

中期报告（未经审计）
截至 2021 年 6 月 30 日止期间

东亚联丰投资系列

东亚联丰亚洲债券及货币基金
东亚联丰亚太区多元收益基金
东亚联丰中国高收益入息基金
东亚联丰亚洲策略债券基金

注意：此中期报告（未经审计）的摘要版本只适用于在此列示的子基金。



目录	页数
投资报告	1 – 57
持有抵押品	58-59
全面收益表	60-61
资产负债表	62 – 65
权益变动表/基金份额持有人应占资产净值变动表	66 – 70
管理及行政	71

附注：

本基金的财务报表已按照香港会计师公会颁布的所有适用的《香港财务报告准则》(此统称包含所有适用的个别《香港财务报告准则》、《香港会计准则》及诠释)、香港公认会计原则、《信托契约》(经修订)的相关条文，以及由香港证监会颁布的该守则当中的相关条文编制。

采纳的主要会计政策与年度财务报表的财务报表附注所采用的政策一致。

投资报告

于2021年6月30日(未经审计)

投资组合

东亚联丰亚洲债券及货币基金

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.89%)			
债务证券 (98.90%)			
以人民币计价 (0.74%)			
Export-Import Bank of Korea 2.80% 03/03/2024	13,000,000	2,035,707	0.25
HSBC Holdings PLC 3.40% 29/06/2027	10,000,000	1,558,578	0.19
Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 3.45% 25/05/2024	16,000,000	2,500,884	0.30
以新加坡元计价 (0.11%)			
Lippo Malls Indonesia Retail Trust 7.00% Perpetual Callable - 27/09/2021	1,500,000	946,754	0.11
以美元计价 (98.05%)			
ABJA Investment Co Pte Ltd 5.45% 24/01/2028	5,500,000	6,067,314	0.73
ABJA Investment Co Pte Ltd 5.95% 31/07/2024	7,800,000	8,641,908	1.04
Adani Green Energy UP Ltd 6.25% 10/12/2024	6,200,000	6,904,976	0.83
Adaro Indonesia PT 4.25% 31/10/2024	5,000,000	5,208,207	0.63
Agile Group Holdings Ltd 5.75% 02/01/2025	1,300,000	1,357,083	0.16
Anton Oilfield Services Group/Hong Kong 7.50% 02/12/2022	1,000,000	994,192	0.12
Azure Power Solar Energy Pvt Ltd 5.65% 24/12/2024	4,700,000	5,006,903	0.60
Bangkok Bank PCL/Hong Kong 5.00% Perpetual Callable - 23/09/2025	2,200,000	2,356,422	0.28
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 3.75% 30/03/2026	3,000,000	3,098,457	0.37

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.89%) (续)			
债务证券 (98.90%) (续)			
以美元计价 (98.05%) (续)			
Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT 4.20% 23/01/2025	2,000,000	2,087,947	0.25
Bukit Makmur Mandiri Utama PT 7.75% 10/02/2026	700,000	739,168	0.09
Champion Path Holdings Ltd 4.50% 27/01/2026	6,100,000	6,468,806	0.78
Champion Path Holdings Ltd 4.85% 27/01/2028	4,500,000	4,792,577	0.58
Champion Sincerity Holdings Ltd 8.125% Perpetual Callable - 08/02/2022	2,300,000	2,445,646	0.30
China Aoyuan Group Ltd 5.375% 13/09/2022	4,650,000	4,579,808	0.55
China Aoyuan Group Ltd 7.95% 19/02/2023	1,500,000	1,533,780	0.18
China Aoyuan Group Ltd 7.95% 21/06/2024	2,000,000	1,948,817	0.24
China Aoyuan Group Ltd 8.50% 23/01/2022	2,200,000	2,296,482	0.28
China Evergrande Group 8.25% 23/03/2022	10,000,000	8,789,583	1.06
China Evergrande Group 8.75% 28/06/2025	3,000,000	2,003,217	0.24
China Evergrande Group 9.50% 11/04/2022	9,100,000	7,986,352	0.96
China Evergrande Group 11.50% 22/01/2023	2,000,000	1,700,043	0.20
China Hongqiao Group Ltd 6.25% 08/06/2024	2,400,000	2,453,503	0.30
China Oil & Gas Group Ltd 4.70% 30/06/2026	3,500,000	3,559,502	0.43

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.89%) (续)			
债务证券 (98.90%) (续)			
以美元计价 (98.05%) (续)			
China Oil & Gas Group Ltd 5.50% 25/01/2023	2,000,000	2,102,787	0.25
China SCE Group Holdings Ltd 5.875% 10/03/2022	8,285,000	8,536,653	1.03
China SCE Group Holdings Ltd 7.25% 19/04/2023	8,800,000	9,200,400	1.11
China SCE Group Holdings Ltd 7.375% 09/04/2024	2,000,000	2,108,337	0.25
Chong Hing Bank Ltd 5.70% Perpetual Callable - 15/07/2024	5,900,000	6,343,523	0.77
CIFI Holdings Group Co Ltd 4.45% 17/08/2026	5,000,000	5,016,444	0.61
CIFI Holdings Group Co Ltd 5.95% 20/10/2025	2,700,000	2,893,090	0.35
CIFI Holdings Group Co Ltd 6.45% 07/11/2024	3,000,000	3,209,895	0.39
CIFI Holdings Group Co Ltd 6.55% 28/03/2024	1,425,000	1,524,124	0.18
Clean Renewable Power Mauritius Pte Ltd 4.25% 25/03/2027	1,100,000	1,133,576	0.14
Cliffon Ltd 6.25% 25/10/2025	11,000,000	11,053,753	1.33
CNAC HK Finbridge Co Ltd 3.00% 22/09/2030	1,950,000	1,947,172	0.23
CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.125% 19/07/2027	2,000,000	2,207,905	0.27
Continuum Energy Levanter Pte Ltd 4.50% 09/02/2027	4,000,000	4,180,720	0.50
Delhi International Airport Ltd 6.125% 03/02/2022	1,500,000	1,548,931	0.19
Delhi International Airport Ltd 6.125% 31/10/2026	3,000,000	3,107,275	0.38
Delhi International Airport Ltd 6.45% 04/06/2029	450,000	459,035	0.06

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.89%) (续)			
债务证券 (98.90%) (续)			
以美元计价 (98.05%) (续)			
Easy Tactic Ltd 5.75% 13/01/2022	6,800,000	6,838,919	0.83
Easy Tactic Ltd 5.875% 13/02/2023	300,000	273,597	0.03
Easy Tactic Ltd 8.125% 27/02/2023	3,700,000	3,564,603	0.43
Easy Tactic Ltd 8.875% 27/09/2021	4,100,000	4,201,941	0.51
Easy Tactic Ltd 9.125% 28/07/2022	700,000	720,714	0.09
Easy Tactic Ltd 11.75% 02/08/2023	7,700,000	7,962,277	0.96
Fantasia Holdings Group Co Ltd 6.95% 17/12/2021	4,600,000	4,459,331	0.54
Fantasia Holdings Group Co Ltd 11.75% 17/04/2022	3,750,000	3,630,835	0.44
Fantasia Holdings Group Co Ltd 15.00% 18/12/2021	3,850,000	3,860,998	0.47
Fortune Star BVI Ltd 5.00% 18/05/2026	4,800,000	4,898,411	0.59
Fortune Star BVI Ltd 5.05% 27/01/2027	1,350,000	1,392,785	0.17
Fortune Star BVI Ltd 5.95% 19/10/2025	7,050,000	7,507,545	0.91
Fortune Star BVI Ltd 6.75% 02/07/2023	5,700,000	6,195,743	0.75
Fortune Star BVI Ltd 6.85% 02/07/2024	3,100,000	3,424,910	0.41
GMR Hyderabad International Airport Ltd 4.75% 02/02/2026	7,300,000	7,581,413	0.92
GMR Hyderabad International Airport Ltd 5.375% 10/04/2024	5,500,000	5,776,011	0.70
Golden Eagle Retail Group Ltd 4.625% 21/05/2023	7,400,000	7,547,178	0.91
Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	2,100,000	2,178,538	0.26
Greenko Solar Mauritius Ltd 5.55% 29/01/2025	6,100,000	6,427,407	0.78
Greenko Solar Mauritius Ltd 5.95% 29/07/2026	6,800,000	7,514,763	0.91

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.89%) (续)			
债务证券 (98.90%) (续)			
以美元计价 (98.05%) (续)			
Greentown China Holdings Ltd 5.65% 13/07/2025	2,500,000	2,660,567	0.32
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd 5.625% 24/10/2024	950,000	993,946	0.12
Hong Seng Ltd 9.875% 27/08/2022	700,000	732,462	0.09
Honghua Group Ltd 6.375% 01/08/2022	3,000,000	3,015,904	0.36
HPCL-Mittal Energy Ltd 5.25% 28/04/2027	1,000,000	1,054,567	0.13
IIFL Finance Ltd 5.875% 20/04/2023	9,400,000	9,339,058	1.13
India Green Energy Holdings 5.375% 29/04/2024	4,200,000	4,453,247	0.54
India Green Power Holdings 4.00% 22/02/2027	7,400,000	7,562,899	0.91
Indiabulls Housing Finance Ltd 6.375% 28/05/2022	8,600,000	8,259,128	1.00
Indika Energy Capital III Pte Ltd 5.875% 09/11/2024	9,500,000	9,724,733	1.17
Indika Energy Capital IV Pte Ltd 8.25% 22/10/2025	13,700,000	14,774,114	1.78
Jababeka International BV 6.50% 05/10/2023	2,300,000	2,293,808	0.28
JSW Hydro Energy Ltd 4.125% 18/05/2031	5,900,000	6,022,172	0.73
JSW Steel Ltd 5.375% 04/04/2025	3,000,000	3,242,189	0.39
Kaisa Group Holdings Ltd 8.50% 30/06/2022	7,900,000	7,893,886	0.95
Kaisa Group Holdings Ltd 9.375% 30/06/2024	3,800,000	3,586,214	0.43
Kaisa Group Holdings Ltd 9.75% 28/09/2023	2,100,000	2,123,746	0.26
Kaisa Group Holdings Ltd 10.50% 15/01/2025	4,000,000	3,963,107	0.48

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.89%) (续)			
债务证券 (98.90%) (续)			
以美元计价 (98.05%) (续)			
Kaisa Group Holdings Ltd 10.875% 23/07/2023	750,000	788,017	0.10
Kaisa Group Holdings Ltd 11.25% 09/04/2022	3,100,000	3,257,960	0.39
Kaisa Group Holdings Ltd 11.25% 16/04/2025	2,000,000	1,948,795	0.24
Kaisa Group Holdings Ltd 11.50% 30/01/2023	6,900,000	7,327,566	0.88
Kaisa Group Holdings Ltd 11.65% 01/06/2026	3,000,000	2,844,325	0.34
Kaisa Group Holdings Ltd 11.70% 11/11/2025	3,500,000	3,362,450	0.41
Kaisa Group Holdings Ltd 11.95% 22/10/2022	5,600,000	5,906,791	0.71
Kaisa Group Holdings Ltd 11.95% 12/11/2023	2,600,000	2,706,068	0.33
Kasikornbank PCL/Hong Kong 5.275% Perpetual Callable - 14/10/2025	3,000,000	3,223,778	0.39
Krung Thai Bank PCL/Cayman Islands 4.40% Perpetual Callable - 25/03/2026	3,000,000	3,081,100	0.37
KWG Group Holdings Ltd 5.20% 21/09/2022	200,000	204,973	0.02
KWG Group Holdings Ltd 5.875% 10/11/2024	4,200,000	4,273,806	0.52
KWG Group Holdings Ltd 5.95% 10/08/2025	500,000	510,422	0.06
KWG Group Holdings Ltd 7.40% 05/03/2024	1,200,000	1,282,613	0.15
KWG Group Holdings Ltd 7.875% 01/09/2023	2,900,000	3,044,159	0.37

