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	0.26%	6,590,114
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	0.05%	1,150,316
美林国际	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2035年8月15日	三方抵押品	0.00%	305
摩根士丹利国际公司	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2033年9月20日	三方抵押品	0.31%	7,543,407
摩根士丹利国际公司	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2045年9月20日	三方抵押品	0.31%	7,543,342
摩根士丹利国际公司	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2042年9月20日	三方抵押品	0.31%	7,543,553

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表

证券借贷交易抵押品

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	三方抵押品结算/清算	抵押品覆盖的资产净值百分比	抵押品公允价值 美元
摩根士丹利国际公司	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2044年12月20日	三方抵押品	0.08%	1,992,217
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	0.30%	7,543,518
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2047年11月15日	三方抵押品	0.30%	7,537,107
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	0.19%	4,770,381
野村国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年3月28日	三方抵押品	0.03%	835,463
野村国际	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%	22,535
野村国际	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%	62,863
野村国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2047年6月22日	三方抵押品	0.19%	4,770,382
野村国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年6月22日	三方抵押品	0.03%	789,215
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	0.19%	4,770,382
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	0.11%	2,777,418
野村国际	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	0.00%	123
野村国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年6月22日	三方抵押品	0.00%	45,090
野村国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年6月22日	三方抵押品	0.00%	16,314
野村国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2031年6月22日	三方抵押品	0.00%	62

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表

证券借贷交易抵押品

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	抵押品公平价值 美元
野村国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年10月25日	三方抵押品	0.02%	380,706
野村国际	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	0.00%	45,622
野村国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2045年5月25日	三方抵押品	0.00%	-
野村国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年5月25日	三方抵押品	0.00%	43,237
野村国际	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年11月25日	三方抵押品	0.04%	1,007,707
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	0.19%	4,769,774
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10月20日	三方抵押品	0.00%	90,831
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%	1,244
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%	358
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%	2026年3月1日	三方抵押品	0.00%	4,417
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%	2053年12月1日	三方抵押品	0.00%	474
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9月1日	三方抵押品	0.02%	478,443
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%	2028年3月1日	三方抵押品	0.02%	478,473

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表

证券借贷交易抵押品

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%	2029年3月1日	三方抵押品	0.00%	6,212
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%	2034年3月1日	三方抵押品	0.00%	18,210
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9月1日	三方抵押品	0.00%	764
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%	2030年3月1日	三方抵押品	0.00%	100,884
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%	1,727
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%	8,451
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	0.01%	275,763
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	0.00%	113,552
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%	1,819
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%	2052年5月25日	三方抵押品	0.00%	1
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%	6,417
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%	60
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%	25,238

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表

证券借贷交易抵押品

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%	2039年8月15日	三方抵押品	0.00%	6,606
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	0.00%	6,321
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	0.00%	2,078
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%	74,153
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8月15日	三方抵押品	0.00%	76
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	0.00%	77
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	0.00%	98,911
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11月15日	三方抵押品	0.00%	96,571
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%	2049年5月15日	三方抵押品	0.00%	23,876
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%	2050年8月15日	三方抵押品	0.00%	50
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%	2040年11月15日	三方抵押品	0.00%	130

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表

证券借贷交易抵押品

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%	2051年5月15日	三方抵押品	0.00%	127
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%	2052年2月15日	三方抵押品	0.00%	24,384
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2月15日	三方抵押品	0.00%	14,845
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%	99,792
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%	18,859
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8月15日	三方抵押品	0.00%	1,289
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%	99,153
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3月31日	三方抵押品	0.00%	14,962
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%	2029年3月31日	三方抵押品	0.00%	15,176
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%	2032年8月15日	三方抵押品	0.00%	94
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%	2026年8月15日	三方抵押品	0.00%	408

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表

证券借贷交易抵押品

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%	2031年8月31日	三方抵押品	0.00%	1,408
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12月15日	三方抵押品	0.00%	101
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3月31日	三方抵押品	0.01%	227,920
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5月15日	三方抵押品	0.00%	1,814
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%	2030年5月31日	三方抵押品	0.00%	48,471
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
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%	2032年9月30日	三方抵押品	0.00%	1,804
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11月15日	三方抵押品	0.00%	26,217
								8.87%	222,561,915

