

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

(东方汇理香港组合之子基金)

未经审计中期报告
截至 **2026 年 6 月 30 日** 止六个月

东方汇理资产管理香港有限公司
香港鲗鱼涌英皇道 979 号太古坊
太古坊二座 32 楼 04-06 室
电话: (852) 2521 4231
传真: (852) 2868 1450
电邮: info@hk.amundi.com
网页: www.amundi.com.hk

东方汇理香港组合

未经审计
中期报告
截至 2026 年 6 月 30 日止六个月

目录	页
管理层和行政管理	1
财务状况表 - 东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金 (未经审计)	2 - 3
综合收益表 - 东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金 (未经审计)	4
归属基金份额持有人资产净值变动表 - 东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金 (未经审计)	5 - 8
收益分派 - 东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金 (未经审计)	9 - 12
投资组合 - 东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金 (未经审计)	13 - 34
投资组合变动表 - 东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金 (未经审计)	35 - 36
衍生金融工具详情 - 东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金 (未经审计)	37 - 38
持有抵押品 - 东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金 (未经审计)	39

附注:

子基金的未经审计中期报告已依据截至 2025 年 12 月 31 日的年度报告中相同的会计政策所编制。

东方汇理香港组合

管理层和行政管理

基金管理人

东方汇理资产管理香港有限公司
香港鲗鱼涌英皇道 979 号太古坊
太古坊二期 32 楼 04-06 室

基金管理人的董事

Julien Faucher
Zhong Xiao Feng 钟小锋
Fannie Wurtz
John o Toole
Tai Che Eddy Wong

受托人和基金登记机构

汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司
香港皇后大道中 1 号

法律顾问

的近律师行
香港中环遮打道 18 号历山大厦 5 楼

审计师

罗兵咸永道会计师事务所
香港中环太子大厦 22 楼

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

财务状况表 (未经审计)
于 2026 年 6 月 30 日

	于 2026 年 6 月 30 日 美元	于 2025 年 12 月 31 日 美元
资产		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	80,886,829	106,303,442
衍生金融工具	713,936	112,288
应收经纪款项	170,380	367,918
应收基金份额持有人款项	70,013	1,148,418
应收银行利息	44	35
应收股息	21,683	12,700
应收债券利息	567,275	814,657
经纪存款	18,540	23,113
现金和现金等价物	2,193,854	1,179,388
资产总计	84,642,554	109,961,959
负债		
衍生金融工具	148,417	132,741
应付现金抵押品	630,000	-
应付经纪人款项	170,935	128,212
应付基金份额持有人款项	81,401	1,017,244
其他应付款项	105,435	145,091
负债合计 (不含归属基金份额持有人的资产净值)	1,136,188	1,423,288
归属基金份额持有人的资产净值 (按照国际财务报告会计准则编制)	83,506,366	108,538,671
子基金初步费用的调整	23,145	49,007
归属基金份额持有人的资产净值 (按照基金说明书编制)	83,529,511	108,587,678

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

财务状况表 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	基金份额数量		每基金份额归属 基金份额持有人资产净值	
	于 2026 年 6 月 30 日	于 2025 年 12 月 31 日	于 2026 年 6 月 30 日	于 2025 年 12 月 31 日
- 普通美元累算	89,039.410	229,461.525	美元 14.09	美元 13.63
- 普通美元分派	1,092,992.458	1,369,115.377	美元 8.03	美元 7.97
- 普通港元分派	10,572,454.510	9,015,074.115	港元 8.40	港元 8.25
- 普通人民币累算	66,020.252	107,490.437	离岸人民币 11.09	离岸人民币 11.03
- 普通人民币分派	145,386.252	144,174.332	离岸人民币 9.07	离岸人民币 9.21
- 普通澳元 (对冲)分派	661,134.327	825,622.362	澳元 7.84	澳元 7.80
- 普通加元 (对冲)分派	1,197,139.087	897,824.847	加元 7.99	加元 7.99
- 普通欧元 (对冲)分派	74,998.338	67,333.604	欧元 8.00	欧元 7.94
- 普通英镑 (对冲)分派	490,183.277	408,481.916	英镑 8.02	英镑 7.97
- 普通新西兰元 (对冲)分派	478,119.118	482,915.018	新西兰元 7.83	新西兰元 7.77
- 普通人民币 (对冲)累算	1,252.012	1,252.012	离岸人民币 9.43	离岸人民币 9.21
- 普通人民币 (对冲)分派	3,498,520.144	3,803,719.748	离岸人民币 7.52	离岸人民币 7.47
- 机构 II 美元累算	328,091.163	328,010.634	美元 13.72	美元 13.23
- 机构 III 美元累算	1,604,441.941	3,543,508.893	美元 16.84	美元 16.22
- 普通 M 人民币(对冲)累算	18,132,725.270	5,522,900.720	离岸人民币 1.03	离岸人民币 1.00
- 普通 M 人民币(对冲)分派	6,593,888.270	2,551,813.390	离岸人民币 1.02	离岸人民币 1.00
- 普通 M 人民币累算	15,597,905.620	4,942,154.900	离岸人民币 1.00	离岸人民币 0.99
- 普通 M 人民币分派	14,255,429.200	1,516,736.270	离岸人民币 0.97	离岸人民币 0.99

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

综合收益表 (未经审计)

截至 2026 年 6 月 30 日止期间

	由 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 美元	由 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日 美元
收入/ (亏损)		
股息收入	294,389	352,565
债券利息	1,320,127	1,486,472
利息收入	11,858	9,697
以公允价值计量且其变动计入当期损益的 金融资产及衍生金融工具净收益	2,614,503	6,967,688
汇兑亏损净额	(104,436)	(206,586)
其他收入	28	-
净收入合计	4,136,469	8,609,836
费用		
管理费	377,448	377,540
受托人费用	45,678	47,719
基金登记机构费用	26,640	23,150
律师和专业咨询费	3,084	3,214
估值费用	107,100	84,000
银行和次保管人费用	7,233	7,096
交易成本	25,945	24,700
审计费	6,093	5,361
初步费用	49,007	-
其他经营费用	71,160	41,105
经营费用合计	719,388	613,885
经营利润净额	3,417,081	7,995,951
融资成本		
分派予基金份额持有人	(987,165)	(1,031,239)
分派后及除税前净收入	2,429,916	6,964,712
预扣税	(55,818)	(67,231)
源自年度经营活动的归属基金份额持有人的 资产净值增加 (按照国际财务报告会计准则编制)	2,374,098	6,897,481
子基金初步费用的调整	23,145	-
源自年度经营活动的归属基金份额持有人的 资产净值 增加 (按照基金说明书编制)	2,397,243	6,897,481

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

归属基金份额持有人净资产变动表 (未经审计)
截至 2026 年 6 月 30 日止期间

	由 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 美元	由 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 美元
期初归属基金份额持有人的资产净值	108,587,678	114,987,821
基金份额申购	19,967,479	6,582,660
基金份额赎回	(47,422,889)	(19,422,990)
净赎回金额	(27,455,410)	(12,840,330)
源自期间经营活动的归属基金份额持有人的 资产净值增加	2,397,243	6,897,481
期末归属基金份额持有人的资产净值	83,529,511	109,044,972

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

归属基金份额持有人资产净值变动表 (未经审计)
 截至 2026 年 6 月 30 日止期间 (续)

	普通美元累算		普通美元分派		普通港元分派		普通人民币累算	
	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日	由 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日	由 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日	由 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日	由 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日
	基金份额 数量	基金份额 数量	基金份额 数量	基金份额 数量	基金份额 数量	基金份额 数量	基金份额 数量	基金份额 数量
期初	229,461.525	399,998.753	1,369,115.377	1,725,771.615	9,015,074.115	11,549,905.039	107,490.437	13,650.330
已申购基金份额	772.386	10,584.011	97,460.875	157,355.144	4,971,538.629	1,809,007.930	12,758.321	22,205.851
已赎回基金份额	(141,194.501)	(127,126.512)	(373,583.794)	(580,312.563)	(3,414,158.234)	(3,428,968.287)	(54,228.506)	(1,497.808)
期末	89,039.410	283,456.252	1,092,992.458	1,302,814.196	10,572,454.510	9,929,944.682	66,020.252	34,358.373

	普通人民币分派		普通澳元 (对冲)分派		普通加元 (对冲)分派		普通欧元 (对冲)分派	
	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日	由 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日	由 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日	由 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日	由 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日
	基金份额 数量	基金份额 数量	基金份额 数量	基金份额 数量	基金份额 数量	基金份额 数量	基金份额 数量	基金份额 数量
期初	144,174.332	34,992.010	825,622.362	891,098.806	897,824.847	1,324,003.072	67,333.604	55,223.151
已申购基金份额	2,321.797	-	32,605.882	579.221	458,475.330	16,893.606	12,664.734	43,021.824
已赎回基金份额	(1,109.877)	-	(197,093.917)	(63,652.162)	(159,161.090)	(281,173.183)	(5,000.000)	(4,277.677)
期末	145,386.252	34,992.010	661,134.327	828,025.865	1,197,139.087	1,059,723.495	74,998.338	93,967.298

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

归属基金份额持有人资产净值变动表 (未经审计)
 截至 2026 年 6 月 30 日止期间 (续)

	普通英镑 (对冲)分派		普通新西兰元 (对冲)分派		普通人民币 (对冲)累算		普通人民币 (对冲)分派	
	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日 基金份额 数量
期初	408,481.916	710,533.730	482,915.018	593,335.327	1,252.012	1,252.012	3,803,719.748	4,854,361.955
已申购基金份额	105,498.730	39,116.907	123,983.858	16,677.897	-	-	117,774.956	230,843.120
已赎回基金份额	(23,797.369)	(176,355.337)	(128,779.758)	(130,486.993)	-	-	(422,974.560)	(862,837.000)
期末	490,183.277	573,295.300	478,119.118	479,526.231	1,252.012	1,252.012	3,498,520.144	4,222,368.075

	机构 II 美元累算		机构 III 美元累算		普通 M 人民币 (对冲)累算		普通 M 人民币 (对冲)分派	
	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日 基金份额 数量		由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日 基金份额 数量	
期初	328,010.634	327,849.785	3,543,508.893	3,833,926.654	5,522,900.720		2,551,813.390	
已申购基金份额	80.529	81.527	101,886.225	213,496.123	16,725,751.250		6,015,369.000	
已赎回基金份额	-	-	(2,040,953.177)	(396,778.459)	(4,115,926.700)		(1,973,294.120)	
期末	328,091.163	327,931.312	1,604,441.941	3,650,644.318	18,132,725.270		6,593,888.270	

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

归属基金份额持有人资产净值变动表 (未经审计)
截至 2026 年 6 月 30 日止期间 (续)