投资报告

于2021年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.89%) (续)			
债务证券 (98.90%) (续)			
以美元计价 (98.05%) (续)			
LMIRT Capital Pte Ltd 7.25% 19/06/2024	4,700,000	4,924,127	0.59
LMIRT Capital Pte Ltd 7.50% 09/02/2026	12,250,000	13,081,571	1.58
Logan Group Co Ltd 4.85% 14/12/2026	3,200,000	3,223,905	0.39
Logan Group Co Ltd 5.25% 23/02/2023	4,000,000	4,073,687	0.49
Logan Group Co Ltd 5.25% 19/10/2025	2,000,000	2,079,460	0.25
Logan Group Co Ltd 6.50% 16/07/2023	4,230,000	4,459,104	0.54
Marble II Pte Ltd 5.30% 20/06/2022	2,700,000	2,711,824	0.33
Medco Bell Pte Ltd 6.375% 30/01/2027	2,700,000	2,864,347	0.35
Medco Oak Tree Pte Ltd 7.375% 14/05/2026	9,000,000	9,929,686	1.20
Medco Platinum Road Pte Ltd 6.75% 30/01/2025	13,000,000	14,014,812	1.69
Melco Resorts Finance Ltd 5.25% 26/04/2026	2,400,000	2,519,806	0.30
Melco Resorts Finance Ltd 5.375% 04/12/2029	2,600,000	2,755,795	0.33
Melco Resorts Finance Ltd 5.625% 17/07/2027	3,900,000	4,188,580	0.51
Melco Resorts Finance Ltd 5.75% 21/07/2028	2,100,000	2,276,013	0.27
MGM China Holdings Ltd 5.25% 18/06/2025	500,000	521,358	0.06
MGM China Holdings Ltd 5.875% 15/05/2026	6,710,000	7,100,703	0.86
Minejesa Capital BV 4.625% 10/08/2030	2,000,000	2,161,829	0.26

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.89%) (续)			
债务证券 (98.90%) (续)			
以美元计价 (98.05%) (续)			
Modern Land China Co Ltd 11.50% 13/11/2022	1,550,000	1,578,809	0.19
Modern Land China Co Ltd 11.80% 26/02/2022	6,300,000	6,464,066	0.78
Modern Land China Co Ltd 12.85% 25/10/2021	2,050,000	2,108,504	0.25
Nanyang Commercial Bank Ltd 5.00% Perpetual Callable - 02/06/2022	8,400,000	8,487,593	1.02
New Metro Global Ltd 4.80% 15/12/2024	3,300,000	3,333,308	0.40
New Metro Global Ltd 5.00% 08/08/2022	1,000,000	1,030,141	0.12
New Metro Global Ltd 6.50% 20/05/2022	2,000,000	2,059,646	0.25
New Metro Global Ltd 6.80% 05/08/2023	3,000,000	3,208,523	0.39
New Metro Global Ltd 7.50% 20/03/2022	300,000	313,084	0.04
NWD Finance BVI Ltd 4.125% Perpetual Callable - 10/03/2028	2,400,000	2,432,823	0.29
Pakuwon Jati Tbk PT 4.875% 29/04/2028	5,900,000	6,211,908	0.75
Perenti Finance Pty Ltd 6.50% 07/10/2025	2,800,000	2,995,935	0.36
Periama Holdings LLC/DE 5.95% 19/04/2026	14,800,000	16,281,184	1.97
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 3.90% 13/04/2022	4,300,000	4,332,816	0.52
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 5.95% 30/04/2025	2,700,000	2,817,941	0.34

投资报告

于2021年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.89%) (续)			
债务证券 (98.90%) (续)			
以美元计价 (98.05%) (续)			
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 6.25% 10/08/2024	1,800,000	1,912,427	0.23
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 6.95% 23/07/2023	4,600,000	4,894,137	0.59
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 7.125% 08/11/2022	1,800,000	1,892,069	0.23
Radiance Capital Investments Ltd 8.80% 17/09/2023	1,400,000	1,449,787	0.18
Radiance Capital Investments Ltd 10.50% 16/01/2022	2,020,000	2,156,744	0.26
Radiance Capital Investments Ltd 11.75% 31/10/2021	4,500,000	4,677,344	0.56
Redco Properties Group Ltd 8.50% 19/08/2021	2,500,000	2,581,926	0.31
Redsun Properties Group Ltd 9.95% 11/04/2022	1,000,000	1,036,181	0.13
ReNew Power Pvt Ltd 5.875% 05/03/2027	8,900,000	9,739,854	1.18
ReNew Power Pvt Ltd 6.45% 27/09/2022	3,000,000	3,162,958	0.38
ReNew Power Synthetic 6.67% 12/03/2024	6,000,000	6,446,012	0.78
ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	2,300,000	2,368,873	0.29
RKPF Overseas 2019 A Ltd 6.70% 30/09/2024	600,000	647,914	0.08
Ronshine China Holdings Ltd 5.25% 03/12/2021	2,000,000	1,988,647	0.24
Ronshine China Holdings Ltd 5.50% 01/02/2022	2,000,000	2,015,468	0.24
Ronshine China Holdings Ltd 10.50% 01/03/2022	4,600,000	4,821,904	0.58

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.89%) (续)			
债务证券 (98.90%) (续)			
以美元计价 (98.05%) (续)			
Shriram Transport Finance Co Ltd 4.40% 13/03/2024	4,000,000	4,100,253	0.49
Shriram Transport Finance Co Ltd 5.10% 16/07/2023	3,000,000	3,120,285	0.38
Shriram Transport Finance Co Ltd 5.70% 27/02/2022	2,000,000	2,064,047	0.25
Shriram Transport Finance Co Ltd 5.95% 24/10/2022	4,700,000	4,869,499	0.59
Shui On Development Holding Ltd 6.15% 24/08/2024	300,000	318,227	0.04
Sinic Holdings Group Co Ltd 8.50% 24/01/2022	500,000	477,512	0.06
Sinic Holdings Group Co Ltd 9.50% 18/10/2021	4,050,000	4,015,940	0.48
SoftBank Group Corp 4.625% 06/07/2028	8,700,000	8,700,000	1.05
SoftBank Group Corp 5.25% 06/07/2031	7,300,000	7,300,000	0.88
Sri Lanka Government International Bond 5.75% 18/04/2023	7,000,000	5,362,278	0.65
Sri Lanka Government International Bond 6.85% 14/03/2024	4,500,000	3,226,814	0.39
Studio City Finance Ltd 6.00% 15/07/2025	9,700,000	10,484,019	1.27
Studio City Finance Ltd 6.50% 15/01/2028	4,500,000	4,952,710	0.60
Sunac China Holdings Ltd 5.95% 26/04/2024	6,800,000	6,884,647	0.83
Sunac China Holdings Ltd 6.50% 09/07/2023	4,000,000	4,215,542	0.51
Sunac China Holdings Ltd 7.25% 14/06/2022	6,400,000	6,588,951	0.80

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.89%) (续)			
债务证券 (98.90%) (续)			
以美元计价 (98.05%) (续)			
Sunac China Holdings Ltd 7.50% 01/02/2024	500,000	528,435	0.06
Sunac China Holdings Ltd 7.95% 08/08/2022	1,300,000	1,373,540	0.17
Sunac China Holdings Ltd 8.35% 19/04/2023	7,700,000	8,107,869	0.98
Theta Capital Pte Ltd 6.75% 31/10/2026	1,600,000	1,593,932	0.19
Theta Capital Pte Ltd 8.125% 22/01/2025	12,300,000	13,223,428	1.60
Times China Holdings Ltd 5.55% 04/06/2024	4,800,000	4,833,948	0.58
Times China Holdings Ltd 6.60% 02/03/2023	5,850,000	5,985,564	0.72
Times China Holdings Ltd 6.75% 08/07/2025	1,400,000	1,467,085	0.18
Times China Holdings Ltd 7.625% 21/02/2022	470,000	488,901	0.06
TMBThanachart Bank PCL 4.90% Perpetual Callable - 02/12/2024	1,850,000	1,891,564	0.23
TML Holdings Pte Ltd 4.35% 09/06/2026	2,400,000	2,421,812	0.29
Vedanta Resources Finance II PLC 8.00% 23/04/2023	8,400,000	8,104,161	0.98
Vedanta Resources Finance II PLC 13.875% 21/01/2024	7,800,000	9,089,880	1.10
Vedanta Resources Ltd 6.375% 30/07/2022	22,000,000	22,361,011	2.70
Vedanta Resources Ltd 7.125% 31/05/2023	6,000,000	5,607,730	0.68
West China Cement Ltd 4.95% 08/07/2026	4,200,000	4,257,750	0.51

投资报告

于2021年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.89%) (续)			
债务证券 (98.90%) (续)			
以美元计价 (98.05%) (续)			
Woori Bank 4.25% Perpetual Callable - 04/10/2024	1,500,000	1,575,466	0.19
Wynn Macau Ltd 5.50% 15/01/2026	7,180,000	7,702,138	0.93
Wynn Macau Ltd 5.50% 01/10/2027	2,300,000	2,433,906	0.29
Wynn Macau Ltd 5.625% 26/08/2028	1,050,000	1,119,448	0.14
Yango Justice International Ltd 5.30% 11/01/2022	2,000,000	2,021,061	0.24
Yango Justice International Ltd 10.25% 18/03/2022	5,860,000	6,069,767	0.73
Yanlord Land HK Co Ltd 6.75% 23/04/2023	1,500,000	1,575,810	0.19
Yanlord Land HK Co Ltd 6.80% 27/02/2024	2,860,000	3,078,510	0.37
Yes Bank Ifsc Banking Unit Branch 3.75% 06/02/2023	5,000,000	5,036,571	0.61
Yuzhou Group Holdings Co Ltd 6.00% 25/01/2022	1,000,000	1,004,990	0.12
Yuzhou Group Holdings Co Ltd 6.00% 25/10/2023	1,500,000	1,333,980	0.16
Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.375% 30/10/2024	6,000,000	5,455,746	0.66
Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.50% 04/02/2023	2,400,000	2,353,892	0.28
Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.50% 26/02/2024	4,300,000	4,062,786	0.49
Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.625% 23/01/2022	1,400,000	1,454,718	0.18
Zhenro Properties Group Ltd 5.98% 13/04/2022	3,500,000	3,551,186	0.43

投资报告

于2021年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.89%) (续)			
债务证券 (98.90%) (续)			
以美元计价 (98.05%) (续)			
Zhenro Properties Group Ltd 8.70% 03/08/2022	4,500,000	4,777,635	0.58
Zhenro Properties Group Ltd 10.25% Perpetual Callable - 25/01/2022	200,000	212,457	0.03
债务证券总额		819,225,259	98.90

基础投资	对手方	未清偿合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
债券期指 (-0.01%)				
美国 (-0.01%)				
US 10Yr Note Future 21/09/2021	花旗银行, 香港	(120)	(62,665)	(0.01)
债券期指总额			(62,665)	(0.01)
投资总额			819,162,594	98.89