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表

证券借贷交易抵押品

2025年1月31日

抵押品提供方	抵押品类型	货币	剩余期限	抵押品提供方所在地	现金抵押品与非现金抵押品占比	非现金抵押品剩余期限	结算/清算	抵押品覆盖的资产净值百分比	抵押品公允价值 美元
巴黎银行 伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2034年5月23日	三方抵押品	0.09%	2,804,078
Jefferies International Limited(母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年10月20日	三方抵押品	0.04%	1,277,365
Jefferies International Limited(母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2027年4月20日	三方抵押品	0.00%	112,246
Jefferies International Limited(母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年2月20日	三方抵押品	0.09%	2,843,452
Jefferies International Limited(母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年2月20日	三方抵押品	0.05%	1,444,291
Jefferies International Limited(母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2049年5月23日	三方抵押品	0.01%	231,924
巴黎银行 伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年3月28日	三方抵押品	0.01%	191,145
Jefferies International Limited(母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年3月28日	三方抵押品	0.04%	1,283,272
Jefferies International Limited(母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2057年6月22日	三方抵押品	0.00%	47
巴黎银行 伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年6月22日	三方抵押品	0.00%	1
Jefferies International Limited(母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年6月22日	三方抵押品	0.01%	462,335
Jefferies International Limited(母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2054年6月22日	三方抵押品	0.00%	1

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易抵押品

2025年1月31日

抵押品提供方	抵押品类型	货币	剩余期限	抵押品提供方所在地	现金抵押品与非现金抵押品占比	非现金抵押品 剩余期限	结算/清算	抵押品覆盖的资产净值百分比	抵押品 公允价值 美元
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2043年6月22日	三方抵押品	0.00%	28,973
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2055年6月22日	三方抵押品	0.00%	812
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年10月22日	三方抵押品	0.00%	95
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2035年6月22日	三方抵押品	0.04%	1,284,811
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年4月15日	三方抵押品	0.29%	9,066,375
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2025年8月15日	三方抵押品	0.01%	322,602
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年2月15日	三方抵押品	0.10%	3,049,705
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2031年1月4日	三方抵押品	0.00%	691
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2034年7月4日	三方抵押品	0.05%	1,402,509
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2039年7月4日	三方抵押品	0.00%	301
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2040年7月4日	三方抵押品	0.00%	11

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易抵押品

2025年1月31日

抵押品提供方	抵押品类型	货币	剩余期限	抵押品提供方所在地	现金抵押品与非现金抵押品占比	非现金抵押品剩余期限	结算/清算	抵押品覆盖的资产净值百分比	抵押品公允价值美元
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2042年7月4日	三方抵押品	0.00%	94,374
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2044年7月4日	三方抵押品	0.00%	32,098
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年12月10日	三方抵押品	0.13%	4,047,529
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年4月18日	三方抵押品	0.10%	3,049,705
巴黎银行伦敦分行	政府债券	丹麦克朗	无固定期限	伦敦	0%	2031年11月15日	三方抵押品	0.00%	-
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2031年4月15日	三方抵押品	0.00%	9,316
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年5月25日	三方抵押品	0.03%	969,935
巴黎银行伦敦分行	债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2031年1月5日	三方抵押品	0.04%	1,331,213
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年5月25日	三方抵押品	0.03%	1,017,265
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2030年5月25日	三方抵押品	0.12%	3,799,990
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2047年7月25日	三方抵押品	0.02%	584,309
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2039年6月25日	三方抵押品	0.00%	24,295
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2027年5月25日	三方抵押品	0.06%	1,903,323
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2048年5月25日	三方抵押品	0.00%	105,084
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2050年5月25日	三方抵押品	0.01%	315,512