	普通人民币累算	普通人民币分派
	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日 基金份额 数量	由 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日 基金份额 数量
期初	4,942,154.900	1,516,736.270
已申购基金份额	12,601,820.070	15,383,812.400
已赎回基金份额	(1,946,069.350)	(2,645,119.470)
期末	15,597,905.620	14,255,429.200

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

收益分派 (未经审计)

截至 2026 年 6 月 30 日止六个月

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金在 2026 年 6 月 30 日期间进行了如下分派:

由 2026 年 1 月 1 日
至 2026 年 6 月 30 日

普通美元分派

美元

- 美元 0.03243 / 基金份额, 计 1,369,115.377 基金份额, 于除息日 2026 年 1 月 2 日	44,400
- 美元 0.03280 / 基金份额, 计 1,313,286.486 基金份额, 于除息日 2026 年 2 月 2 日	43,076
- 美元 0.03304 / 基金份额, 计 1,169,106.002 基金份额, 于除息日 2026 年 3 月 2 日	38,627
- 美元 0.03178 / 基金份额, 计 1,175,802.924 基金份额, 于除息日 2026 年 4 月 1 日	37,367
- 美元 0.03251 / 基金份额, 计 1,168,934.900 基金份额, 于除息日 2026 年 5 月 4 日	38,002
- 美元 0.03263 / 基金份额, 计 1,140,062.539 基金份额, 于除息日 2026 年 6 月 1 日	37,200

普通港元分派

港元

- 港元 0.03361 / 基金份额, 计 9,015,074.115 基金份额, 于除息日 2026 年 1 月 2 日	302,997
- 港元 0.03410 / 基金份额, 计 9,377,761.569 基金份额, 于除息日 2026 年 2 月 2 日	319,782
- 港元 0.03447 / 基金份额, 计 12,325,875.979 基金份额, 于除息日 2026 年 3 月 2 日	424,873
- 港元 0.03312 / 基金份额, 计 11,388,661.608 基金份额, 于除息日 2026 年 4 月 1 日	377,192
- 港元 0.03398 / 基金份额, 计 11,457,530.548 基金份额, 于除息日 2026 年 5 月 4 日	389,327
- 港元 0.03406 / 基金份额, 计 11,223,742.037 基金份额, 于除息日 2026 年 6 月 1 日	382,281

普通人民币分派

离岸人民币

- 离岸人民币 0.03785 / 基金份额, 计 144,174.332 基金份额, 于除息日 2026 年 1 月 2 日	5,457
- 离岸人民币 0.03789 / 基金份额, 计 144,174.332 基金份额, 于除息日 2026 年 2 月 2 日	5,463
- 离岸人民币 0.03785 / 基金份额, 计 144,174.332 基金份额, 于除息日 2026 年 3 月 2 日	5,457
- 离岸人民币 0.03650 / 基金份额, 计 146,496.129 基金份额, 于除息日 2026 年 4 月 1 日	5,347
- 离岸人民币 0.03695 / 基金份额, 计 146,496.129 基金份额, 于除息日 2026 年 5 月 4 日	5,413
- 离岸人民币 0.03687 / 基金份额, 计 146,496.129 基金份额, 于除息日 2026 年 6 月 1 日	5,401

普通澳元 (对冲) 分派

澳元

- 澳元 0.03010 / 基金份额, 计 825,622.362 基金份额, 于除息日 2026 年 1 月 2 日	24,851
- 澳元 0.03128 / 基金份额, 计 820,640.159 基金份额, 于除息日 2026 年 2 月 2 日	25,670
- 澳元 0.03286 / 基金份额, 计 802,336.096 基金份额, 于除息日 2026 年 3 月 2 日	26,365
- 澳元 0.03271 / 基金份额, 计 733,947.280 基金份额, 于除息日 2026 年 4 月 1 日	24,007
- 澳元 0.03485 / 基金份额, 计 728,919.441 基金份额, 于除息日 2026 年 5 月 4 日	25,403
- 澳元 0.03617 / 基金份额, 计 669,638.926 基金份额, 于除息日 2026 年 6 月 1 日	24,221

普通加元 (对冲) 分派

加元

- 加元 0.01934 / 基金份额, 计 897,824.847 基金份额, 于除息日 2026 年 1 月 2 日	17,364
- 加元 0.02135 / 基金份额, 计 949,588.006 基金份额, 于除息日 2026 年 2 月 2 日	20,274
- 加元 0.02303 / 基金份额, 计 1,067,734.678 基金份额, 于除息日 2026 年 3 月 2 日	24,590
- 加元 0.02160 / 基金份额, 计 1,084,600.528 基金份额, 于除息日 2026 年 4 月 1 日	23,427
- 加元 0.02199 / 基金份额, 计 1,112,165.707 基金份额, 于除息日 2026 年 5 月 4 日	24,457
- 加元 0.02233 / 基金份额, 计 1,182,782.572 基金份额, 于除息日 2026 年 6 月 1 日	26,412

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

收益分派 (未经审计)

截至 2026 年 6 月 30 日止六个月 (续)

由 2026 年 1 月 1 日
至 2026 年 6 月 30 日

普通欧元 (对冲)分派

	欧元
- 欧元 0.01889 /基金份额, 计 67,333.604 基金份额, 于除息日 2026 年 1 月 2 日	1,272
- 欧元 0.02075 /基金份额, 计 74,824.170 基金份额, 于除息日 2026 年 2 月 2 日	1,553
- 欧元 0.02189 /基金份额, 计 74,824.170 基金份额, 于除息日 2026 年 3 月 2 日	1,638
- 欧元 0.02005 /基金份额, 计 75,587.456 基金份额, 于除息日 2026 年 4 月 1 日	1,516
- 欧元 0.02077 /基金份额, 计 75,587.456 基金份额, 于除息日 2026 年 5 月 4 日	1,570
- 欧元 0.02078 /基金份额, 计 79,998.338 基金份额, 于除息日 2026 年 6 月 1 日	1,662

普通英镑 (对冲)分派

	英镑
- 英镑 0.03246 /基金份额, 计 408,481.916 基金份额, 于除息日 2026 年 1 月 2 日	13,259
- 英镑 0.03292 /基金份额, 计 414,014.151 基金份额, 于除息日 2026 年 2 月 2 日	13,629
- 英镑 0.03314 /基金份额, 计 411,678.215 基金份额, 于除息日 2026 年 3 月 2 日	13,643
- 英镑 0.03169 /基金份额, 计 411,690.059 基金份额, 于除息日 2026 年 4 月 1 日	13,046
- 英镑 0.03262 /基金份额, 计 401,648.152 基金份额, 于除息日 2026 年 5 月 4 日	13,102
- 英镑 0.03284 /基金份额, 计 468,207.933 基金份额, 于除息日 2026 年 6 月 1 日	15,376

普通新西兰元 (对冲)分派

	新西兰元
- 新西兰元 0.02143 /基金份额, 计 482,915.018 基金份额, 于除息日 2026 年 1 月 2 日	10,349
- 新西兰元 0.02238 /基金份额, 计 532,724.013 基金份额, 于除息日 2026 年 2 月 2 日	11,922
- 新西兰元 0.02350 /基金份额, 计 579,412.670 基金份额, 于除息日 2026 年 3 月 2 日	13,616
- 新西兰元 0.02223 /基金份额, 计 577,719.421 基金份额, 于除息日 2026 年 4 月 1 日	12,843
- 新西兰元 0.02319 /基金份额, 计 550,200.274 基金份额, 于除息日 2026 年 5 月 4 日	12,759
- 新西兰元 0.02343 /基金份额, 计 481,174.902 基金份额, 于除息日 2026 年 6 月 1 日	11,274

普通人民币 (对冲)分派

	离岸人民币
- 离岸人民币 0.01657 /基金份额, 计 3,803,719.748 基金份额, 于除息日 2026 年 1 月 2 日	63,028
- 离岸人民币 0.01885 /基金份额, 计 3,795,498.709 基金份额, 于除息日 2026 年 2 月 2 日	71,545
- 离岸人民币 0.01823 /基金份额, 计 3,720,008.831 基金份额, 于除息日 2026 年 3 月 2 日	67,816
- 离岸人民币 0.01607 /基金份额, 计 3,698,653.313 基金份额, 于除息日 2026 年 4 月 1 日	59,437
- 离岸人民币 0.01536 /基金份额, 计 3,698,653.313 基金份额, 于除息日 2026 年 5 月 4 日	56,811
- 离岸人民币 0.01419 /基金份额, 计 3,683,811.697 基金份额, 于除息日 2026 年 6 月 1 日	52,273

普通 M 人民币(对冲)分派

	离岸人民币
- 离岸人民币 0.00643 /基金份额, 计 2,551,813.390 基金份额, 于除息日 2026 年 1 月 5 日	16,408
- 离岸人民币 0.00658 /基金份额, 计 6,990,125.430 基金份额, 于除息日 2026 年 4 月 1 日	45,995

普通 M 人民币分派

	离岸人民币
- 离岸人民币 0.01224 /基金份额, 计 1,516,736.270 基金份额, 于除息日 2026 年 1 月 5 日	18,565
- 离岸人民币 0.01180 /基金份额, 计 16,758,375.640 基金份额, 于除息日 2026 年 4 月 1 日	197,749

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

收益分派 (未经审计)

截至 2026 年 6 月 30 日止六个月 (续)

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金在 2025 年 6 月 30 日期间进行了如下分派:

由 2025 年 1 月 1 日
至 2025 年 6 月 30 日

普通美元分派

美元

- 美元 0.03088/基金份额, 计 1,725,771.610 基金份额, 于除息日 2025 年 1 月 2 日	53,292
- 美元 0.03088/基金份额, 计 1,677,816.860 基金份额, 于除息日 2025 年 2 月 3 日	51,811
- 美元 0.03125/基金份额, 计 1,648,464.420 基金份额, 于除息日 2025 年 3 月 3 日	51,515
- 美元 0.03117/基金份额, 计 1,465,679.440 基金份额, 于除息日 2025 年 4 月 1 日	59,211
- 美元 0.03096/基金份额, 计 1,378,706.470 基金份额, 于除息日 2025 年 5 月 2 日	42,685
- 美元 0.03125/基金份额, 计 1,361,091.970 基金份额, 于除息日 2025 年 6 月 2 日	42,534

普通港元分派

港元

- 港元 0.03198/基金份额, 计 11,549,905.040 基金份额, 于除息日 2025 年 1 月 2 日	369,366
- 港元 0.03206/基金份额, 计 10,748,797.710 基金份额, 于除息日 2025 年 2 月 3 日	344,606
- 港元 0.03239/基金份额, 计 10,829,629.540 基金份额, 于除息日 2025 年 3 月 3 日	350,772
- 港元 0.03231/基金份额, 计 10,764,444.730 基金份额, 于除息日 2025 年 4 月 1 日	347,799
- 港元 0.03202/基金份额, 计 10,827,674.510 基金份额, 于除息日 2025 年 5 月 2 日	346,702
- 港元 0.03263/基金份额, 计 9,901,149.090 基金份额, 于除息日 2025 年 6 月 2 日	323,074