投资报告

于2021年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

基础投资	对手方	未清偿合约的名义 金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
外汇远期合约 (-0.07%)				
买入 澳元/卖出 美元	花旗银行,香港	澳元 10,456,398	(72,180)	(0.01)
买入 澳元/卖出 美元	花旗银行,香港	澳元 4,416	(36)	(0.00)
买入 英镑/卖出 美元	花旗银行,香港	英镑 6,000,000	(212,352)	(0.02)
买入 英镑/卖出 美元	花旗银行,香港	英镑 6,000,000	(165,012)	(0.02)
买入 加拿大元/卖出 美元	花旗银行,香港	加元 10,000,000	(56,466)	(0.01)
买入 欧罗/卖出 美元	花旗银行,香港	欧罗 35,215,224	(302,076)	(0.03)
买入 新西兰元/卖出 美元	花旗银行,香港	纽元 11,500,000	(84,076)	(0.01)
买入 挪威克朗/卖出 美元	花旗银行,香港	克朗 70,000,000	(80,056)	(0.01)
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 97,000,000	(154,512)	(0.02)
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 624,691,778	112,830	0.01
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 806,631,509	145,692	0.02
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 9,308	3	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 2,218,033	809	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 2,896,013	900	0.00

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金 (续)

基础投资	对手方	未清偿合约的名义 金额	公允价值 美元	占资产净 值 百分比
外汇远期合约 (-0.07%) (续)				
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 3,459,434	(297)	(0.00)
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 225,120	(13)	(0.00)
买入 美元/卖出 英镑	花旗银行,香港	美元 8,388,000	99,012	0.01
买入 美元/卖出 英镑	花旗银行,香港	美元 8,319,000	30,012	0.00
买入 美元/卖出 加拿大元	花旗银行,香港	美元 8,122,157	46,657	0.01
买入 美元/卖出 新西兰元	花旗银行,香港	美元 8,007,600	(27,784)	(0.00)
买入 美元/卖出 挪威克朗	花旗银行,香港	美元 8,236,263	100,723	0.01
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 3,011	(7)	(0.00)
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 8,867	3	0.00
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 4,780	(4)	(0.00)
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 241,414	(180)	(0.00)
外汇远期合约总额			(618,410)	(0.07)
其他净资产			9,805,487	1.18
净资产总额			828,349,671	100.00
投资总额, 按成本计算			786,245,401	

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚太区多元收益基金

	持有股份 / 份额 / 面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.79%)			
股票 (14.30%)			
澳大利亚 (6.18%)			
BHP Group Ltd	104,365	3,805,558	1.56
Evolution Mining Ltd	373,811	1,262,874	0.52
Megaport Ltd	215,769	2,985,449	1.22
OZ Minerals Ltd	132,594	2,237,770	0.92
Qantas Airways Ltd	669,719	2,343,009	0.96
Viva Energy Group Ltd	1,686,122	2,443,102	1.00
中国 (0.61%)			
LONGi Green Energy Technology Co Ltd - A	107,660	1,480,376	0.61
香港 (1.01%)			
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	41,200	2,455,285	1.01
南韩 (0.95%)			
Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	14,695	2,309,649	0.95
台湾 (3.48%)			
ASE Technology Holding Co Ltd	894,000	3,593,694	1.47
MediaTek Inc	83,000	2,865,753	1.18
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	95,000	2,028,739	0.83
泰国 (1.24%)			
Precious Shipping PCL - NVDR	4,622,300	3,014,206	1.24

投资报告

于2021年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份/ 份额/面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市/挂牌投资(98.79%)(续)			
股票(14.30%)(续)			
美国(0.83%)			
CrowdStrike Holdings Inc	8,086	2,032,093	0.83
股票总额		34,857,557	14.30
债务证券(44.47%)			
以人民币计价(1.17%)			
China Development Bank 3.30% 01/02/2024	5,000,000	790,120	0.32
China Government Bond 3.60% 06/09/2025	5,000,000	822,455	0.33
Export-Import Bank Of India/London 3.45% 25/06/2026	2,000,000	309,010	0.13
GLP China Holdings Ltd 4.00% 02/07/2024	2,000,000	310,578	0.13
HSBC Holdings PLC 3.40% 29/06/2027	2,000,000	311,716	0.13
Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 3.45% 25/05/2024	2,000,000	312,610	0.13
以美元计价(43.30%)			
AAC Technologies Holdings Inc 2.625% 02/06/2026	200,000	202,837	0.08
ABJA Investment Co Pte Ltd 5.45% 24/01/2028	1,300,000	1,434,092	0.59
ABJA Investment Co Pte Ltd 5.95% 31/07/2024	2,800,000	3,102,223	1.27
Agile Group Holdings Ltd 5.75% 02/01/2025	400,000	417,564	0.17

投资报告

于2021年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份/ 份额/面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市/挂牌投资(98.79%)(续)			
债务证券(44.47%)(续)			
以美元计价(43.30%)(续)			
Anton Oilfield Services Group/Hong Kong 7.50% 02/12/2022	350,000	347,967	0.14
Bangkok Bank PCL/Hong Kong 5.00% Perpetual Callable - 23/09/2025	350,000	374,885	0.15
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 3.75% 30/03/2026	400,000	413,128	0.17
Bank of Communications Hong Kong Ltd 2.304% 08/07/2031	700,000	699,209	0.29
Bukit Makmur Mandiri Utama PT 7.75% 10/02/2026	1,000,000	1,055,954	0.43
Champion Path Holdings Ltd 4.50% 27/01/2026	200,000	212,092	0.09
Champion Path Holdings Ltd 4.85% 27/01/2028	1,000,000	1,065,017	0.44
Champion Sincerity Holdings Ltd 8.125% Perpetual Callable - 08/02/2022	1,400,000	1,488,654	0.61
China Aoyuan Group Ltd 8.50% 23/01/2022	2,000,000	2,087,711	0.86
China Hongqiao Group Ltd 6.25% 08/06/2024	200,000	204,459	0.08
China Oil & Gas Group Ltd 4.70% 30/06/2026	450,000	457,650	0.19
China Oil & Gas Group Ltd 5.50% 25/01/2023	1,000,000	1,051,393	0.43
China SCE Group Holdings Ltd 5.95% 29/09/2024	450,000	458,899	0.19
China SCE Group Holdings Ltd 7.25% 19/04/2023	2,000,000	2,091,000	0.86
China SCE Group Holdings Ltd 7.375% 09/04/2024	400,000	421,667	0.17

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚太区多元收益基金 (续)

	持有股份 / 份额 / 面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.79%) (续)			
债务证券 (44.47%) (续)			
以美元计价 (43.30%) (续)			
Chong Hing Bank Ltd 5.70% Perpetual Callable - 15/07/2024	1,000,000	1,075,173	0.44
CIFI Holdings Group Co Ltd 4.45% 17/08/2026	600,000	601,973	0.25
CIFI Holdings Group Co Ltd 5.95% 20/10/2025	1,000,000	1,071,515	0.44
Clean Renewable Power Mauritius Pte Ltd 4.25% 25/03/2027	200,000	206,105	0.08
Clifton Ltd 6.25% 25/10/2025	500,000	502,443	0.21
Continuum Energy Levanter Pte Ltd 4.50% 09/02/2027	700,000	731,626	0.30
Easy Tactic Ltd 8.875% 27/09/2021	400,000	409,945	0.17
ENN Clean Energy International Investment Ltd 3.375% 12/05/2026	250,000	256,056	0.10
Fantasia Holdings Group Co Ltd 6.95% 17/12/2021	400,000	387,768	0.16
Fortune Star BVI Ltd 5.00% 18/05/2026	300,000	306,151	0.13
Fortune Star BVI Ltd 5.05% 27/01/2027	450,000	464,262	0.19
Fortune Star BVI Ltd 5.95% 19/10/2025	1,250,000	1,331,125	0.55
Fortune Star BVI Ltd 6.75% 02/07/2023	1,100,000	1,195,670	0.49
Fortune Star BVI Ltd 6.85% 02/07/2024	800,000	883,848	0.36
Global Prime Capital Pte Ltd 5.95% 23/01/2025	1,000,000	1,070,264	0.44
GMR Hyderabad International Airport Ltd 4.75% 02/02/2026	800,000	830,840	0.34

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚太区多元收益基金 (续)

	持有股份 / 份额 / 面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.79%) (续)			
债务证券 (44.47%) (续)			
以美元计价 (43.30%) (续)			
GMR Hyderabad International Airport Ltd 5.375% 10/04/2024	2,200,000	2,310,404	0.95
Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	300,000	311,220	0.13
Greenko Solar Mauritius Ltd 5.55% 29/01/2025	1,000,000	1,053,673	0.43
Greentown China Holdings Ltd 4.70% 29/04/2025	500,000	507,977	0.21
Greentown China Holdings Ltd 5.65% 13/07/2025	600,000	638,536	0.26
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd 5.625% 24/10/2024	250,000	261,565	0.11
Hong Seng Ltd 9.875% 27/08/2022	400,000	418,550	0.17
Honghua Group Ltd 6.375% 01/08/2022	1,200,000	1,206,362	0.49
India Green Energy Holdings 5.375% 29/04/2024	400,000	424,119	0.17
India Green Power Holdings 4.00% 22/02/2027	450,000	459,906	0.19
Indika Energy Capital III Pte Ltd 5.875% 09/11/2024	1,000,000	1,023,656	0.42
Indika Energy Capital IV Pte Ltd 8.25% 22/10/2025	2,300,000	2,480,326	1.02
JSW Hydro Energy Ltd 4.125% 18/05/2031	1,000,000	1,020,707	0.42
JSW Steel Ltd 5.95% 18/04/2024	1,600,000	1,734,552	0.71
Kaisa Group Holdings Ltd 9.75% 28/09/2023	700,000	707,915	0.29
Kaisa Group Holdings Ltd 10.875% 23/07/2023	200,000	210,138	0.09

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚太区多元收益基金 (续)

	持有股份 / 份额 / 面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.79%) (续)			
债务证券 (44.47%) (续)			
以美元计价 (43.30%) (续)			
Kaisa Group Holdings Ltd 11.50% 30/01/2023	800,000	849,573	0.35
Kaisa Group Holdings Ltd 11.65% 01/06/2026	1,000,000	948,108	0.39
Kaisa Group Holdings Ltd 11.70% 11/11/2025	450,000	432,315	0.18
Kaisa Group Holdings Ltd 11.95% 22/10/2022	400,000	421,914	0.17
Kaisa Group Holdings Ltd 11.95% 12/11/2023	400,000	416,318	0.17
Kasikornbank PCL/Hong Kong 5.275% Perpetual Callable - 14/10/2025	850,000	913,404	0.37
Krung Thai Bank PCL/Cayman Islands 4.40% Perpetual Callable - 25/03/2026	600,000	616,220	0.25
KWG Group Holdings Ltd 7.875% 01/09/2023	900,000	944,739	0.39
LMIRT Capital Pte Ltd 7.25% 19/06/2024	1,500,000	1,571,530	0.64
LMIRT Capital Pte Ltd 7.50% 09/02/2026	500,000	533,942	0.22
Logan Group Co Ltd 4.85% 14/12/2026	400,000	402,988	0.16
Logan Group Co Ltd 5.75% 14/01/2025	1,500,000	1,601,825	0.66
Logan Group Co Ltd 6.50% 16/07/2023	1,000,000	1,054,162	0.43
Logan Group Co Ltd 6.90% 09/06/2024	700,000	752,848	0.31
Marble II Pte Ltd 5.30% 20/06/2022	3,000,000	3,013,138	1.24

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚太区多元收益基金 (续)