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易抵押品

2025年1月31日

抵押品提供方	抵押品类型	货币	剩余期限	抵押品提供方所在地	现金抵押品与非现金抵押品占比	非现金抵押品剩余期限	结算/清算	抵押品覆盖的资产净值百分比	抵押品公允价值美元
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2027年2月25日	三方抵押品	0.13%	4,111,086
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2032年5月25日	三方抵押品	0.02%	519,763
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年2月25日	三方抵押品	0.00%	1,292
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2043年5月25日	三方抵押品	0.00%	2
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2026年9月24日	三方抵押品	0.00%	961
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2029年2月25日	三方抵押品	0.00%	2,534
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2055年5月25日	三方抵押品	0.00%	140
摩根士丹利国际公司	GIL	英镑	无固定期限	伦敦	0%	2038年1月29日	三方抵押品	0.00%	33,647
摩根士丹利国际公司	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2025年3月1日	三方抵押品	0.04%	1,297,459
巴黎银行伦敦分行	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2036年12月20日	三方抵押品	0.00%	8,308
摩根士丹利国际公司	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2040年6月20日	三方抵押品	0.04%	1,292,604

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易抵押品

2025年1月31日

抵押品提供方	抵押品类型	货币	剩余期限	抵押品提供方所在地	现金抵押品与非现金抵押品占比	非现金抵押品剩余期限	结算/清算	抵押品覆盖的资产净值百分比	抵押品公允价值 美元
摩根士丹利国际公司	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2040年12月20日	三方抵押品	0.04%	1,293,144
摩根士丹利国际公司	政府债券	日元	无固定期限	伦敦	0%	2039年3月20日	三方抵押品	0.01%	340,617
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2028年1月15日	三方抵押品	0.07%	2,074,248
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2042年1月15日	三方抵押品	0.00%	77,016
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2047年1月15日	三方抵押品	0.00%	143,477
巴黎银行伦敦分行	政府债券	欧元	无固定期限	伦敦	0%	2052年1月15日	三方抵押品	0.03%	1,017,739
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2049年8月15日	三方抵押品	0.00%	63
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2052年11月15日	三方抵押品	0.00%	88
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2043年8月15日	三方抵押品	0.07%	2,316,524
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028年8月15日	三方抵押品	0.00%	34,601
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028年11月15日	三方抵押品	0.00%	1,062
巴黎银行伦敦分行	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2026年7月15日	三方抵押品	0.00%	6,856
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2031年2月15日	三方抵押品	0.00%	83
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028年3月31日	三方抵押品	0.06%	1,828,066

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(C) 证券借贷和回购交易明细表(续)

证券借贷交易抵押品

2025年1月31日

抵押品提供方	抵押品类型	货币	剩余期限	抵押品提供方所在地	现金抵押品与非现金抵押品占比	非现金抵押品剩余期限	结算/清算	抵押品覆盖的资产净值百分比	抵押品公允价值 美元
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028年8月31日	三方抵押品	0.00%	89,967
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028年8月31日	三方抵押品	0.00%	90
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2027年2月28日	三方抵押品	0.05%	1,678,638
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2027年11月30日	三方抵押品	0.29%	9,066,358
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2026年2月15日	三方抵押品	0.06%	1,882,040
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2030年5月31日	三方抵押品	0.01%	260,564
Jefferies International Limited (母公司)	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2028年12月31日	三方抵押品	0.03%	808,173
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2027年9月15日	三方抵押品	0.04%	1,280,815
摩根士丹利国际公司	政府债券	美元	无固定期限	伦敦	0%	2026年10月31日	三方抵押品	0.04%	1,297,359
								2.40%	75,856,374

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(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

2026年1月31日

借出的可转让 证券总值 ³ 美元	借出证券金额占可借 出资产总额的百分比 ³ %	借出证券金额占本基金管 理资产规模的百分比 ³ %	回购交易的 绝对金额 美元
205,772,398	96.3707	8.2018	不适用

2025年1月31日

借出的可转让 证券总值 ³ 美元	借出证券金额占可借 出资产总额的百分比 ³ %	借出证券金额占本基金管 理资产规模的百分比 ³ %	回购交易的 绝对金额 美元
71,492,476	2.4694	2.2990	不适用

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) 使用现金抵押品进行的投资

不适用。截至2026年和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年和2025年1月31日止期间，所收到的抵押品中无任何部分用于借出证券的再利用或再抵押。