普通人民币分派

离岸人民币

- 离岸人民币 0.03756/基金份额, 计 34,992.020 基金份额, 于除息日 2025 年 1 月 2 日	1,314
- 离岸人民币 0.03744/基金份额, 计 34,992.020 基金份额, 于除息日 2025 年 2 月 3 日	1,310
- 离岸人民币 0.03773/基金份额, 计 34,992.020 基金份额, 于除息日 2025 年 3 月 3 日	1,320
- 离岸人民币 0.03769/基金份额, 计 34,992.020 基金份额, 于除息日 2025 年 4 月 1 日	1,319
- 离岸人民币 0.03756/基金份额, 计 34,992.020 基金份额, 于除息日 2025 年 5 月 2 日	1,314
- 离岸人民币 0.03732/基金份额, 计 34,992.020 基金份额, 于除息日 2025 年 6 月 2 日	1,306

普通澳元 (对冲)分派

澳元

- 澳元 0.02911/基金份额, 计 891,098.820 基金份额, 于除息日 2025 年 1 月 2 日	25,940
- 澳元 0.03014/基金份额, 计 887,407.790 基金份额, 于除息日 2025 年 2 月 3 日	26,746
- 澳元 0.02968/基金份额, 计 885,483.050 基金份额, 于除息日 2025 年 3 月 3 日	26,281
- 澳元 0.02871/基金份额, 计 884,272.600 基金份额, 于除息日 2025 年 4 月 1 日	25,387
- 澳元 0.02820/基金份额, 计 872,050.370 基金份额, 于除息日 2025 年 5 月 2 日	24,592
- 澳元 0.02767/基金份额, 计 859,343.630 基金份额, 于除息日 2025 年 6 月 2 日	23,778

普通加元 (对冲)分派

加元

- 加元 0.02204/基金份额, 计 1,324,003.080 基金份额, 于除息日 2025 年 1 月 2 日	29,181
- 加元 0.02209/基金份额, 计 1,318,014.140 基金份额, 于除息日 2025 年 2 月 3 日	29,115
- 加元 0.02227/基金份额, 计 1,293,924.020 基金份额, 于除息日 2025 年 3 月 3 日	28,816
- 加元 0.02055/基金份额, 计 1,101,532.840 基金份额, 于除息日 2025 年 4 月 1 日	22,636
- 加元 0.01880/基金份额, 计 1,094,468.990 基金份额, 于除息日 2025 年 5 月 2 日	20,576
- 加元 0.01933/基金份额, 计 1,108,722.910 基金份额, 于除息日 2025 年 6 月 2 日	21,432

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

收益分派 (未经审计)

截至 2026 年 6 月 30 日止六个月 (续)

由 2025 年 1 月 1 日
至 2025 年 6 月 30 日

普通欧元 (对冲)分派

	欧元
- 欧元 0.02057/基金份额, 计 55,223.150 基金份额, 于除息日 2025 年 1 月 2 日	1,136
- 欧元 0.02082/基金份额, 计 55,223.150 基金份额, 于除息日 2025 年 2 月 3 日	1,150
- 欧元 0.02095/基金份额, 计 55,223.150 基金份额, 于除息日 2025 年 3 月 3 日	1,157
- 欧元 0.01876/基金份额, 计 50,945.480 基金份额, 于除息日 2025 年 4 月 1 日	956
- 欧元 0.01733/基金份额, 计 58,892.070 基金份额, 于除息日 2025 年 5 月 2 日	1,021
- 欧元 0.01622/基金份额, 计 93,967.300 基金份额, 于除息日 2025 年 6 月 2 日	1,524

普通英镑 (对冲)分派

	英镑
- 英镑 0.03215/基金份额, 计 710,533.730 基金份额, 于除息日 2025 年 1 月 2 日	22,844
- 英镑 0.03276/基金份额, 计 695,032.240 基金份额, 于除息日 2025 年 2 月 3 日	22,769
- 英镑 0.03214/基金份额, 计 604,018.040 基金份额, 于除息日 2025 年 3 月 3 日	19,413
- 英镑 0.03184/基金份额, 计 594,360.950 基金份额, 于除息日 2025 年 4 月 1 日	18,924
- 英镑 0.03093/基金份额, 计 586,369.710 基金份额, 于除息日 2025 年 5 月 2 日	18,136
- 英镑 0.03028/基金份额, 计 583,933.650 基金份额, 于除息日 2025 年 6 月 2 日	17,682

普通新西兰元 (对冲)分派

	新西兰元
- 新西兰元 0.02774/基金份额, 计 593,335.330 基金份额, 于除息日 2025 年 1 月 2 日	16,459
- 新西兰元 0.02878/基金份额, 计 603,415.850 基金份额, 于除息日 2025 年 2 月 3 日	17,366
- 新西兰元 0.02781/基金份额, 计 546,994.990 基金份额, 于除息日 2025 年 3 月 3 日	15,212
- 新西兰元 0.02590/基金份额, 计 539,369.530 基金份额, 于除息日 2025 年 4 月 1 日	13,970
- 新西兰元 0.02434/基金份额, 计 539,369.530 基金份额, 于除息日 2025 年 5 月 2 日	13,128
- 新西兰元 0.02343/基金份额, 计 479,526.240 基金份额, 于除息日 2025 年 6 月 2 日	11,235

普通人民币 (对冲)分派

	离岸人民币
- 离岸人民币 0.01988/基金份额, 计 4,854,361.960 基金份额, 于除息日 2025 年 1 月 2 日	96,505
- 离岸人民币 0.02145/基金份额, 计 4,667,926.090 基金份额, 于除息日 2025 年 2 月 3 日	100,127
- 离岸人民币 0.01882/基金份额, 计 4,241,606.350 基金份额, 于除息日 2025 年 3 月 3 日	79,827
- 离岸人民币 0.01431/基金份额, 计 4,082,570.850 基金份额, 于除息日 2025 年 4 月 1 日	58,422
- 离岸人民币 0.01438/基金份额, 计 4,059,617.700 基金份额, 于除息日 2025 年 5 月 2 日	58,377
- 离岸人民币 0.01251/基金份额, 计 4,021,539.270 基金份额, 于除息日 2025 年 6 月 2 日	50,309

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/报价货币市场工具 (按来源地)			
债券 (67.38 %)			
澳大利亚 (1.71%)			
AUST & NZ BANKING GROUP SER REGS (REG S) VAR 30/9/2035	200,000	197,100	0.24
AUSTRALIA (GOVT OF) SER 166 (REG S) 3% 21/11/2033	1,000,000	625,006	0.75
NATIONAL AUSTRALIA BK/NY SER B 4.434 % 04/06/2029	300,000	299,742	0.36
QBE INSURANCE GROUP LTD SER EMTN VAR 10/11/2037	300,000	298,035	0.36
		1,419,883	1.71
		-----	-----
智利 (1.17%)			
ANTOFAGASTA PLC SER REGS 5.625 % 09/09/2035	250,000	253,414	0.30
CHILE (REP OF) (REG) 1.25% 29/01/2040	400,000	335,104	0.40
CHILE (REP OF) (REG) 1.3% 26/07/2036	300,000	274,187	0.33
REPUBLIC OF CHILE 3.75 % 14/01/2032	100,000	115,841	0.14
		978,546	1.17
		-----	-----
中国 (1.22%)			
CHINA (GOVT OF) SER INBK (REG) 2.91% 14/10/2028(INTERBANK)	3,000,000	460,282	0.55
CHINA (GOVT OF) SER INBK (REG) 3.28% 03/12/2027(INTERBANK)	2,200,000	335,237	0.40
CHINA GOVERNMENT BOND SER INBK 1.49% 25/12/2031 (INTERBANK)	1,500,000	221,480	0.27
		1,016,999	1.22
		-----	-----
芬兰 (0.31%)			
NORDEA BANK ABP SER EMTN (REG S) (BR) VAR 18/08/2031	230,000	262,341	0.31
		262,341	0.31
		-----	-----
法国 (4.66%)			
CREDIT AGRICOLE SA (REG S) (BR) VAR PERP 31/12/2049	300,000	343,305	0.41
FRANCE (GOVT OF) (REG S) 1.5% 25/05/2050	200,000	133,800	0.16
FRANCE (GOVT OF) (REG S) 2% 25/11/2032	450,000	480,115	0.57
FRANCE (GOVT OF) (REG) (REG S) 0.5% 25/05/2040	360,000	261,613	0.31
FRANCE (GOVT OF) (REG) 4.75% 25/04/2035	600,000	752,873	0.90
FRANCE (GOVT OF) (REGS) 1.5% 25/05/2031	500,000	534,148	0.64
FRANCE (GOVT OF) 1.75% 25/06/2039	500,000	450,617	0.54
SOCIETE GENERALE SA SER REGS (REG S) VAR 10/04/2037	371,000	363,822	0.44

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/报价货币市场工具 (按来源地) (续)			
债券 (67.38%) (续)			
法国 (4.66%) (续)			
SOCIETE GENERALE SER REGS (REG) (REG S) VAR 21/01/2033	400,000	363,409	0.44
TOTAL CAPITAL SA (REG) 3.883% 11/10/2028	210,000	207,966	0.25
		3,891,668	4.66
德国 (5.49%)			
ALLIANZ SE (REG S) (BR) VAR PERP 31/12/2049	200,000	203,671	0.24
BMW US CAPITAL LLC SER REGS (REG) (REG S) 1.95% 12/08/2031	404,000	349,902	0.42
BUNDESCHATZANWEISINGEN (REG S) (BR) 0% 15/08/2031	400,000	401,209	0.48
BUNDESCHATZANWEISINGEN (REG S) (BR) 0% 15/02/2032	300,000	296,566	0.35
BUNDESCHATZANWEISINGEN (REG S) (BR) 2.1% 15/03/2028	500,000	567,597	0.68
BUNDESCHATZANWEISINGEN (REG S) (BR) 2.3% 15/02/2033	850,000	949,102	1.14
BUNDESCHATZANWEISINGEN (REG S) (BR) 2.9% 15/02/2036	300,000	344,350	0.41
BUNDESCHATZANWEISINGEN SER 189 (REG S) (BR) 2.1% 12/04/2029	400,000	452,141	0.54
DEUTSCHE BANK NY (REG) VAR 18/09/2031	400,000	377,687	0.45
GERMANY (REP OF) (BR) 3.25% 04/07/2042	220,000	252,262	0.30
KFW 4% 28/06/2027	400,000	399,655	0.48
		4,594,142	5.49
香港 (1.02%)			
AIA GROUP LTD SER GMTN (REG) (REG S) VAR 09/09/2033	100,000	108,876	0.13
AIRPORT AUTHORITY HK SER REGS 5.125% 15/01/2035	200,000	209,426	0.25
MTR CORP LTD SER EMTN (REG) 4.875% 01/04/2035	300,000	308,330	0.37
MTR CORP LTD SER EMTN 3.625% 10/06/2038	200,000	226,646	0.27
		853,278	1.02
匈牙利 (0.24%)			
HUNGARY SER REGS 5.375% 26/09/2030	200,000	203,197	0.24
		203,197	0.24