	持有股份 / 份额 / 面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.79%) (续)			
债务证券 (44.47%) (续)			
以美元计价 (43.30%) (续)			
Medco Bell Pte Ltd 6.375% 30/01/2027	1,200,000	1,273,044	0.52
Medco Oak Tree Pte Ltd 7.375% 14/05/2026	2,000,000	2,206,597	0.90
Melco Resorts Finance Ltd 5.375% 04/12/2029	700,000	741,945	0.30
Melco Resorts Finance Ltd 5.75% 21/07/2028	300,000	325,145	0.13
MGM China Holdings Ltd 5.875% 15/05/2026	200,000	211,645	0.09
Minejesa Capital BV 4.625% 10/08/2030	1,000,000	1,080,915	0.44
New Metro Global Ltd 4.80% 15/12/2024	600,000	606,056	0.25
New Metro Global Ltd 6.80% 05/08/2023	700,000	748,655	0.31
NWD Finance BVI Ltd 4.125% Perpetual Callable - 10/03/2028	500,000	506,838	0.21
Pakuwon Jati Tbk PT 4.875% 29/04/2028	700,000	737,006	0.30
Perenti Finance Pty Ltd 6.50% 07/10/2025	600,000	641,986	0.26
Periama Holdings LLC/DE 5.95% 19/04/2026	2,000,000	2,200,160	0.90
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 3.90% 13/04/2022	500,000	503,816	0.21
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 5.95% 30/04/2025	200,000	208,736	0.09
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 6.25% 10/08/2024	400,000	424,984	0.17

投资报告

于2021年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份/ 份额/面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市/挂牌投资(98.79%)(续)			
债务证券(44.47%)(续)			
以美元计价(43.30%)(续)			
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 7.125% 08/11/2022	700,000	735,805	0.30
ReNew Power Pvt Ltd 6.45% 27/09/2022	1,200,000	1,265,183	0.52
ReNew Power Synthetic 6.67% 12/03/2024	2,200,000	2,363,538	0.97
ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	300,000	308,983	0.13
RKPF Overseas 2019 A Ltd 6.70% 30/09/2024	800,000	863,885	0.35
RKPF Overseas 2019 A Ltd 7.875% 01/02/2023	1,000,000	1,072,522	0.44
Ronshine China Holdings Ltd 5.50% 01/02/2022	500,000	503,867	0.21
Ronshine China Holdings Ltd 10.50% 01/03/2022	1,600,000	1,677,184	0.69
Ronshine China Holdings Ltd 11.25% 22/08/2021	200,000	209,750	0.09
Shimao Group Holdings Ltd 4.60% 13/07/2030	700,000	725,380	0.30
Shui On Development Holding Ltd 5.75% 12/11/2023	500,000	519,333	0.21
Sinic Holdings Group Co Ltd 9.50% 18/10/2021	750,000	743,692	0.30
SoftBank Group Corp 4.625% 06/07/2028	1,100,000	1,100,000	0.45
SoftBank Group Corp 5.25% 06/07/2031	900,000	900,000	0.37
Studio City Finance Ltd 6.00% 15/07/2025	300,000	324,248	0.13

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚太区多元收益基金 (续)

	持有股份 / 份额 / 面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.79%) (续)			
债务证券 (44.47%) (续)			
以美元计价 (43.30%) (续)			
Studio City Finance Ltd 6.50% 15/01/2028	1,000,000	1,100,603	0.46
Sunac China Holdings Ltd 5.95% 26/04/2024	500,000	506,224	0.21
Sunac China Holdings Ltd 6.50% 09/07/2023	800,000	843,108	0.35
Sunac China Holdings Ltd 6.50% 10/01/2025	700,000	711,147	0.29
Sunac China Holdings Ltd 7.00% 09/07/2025	500,000	509,787	0.21
Sunac China Holdings Ltd 7.50% 01/02/2024	600,000	634,122	0.26
Theta Capital Pte Ltd 8.125% 22/01/2025	1,800,000	1,935,136	0.79
Times China Holdings Ltd 5.55% 04/06/2024	600,000	604,243	0.25
Times China Holdings Ltd 6.20% 22/03/2026	600,000	600,912	0.25
Times China Holdings Ltd 6.60% 02/03/2023	500,000	511,587	0.21
Times China Holdings Ltd 6.75% 16/07/2023	1,400,000	1,482,457	0.61
Times China Holdings Ltd 6.75% 08/07/2025	900,000	943,126	0.39
TMBThanachart Bank PCL 4.90% Perpetual Callable - 02/12/2024	700,000	715,727	0.29
TML Holdings Pte Ltd 4.35% 09/06/2026	400,000	403,635	0.17
Vedanta Resources Finance II PLC 8.00% 23/04/2023	500,000	482,391	0.20

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚太区多元收益基金 (续)

	持有股份 / 份额 / 面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (98.79%) (续)			
债务证券 (44.47%) (续)			
以美元计价 (43.30%) (续)			
Vedanta Resources Finance II PLC 13.875% 21/01/2024	250,000	291,342	0.12
Vedanta Resources Ltd 6.375% 30/07/2022	2,600,000	2,642,665	1.08
Vedanta Resources Ltd 7.125% 31/05/2023	500,000	467,311	0.19
West China Cement Ltd 4.95% 08/07/2026	550,000	557,563	0.23
Wynn Macau Ltd 5.50% 15/01/2026	300,000	321,816	0.13
Wynn Macau Ltd 5.625% 26/08/2028	700,000	746,299	0.31
Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.375% 30/10/2024	800,000	727,433	0.30
Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.50% 04/02/2023	400,000	392,315	0.16
Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.625% 23/01/2022	1,900,000	1,974,260	0.81
Zhenro Properties Group Ltd 5.98% 13/04/2022	500,000	507,312	0.21
Zhenro Properties Group Ltd 9.80% 20/08/2021	1,000,000	1,042,831	0.43
债务证券总额		<u>108,396,534</u>	<u>44.47</u>
合订证券 (1.70%)			
澳大利亚 (1.70%)			
Transurban Group	387,772	<u>4,142,635</u>	<u>1.70</u>
合订证券总额		<u>4,142,635</u>	<u>1.70</u>

投资报告

于2021年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份/ 份额/面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市/挂牌投资(98.79%)(续)			
投资基金(27.42%)			
香港(27.42%)			
东亚联丰亚太区债券基金- Class ADU	2,006,104	29,590,027	12.14
东亚联丰亚洲债券及货币基金 - Class ADU	55,388	689,032	0.28
东亚联丰亚洲债券及货币基金 - Class IAU	1,141,575	12,568,738	5.16
东亚联丰亚太区债券基金	2,310,000	24,000,900	9.84
投资基金总额		66,848,697	27.42

房地产投资信托基金(10.90%)

澳大利亚(1.86%)

Charter Hall Group	182,875	2,130,794	0.87
Goodman Group	152,015	2,416,032	0.99

香港(1.55%)

Link REIT	389,800	3,777,110	1.55
-----------	---------	-----------	------

新加坡(5.15%)

Ascendas Real Estate Investment Trust	1,181,995	2,594,023	1.06
CapitaLand Integrated Commercial Trust	2,386,944	3,711,288	1.52
Keppel DC REIT	665,100	1,232,033	0.51
Mapletree Industrial Trust	1,330,665	2,801,505	1.15
Mapletree Logistics Trust	1,459,757	2,226,233	0.91

投资报告

于2021年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

		持有股份/ 份额/面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市/挂牌投资(98.79%)(续)				
房地产投资信托基金(10.90%)(续)				
美国(2.34%)				
Prologis Inc		47,626	5,692,736	2.34
房地产投资信托基金总额			26,581,754	10.90
基础投资				
	对手方	未清偿合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值
债券期指(0.00%)				
美国(0.00%)				
US 10Yr Note Future 21/09/2021	花旗银行,香港	(20)	(10,156)	(0.00)
债券期货总额			(10,156)	(0.00)
投资总额			240,817,021	98.79

投资报告

于2021年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

基础投资	对手方	未清偿合约的名义 金额	公允价值 美元	占资产净 值 百分比
外汇远期合约 (-0.18%)				
买入 澳元/卖出 美元	花旗银行,香港	澳元 38,140,811	(263,286)	(0.11)
买入 英镑/卖出 美元	花旗银行,香港	英镑 1,800,000	(63,706)	(0.03)
买入 英镑/卖出 美元	花旗银行,香港	英镑 1,800,000	(49,504)	(0.02)
买入 加拿大元/卖出 美元	花旗银行,香港	加元 3,000,000	(16,940)	(0.01)
买入 欧罗/卖出 美元	花旗银行,香港	欧罗 49,773	(427)	(0.00)
买入 欧罗/卖出 美元	花旗银行,香港	欧罗 53,082	(455)	(0.00)
买入 新西兰元/卖出 美元	花旗银行,香港	纽元 3,300,000	(24,126)	(0.01)
买入 新西兰元/卖出 美元	花旗银行,香港	纽元 11,384,742	(82,858)	(0.03)
买入 挪威克朗/卖出 美元	花旗银行,香港	克朗 20,000,000	(22,873)	(0.01)
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 32,000,000	(50,973)	(0.02)
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 323,219,315	58,379	0.02
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 478,838	87	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 436,733	136	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 1,000	-	0.00

投资报告

于2021年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

基础投资	对手方	未清偿合约的 名义金额	公允价值 美元	占资产净 值 百分比
外汇远期合约 (-0.18%)(续)				
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 527,703	(31)	(0.00)
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 902	-	0.00
买入 美元/卖出 澳元	花旗银行,香港	美元 439,377	4,689	0.00
买入 美元/卖出 澳元	花旗银行,香港	美元 56,917	51	0.00
买入 美元/卖出 英镑	花旗银行,香港	美元 2,516,400	29,704	0.01
买入 美元/卖出 英镑	花旗银行,香港	美元 2,495,700	9,004	0.01
买入 美元/卖出 加拿大元	花旗银行,香港	美元 2,436,647	13,997	0.01
买入 美元/卖出 新西兰元	花旗银行,香港	美元 2,297,833	(7,973)	(0.00)
买入 美元/卖出 新西兰元	花旗银行,香港	美元 56,435	760	0.00
买入 美元/卖出 挪威克朗	花旗银行,香港	美元 2,353,218	28,778	0.01
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 54,965	(141)	(0.00)
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 49	-	0.00

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚太区多元收益基金 (续)

基础投资	对手方	未清偿合约的 名义金额	公允价值 美元	占资产净 值 百分比
外汇远期合约 (-0.18%) (续)				
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行, 香港	美元 106,474	(80)	(0.00)
外汇远期合约总额			(437,788)	(0.18)
其他净资产			3,394,291	1.39
净资产总额			243,773,524	100.00
投资总额, 按成本计算			217,609,998	

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰中国高收益入息基金

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (97.51%)			
债务证券 (97.52%)			
以美元计价 (97.52%)			
Central China Real Estate Ltd 7.75% 24/05/2024	300,000	269,990	0.52
Champion Path Holdings Ltd 4.50% 27/01/2026	200,000	212,092	0.41
Champion Path Holdings Ltd 4.85% 27/01/2028	200,000	213,003	0.41
China Aoyuan Group Ltd 5.375% 13/09/2022	700,000	689,433	1.34
China Aoyuan Group Ltd 6.35% 08/02/2024	700,000	680,935	1.32
China Aoyuan Group Ltd 7.95% 19/02/2023	500,000	511,260	0.99
China Aoyuan Group Ltd 8.50% 23/01/2022	200,000	208,771	0.41
China Evergrande Group 8.25% 23/03/2022	400,000	351,583	0.68
China Evergrande Group 8.75% 28/06/2025	600,000	400,643	0.78
China Evergrande Group 9.50% 11/04/2022	3,200,000	2,808,388	5.46
China Evergrande Group 11.50% 22/01/2023	300,000	255,006	0.50
China Oil & Gas Group Ltd 4.70% 30/06/2026	450,000	457,650	0.89
China SCE Group Holdings Ltd 5.95% 29/09/2024	250,000	254,944	0.50
China SCE Group Holdings Ltd 7.25% 19/04/2023	850,000	888,675	1.73
China SCE Group Holdings Ltd 7.375% 09/04/2024	200,000	210,834	0.41
CIFI Holdings Group Co Ltd 4.45% 17/08/2026	300,000	300,987	0.58