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(G)十大抵押品发行人

	抵押品 公允价值 美元	占资产净值总 额的百分比 %
2026年1月31日		
巴黎银行伦敦分行	21,979,704	0.8761%
摩根士丹利国际公司	39,703,144	1.5825%
Jefferies International Limited (母公司)	7,865,174	0.3135%
德意志银行	82,065,464	3.2710%
汇丰银行	8,635,503	0.3442%
美林国际	34,686,541	1.3826%
野村国际	25,107,274	1.0007%
多伦多道明银行伦敦分行	2,519,111	0.1004%
	222,561,915	8.8710%
2025年1月31日		
巴黎银行伦敦分行	21,302,785	0.6851%
摩根士丹利国际公司	6,835,823	0.2198%
Jefferies International Limited (母公司)	47,717,766	1.5345%
	75,856,374	2.4394%

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

	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		
JAPAN JPGV 3.100 03/20/65	30,927,298	1.2327%
FINLAND FIGV 3.000 09/15/35	15,215,139	0.6065%
BELGIUM BEGV 3.400 06/22/36	13,639,791	0.5437%
JAPAN JPGV 1.900 09/20/42	12,239,182	0.4878%
JAPAN JPGV 0.800 09/20/33	9,385,777	0.3741%
GERMANY DEGV 2.600 05/15/41	7,543,553	0.3007%
FRANCE FRGV 0.750 05/25/53	7,543,342	0.3007%
US TREASURY UST 3.875 08/15/34	7,543,518	0.3007%
JAPAN JPGV 2.700 09/20/45	7,543,407	0.3006%
GERMANY DEGV 1.900 09/16/27	6,590,412	0.2627%
	118,171,419	4.7102%
2025年1月31日		
GERMANY DEGV 0.100 04/15/26	9,066,375	0.2916%
US TREASURY UST 3.875 11/30/27	9,066,358	0.2916%
FRANCE FRGV 02/25/27	4,111,086	0.1322%
GERMANY DEGV 2.000 12/10/26	4,047,529	0.1302%
FRANCE FRGV 2.500 05/25/30	3,799,990	0.1222%
GERMANY DEGV 0.250 02/15/29	3,049,705	0.0981%
GERMANY DEGV 2.400 04/18/30	3,049,705	0.0981%
AUSTRIA ATGV 02/20/30	2,843,452	0.0914%
AUSTRIA ATGV 2.400 05/23/34	2,804,078	0.0902%
US TREASURY UST 4.375 08/15/43	2,316,524	0.0745%
	44,154,802	1.4201%

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

	借出证券 公允价值 2026年1月31日 ³ 美元	占资产净值总 额的百分比 2026年1月31日 ³ %
德意志银行	51,025,640	2.0338%
摩根士丹利国际公司	49,251,763	1.9631%
巴黎银行伦敦分行	32,840,744	1.3090%
野村国际	31,271,175	1.2464%
美林国际	28,708,326	1.1443%
Jefferies International Limited (母公司)	6,341,407	0.2528%
汇丰银行	4,835,084	0.1927%
多伦多道明银行伦敦分行	1,498,258	0.0597%
	<hr/>	<hr/>
	205,772,397	8.2018%

2025年1月31日

巴黎银行伦敦分行	30,071,558	0.9670%
摩根士丹利国际公司	2,664,195	0.0857%
Jefferies International Limited (母公司)	38,756,723	1.2463%
	<hr/>	<hr/>
	71,492,476	2.2990%

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

(J) 保管人及每家保管人持有的资产金额

	公允价值 2026年1月31日 美元
抵押品证券保管人	
汇丰银行	<hr/>
	230,872,251

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(J) 保管人及每家保管人持有的资产金额(续)

公允价值
2026年1月31日
美元

借给借券人的证券保管人 ^{3,5}	205,772,397
<hr/>	
2025年1月31日	
抵押品证券保管人	
汇丰银行	75,856,374
<hr/>	
借给借券人的证券保管人 ^{3,5}	71,492,476
<hr/>	

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	538,286	8,942
- 管理费	-	1,192
- HSS收入	-	1,788
	<hr/>	<hr/>
	538,286	11,922
	<hr/>	<hr/>

证券借贷安排和抵押品持有明细表(续)

(L) 证券借贷和回购交易收益与现金抵押品再投资收益的划分

	截至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	538,286	11,922
现金抵押品再投资收益	-	-

行政

管理人

汇丰投资基金(香港)有限公司
香港中环
皇后大道中1号
汇丰总行大厦

管理人董事

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