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/报价货币市场 工具(按来源地) (续)			
债券 (67.38%) (续)			
印度 (0.82%)			
INDIAN RAILWAY FINANCE SER REGS (REG) (REG S) 3.57% 21/01/2032	200,000	186,188	0.22
STATE BANK INDIA/LONDON SER EMTN (REG) 5.125% 25/11/2029	500,000	503,975	0.60
		690,163	0.82
		-----	-----
印度尼西亚 (2.21%)			
BANK MANDIRI PT SER EMTN 5.25% 10/04/2031	200,000	199,738	0.24
HUTAMA KARYA PERSERO PT SER REGS (REG S) 3.75% 11/05/2030	250,000	238,159	0.29
INDONESIA (REP OF) (REG) 3.05% 12/03/2051	355,000	227,765	0.27
INDONESIA (REP OF) SER FR 6.625% 15/02/2034	4,902,000,000	263,325	0.32
INDONESIA (REP OF) SER FR65 6.625PCT 15/05/2033	5,500,000,000	295,746	0.35
INDONESIA (REP OF) SER FR91 6.375% 15/04/2032	4,000,000,000	213,981	0.26
PERTAMINA HULU ENERGI PT SER REGS 5.25% 21/05/2030	200,000	199,713	0.24
REPUBLIC OF INDONESIA 5.69% 29/05/2036	200,000	204,350	0.24
		1,842,777	2.21
		-----	-----
意大利 (6.14%)			
A2A SPA SER EMTN (REG S) (BR) 0.625% 15/07/2031	205,000	205,380	0.25
BUONI POLIENNALI DEL TES (BR) (REG S) 2.25% 01/09/2036	600,000	609,079	0.73
BUONI POLIENNALI DEL TES (REG S) 3.45% 01/03/2048	250,000	255,478	0.31
BUONI POLIENNALI DEL TES SER 7Y 3.25% 15/07/2032	250,000	287,468	0.34
CASSA DEPOSITI E PRESTIT SER EMTN 3.25% 03/06/2031	300,000	343,727	0.41
CASSA DEPOSITI E PRESTIT SER EMTN 3.25% 17/06/2033	100,000	113,132	0.14
CASSA DEPOSITI E PRESTIT SER REGS (REG S) 5.875% 30/04/2029	285,000	294,451	0.35
ENI SPA SER NC6 (REG S) (BR) VAR PERP 31/12/2049	200,000	226,314	0.27
ENI SPA SER REGS 5.75% 19/05/2035	200,000	205,696	0.25
GENERALI SER EMTN 4.135% 18/06/2036	200,000	228,541	0.27
ITALY (REP OF) (REG S) (BR) 0.95% 01/06/2032	300,000	303,562	0.36
ITALY (REP OF) (REG S) 3.25% 01/03/2038	410,000	447,544	0.54
ITALY (REP OF) (REG) 4% 17/10/2049	500,000	385,617	0.46
ITALY (REP OF) 5PCT 01/09/2040	250,000	320,444	0.38
ITALY (REP OF) SER 10Y (REG S) (BR) 3.45% 01/02/2036	300,000	340,275	0.41

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)			
债券 (67.38 %) (续)			
意大利 (6.14%)(续)			
ITALY (REP OF) SER 5Y (REG S) (BR) 2.85%			
01/02/2031	200,000	227,445	0.27
ITALY (REP OF) SER CPI (REG S) 2.55% 15/09/2041	190,000	336,038	0.40
		5,130,191	6.14
日本 (2.22%)			
JAPAN (GOVT OF) SER 169 0.3% 20/06/2039	80,000,000	347,577	0.42
JAPAN (GOVT OF) SER 363 0.1% 20/06/2031	22,000,000	123,857	0.15
JAPAN (GOVT OF) SER 65 0.4% 20/12/2049	58,000,000	170,215	0.20
JPN BANK FOR INT'L COOP 3.875% 03/07/2028	350,000	347,231	0.42
MELJI YASUDA LIFE INSURA SER REGS VAR			
11/06/2055	500,000	506,325	0.61
NOMURA HOLDINGS INC 4.904% 01/07/2030	350,000	349,448	0.42
		1,844,653	2.22
哈萨克斯坦 (0.47%)			
REPUBLIC OF KAZAKHSTAN SER REGS (REG)			
4.714% 09/04/2035	400,000	392,838	0.47
		392,838	0.47
韩国 (0.79%)			
INDUSTRIAL BANK OF KOREA SER REGS 4.375%			
24/06/2030	270,000	269,740	0.32
KOREA HOUSING FINANCE CO SER REGS 3.875%			
17/09/2030	400,000	390,642	0.47
		660,382	0.79
卢森堡 (0.79%)			
EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.25 % 16/08/2032	400,000	399,598	0.48
INTL BK RECON & DEVELOP SER EMTN (REG)			
6.5% 17/04/2030	25,000,000	257,517	0.31
		657,115	0.79
澳门 (0.23%)			
SANDS CHINA LTD SER WI (REG) 4.375%			
18/06/2030	200,000	193,997	0.23
		193,997	0.23

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)			
债券 (67.38%) (续)			
马来西亚 (1.98%)			
KHAZANAH CAPITAL LTD SER EMTN (REG) (REG S) 4.876% 01/06/2033	200,000	202,239	0.24
MALAYSIA GOVERNMENT SER 223 3.519% 20/04/2028	2,800,000	690,835	0.83
MALAYSIA GOVERNMENT SER 225 3.476% 02/07/2035	1,000,000	242,881	0.29
PETRONAS CAPITAL LTD SER REGS 5.848% 03/04/2055	500,000	519,790	0.62
		1,655,745	1.98
墨西哥 (2.49%)			
(D)MEXICAN BONOS DESARROL 7.5% 03/06/2027	87,000	503,172	0.60
(DIRTY)MEXICO (UTD STATES OF) 8.5% 31/05/2029	70,000	409,505	0.49
(DIRTY)MEXICO (UTD STATES OF) SER M 7.5% 26/05/2033	27,000	146,026	0.17
(DIRTY)MEXICO (UTD STATES OF) SER M 7.5% 26/05/2033	80,000	432,668	0.52
MEXICO (UTD STATES OF) (REG) 4.875% 16/05/2036	237,000	271,895	0.33
UNITED MEXICAN STATES 3.5% 19/09/2029	150,000	170,505	0.20
UNITED MEXICAN STATES 4.5% 19/03/2034	130,000	148,718	0.18
		2,082,489	2.49
荷兰 (1.01%)			
ABN AMRO BANK NV SER REGS VAR 03/12/2035	200,000	203,364	0.24
AKZO NOBEL NV SER EMTN (REG S) (BR) 3.75% 16/09/2034	120,000	135,278	0.16
ING GROEP NV VAR 25/03/2036	241,000	244,845	0.29
JDE PEET'S NV SER EMTN (REG S) (BR) 0.5% 16/01/2029	250,000	265,877	0.32
		849,364	1.01
菲律宾 (1.09%)			
PHILIPPINES (REP OF) (REG) 0.7% 03/02/2029	250,000	267,849	0.32
PHILIPPINES (REP OF) SER 2017 8PCT 109/07/2031	12,000,000	206,010	0.25
PHILIPPINES (REP OF) SER 770 6.375% 27/07/2030	15,000,000	242,212	0.29
REPUBLIC OF PHILIPPINES (REG) 2.65% 10/12/2045	306,000	196,271	0.23
		912,342	1.09
波兰 (0.71%)			
REPUBLIC OF POLAND 3.875% 22/10/2039	250,000	283,244	0.34
REPUBLIC OF POLAND 5.375% 12/02/2035	300,000	306,737	0.37
		589,981	0.71

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具 (按来源地) (续)			
债券 (67.38%) (续)			
沙特阿拉伯 (0.96%)			
SAUDI ARABIAN OIL CO SER REGS 4.75% 02/06/2030	200,000	199,288	0.24
SAUDI ARABIAN OIL CO SER REGS 5 % 02/02/2036	240,000	234,941	0.28
SAUDI INTERNATIONAL BOND SER REGS (REG S) 2.25% 02/02/2033	200,000	170,164	0.20
SAUDI INTERNATIONAL BOND SER REGS 4.875 % 12/01/2036	200,000	196,876	0.24
		801,269	0.96
新加坡 (1.01%)			
OVERSEA-CHINESE BANKING (REG S) VAR 15/06/2032	290,000	289,782	0.35
PSA TREASURY PTE LTD SER EMTN (REG) 2.7% 03/06/2035	1,000,000	150,636	0.18
SINGAPORE GOVERNMENT 2.625% 01/08/2032	500,000	403,378	0.48
		843,796	1.01
西班牙 (2.06%)			
REPSOL EUROPE FINANCE SER EMTN (REG S) (BR) 3.625% 05/09/2034	300,000	342,744	0.41
SPAIN (GOVT OF) (REG S) 1.9% 31/10/2052	480,000	365,294	0.44
SPAIN (GOVT OF) (REG S) 3.45% 30/07/2043	492,000	540,105	0.65
SPAIN (GOVT OF) (REG) (REG S) 3.45% 31/10/2034	400,000	467,082	0.56
		1,715,225	2.06
瑞典 (0.42%)			
MOLNLYCKE HOLDING AB SER EMTN (REG S) (BR) 4.25% 11/06/2034	300,000	353,090	0.42
		353,090	0.42
瑞士 (0.88%)			
UBS GROUP AG SER REGS (REG) (REG S) VAR 11/02/2032	200,000	176,365	0.21
UBS GROUP AG SER REGS VAR 06/05/2047	350,000	338,564	0.41
UBS GROUP AG SER REGS VAR 06/11/2033	220,000	216,203	0.26
		731,132	0.88