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰中国高收益入息基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (97.51%) (续)			
债务证券 (97.52%) (续)			
以美元计价 (97.52%) (续)			
CIFI Holdings Group Co Ltd 5.95% 20/10/2025	400,000	428,606	0.83
CIFI Holdings Group Co Ltd 6.00% 16/07/2025	300,000	324,945	0.63
CIFI Holdings Group Co Ltd 6.45% 07/11/2024	550,000	588,481	1.14
Cliffon Ltd 6.25% 25/10/2025	500,000	502,443	0.98
Continuum Energy Levanter Pte Ltd 4.50% 09/02/2027	200,000	209,036	0.41
Easy Tactic Ltd 5.75% 13/01/2022	800,000	804,579	1.56
Easy Tactic Ltd 5.875% 13/02/2023	300,000	273,597	0.53
Easy Tactic Ltd 8.125% 27/02/2023	300,000	289,022	0.56
Easy Tactic Ltd 8.875% 27/09/2021	800,000	819,891	1.59
Easy Tactic Ltd 9.125% 28/07/2022	200,000	205,918	0.40
Easy Tactic Ltd 11.75% 02/08/2023	300,000	310,219	0.60
Fantasia Holdings Group Co Ltd 6.95% 17/12/2021	500,000	484,710	0.94
Fantasia Holdings Group Co Ltd 11.75% 17/04/2022	600,000	580,934	1.13
Fantasia Holdings Group Co Ltd 15.00% 18/12/2021	1,050,000	1,052,999	2.05
Fortune Star BVI Ltd 5.00% 18/05/2026	200,000	204,100	0.40
Fortune Star BVI Ltd 5.95% 19/10/2025	1,250,000	1,331,125	2.59
Fortune Star BVI Ltd 6.75% 02/07/2023	400,000	434,789	0.84
Fortune Star BVI Ltd 6.85% 02/07/2024	300,000	331,443	0.64
Global Prime Capital Pte Ltd 5.95% 23/01/2025	400,000	428,106	0.83

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰中国高收益入息基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (97.51%) (续)			
债务证券 (97.52%) (续)			
以美元计价 (97.52%) (续)			
GMR Hyderabad International Airport Ltd 4.75% 02/02/2026	400,000	415,420	0.81
Greentown China Holdings Ltd 5.65% 13/07/2025	200,000	212,845	0.41
Hong Seng Ltd 9.875% 27/08/2022	200,000	209,275	0.41
IIFL Finance Ltd 5.875% 20/04/2023	700,000	695,462	1.35
Indiabulls Housing Finance Ltd 6.375% 28/05/2022	400,000	384,145	0.75
Indika Energy Capital IV Pte Ltd 8.25% 22/10/2025	900,000	970,562	1.89
JSW Hydro Energy Ltd 4.125% 18/05/2031	200,000	204,141	0.40
Kaisa Group Holdings Ltd 9.375% 30/06/2024	500,000	471,870	0.92
Kaisa Group Holdings Ltd 9.75% 28/09/2023	200,000	202,261	0.39
Kaisa Group Holdings Ltd 10.50% 15/01/2025	700,000	693,544	1.35
Kaisa Group Holdings Ltd 11.25% 16/04/2025	500,000	487,199	0.95
Kaisa Group Holdings Ltd 11.50% 30/01/2023	1,500,000	1,592,949	3.09
Kaisa Group Holdings Ltd 11.65% 01/06/2026	200,000	189,622	0.37
Kaisa Group Holdings Ltd 11.70% 11/11/2025	250,000	240,175	0.47
Kaisa Group Holdings Ltd 11.95% 12/11/2023	300,000	312,239	0.61
KWG Group Holdings Ltd 7.40% 05/03/2024	1,000,000	1,068,844	2.08

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰中国高收益入息基金 (续)

	面值	市值	占资产净值
		美元	百分比
上市 / 挂牌投资 (97.51%) (续)			
债务证券 (97.52%) (续)			
以美元计价 (97.52%) (续)			
LMIRT Capital Pte Ltd 7.50%			
09/02/2026	200,000	213,577	0.41
Logan Group Co Ltd 4.85%			
14/12/2026	400,000	402,988	0.78
Logan Group Co Ltd 5.25%			
19/10/2025	200,000	207,946	0.40
Logan Group Co Ltd 5.75%			
14/01/2025	300,000	320,365	0.62
Logan Group Co Ltd 6.50%			
16/07/2023	400,000	421,665	0.82
Logan Group Co Ltd 6.90%			
09/06/2024	800,000	860,397	1.67
MGM China Holdings Ltd 5.875%			
15/05/2026	200,000	211,645	0.41
Modern Land China Co Ltd 11.80%			
26/02/2022	1,200,000	1,231,251	2.39
New Metro Global Ltd 4.80%			
15/12/2024	250,000	252,523	0.49
New Metro Global Ltd 6.80%			
05/08/2023	200,000	213,902	0.42
Powerlong Real Estate Holdings Ltd			
3.90% 13/04/2022	200,000	201,526	0.39
Powerlong Real Estate Holdings Ltd			
6.95% 23/07/2023	300,000	319,183	0.62
Powerlong Real Estate Holdings Ltd			
7.125% 08/11/2022	400,000	420,460	0.82
Radiance Capital Investments Ltd			
8.80% 17/09/2023	700,000	724,894	1.41
Radiance Capital Investments Ltd			
11.75% 31/10/2021	400,000	415,764	0.81

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰中国高收益入息基金 (续)

	面值	市值	占资产净值
		美元	百分比
上市 / 挂牌投资 (97.51%) (续)			
债务证券 (97.52%) (续)			
以美元计价 (97.52%) (续)			
Redco Properties Group Ltd 8.50%			
19/08/2021	200,000	206,554	0.40
ReNew Power Synthetic 6.67%			
12/03/2024	300,000	322,301	0.63
Ronshine China Holdings Ltd 5.25%			
03/12/2021	300,000	298,297	0.58
Ronshine China Holdings Ltd 5.50%			
01/02/2022	300,000	302,320	0.59
Ronshine China Holdings Ltd 10.50%			
01/03/2022	900,000	943,416	1.83
Scenery Journey Ltd 12.00%			
24/10/2023	300,000	252,136	0.49
Shriram Transport Finance Co Ltd			
5.10% 16/07/2023	500,000	520,048	1.01
Shriram Transport Finance Co Ltd			
5.95% 24/10/2022	300,000	310,819	0.60
Sinic Holdings Group Co Ltd 8.50%			
24/01/2022	700,000	668,516	1.30
Sinic Holdings Group Co Ltd 9.50%			
18/10/2021	900,000	892,431	1.73
SoftBank Group Corp 4.625%			
06/07/2028	400,000	400,000	0.78
SoftBank Group Corp 5.25%			
06/07/2031	300,000	300,000	0.58
Studio City Finance Ltd 6.00%			
15/07/2025	200,000	216,165	0.42
Studio City Finance Ltd 6.50%			
15/01/2028	300,000	330,181	0.64
Sunac China Holdings Ltd 5.95%			
26/04/2024	400,000	404,979	0.79

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰中国高收益入息基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (97.51%) (续)			
债务证券 (97.52%) (续)			
以美元计价(97.52%) (续)			
Sunac China Holdings Ltd 6.50% 26/01/2026	300,000	298,556	0.58
Sunac China Holdings Ltd 6.65% 03/08/2024	600,000	618,689	1.20
Sunac China Holdings Ltd 7.00% 09/07/2025	200,000	203,915	0.40
Sunac China Holdings Ltd 7.95% 08/08/2022	300,000	316,971	0.62
Sunac China Holdings Ltd 8.35% 19/04/2023	900,000	947,673	1.84
Times China Holdings Ltd 5.55% 04/06/2024	350,000	352,475	0.68
Times China Holdings Ltd 6.60% 02/03/2023	800,000	818,539	1.59
Times China Holdings Ltd 6.75% 08/07/2025	400,000	419,167	0.81
Vedanta Resources Finance II PLC 8.00% 23/04/2023	200,000	192,956	0.37
Vedanta Resources Finance II PLC 13.875% 21/01/2024	200,000	233,074	0.45
Vedanta Resources Ltd 6.375% 30/07/2022	1,100,000	1,118,051	2.17
West China Cement Ltd 4.95% 08/07/2026	700,000	709,625	1.38
Yango Justice International Ltd 5.30% 11/01/2022	200,000	202,106	0.39
Yango Justice International Ltd 10.25% 18/03/2022	1,000,000	1,035,796	2.01
Yanlord Land HK Co Ltd 6.80% 27/02/2024	500,000	538,201	1.05
Yuzhou Group Holdings Co Ltd 6.00% 25/10/2023	300,000	266,796	0.52

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰中国高收益入息基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (97.51%) (续)			
债务证券 (97.52%) (续)			
以美元计价(97.52%) (续)			
Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.375% 30/10/2024	200,000	181,858	0.35
Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.50% 04/02/2023	250,000	245,197	0.48
Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.50% 26/02/2024	500,000	472,417	0.92
Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.625% 23/01/2022	300,000	311,725	0.61
Zhenro Properties Group Ltd 5.98% 13/04/2022	200,000	202,925	0.39
Zhenro Properties Group Ltd 8.70% 03/08/2022	700,000	743,188	1.44
Zhenro Properties Group Ltd 9.15% 06/05/2023	300,000	316,623	0.61
债务证券总额		50,202,462	97.52

基础投资	对手方	未清偿合约 的名义金额	公允价值	占资产净值
债务证券期指 (-0.01%)				
美国				
(-0.01%)				
US 10Yr Note Future 21/09/2021	花旗银行, 香港	(8)	(4,167)	(0.01)
债务证券期指总额			(4,167)	(0.01)
投资总额			50,198,295	97.51

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰中国高收益入息基金 (续)

基础投资	对手方	未清偿合约的名义金 额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
外汇远期合约(-0.11%)				
买入 澳元/卖出 美元	花旗银行,香港	澳元 4,704,740	(32,477)	(0.06)
买入 英镑/卖出 美元	花旗银行,香港	英镑 400,000	(14,157)	(0.03)
买入 英镑/卖出 美元	花旗银行,香港	英镑 400,000	(11,001)	(0.02)
买入 加拿大元/卖出 美元	花旗银行,香港	加元 700,000	(3,953)	(0.01)
买入 新西兰元/卖出 美元	花旗银行,香港	纽元 700,000	(5,118)	(0.01)
买入 挪威克朗/卖出 美元	花旗银行,香港	克朗 4,000,000	(4,575)	(0.01)
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 7,000,000	(11,150)	(0.02)
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 52,455,763	9,474	0.02
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 463,798	169	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 369,328	115	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 49,587	1	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 23,569	(2)	(0.00)
买入 美元/卖出 澳元	花旗银行,香港	美元 169,754	(136)	(0.00)
买入 美元/卖出 英镑	花旗银行,香港	美元 559,200	6,601	0.01

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰中国高收益入息基金 (续)

基础投资	对手方	未清偿合约的名义 金额		公允价值 美元	占资产净值 百分比
外汇远期合约(-0.11%) (续)					
买入 美元/卖出 英镑	花旗银行,香港	美元	554,600	2,001	0.00
买入 美元/卖出 加拿大元	花旗银行,香港	美元	568,551	3,266	0.01
买入 美元/卖出 新西兰元	花旗银行,香港	美元	487,419	(1,691)	(0.00)
买入 美元/卖出 挪威克朗	花旗银行,香港	美元	470,644	5,756	0.01
外汇远期合约总额				(56,877)	(0.11)
其他净资产				1,342,852	2.60
净资产总额				51,484,270	100.00
投资总额, 按成本计算				49,933,472	