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)			
债券 (67.38%) (续)			
阿拉伯联合酋长国 (0.77%)			
ABU DHABI GOVT INT'L SER REGS (REG) (REG S)			
1.875% 15/09/2031	200,000	174,665	0.21
FIRST ABU DHABI 4.38% 10/09/2030	300,000	294,342	0.35
UAE INT'L GOVT BOND SER REGS (REG) (REG S)			
2% 19/10/2031	200,000	177,023	0.21
		646,030	0.77
英国 (5.07%)			
BACR SER EMTN (REG) (REG S) FRN 31/05/2036	200,000	238,392	0.29
BARCLAYS PLC (REG) (REG S) VAR 31/01/2036	160,000	183,790	0.22
CK HUTCHISON INTL 24 SER REGS (REG) (REG S)			
5.375% 26/04/2029	300,000	306,656	0.37
EUROPEAN BK RECON & DEV SER EMTN 6.75%			
13/01/2032	20,000,000	206,425	0.25
HSBC HOLDINGS PLC VAR 06/11/2036	300,000	295,375	0.35
HSBC HOLDINGS PLC VAR 10/09/2036	300,000	302,313	0.36
HSBC HOLDINGS PLC VAR 25/09/2030	200,000	229,873	0.28
HSBC HOLDINGS PLC VAR PERP 31/12/2049	200,000	205,402	0.25
INTER-AMERICAN DEVEL BK SER EMTN (REG) 7%			
17/04/2033	25,000,000	258,534	0.31
LLOYDS BANKING GROUP PLC SER VAR 13/06/2036	350,000	360,811	0.43
LLOYDS BANKING GROUP PLC VAR 04/11/2036	300,000	291,251	0.35
STANDARD CHARTERED SER REGS (REG S) VAR			
29/06/2032	200,000	179,410	0.21
STANDARD CHARTERED PLC SER REGS VAR			
13/05/2031	200,000	202,326	0.24
TESCO CORP TREASURY SERV SER EMTN 3.5%			
13/10/2033	200,000	227,047	0.27
UK (GILTS) (REG) (REG S) 3.25% 31/01/2033	300,000	370,645	0.44
UK (GILTS) (REG) (REG S) 4.125% 22/07/2029	100,000	132,409	0.16
UK TREASURY 4.5% 07/12/2042	200,000	243,444	0.29
		4,234,103	5.07
美国 (19.07%)			
ABBOTT LABORATORIES (REG) 4.75% 15/04/2043	200,000	184,081	0.22
ALPHABET INC 4.1 % 11/05/2039	100,000	116,723	0.14
AMGEN INC (REG) 1.65% 15/08/2028	300,000	282,758	0.34
BEST BUY CO INC 1.95% 01/10/2030	340,000	302,957	0.36
BP CAP MARKETS AMERICA 1.749% 10/08/2030	400,000	357,170	0.43

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)			
债券 (67.38%) (续)			
美国 (19.07%)(续)			
CATERPILLAR INC 5.5% 15/05/2055	196,000	199,195	0.24
COMCAST CORP 1.95% 15/01/2031	280,000	247,468	0.30
CVS HEALTH CORP (REG) 2.125% 15/09/2031	200,000	174,922	0.21
CVS HEALTH CORP 1.875% 28/02/2031	400,000	350,946	0.42
FEDEX CORP SER (REG) 2.4% 15/05/2031	200,000	180,476	0.22
GENERAL MOTORS FINL CO (REG) 3.1% 12/01/2032	400,000	362,227	0.43
HYUNDAI CAPITAL AMERICA SER REGS (REG S) 3% 10/02/2027	235,000	232,900	0.28
INTEL CORP (REG) 2.45% 15/11/2029	350,000	325,727	0.39
INTER-AMERICAN DEVEL BK 4.375% 16/07/2035	400,000	398,424	0.48
INTL BK RECON & DEVELOP (REG) 6.85% 24/04/2028	38,000,000	398,351	0.48
INTL FINANCE CORP SER GMTN 3.875% 02/07/2030	350,000	346,072	0.41
JPMORGAN CHASE & CO VAR 22/04/2032	400,000	360,579	0.43
MERCK & CO INC (REG) 2.15% 10/12/2031	400,000	353,108	0.42
MORGAN STANLEY (REG) VAR 19/01/2038	200,000	205,857	0.25
NIKE INC (REG) 2.85% 27/03/2030	330,000	311,211	0.37
PHILLIPS 66 (REG) 2.15% 15/12/2030	400,000	358,932	0.43
PROLOGIS LP (REG) 1.25% 15/10/2030	200,000	173,923	0.21
RTX CORPORATION (REG) 1.9% 01/09/2031	400,000	349,629	0.42
THERMO FISHER SCIENTIFIC (REG) 2% 15/10/2031	400,000	351,713	0.42
UNITED PARCEL SERVICE 5.95% 14/05/2055	400,000	408,977	0.49
US TREASURY 2% 15/08/2051	595,700	339,293	0.41
US TREASURY 2.375% 15/02/2042	600,000	437,801	0.52
US TREASURY 2.75% 15/08/2032	300,000	275,566	0.33
US TREASURY 2.875% 15/05/2052	700,000	484,354	0.58
US TREASURY 3.5% 31/01/2030	651,000	636,454	0.76
US TREASURY 3.625% 31/05/2028	300,000	297,070	0.36
US TREASURY 3.875% 15/08/2034	690,000	666,551	0.80
US TREASURY 4.125% 15/08/2044	600,000	542,813	0.65
US TREASURY 4.625% 15/05/2044	1,072,000	1,035,946	1.24
US TREASURY N/B 1.125% 105/05/2040	900,000	569,830	0.68
US TREASURY N/B 2.625% 15/02/2029	350,000	336,731	0.40
US TREASURY N/B 2.875% 15/08/2028	400,000	389,648	0.47
US TREASURY N/B 4.625% 15/02/2055	600,000	570,305	0.68
US TREASURY NOTE/BOND 1.5% 15/02/2030	650,000	592,262	0.71
US TREASURY NOTES 6.125% 15/11/2027	1,200,000	1,231,734	1.47
VERIZON COMMUNICATIONS 2.55% 21/03/2031	200,000	181,617	0.22
		15,922,301	19.07

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)			
债券 (67.38%) (续)			
乌拉圭 (0.25%)			
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.442% 14/02/2037	200,000	205,500	0.25
		205,500	0.25
委内瑞拉 (0.38%)			
CORP ANDINA DE FOMENTO 4.625 % 15/01/2036	100,000	98,674	0.12
		98,674	0.12
债券合计		56,273,211	67.38
股票 (22.32%)			
澳大利亚 (0.51%)			
ANZ GROUP HOLDINGS LTD (澳新银行集团有限公司)	920	22,531	0.03
ARISTOCRAT LEISURE LTD (雅士利休闲有限公司)	546	23,177	0.03
BHP GROUP LTD (必和必拓)	2,106	86,667	0.10
COLES GROUP LTD (科尔斯集团)	551	9,303	0.01
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA (澳洲联邦银行)	415	47,330	0.06
FORTESCUE LTD (福德士河集团有限公司)	640	8,491	0.01
MACQUARIE GROUP LTD (麦格理集团有限公司)	247	42,830	0.05
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD (澳洲国民银行)	1,023	26,833	0.03
ORIGIN ENERGY LIMITED (起源能源有限公司)	1,950	14,834	0.02
RIO TINTO LTD (力拓集团)	358	42,786	0.05
TELSTRA GROUP LTD (澳洲电信)	3,210	11,297	0.01
WESFARMERS LTD (西农集团)	377	23,611	0.03
WESTPAC BANKING CORP (西太平洋银行)	1,278	31,175	0.04
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD (伍德赛德能源集团)	1,215	23,746	0.03
WOOLWORTHS GROUP LTD (伍尔沃斯集团有限公司)	441	12,230	0.01
		426,841	0.51

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)			
股票 (22.32%) (续)			
比利时 (0.10%)			
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA	477	39,625	0.05
KBC GROUPE (比利时联合银行)	310	42,283	0.05
		81,908	0.10
中国 (1.43%)			
中国农业银行股份有限公司 - H	21,000	14,300	0.02
康方生物科技(開曼)有限公司	1,000	11,228	0.01
阿里巴巴集团控股有限公司	10,500	124,320	0.15
安踏体育用品有限公司	600	5,436	0.01
百度集团股份有限公司 - A	2,850	39,831	0.05
中国银行股份有限公司 - H	64,000	40,724	0.05
比亚迪股份有限公司	2,500	23,097	0.03
中国建设银行股份有限公司 - H	59,000	60,715	0.07
中国宏桥集团有限公司	5,000	12,790	0.02
中国国际金融股份有限公司 - H	3,600	9,640	0.01
中国人寿保险股份有限公司 - H	8,000	27,197	0.03
中国蒙牛乳业有限公司	5,000	10,259	0.01
中国招商银行股份有限公司 - H	2,500	14,320	0.02
中国海外发展有限公司	7,500	11,534	0.01
中国石油化工股份有限公司 - H	14,000	7,141	0.01
华润置地有限公司	2,000	7,651	0.01
中信证券股份有限公司 - H	2,000	6,952	0.01
洛阳栾川钼业集团股份有限公司 - H	15,000	29,036	0.03
宁德时代新能源科技股份有限公司	200	17,903	0.02
中国中车股份有限公司 - H	16,000	9,161	0.01
新奥能源控股有限公司	2,400	12,382	0.01
万国数据控股有限公司 - A	2,700	9,723	0.01
吉利汽车控股有限公司 - A	4,000	8,600	0.01
地平线机器人有限公司	10,800	5,619	0.01
华虹半导体有限公司	1,000	27,442	0.03
中国工商银行股份有限公司 - H	54,000	44,277	0.05
信达生物制药	2,000	20,301	0.02
京东集团股份有限公司 - A	2,950	37,336	0.04
快手科技	2,700	14,323	0.02
昆仑能源有限公司	8,000	6,560	0.01
联想集团有限公司	6,000	17,613	0.02
美团 - B	3,450	30,136	0.04
美的集团股份有限公司 - H	1,000	10,533	0.01
敏实集团有限公司	3,300	11,118	0.01

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)			
股票 (22.32%) (续)			
中国 (1.43%) (续)			
网易	900	23,229	0.03
新东方教育科技集团有限公司	1,100	5,033	0.01
蔚来集团 - A	1,080	5,335	0.01
农夫山泉股份有限公司 - H	1,600	8,084	0.01
中国石油天然气股份有限公司 - H	38,000	41,091	0.05
中国人民财产保险股份有限公司 - H	2,000	3,652	0.00
中国平安保险(集团)股份有限公司 - H	7,500	48,823	0.06
泡泡玛特国际集团有限公司	400	7,891	0.01
PROSUS NV	863	37,484	0.04
山东黄金矿业股份有限公司	1,750	3,727	0.00
中国生物制药有限公司	16,000	8,998	0.01
国药控股股份有限公司 - H	1,600	3,246	0.00
桑德国际有限公司	159,000	-	-
腾讯控股有限公司	2,600	142,498	0.17
携程集团有限公司	550	21,854	0.03
潍柴动力股份有限公司 - H	7,000	30,438	0.04
药明生物技术有限公司	3,500	15,442	0.02
小米集团	9,600	26,491	0.03
小鹏汽车有限公司 - A	800	5,167	0.01
百胜中国控股有限公司	250	10,189	0.01
中联重科股份有限公司	10,600	9,327	0.01
中通快递(开曼)有限公司	300	6,565	0.01
		1,203,762	1.43
丹麦 (0.14%)			
CARLSBERG - B (嘉士伯)	226	29,617	0.04
NOVO NORDISK (诺和诺德)	700	33,683	0.04
NOVONESIS (NOVOZYMES) - B (诺和新元)	746	47,113	0.06
		110,413	0.14
芬兰 (0.08%)			
KONE OYJ - B (通力)	815	46,366	0.06
NOKIA OYJ (诺基亚公司)	1,114	14,717	0.02
		61,083	0.08
法国 (0.38%)			
AIR LIQUIDE SA (液化空气集团)	183	36,254	0.04
AIRBUS SE (空中巴士集团)	175	38,923	0.05
ARKEMA (阿科玛)	312	19,673	0.02