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲策略债券基金

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (103.26%)			
债务证券 (88.80%)			
Denominated in Renminbi (2.30%)			
Export-Import Bank Of India/London 3.45% 25/06/2026	2,000,000	309,010	0.34
GLP China Holdings Ltd 4.00% 02/07/2024	1,500,000	232,933	0.25
HSBC Holdings PLC 3.40% 29/06/2027	2,000,000	311,716	0.34
Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 3.45% 25/05/2024	3,000,000	468,916	0.51
Wharf REIC Finance BVI Ltd 3.20% 15/09/2023	5,000,000	790,740	0.86
以美元计价(86.50%)			
AAC Technologies Holdings Inc 2.625% 02/06/2026	200,000	202,837	0.22
AAC Technologies Holdings Inc 3.75% 02/06/2031	250,000	256,898	0.28
ABJA Investment Co Pte Ltd 5.95% 31/07/2024	200,000	221,587	0.24
Anton Oilfield Services Group/Hong Kong 7.50% 02/12/2022	300,000	298,257	0.32
Azure Power Energy Ltd 5.50% 03/11/2022	500,000	513,165	0.56
Azure Power Solar Energy Pvt Ltd 5.65% 24/12/2024	300,000	319,590	0.35
Bangkok Bank PCL/Hong Kong 5.00% Perpetual Callable - 23/09/2025	200,000	214,220	0.23
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 3.75% 30/03/2026	200,000	206,564	0.23
Bank of China Hong Kong Ltd 5.90% Perpetual Callable - 14/09/2023	500,000	547,818	0.60

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲策略债券基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (103.26%) (续)			
债务证券 (88.80%) (续)			
以美元计价(86.50%) (续)			
Bank of Communications Hong Kong Ltd 2.304% 08/07/2031	1,000,000	998,870	1.09
Bluestar Finance Holdings Ltd 3.375% 16/07/2024	1,000,000	1,060,919	1.15
Bukit Makmur Mandiri Utama PT 7.75% 10/02/2026	400,000	422,382	0.46
Champion Path Holdings Ltd 4.50% 27/01/2026	200,000	212,092	0.23
Champion Sincerity Holdings Ltd 8.125% Perpetual Callable - 08/02/2022	200,000	212,665	0.23
China Aoyuan Group Ltd 8.50% 23/01/2022	600,000	626,313	0.68
China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd 3.08% Perpetual Callable - 09/12/2025	800,000	819,802	0.89
China Oil & Gas Group Ltd 4.70% 30/06/2026	200,000	203,400	0.22
China Oil & Gas Group Ltd 5.50% 25/01/2023	300,000	315,418	0.34
China SCE Group Holdings Ltd 7.25% 19/04/2023	500,000	522,750	0.57
Chong Hing Bank Ltd 5.70% Perpetual Callable - 15/07/2024	1,500,000	1,612,760	1.75
CIFI Holdings Group Co Ltd 6.45% 07/11/2024	350,000	374,488	0.41
Cliffon Ltd 6.25% 25/10/2025	500,000	502,443	0.55
CMB Wing Lung Bank Ltd 3.75% 22/11/2027	600,000	616,009	0.67

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲策略债券基金 (续)

	面值	市值	占资产净值
	美元	美元	百分比
上市 / 挂牌投资 (103.26%) (续)			
债务证券 (88.80%) (续)			
以美元计价(86.50%) (续)			
CNAC HK Finbridge Co Ltd 3.375% 19/06/2024	900,000	944,563	1.03
CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.125% 19/07/2027	500,000	551,976	0.60
CNAC HK Finbridge Co Ltd 5.125% 14/03/2028	500,000	580,271	0.63
CNOOC Finance 2013 Ltd 3.30% 30/09/2049	300,000	282,189	0.31
CNOOC Petroleum North America ULC 5.875% 10/03/2035	500,000	628,307	0.68
Continuum Energy Levanter Pte Ltd 4.50% 09/02/2027	250,000	261,295	0.28
Country Garden Holdings Co Ltd 5.125% 14/01/2027	200,000	218,515	0.24
Country Garden Holdings Co Ltd 6.15% 17/09/2025	400,000	446,791	0.49
Country Garden Holdings Co Ltd 7.25% 08/04/2026	400,000	450,562	0.49
Dah Sing Bank Ltd 4.25% 30/11/2026	500,000	506,045	0.55
Easy Tactic Ltd 5.75% 13/01/2022	200,000	201,145	0.22
Easy Tactic Ltd 8.875% 27/09/2021	200,000	204,973	0.22
ENN Clean Energy International Investment Ltd 3.375% 12/05/2026	250,000	256,056	0.28
Fantasia Holdings Group Co Ltd 6.95% 17/12/2021	700,000	678,594	0.74
Fortune Star BVI Ltd 5.00% 18/05/2026	200,000	204,100	0.22
Fortune Star BVI Ltd 5.95% 29/01/2023	300,000	316,228	0.34
Fortune Star BVI Ltd 5.95% 19/10/2025	400,000	425,960	0.46

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲策略债券基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (103.26%) (续)			
债务证券 (88.80%) (续)			
以美元计价(86.50%) (续)			
Fortune Star BVI Ltd 6.75% 02/07/2023	300,000	326,092	0.35
Fortune Star BVI Ltd 6.85% 02/07/2024	200,000	220,962	0.24
GC Treasury Center Co Ltd 2.98% 18/03/2031	700,000	720,906	0.78
GC Treasury Center Co Ltd 4.30% 18/03/2051	1,000,000	1,114,243	1.21
Global Prime Capital Pte Ltd 5.95% 23/01/2025	400,000	428,106	0.47
GLP China Holdings Ltd 2.95% 29/03/2026	450,000	459,926	0.50
GMR Hyderabad International Airport Ltd 4.75% 02/02/2026	500,000	519,275	0.56
GMR Hyderabad International Airport Ltd 5.375% 10/04/2024	200,000	210,037	0.23
Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	200,000	207,480	0.23
Greenko Solar Mauritius Ltd 5.55% 29/01/2025	400,000	421,469	0.46
Greentown China Holdings Ltd 4.70% 29/04/2025	200,000	203,191	0.22
Greentown China Holdings Ltd 5.65% 13/07/2025	200,000	212,845	0.23
HKT Capital No 5 Ltd 3.25% 30/09/2029	600,000	640,389	0.70
Hong Seng Ltd 9.875% 27/08/2022	200,000	209,275	0.23
Honghua Group Ltd 6.375% 01/08/2022	200,000	201,060	0.22
India Green Energy Holdings 5.375% 29/04/2024	250,000	265,074	0.29

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲策略债券基金 (续)

	面值	市值	占资产净值
	美元	美元	百分比
上市 / 挂牌投资 (103.26%) (续)			
债务证券 (88.80%) (续)			
以美元计价(86.50%) (续)			
India Green Power Holdings 4.00% 22/02/2027	250,000	255,503	0.28
Indika Energy Capital III Pte Ltd 5.875% 09/11/2024	500,000	511,828	0.56
Indika Energy Capital IV Pte Ltd 8.25% 22/10/2025	750,000	808,802	0.88
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 4.75% 15/05/2025	200,000	221,554	0.24
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.45% 15/05/2030	1,650,000	1,936,760	2.11
JMH Co Ltd 2.50% 09/04/2031	900,000	916,915	1.00
JMH Co Ltd 2.875% 09/04/2036	750,000	764,151	0.83
JSW Hydro Energy Ltd 4.125% 18/05/2031	600,000	612,424	0.67
JSW Steel Ltd 5.95% 18/04/2024	200,000	216,819	0.24
Kaisa Group Holdings Ltd 6.50% 07/12/2021	200,000	201,535	0.22
Kaisa Group Holdings Ltd 9.375% 30/06/2024	500,000	471,870	0.51
Kaisa Group Holdings Ltd 11.25% 16/04/2025	200,000	194,879	0.21
Kaisa Group Holdings Ltd 11.50% 30/01/2023	200,000	212,393	0.23
Kaisa Group Holdings Ltd 11.65% 01/06/2026	500,000	474,054	0.52
Kaisa Group Holdings Ltd 11.70% 11/11/2025	200,000	192,140	0.21
Kaisa Group Holdings Ltd 11.95% 22/10/2022	200,000	210,957	0.23
Kaisa Group Holdings Ltd 11.95% 12/11/2023	300,000	312,239	0.34

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲策略债券基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (103.26%) (续)			
债务证券 (88.80%) (续)			
以美元计价(86.50%) (续)			
Kasikornbank PCL/Hong Kong 5.275% Perpetual Callable - 14/10/2025	200,000	214,918	0.23
Krung Thai Bank PCL/Cayman Islands 4.40% Perpetual Callable - 25/03/2026	200,000	205,407	0.22
KWG Group Holdings Ltd 7.875% 01/09/2023	200,000	209,942	0.23
LG Chem Ltd 2.375% 07/07/2031	650,000	650,221	0.71
LMIRT Capital Pte Ltd 7.25% 19/06/2024	250,000	261,922	0.28
LMIRT Capital Pte Ltd 7.50% 09/02/2026	200,000	213,577	0.23
Logan Group Co Ltd 5.25% 19/10/2025	200,000	207,946	0.23
Logan Group Co Ltd 6.90% 09/06/2024	300,000	322,649	0.35
Malaysia Wakala Sukuk Bhd 3.075% 28/04/2051	500,000	525,741	0.57
Medco Oak Tree Pte Ltd 7.375% 14/05/2026	700,000	772,309	0.84
Meituan 2.125% 28/10/2025	500,000	498,124	0.54
Melco Resorts Finance Ltd 5.375% 04/12/2029	200,000	211,984	0.23
Melco Resorts Finance Ltd 5.625% 17/07/2027	1,000,000	1,073,995	1.17
Minejesa Capital BV 4.625% 10/08/2030	700,000	756,640	0.82
Minejesa Capital BV 5.625% 10/08/2037	200,000	221,752	0.24

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲策略债券基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (103.26%) (续)			
债务证券 (88.80%) (续)			
以美元计价(86.50%) (续)			
Mirae Asset Securities Co Ltd 2.625% 30/07/2025	950,000	987,839	1.07
Mongolia Government International Bond 3.50% 07/07/2027	200,000	197,336	0.21
New Metro Global Ltd 4.80% 15/12/2024	200,000	202,019	0.22
New Metro Global Ltd 6.80% 05/08/2023	300,000	320,852	0.35
New Metro Global Ltd 7.50% 16/12/2021	200,000	204,579	0.22
New World China Land Ltd 4.75% 23/01/2027	400,000	437,443	0.48
NTPC Ltd 4.25% 26/02/2026	900,000	983,976	1.07
NWD Finance BVI Ltd 4.125% Perpetual Callable - 10/03/2028	300,000	304,103	0.33
NWD Finance BVI Ltd 6.25% Perpetual Callable - 07/03/2024	600,000	646,189	0.70
NWD MTN Ltd 3.75% 14/01/2031	850,000	874,536	0.95
Oil India International Pte Ltd 4.00% 21/04/2027	500,000	532,874	0.58
ONGC Videsh Ltd 4.625% 15/07/2024	800,000	887,701	0.97
Pakuwon Jati Tbk PT 4.875% 29/04/2028	200,000	210,573	0.23
Pelabuhan Indonesia II PT 4.25% 05/05/2025	800,000	881,089	0.96
Perenti Finance Pty Ltd 6.50% 07/10/2025	200,000	213,995	0.23
Periama Holdings LLC/DE 5.95% 19/04/2026	750,000	825,060	0.90