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)			
股票 (22.32%) (续)			
法国 (0.38%)(续)			
AXA (安盛集团)	1,011	50,685	0.06
ESSILORLUXOTTICA (依视路陆逊梯卡集团)	121	22,695	0.03
KERING (开云)	75	21,205	0.03
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE (路威酩轩集团)	40	22,139	0.03
MICHELIN (CGDE) (米其林)	729	28,129	0.03
THALES SA (达利斯)	99	25,444	0.03
VEOLIA ENVIRONNEMENT (威立雅环境服务有限公司)	1,177	49,036	0.06
		314,183	0.38
		-----	-----
德国 (0.54%)			
ADIDAS (阿迪达斯股份公司)	139	28,510	0.03
ALLIANZ SE REG (安联欧洲股份公司)	151	71,490	0.09
DAIMLER TRUCK HOLDING AG (戴姆勒卡车控股股份公司)	890	42,940	0.05
DEUTSCHE POST AG (德国邮政股份公司)	323	19,609	0.02
DEUTSCHE TELEKOM AG (德国电信股份公司)	1,047	28,549	0.03
HENKEL AG AND CO KGAA – P	368	30,941	0.04
INFINEON TECHNOLOGIES AG (英飞凌科技股份公司)	503	46,967	0.06
KION GROUP AG (凯傲集团)	518	22,961	0.03
MERCK KGAA (默克集团)	333	55,909	0.07
SAP SE (SAP 公司)	269	41,211	0.05
SIEMENS AG (西门子股份有限公司)	193	62,038	0.07
		451,125	0.54
		-----	-----
希腊(0.05%)			
HELLENIC TELECOMMUNICATION ORGANIZATION (希腊电信组织有限公司)	2,021	44,895	0.05
		44,895	0.05
		-----	-----
香港 (0.31%)			
友邦保险控股有限公司	7,400	67,422	0.08
ASMPT LIMITED	200	6,090	0.01
中国银行(香港)有限公司	5,500	29,723	0.04
中电控股有限公司	1,500	14,001	0.02
长江实业集团有限公司	1,500	8,451	0.01
长江基建集团有限公司	1,000	7,613	0.01
香港交易及结算所有限公司	897	41,521	0.05
置地控股有限公司	1,600	11,392	0.01

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
股票 (22.32%) (续)			
香港 (0.31%) (续)			
领展资产管理有限公司	1,800	8,378	0.01
新鸿基地产发展有限公司	1,529	21,896	0.03
创科实业有限公司	1,500	24,770	0.03
万洲国际有限公司	5,500	5,814	0.01
		247,071	0.31
印度尼西亚 (0.03%)			
BANK CENTRAL ASIA TBK (中亚银行)	37,400	11,609	0.01
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED (怡和控股有限公司)	300	18,450	0.02
		30,059	0.03
爱尔兰 (0.08%)			
BANK OF IRELAND GROUP PLC (爱尔兰银行集团有限公司)	3,228	64,308	0.08
		64,308	0.08
意大利 (0.11%)			
BANCO BPM SPA (BPM银行)	1,888	32,616	0.04
BCA MPS (锡耶纳牧山银行)	1,842	22,879	0.03
DAVIDE CAMPARI MILANO NV (达维德·坎帕里-米兰公司)	2,562	15,958	0.02
INTESA SANPAOLO (意大利联合圣保罗银行)	2,874	19,682	0.02
		91,135	0.11
日本 (2.29%)			
ADVANTEST CORPORATION (爱德万测试株式会社)	300	59,695	0.07
AJINOMOTO CO INC (味之素株式会社)	700	25,295	0.03
ASAHI KASEI CORPORATION (旭化成株式会社)	1,600	17,632	0.02
ASICS CORP (亚瑟士株式会社)	600	16,151	0.02
ASTELLAS PHARMA INC (安斯泰来制药株式会社)	2,000	26,765	0.03
BRIDGESTONE CORP (普利司通株式会社)	400	8,393	0.01
CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD (中外制药株式会社)	200	9,271	0.01
DAIFUKU CO LTD (大福株式会社)	200	8,768	0.01
DAIICHI LIFE GROUP INC (第一生命控股株式会社)	2,800	30,640	0.04
DAIKIN INDUSTRIES LIMITED (大金工业株式会社)	200	30,377	0.04
EAST JAPAN RAILWAY CO (东日本旅客铁路株式会社)	1,000	20,969	0.03
EBARA CORPORATION (荏原制作所)	600	23,096	0.03
ENEOS HOLDINGS INC (ENEOS 控股株式会社)	2,100	15,467	0.02
FANUC CORP (发那科株式会社)	400	18,102	0.02
FAST RETAILING COMPANY LIMITED (迅销有限公司)	100	50,952	0.06

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)			
股票 (22.32%) (续)			
日本 (2.29%) (续)			
FUJIFILM HLDGS CORP (富士胶片股份有限公司)	900	19,287	0.02
FUJIKURA LTD (藤仓株式会社)	800	30,705	0.04
FUJITSU LIMITED (富士通株式会社)	1,100	21,976	0.03
HITACHI LTD (日立制作所)	1,900	52,268	0.06
HONDA MOTOR COMPANY LIMITED (本田技研工业株式会社)	1,300	11,838	0.01
HOYA CORPORATION (豪雅株式会社)	200	31,934	0.04
JAPAN POST BANK CO LTD (本邮政银行株式会社)	700	13,192	0.02
JAPAN POST HOLDINGS CO LTD (日本邮政控股株式会社)	1,200	16,015	0.02
JX ADVANCED METALS CORP	400	10,824	0.01
KAWASAKI HEAVY INDUSTRIES LIMITED (川崎重工业株式会社)	600	10,789	0.01
KDDI CORPORATION (KDDI 株式会社)	1,300	21,957	0.03
KEYENCE CORPORATION (基恩斯株式会社)	100	49,875	0.06
KIOXIA HOLDINGS CORP (铠侠控股株式会社)	100	55,179	0.07
KIRIN HOLDINGS COMPANY LIMITED (麒麟控股株式会社)	1,400	24,210	0.03
KOMATSU LIMITED (小松制作所)	400	15,461	0.02
KYOCERA CORPORATION(京瓷株式会社)	500	10,955	0.01
MITSUBISHI ELECTRIC CORPORATION (三菱电机株式会社)	1,100	39,770	0.05
MITSUBISHI ESTATE COMPANY LIMITED (三菱地所株式会社)	500	12,752	0.02
MITSUBISHI HEAVY INDUSTRIES LTD (三菱重工业株式会社)	1,200	27,068	0.03
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC (三菱日联金融集团)	4,400	86,822	0.10
MITSUI AND COMPANY LIMITED (三井物产株式会社)	1,600	44,271	0.05
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC (瑞穗金融集团股份有限公司)	1,000	47,642	0.06
MS AND AD INSURANCE GROUP HOLDINGS INC (MS&AD 保险集团控股)	500	13,044	0.02
MURATA MANUFACTURING CO LTD(村田制作所)	1,000	70,112	0.08
NEC CORPORATION (日本电气股份有限公司)	800	19,320	0.02
NINTENDO COMPANY LIMITED (任天堂株式会社)	300	12,580	0.02
NOMURA HLDGS INC (野村控股株式会社)	2,500	21,743	0.03
ORIX CORPORATION (欧力士株式会社)	800	30,267	0.04
OSAKA GAS COMPANY LIMITED (大阪瓦斯株式会社)	500	16,785	0.02
OTSUKA HOLDINGS CO LTD (大冢控股株式会社)	200	13,296	0.02
PANASONIC HOLDINGS CORP (松下控股株式会社)	1,400	38,781	0.05
RECRUIT HOLDINGS CO LTD (瑞可利)	700	48,799	0.06
RENESAS ELECTRONICS CORPORATION (瑞萨电子)	1,200	35,492	0.04
RESONA HOLDINGS INC (里索那控股株式会社)	800	10,366	0.01

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)			
股票 (22.32%) (续)			
日本 (2.29%) (续)			
SHIN-ETSU CHEMICAL COMPANY LIMITED (信越化学工业株式会社)	900	38,808	0.05
SHIONOGI & CO LTD (盐野义制药株式会社)	400	6,864	0.01
SHISEIDO CO LTD(资生堂株式会社)	500	8,054	0.01
SOFTBANK CORP (软银株式会社)	10,200	13,060	0.02
SOFTBANK GROUP CORP (软银集团)	1,300	47,697	0.06
SOMPO HOLDINGS INC (损保控股株式会社)	300	11,515	0.01
SONY GROUP CORP (索尼公司)	2,700	54,490	0.07
SUMITOMO ELECTRIC INDUSTRIES LIMITED (住友电气工业株式会社)	1,200	21,611	0.03
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC (三井住友金融集团)	1,300	50,760	0.06
SUZUKI MOTOR CORPORATION (铃木株式会社)	500	6,016	0.01
TAISEI CORPORATION (大成建设株式会社)	200	17,536	0.02
TAKEDA PHARMACEUTICAL COMPANY LIMITED (武田药品工业)	500	15,859	0.02
TDK CORP (TDK株式会社)	800	17,573	0.02
TOKIO MARINE HOLDINGS INC (东京海上控股)	900	39,882	0.05
TOKYO ELECTRON LTD (东京威力科创)	200	94,939	0.11
TOYOTA MOTOR CORP (丰田汽车)	3,700	62,037	0.07
TOYOTA TSUSHO CORP (丰田通商株式会社)	700	25,747	0.03
		1,879,396	2.29
		-----	-----
韩国 (1.17%)			
APR CORP/KOREA	69	17,169	0.02
DOOSAN CO LTD (斗山集团)	34	32,633	0.04
HANWHA AEROSPACE CO LTD (韩华航空航天股份有限公司)	17	10,918	0.01
HYOSUNG HEAVY INDUSTRIES CORP (晓星重工业)	12	26,629	0.03
HYUNDAI MOTOR COMPANY LIMITED (现代汽车)	123	39,298	0.05
KB FINANCIAL GROUP INC (韩国国民银行金融集团)	388	39,819	0.05
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD (三星生物制剂公司)	8	7,183	0.01
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS COMPANY LIMITED (三星电机股份有限公司)	32	45,109	0.05
SAMSUNG ELECTRONIC COMPANY LIMITED - PREFERENCE SHARE (三星电子有限公司优先股)	248	33,935	0.04
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD (三星电子有限公司)	1,457	314,102	0.38
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD (三星重工业有限公司)	1,333	20,047	0.02
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD (三星生命保险股份有限公司)	66	17,083	0.02
SAMSUNG SDI COMPANY LIMITED (三星SDI股份有限公司)	20	6,287	0.01

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)			
股票 (22.32%) (续)			
韩国 (1.17%) (续)			
SHINHAN FINANCIAL GROUP COMPANY LIMITED (新韩金融集团股份有限公司)	439	27,145	0.03
SK HYNIX INC (SK海力士)	175	299,329	0.36
SK SQUARE CO LTD	30	32,860	0.04
SK TELECOM COMPANY LIMITED	164	9,358	0.01
		978,904	1.17
卢森堡 (0.05%)			
ARCELORMITTAL SA (安赛乐米塔尔)	655	39,465	0.05
		39,465	0.05
澳门 (0.01%)			
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD (银河娱乐集团有限公司)	3,000	11,255	0.01
		11,255	0.01
马来西亚 (0.06%)			
CIMB GROUP HOLDINGS BHD (联昌国际银行)	7,600	13,811	0.02
MALAYAN BANKING BHD (马来亚银行有限公司)	4,200	11,104	0.01
TENAGA NASIONAL BHD (国家能源有限公司)	6,900	24,165	0.03
		49,080	0.06
荷兰 (0.35%)			
ABN AMRO BANK NV (荷兰银行)	1,405	59,724	0.07
ASML HOLDING NV (艾司摩尔)	104	204,680	0.25
ASR NEDERLAND NV			
	442	33,373	0.04
		297,777	0.35
葡萄牙(0.03%)			
GALP ENERGIA SGPS - B (高浦能源公司)	1,282	27,328	0.03
		27,328	0.03

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)			
股票 (22.32%) (续)			
新加坡 (0.20%)			
DBS GROUP HOLDINGS LTD (星展集团控股有限公司)	1,110	56,124	0.07
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD (华侨银行有限公司)	2,100	40,248	0.05
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD (新加坡电信有限公司)	6,600	22,503	0.03
STMICROELECTRONICS NV (意法半导体股份有限公司)	330	24,331	0.03
UOL GROUP LTD (华业集团有限公司)	2,300	16,928	0.02
		160,134	0.20
南非 (0.08%)			
ANGLO AMERICAN PLC (英美资源集团有限公司)	1,302	63,887	0.08
		63,887	0.08
西班牙 (0.33%)			
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA SA (西班牙对外银行)	3,331	83,288	0.10
CAIXABANK (凯克萨银行)	2,565	36,320	0.04
IBERDROLA S.A. (伊维尔德罗拉)	2,394	59,777	0.07
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL S.A. (印地纺集团)	678	42,727	0.05
REDEIA CORP SA	1,272	21,654	0.03
TELEFONICA SA (西班牙电信股份有限公司)	8,035	32,299	0.04
		276,065	0.33
瑞典 (0.23%)			
ASSA ABLOY AB - B (亚萨合莱)	1,630	57,667	0.07
ATLAS COPCO AB - A (阿特拉斯·科普柯)	4,133	83,765	0.10
EPIROC AB - A (安百拓)	1,962	53,905	0.06
		195,337	0.23
瑞士 (0.33%)			
CIE FINANCIERE RICHEMONT - REG (历峰集团)	83	19,195	0.02
DSM-FIRMENICH AG (帝斯曼)	364	34,541	0.04
LONZA GROUP AG - REG (龙沙集团)	82	55,483	0.07
NESTLE SA - REG (雀巢公司)	562	57,883	0.07
SGS SA	488	56,698	0.07
SIKA AG - REG (西卡)	261	53,954	0.06
		277,754	0.33

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续))			
股票 (22.32%) (续)			
台湾 (0.99%)			
亚德客国际集团股份有限公司	1,000	41,907	0.05
日月光投资控股股份有限公司	2,000	42,691	0.05
中华电信股份有限公司	3,000	13,325	0.02
中国信托金融控股股份有限公司	26,000	57,947	0.07
台达电子工业股份有限公司	1,000	61,212	0.07
富邦金融控股公司	6,000	24,391	0.03
鸿海精密工业股份有限公司	6,000	47,275	0.06
联发科技股份有限公司	1,000	133,254	0.16
广达电脑股份有限公司	2,000	23,104	0.03
台湾积体电路制造股份有限公司	5,000	378,259	0.45
		823,365	0.99
泰国 (0.07%)			
DELTA ELECTRONICS THAI PCL (台达电子(泰国)工业股份有限公司)	2,900	28,371	0.03
KASIKORNBANK PCL (开泰银行大众有限公司)	4,600	30,186	0.04
		58,557	0.07
英国 (0.85%)			
ASTRAZENECA PLC (阿斯特捷利康制药公司)	484	90,577	0.11
BAE SYSTEMS PLC (貝宜系統公司)	1,069	26,163	0.03
BURBERRY GROUP PLC (巴宝莉集团)	2,128	29,995	0.04
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD (长江和记实业有限公司)	2,500	21,120	0.03
DIAGEO PLC (帝亚吉欧)	1,610	32,534	0.04
HSBC HLDGS PLC (汇丰控股有限公司)	10,461	197,293	0.24
HSBC HOLDINGS PLC (汇丰控股有限公司)	2,579	48,976	0.06
LLOYDS BANKING GROUP PLC (劳埃德银行集团)	30,645	45,188	0.05
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC (伦敦证券交易所集团)	160	17,333	0.02
NATIONAL GRID PLC (英国国家电力供应公司)	1,547	25,625	0.03
PERSIMMON PLC (柿子公司)	1,125	15,678	0.02
RECKITT BENCKISER GROUP PLC (利洁时)	542	35,328	0.04
RENTOKIL INITIAL PLC (能多洁公司)	3,144	17,801	0.02
SSE PLC (南苏格兰电力公司)	658	21,274	0.03
UNILEVER PLC (联合利华)	551	33,110	0.04
WHITBREAD PLC (惠特贝瑞)	1,309	41,541	0.05
		699,536	0.85

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)			
股票 (22.32%) (续)			
美国 (11.52%)			
ADVANCED MICRO DEVICES INC (超威半导体)	947	550,122	0.65
AIR PRODUCTS & CHEMICAL INC (空气产品公司)	228	66,845	0.08
AIRBNB INC (爱彼迎)	783	112,047	0.13
ALCOA CORP (美国铝业公司)	1,644	85,718	0.10
ALCON INC (爱尔康)	788	53,338	0.06
ALPHABET INC - A (字母控股 - A)	1,659	592,877	0.71
AMAZON (亚马逊公司)	1,223	291,490	0.35
APPLE INC (苹果公司)	1,688	488,440	0.58
AUTODESK INC (欧特克股份有限公司)	220	42,772	0.05
BAKER HUGHES CO (贝克休斯)	1,318	73,149	0.09
BANK OF AMERICA CORPORATION (美国银行)	2,026	115,441	0.14
BEONE MEDICINES LTD (百济神州)	600	13,037	0.02
BERKSHIRE HATHAWAY INC (伯克希尔哈撒韦公司)	440	220,172	0.26
BJ'S WHOLESALE CLUB HOLDINGS (BJ 批发俱乐部控股)	1,150	100,303	0.12
BOEING CO (波音公司)	636	137,675	0.16
BP PLC (英国艾莫科石油公司)	3,603	22,337	0.03
BROADCOM INC (博通)	210	79,328	0.09
C S X CORPORATION	3,054	145,157	0.17
CARRIER GLOBAL CORP (开利全球公司)	1,520	111,492	0.13
CISCO SYSTEMS INC (思科系统公司)	2,019	237,152	0.28
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC (公民金融集团)	2,514	176,156	0.21
CMS ENERGY CORP (CMS 能源)	2,307	176,486	0.21
COCA-COLA CO/THE (可口可乐公司)	1,695	137,753	0.16
COMCAST CORPORATION - A (康卡斯特 - A)	3,935	96,604	0.12
DANAHER CORPORATION (丹纳赫集团)	445	84,764	0.10
DEERE AND CO (强鹿)	216	137,015	0.16
ELI LILLY & CO (礼来)	112	134,336	0.16
ESTEE LAUDER COMPANIES INC (雅诗兰黛股份有限公司)	987	77,924	0.09
EVERPURE INC	1,129	88,954	0.11
GENERAC HOLDINGS INC	398	116,538	0.14
GILEAD SCIENCES INC (吉利德科学公司)	626	79,089	0.09
HOME DEPOT INC (家得宝)	480	169,286	0.20
HUNTINGTON BANCSHARES INCORPORATED (亨廷顿银行)	6,108	108,295	0.13
IBM CORP (国际商业机器公司)	327	91,956	0.11
ILLINOIS TOOL WORKS INC (伊利诺伊工具制造公司)	219	59,233	0.07
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC (洲际交易所集团)	373	45,920	0.04
INTERNATIONAL FLAVORS AND FRAGRANCE INC (国际香精香料公司)	1,131	89,598	0.10

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)			
股票 (22.32%) (续)			
美国 (11.52%) (续)			
JOHNSON & JOHNSON (强生公司)	754	191,493	0.23
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC (是德科技)	631	220,894	0.26
LAM RESEARCH CORP (泛林集团)	532	230,532	0.28
MCCORMICK AND COMPANY INCORPORATED - NON VOTING SHARE (味好美)	1,770	89,243	0.11
MEDTRONIC PLC (美敦力公司)	1,329	103,968	0.12
META PLATFORMS INC - A	120	67,595	0.08
MICROSOFT CORP (微软公司)	967	360,710	0.43
MOTOROLA SOLUTIONS INC (摩托罗拉系统公司)	342	142,029	0.17
NVIDIA CORP (英伟达)	3,233	646,891	0.77
ORACLE CORP (甲骨文公司)	125	18,319	0.02
PFIZER INC (辉瑞)	5,816	140,049	0.17
PROLOGIS INC (普洛斯公司)	1,489	201,715	0.24
QUANTA SERVICES INC (广达服务公司)	262	188,650	0.23
ROCHE HOLDINGS AG GENUSSSCHEINE (罗氏)	202	83,339	0.10
ROCKWELL AUTOMATION INC (洛克威尔自动化公司)	226	111,888	0.13
SANOFI-AVENTIS (法国赛诺菲-安万特集团)	314	26,953	0.03
SCHNEIDER ELECTRIC SE (施耐德电气)	288	93,974	0.11
SHELL PLC (壳牌股份有限公司)	740	28,807	0.03
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE (宣伟)	273	93,999	0.11
SLB LTD (斯伦贝谢)	2,553	118,689	0.14
STARBUCKS CORP (星巴克股份有限公司)	1,317	134,584	0.16
SUNBELT RENTALS HOLDINGS INC	423	30,856	0.04
SYNOPSYS INC (新思科技)	254	113,302	0.14
SYSCO CORP (西斯科)	1,453	121,442	0.15
TESLA INC (特斯拉)	206	86,644	0.10
UNION PACIFIC CORP - B (联合包裹服务公司 - B)	1,476	158,670	0.19
UNITEDHEALTH GROUP INC (联合健康集团)	253	105,154	0.13
VISA INC - A (维萨 - A)	339	116,308	0.14
WALT DISNEY CO/THE (华特迪士尼公司)	1,321	127,146	0.15
WELLS FARGO & CO (富国银行公司)	1,613	133,298	0.16
		9,695,940	11.52
		-----	-----
上市股票合计		18,660,563	22.32
		-----	-----