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲策略债券基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (103.26%) (续)			
债务证券 (88.80%) (续)			
以美元计价(86.50%) (续)			
Pertamina Persero PT 2.30% 09/02/2031	600,000	582,271	0.63
Pertamina Persero PT 6.45% 30/05/2044	850,000	1,114,319	1.21
Perusahaan Listrik Negara PT 3.875% 17/07/2029	750,000	811,030	0.88
Perusahaan Listrik Negara PT 4.125% 15/05/2027	1,000,000	1,093,041	1.19
Perusahaan Listrik Negara PT 5.45% 21/05/2028	500,000	588,193	0.64
Perusahaan Listrik Negara PT 6.15% 21/05/2048	300,000	380,737	0.41
Petronas Capital Ltd 3.404% 28/04/2061	1,300,000	1,344,144	1.46
Philippine Government International Bond 3.20% 06/07/2046	600,000	602,995	0.66
Poly Developments and Holdings Group Co Ltd 4.75% 17/09/2023	350,000	376,426	0.41
Power Finance Corp Ltd 3.75% 06/12/2027	1,000,000	1,043,564	1.13
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 3.90% 13/04/2022	200,000	201,526	0.22
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 6.25% 10/08/2024	200,000	212,492	0.23
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 7.125% 08/11/2022	300,000	315,345	0.34
PTT PCL 5.875% 03/08/2035	800,000	1,048,994	1.14
Qatar Petroleum 1.375% 12/09/2026	650,000	649,383	0.71
Qatar Petroleum 2.25% 12/07/2031	650,000	643,090	0.70
Qatar Petroleum 3.125% 12/07/2041	1,500,000	1,494,465	1.62

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲策略债券基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (103.26%) (续)			
债务证券 (88.80%) (续)			
以美元计价(86.50%) (续)			
Radiance Capital Investments Ltd 10.50% 16/01/2022	200,000	213,539	0.23
ReNew Power Pvt Ltd 6.45% 27/09/2022	200,000	210,864	0.23
ReNew Power Synthetic 6.67% 12/03/2024	250,000	268,584	0.29
RKPF Overseas 2019 A Ltd 7.875% 01/02/2023	200,000	214,504	0.23
Ronshine China Holdings Ltd 5.50% 01/02/2022	200,000	201,547	0.22
Ronshine China Holdings Ltd 11.25% 22/08/2021	200,000	209,750	0.23
Shimao Group Holdings Ltd 4.60% 13/07/2030	500,000	518,128	0.56
Shimao Group Holdings Ltd 5.60% 15/07/2026	600,000	647,095	0.70
Sinic Holdings Group Co Ltd 8.50% 24/01/2022	300,000	286,507	0.31
Sinic Holdings Group Co Ltd 9.50% 18/10/2021	200,000	198,318	0.22
SMBC Aviation Capital Finance DAC 2.30% 15/06/2028	400,000	405,957	0.44
SoftBank Group Corp 4.625% 06/07/2028	400,000	400,000	0.44
SoftBank Group Corp 5.25% 06/07/2031	300,000	300,000	0.33
Sri Lanka Government International Bond 5.75% 18/04/2023	700,000	536,228	0.58
Sri Lanka Government International Bond 6.85% 14/03/2024	500,000	358,535	0.39

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲策略债券基金 (续)

	面值	市值	占资产净值
		美元	百分比
上市 / 挂牌投资 (103.26%) (续)			
债务证券 (88.80%) (续)			
以美元计价(86.50%) (续)			
Studio City Finance Ltd 6.00%			
15/07/2025	200,000	216,165	0.24
Studio City Finance Ltd 6.50%			
15/01/2028	500,000	550,301	0.60
Sunac China Holdings Ltd 6.50%			
09/07/2023	300,000	316,166	0.34
Sunac China Holdings Ltd 7.00%			
09/07/2025	200,000	203,915	0.22
Sunac China Holdings Ltd 7.50%			
01/02/2024	300,000	317,061	0.34
Talent Yield International Ltd 3.125%			
06/05/2031	700,000	732,098	0.80
Tencent Holdings Ltd 2.88%			
22/04/2031	250,000	259,867	0.28
Tencent Holdings Ltd 3.68%			
22/04/2041	900,000	964,569	1.05
Tencent Holdings Ltd 3.84%			
22/04/2051	700,000	760,046	0.83
Theta Capital Pte Ltd 8.125%			
22/01/2025	700,000	752,553	0.82
Three Gorges Finance I Cayman Islands Ltd 3.20% 16/10/2049	360,000	353,494	0.38
Times China Holdings Ltd 5.55%			
04/06/2024	400,000	402,829	0.44
Times China Holdings Ltd 6.60%			
02/03/2023	300,000	306,952	0.33
Times China Holdings Ltd 6.75%			
16/07/2023	200,000	211,779	0.23
TMBThanachart Bank PCL 4.90%			
Perpetual Callable - 02/12/2024	750,000	766,850	0.83

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲策略债券基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (103.26%) (续)			
债务证券 (88.80%) (续)			
以美元计价(86.50%) (续)			
TML Holdings Pte Ltd 4.35% 09/06/2026	200,000	201,818	0.22
TNB Global Ventures Capital Bhd 3.244% 19/10/2026	1,000,000	1,075,588	1.17
United Overseas Bank Ltd 2.00% 14/10/2031	600,000	603,383	0.66
Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 3.15% 12/05/2025	500,000	521,304	0.57
Vedanta Resources Finance II PLC 8.00% 23/04/2023	500,000	482,391	0.52
Vedanta Resources Finance II PLC 13.875% 21/01/2024	400,000	466,148	0.51
Vedanta Resources Ltd 6.375% 30/07/2022	700,000	711,487	0.77
Vedanta Resources Ltd 7.125% 31/05/2023	500,000	467,311	0.51
West China Cement Ltd 4.95% 08/07/2026	200,000	202,750	0.22
Wynn Macau Ltd 5.625% 26/08/2028	500,000	533,071	0.58
Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.50% 04/02/2023	200,000	196,158	0.21
Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.625% 23/01/2022	500,000	519,542	0.56
Zhenro Properties Group Ltd 5.98% 13/04/2022	200,000	202,925	0.22
Zhenro Properties Group Ltd 8.70% 03/08/2022	400,000	424,679	0.46
债务证券总额		81,679,347	88.80

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲策略债券基金 (续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (103.26%) (续)			
投资基金 (14.47%)			
香港 (14.47%)			
东亚联丰亚太区债券基金	1,280,639	13,305,841	14.47
投资基金总额		<u>13,305,841</u>	<u>14.47</u>

基础投资	对手方	未清偿合约的 名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
债务证券期指 (-0.01%)				
美国 (-0.01%)				
US 10Yr Note Future 21/09/2021	花旗银行, 香港	(16)	(8,333)	(0.01)
债务证券期指总额			<u>(8,333)</u>	<u>(0.01)</u>
投资总额			<u>94,976,855</u>	<u>103.26</u>

投资报告

于2021年6月30日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲策略债券基金 (续)

基础投资	对手方	未清偿合约的名义 金额	公允价值 美元	占资产净 值 百分比
外汇远期合约(-0.21%)				
买入 澳元/卖出 美元	花旗银行,香港	澳元 23,485,472	(162,120)	(0.18)
买入 澳元/卖出 美元	花旗银行,香港	澳元 13,841	(93)	(0.00)
买入 英镑/卖出 美元	花旗银行,香港	英镑 700,000	(24,774)	(0.03)
买入 英镑/卖出 美元	花旗银行,香港	英镑 700,000	(19,251)	(0.02)
买入 加拿大元/卖出 美元	花旗银行,香港	加元 1,200,000	(6,776)	(0.01)
买入 新西兰元/卖出 美元	花旗银行,香港	纽元 1,300,000	(9,504)	(0.01)
买入 挪威克朗/卖出 美元	花旗银行,香港	克朗 8,000,000	(9,149)	(0.01)
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 6,500,000	(10,354)	(0.01)
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 93,000,948	16,798	0.03
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 15,086	(1)	(0.00)
买入 美元/卖出 澳元	花旗银行,香港	美元 398,609	4,254	0.00
买入 美元/卖出 澳元	花旗银行,香港	美元 22,360	188	0.00
买入 美元/卖出 英镑	花旗银行,香港	美元 978,600	11,551	0.01

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲策略债券基金 (续)

基础投资	对手方	未清偿合约的名义金额	公允价值 美元	占资产净 值 百分比
外汇远期合约(-0.21%) (续)				
买入 美元/卖出 英镑	花旗银行,香港	美元 970,550	3,501	0.00
买入 美元/卖出 加拿大元	花旗银行,香港	美元 974,659	5,599	0.01
买入 美元/卖出 新西兰元	花旗银行,香港	美元 905,207	(3,141)	(0.00)
买入 美元/卖出 挪威克朗	花旗银行,香港	美元 941,287	11,511	0.01
外汇远期合约总额			<u>(191,761)</u>	<u>(0.21)</u>
其他净资产			<u>(2,803,281)</u>	<u>(3.05)</u>
净资产总额			<u>91,981,813</u>	<u>100.00</u>
投资总额, 按成本计算			<u>92,124,167</u>	

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合变动表

东亚联丰亚洲债券及货币基金

	占资产净值百分比	
	于 2021 年 6 月 30 日	于 2020 年 12 月 31 日
债务证券		
印度尼西亚盾	-	2.90
人民币	0.74	-
新加坡元	0.11	-
美元	98.05	94.62
债券期指		
美国	(0.01)	0.00
信贷违约掉期	-	0.26
外汇远期合约	(0.07)	0.24
	<u>98.82</u>	<u>98.02</u>

投资报告 于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合变动表 (续)

东亚联丰亚太区多元收益基金

	占资产净值百分比	
	于 2021 年 6 月 30 日	于 2020 年 12 月 31 日
股票		
澳大利亚	6.18	2.77
中国	0.61	-
香港	1.01	1.25
南韩	0.95	-
新加坡	-	1.56
台湾	3.48	5.24
泰国	1.24	-
美国	0.83	-
债务证券		
港元	-	0.62
印度尼西亚盾	-	1.55
人民币	1.17	0.58
美元	43.30	41.91
合订证券		
澳大利亚	1.70	1.68
投资基金		
香港	27.42	24.14
房地产投资信托基金		
澳大利亚	1.86	1.56
香港	1.55	1.86
新加坡	5.15	11.50
美国	2.34	1.73
债券期指		
美国	(0.00)	-
外汇远期合约	(0.18)	0.35
	<u>98.61</u>	<u>98.30</u>

投资报告

于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

投资组合变动表 (续)

东亚联丰中国高收益入息基金

	占资产净值百分比	
	于 2021 年 6 月 30 日	于 2020 年 12 月 31 日
债务证券		
印度尼西亚盾	-	2.06
美元	97.52	96.03
债务证券期指		
美国	(0.01)	0.00
外汇远期合约	(0.11)	0.26
	<u>97.40</u>	<u>98.35</u>

东亚联丰亚洲策略债券基金

	占资产净值百分比	
	于 2021 年 6 月 30 日	于 2020 年 12 月 31 日
债务证券		
印度尼西亚盾	-	2.58
人民币	2.30	1.03
美元	86.50	82.88
投资基金		
香港	14.47	12.25
债务证券期指		
美国	(0.01)	-
外汇远期合约	(0.21)	0.41
	<u>103.05</u>	<u>99.15</u>

持有抵押品 于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计)

东亚联丰亚洲债券及货币基金

抵押品提供者	抵押品性质	到期年期	面值货币	抵押品占资产 净值百分比	抵押品价值 美元
Citibank N.A., New York Branch	现金	N/A	美元	0.57	4,700,310
Barclays Bank PLC	现金	N/A	美元	0.09	770,000
BNP Paribas	现金	N/A	美元	0.05	390,000

于 2021 年 6 月 30 日, 子基金没有将现金抵押品再投资。.