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)			
交易所买卖基金 (5.11%) (续)			
香港 (0.29%)			
BLACKROCK ASSET MANAGEMENT NORTH ASIA LTD - ISHARES CORE CSI 300 ETF-HKD (贝莱德资产管理 北亚有限公司 - 安硕核心 300股票指数 - 港元)	48,002	238,111	0.29
		238,111	0.29
爱尔兰 (1.73%)			
BARCLAYS GLOBAL INVESTORS IRELAND LTD - ISHARES MSCI AC FAR EAST EX-JAPAN	9,500	933,708	1.12
BLACKROCK ASSET MANAGEMENT IRELAND LTD - ISHARES PLC - ISHARES CORE FTSE 100	37,455	507,859	0.61
		1,441,567	1.73
美国 (3.09%)			
BLACKROCK FUND ADVISORS - ISHARES CORE MSCI EUROPE ETF - ETF (贝莱德 - 安硕核心 MSCI 欧洲 ETF)	2,300	172,891	0.21
BLACKROCK FUND ADVISORS - ISHARES CORE S&P 500 ETF (贝莱德 - 安硕核心 500股票指数基金)	708	530,214	0.63
BLACKROCK FUND ADVISORS - ISHARES MSCI INDIA ETF (贝莱德 - 安硕MSCI印度指数基金)	10,195	503,531	0.60
BLACKROCK FUND ADVISORS - ISHARES MSCI JAPAN ETF - ETF (贝莱德 - 安硕MSCI日本ETF)	6,600	615,582	0.74
COHEN & STEERS CAPITAL MANAGEMENT INC - ISHARES US TECHNOLOGY ETF (安硕科技指数基金)	2,330	587,696	0.70
ISHARES LATIN AMERICA 40 ETF (安硕拉丁美洲40指 数基金)	5,100	172,125	0.21
		2,582,039	3.09
交易所买卖基金合计		4,261,717	5.11
货币市场工具 (2.02%)			
US TREASURY BILLS 0% 20/08/2026	1,700,000	1,691,338	2.02
		1,691,338	2.02
货币市场工具合计		1,691,338	2.02
上市股票/交易所买卖基金/挂牌债券及货币市场工具合计		80,886,829	96.83

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	持有数量	公允价值 美元	资产净值的%
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)			
衍生金融工具			
远期外汇合约			
法国巴黎银行		653,583	0.79
摩根士丹利		37,098	0.04
渣打银行		(75,024)	(0.09)
香港上海汇丰银行有限公司		(55,853)	(0.07)
远期外汇合约合计		559,804	0.67
期权			
PUT JULY 26 PUTS ON SPX 17-JUL-2026 100		(2,280)	0.00
PUT JULY 26 PUTS ON SPX 17-JUL-2026 100		7,995	0.01
期权合计		5,715	0.01
衍生金融工具合计		565,519	0.68
投资合计		81,452,348	97.51
其他净资产		2,077,163	2.49
于2026年6月30日归属基金份额持有人资产净值		83,529,511	100.00
按成本投资总额		79,591,294	

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合变动表 (未经审计)
于 2026 年 6 月 30 日

	于2026年6月30日 占资产净值百分比 %	于2025年12月31日 占资产净值百分比 %
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地)		
债券		
澳大利亚	1.71	1.47
智利	1.17	0.91
中国	1.22	1.74
芬兰	0.31	0.46
法国	4.66	4.37
德国	5.49	4.13
香港	1.02	1.06
匈牙利	0.24	0.19
印度	0.82	0.65
印度尼西亚	2.21	2.77
意大利	6.14	5.24
日本	2.22	2.06
哈萨克斯坦	0.47	0.37
韩国	0.79	1.63
卢森堡	0.79	0.83
澳门	0.23	0.18
马来西亚	1.98	0.67
墨西哥	2.49	1.26
荷兰	1.01	1.84
菲律宾	1.09	1.56
波兰	0.71	0.55
沙特阿拉伯	0.96	0.88
新加坡	1.01	1.56
西班牙	2.06	1.61
瑞典	0.42	0.33
瑞士	0.88	0.69
阿拉伯联合酋长国	0.77	1.01
英国	5.07	7.21
美国	19.07	22.86
乌拉圭	0.25	0.38
委内瑞拉	0.12	-
股票		
澳大利亚	0.51	0.83
比利时	0.10	-
中国	1.43	1.80
丹麦	0.14	0.27
芬兰	0.08	0.09
法国	0.38	0.44
德国	0.54	0.81
希腊	0.05	-
香港	0.31	0.42
印度尼西亚	0.03	0.10

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

投资组合变动表 (未经审计)
于 2026 年 6 月 30 日 (续)

	于2026年6月30日 占资产净值百分比 %	于2025年12月31日 占资产净值百分比 %
上市股票/交易所买卖基金/报价债券/ 报价货币市场工具(按来源地) (续)		
股票 (续)		
爱尔兰	0.08	0.08
意大利	0.11	0.30
日本	2.29	2.68
韩国	1.17	0.87
卢森堡	0.05	-
澳门	0.01	0.05
马来西亚	0.06	-
荷兰	0.35	0.44
葡萄牙	0.03	-
新加坡	0.20	0.19
南非	0.08	0.05
西班牙	0.33	0.10
瑞典	0.23	0.25
瑞士	0.33	0.38
台湾	0.99	0.91
泰国	0.07	0.08
英国	0.85	1.01
美国	11.52	12.02
交易所买卖基金		
香港	0.29	0.36
爱尔兰	1.73	0.67
美国	3.09	2.92
货币市场工具		
美国	2.02	-
上市股票/交易所买卖基金/ 报价债券合计	96.83	97.90
衍生金融工具		
远期外汇合约	0.67	(0.02)
期权	0.01	-
其他净资产	2.49	2.12
归属基金份额持有人的资产净值	100.00	100.00

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

衍生金融工具详情 (未经审计)

于 2026 年 6 月 30 日

远期外汇合约

子基金期末的远期外汇合约如下：

待交付合约	交换对象	结算日	交易方	公允价值 美元
于2026年6月30日				
金融资产：				
欧元14,200,000	美元16,810,031	2026年7月17日	法国巴黎银行股份有 限公司 ("法国巴黎银行")	564,862
英镑2,065,000	美元2,800,026	2026年7月17日	法国巴黎银行	59,290
英镑550,000	美元748,890	2026年7月17日	法国巴黎银行	18,912
印度卢比130,500,000	美元1,378,776	2026年7月17日	法国巴黎银行	1,867
菲律宾比索21,500,000	美元357,254	2026年7月17日	法国巴黎银行	7,003
新台币12,650,000	美元399,105	2026年7月17日	法国巴黎银行	1,649
人民币6,150,000	美元908,141	2026年7月17日	摩根士丹利国际有限 公司("摩根士丹")	1,202
印尼盾10,425,000,000	美元605,510	2026年7月17日	摩根士丹利	23,298
墨西哥比索7,200,000	美元414,012	2026年7月17日	摩根士丹利	2,500
新加坡元860,000	美元680,956	2026年7月17日	摩根士丹利	15,343
美元759,486	印度卢比72,000,000	2026年7月17日	摩根士丹利	188
人民币48,932	美元7,237	2026年7月31日	香港上海汇丰银行 有限公司("汇丰")	14
美元138,899	加元197,010	2026年7月31日	汇丰	154
美元69,820	加元99,100	2026年7月31日	汇丰	126
美元18,604	人民币126,100	2026年7月31日	汇丰	10
美元137,219	人民币931,200	2026年7月31日	汇丰	237
美元688,833	欧元601,815	2026年7月31日	汇丰	84
美元5,227,812	英镑3,945,849	2026年7月31日	汇丰	9,202
美元123	英镑93	2026年7月31日	汇丰	-
				705,941
金融负债：				
美元392,417	新加坡元 500,000	2026年7月17日	摩根士丹利	(5,433)
美元2,563,832	欧元 2,200,000	2026年7月17日	渣打银行	(46,975)
美元745,608	英镑 550,000	2026年7月17日	渣打银行	(15,630)
美元938,336	英镑 700,000	2026年7月17日	渣打银行	(9,273)
美元268,592	英镑 200,000	2026年7月17日	渣打银行	(3,146)
离岸人民币368,059	美元 54,210	2026年7月31日	汇丰	(120)
离岸人民币95,455	美元 14,033	2026年7月31日	汇丰	(57)
离岸人民币98,791	美元 14,575	2026年7月31日	汇丰	(8)
美元3,626,838	澳元 5,196,110	2026年7月31日	汇丰	(29,005)
美元6,581,372	加拿大元 9,304,164	2026年7月31日	汇丰	(14,354)
美元2,811,496	离岸人民币 19,006,671	2026年7月31日	汇丰	(5,883)
美元3,936,974	离岸人民币 26,614,106	2026年7月31日	汇丰	(8,412)
美元1,753	离岸人民币 11,848	2026年7月31日	汇丰	(4)
美元855,364	离岸人民币 5,782,297	2026年7月31日	汇丰	(1,827)

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

衍生金融工具详情 (未经审计)
于 2026 年 6 月 30 日 (续)

远期外汇合约

子基金期末的远期外汇合约如下:

待交付合约	交换对象	结算日	交易方	公允价值 美元
于2026年6月30日				
金融负债(续):				
美元2,145,009	新西兰元3,756,274	2026年7月31日	汇丰	(6,010)
				(146,137)
				559,804

子基金持有的期权如下:

	标的资产	持仓	名义金额 美元	交易方	公允价值 美元
于2026年6月30日					
PUT S&P 500 INDEX 17/07/2026 100	S&P 500	短仓	(10,626)	高盛	(2,280)
PUT S&P 500 INDEX 17/07/2026 100	S&P 500	长仓	27,036	高盛	7,995
					5,715
					565,519

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

持有抵押品 (未经审计)
于 2026 年 6 月 30 日

东方汇理香港组合 - 灵活配置平稳基金

抵押品提供方	抵押品性质	期限	计价货币	担保品覆盖的 资产净值百分比	抵押品价值 美元
法国巴黎银行	现金	不适用	美元	0.78	(630,000)