东亚联丰亚太区多元收益基金

抵押品提供者	抵押品性质	到期年期	面值货币	抵押品占资产 净值百分比	抵押品价值 美元
Citibank N.A., New York Branch	现金	N/A	美元	0.89	2,170,136

于 2021 年 6 月 30 日, 子基金没有将现金抵押品再投资。.

持有抵押品 于 2021 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

东亚联丰中国高收益入息基金

抵押品提供者	抵押品性质	到期年期	面值货币	抵押品占资产 净值百分比	抵押品价值 美元
Citibank N.A., New York Branch	现金	N/A	美元	0.54	280,016

于 2021 年 6 月 30 日, 子基金没有将现金抵押品再投资。.

东亚联丰亚洲策略债券基金

抵押品提供者	抵押品性质	到期年期	面值货币	抵押品占资产 净值百分比	抵押品价值 美元
Citibank N.A., New York Branch	现金	N/A	美元	0.97	890,051

于 2021 年 6 月 30 日, 子基金没有将现金抵押品再投资。.

全面收益表

截至 2021 年 6 月 30 日止期间 (未经审计)

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金	
	2021 美元	2020 美元	2021 美元	2020 美元
收入				
股息收入	-	-	935,850	1,254,640
银行存款利息	1,308	20,307	347	10,219
其他收入	47,780	63,500	328,072	248,907
投资的净变现利润/(亏损)	27,581,067	(81,475,243)	3,686,464	(9,016,234)
投资的未变现(亏损)/利润的净变动	(18,638,439)	(28,836,333)	5,451,169	(14,511,396)
外汇((亏损)/利润)	<u>(164,595)</u>	<u>(188,698)</u>	<u>(1,120,189)</u>	<u>(2,591,954)</u>
投资收入总额	8,827,121	(110,416,467)	9,281,713	(24,605,818)
其他收入	<u>-</u>	<u>7,829,214</u>	<u>-</u>	<u>-</u>
	<u>8,827,121</u>	<u>(102,587,253)</u>	<u>9,281,713</u>	<u>(24,605,818)</u>
支出				
投资管理费	4,244,392	4,094,343	1,774,108	2,087,990
受托人费用	519,988	466,910	190,083	223,713
保管费及银行费用	40,124	39,942	13,706	17,208
审计师酬金	5,687	5,234	5,687	5,234
基金登记机构费用	76,030	69,702	32,645	36,046
印刷及出版费用	9,718	8,504	2,877	4,276
监管费	580	1,167	579	1,166
法律及专业服务费用	11,516	8,185	11,516	18,692
交易成本	15,281	28,363	251,654	236,119
利息费用	3,073	1,763	29	692
其他营运费用	<u>73,661</u>	<u>74,395</u>	<u>29,232</u>	<u>29,947</u>
	<u>5,000,050</u>	<u>4,798,508</u>	<u>2,312,116</u>	<u>2,661,083</u>
计算融资成本前的利润 / (亏损)	3,827,071	(107,385,761)	6,969,597	(27,266,901)
向基金份额持有人作出收益分配	<u>(19,709,986)</u>	<u>(13,191,336)</u>	<u>(7,674,496)</u>	<u>(9,478,161)</u>
税前 (亏损) / 利润	(15,882,915)	(120,577,097)	(704,899)	(36,745,062)
税项 (包括预扣税)	<u>(8,784)</u>	<u>(254,783)</u>	<u>(68,194)</u>	<u>(180,646)</u>
年内 (损失) / 利润及全面收益总额	<u>(15,891,699)</u>	<u>(120,831,880)</u>	<u>(773,093)</u>	<u>(36,925,708)</u>

全面收益表

截至 2021 年 6 月 30 日止期间 (未经审计)

	东亚联丰中国高收益入息基金		东亚联丰亚洲策略债券基金	
	2021 美元	2020 美元	2021 美元	2020 美元
收入				
股息收入	-	-	-	-
银行存款利息	81	272	176	3,490
其他收入	1,050	1,886	35,849	6,338
投资的净变现利润/(亏损)	1,862,134	1,131,772	2,169,734	3,486,930
投资的未变现(亏损)/利润的净变动	(2,438,406)	(1,949,968)	(3,093,866)	(1,878,300)
外汇((亏损)/利润)	<u>(5,398)</u>	<u>(1,340)</u>	<u>(17,856)</u>	<u>(69,333)</u>
投资收入总额	(580,539)	(817,378)	(905,963)	1,549,125
其他收入	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>
	<u><u>(580,539)</u></u>	<u><u>(817,378)</u></u>	<u><u>(905,963)</u></u>	<u><u>1,549,125</u></u>
支出				
投资管理费	321,848	326,213	538,845	689,374
受托人费用	40,231	40,777	67,356	86,172
保管费及银行费用	4,993	5,580	8,129	11,303
审计师酬金	5,687	5,234	5,687	5,234
基金登记机构费用	13,309	13,464	21,658	24,015
印刷及出版费用	630	752	1,112	1,881
监管费	579	581	-	-
法律及专业服务费用	47	-	47	-
交易成本	960	676	2,047	799
利息费用	27	6	102	268
其他营运费用	<u>4,054</u>	<u>3,173</u>	<u>10,405</u>	<u>11,118</u>
	<u><u>392,365</u></u>	<u><u>396,456</u></u>	<u><u>655,388</u></u>	<u><u>830,164</u></u>
计算融资成本前的利润 / (亏损)	(972,904)	(1,213,834)	(1,561,351)	718,961
向基金份额持有人作出收益分配	<u>(2,196,270)</u>	<u>(2,270,169)</u>	<u>(2,767,896)</u>	<u>(3,516,700)</u>
税前 (亏损) / 利润	(3,169,174)	(3,484,003)	(4,329,247)	(2,797,739)
税项 (包括预扣税)	<u>106</u>	<u>-</u>	<u>(1,379)</u>	<u>(35,470)</u>
年内 (损失) / 利润及全面收益总额	<u><u>(3,169,068)</u></u>	<u><u>(3,484,003)</u></u>	<u><u>(4,330,626)</u></u>	<u><u>(2,833,209)</u></u>

资产负债表 于 2021 年 6 月 30 日(未经审计)

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金	
	2021 年 6 月 30 日 美元	2020 年 12 月 31 日 美元	2021 年 6 月 30 日 美元	2020 年 12 月 31 日 美元
资产				
投资	819,162,594	830,395,674	240,817,021	269,399,582
应收外汇远期合同款项	-	2,052,717	-	940,708
应收股息	-	-	189,203	96,948
出售投资应收款项	11,597,910	875,665	4,811,185	1,661,126
认购基金份额的应收款项	341,595	2,338,304	809,458	506,928
其他应收款项	-	-	53,621	53,275
从经纪的应收款项	635,489	306,159	107,878	32,187
银行结余	29,299,857	18,477,727	3,513,880	11,741,415
资产总值	861,037,445	854,446,246	250,302,246	284,432,169
负债				
赎回基金份额的应付款项	1,428,042	1,929,269	706,519	1,195,979
应付外汇远期合同款项	618,410	-	437,788	-
应付购入投资款项	28,615,709	2,368,349	4,859,570	7,784,490
向经纪的应付款项	1,141,822	-	151,937	-
应计费用及其他应付款项	883,791	869,178	372,908	425,519
负债总值 (不包括基金份额持有人应占的资产净值)	32,687,774	5,166,796	6,528,722	9,405,988
基金份额持有人应占的资产净值				
金融负债	828,349,671	849,279,450	243,773,524	275,026,181
权益	-	-	-	-

资产负债表 于 2021 年 6 月 30 日(未经审计)

	东亚联丰中国高收益入息基金		东亚联丰亚洲策略债券基金	
	2021 年 6 月 30 日 美元	2020 年 12 月 31 日 美元	2021 年 6 月 30 日 美元	2020 年 12 月 31 日 美元
资产				
投资	50,198,295	54,416,080	94,976,855	126,694,516
应收外汇远期合同款项	-	149,424	-	537,598
应收股息	-	-	-	-
出售投资应收款项	149,809	26,439	7,983,962	1,264,772
认购基金份额的应收款项	90,229	218,393	2,335	224,961
其他应收款项	-	-	5,453	6,638
从经纪的应收款项	101,792	92,111	63,750	60,373
银行结余	2,580,112	750,329	2,165,937	1,727,559
资产总值	53,120,237	55,652,776	105,198,292	130,516,417
负债				
赎回基金份额的应付款项	16,459	68,301	931,050	265,767
应付外汇远期合同款项	56,877	-	191,761	-
应付购入投资款项	1,416,440	26,793	11,837,166	1,785,782
向经纪的应付款项	75,969	-	151,937	-
应计费用及其他应付款项	70,222	81,342	104,565	147,328
负债总值 (不包括基金份额持有人应占的资产净值)	1,635,967	176,436	13,216,479	2,198,877
基金份额持有人应占的资产净值				
金融负债	51,484,270	55,476,340	91,981,813	128,317,540
权益	-	-	-	-

资产负债表 于2021 年6 月30 日(未经审计) (续)

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金	
	2021 年6 月30 日	2020 年12 月31 日	2021 年6 月30 日	2020 年12 月31 日
<u>A 类别累积</u>				
份额发行数量	4,246,119.10	3,482,472.51	168,712.93	165,799.86
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	24.91	24.85	15.09	14.66
<u>A 类别累积对冲(欧元)</u>				
份额发行数量	3,512,988.76	2,808,804.66	5,000.00	5,000.00
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	12.09	12.50	12.56	12.65
<u>A 类别累积对冲(人民币)</u>				
份额发行数量	5,728,769.44	4,949,959.43	4,086.06	3,431.52
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	17.13	16.81	18.88	18.06
<u>A 类别分派</u>				
份额发行数量	8,396,327.46	9,595,008.07	5,927,350.28	6,738,741.01
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	12.44	12.81	9.85	9.84
<u>A 类别分派(港元)</u>				
份额发行数量	-	-	7,361,240.14	8,040,349.33
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	-	-	12.69	12.68
<u>A 类别分派对冲(澳元)</u>				
份额发行数量	1,200,358.01	1,130,949.32	4,982,353.00	6,093,295.42
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	6.63	7.02	5.85	6.01
<u>A 类别分派对冲(欧元)</u>				
份额发行数量	-	-	5,198.92	5,198.92
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	-	-	11.20	11.55
<u>A 类别分派对冲 (新西兰元)</u>				
份额发行数量	-	-	1,478,686.11	1,613,700.68
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	-	-	5.52	5.69
<u>A 类别分派对冲(人民币)</u>				
份额发行数量	8,487,955.26	6,946,417.72	3,869,267.64	4,370,275.33
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	14.76	15.12	13.39	13.32
<u>H 类别分派(港元)</u>				
份额发行数量	77,457,429.32	74,602,737.85	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	1.28	1.31	-	-
<u>I 类别累积</u>				
份额发行数量	4,779,639.36	4,682,492.42	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	11.01	10.96	-	-
<u>I 类别分派(港元)</u>				
份额发行数量	16,350,671.90	21,450,028.23	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	11.75	12.05	-	-

⁽²⁾ 根据基金说明书，每份额资产净值四舍五入至两个小数位。

资产负债表 于 2021 年 6 月 30 日(未经审计) (续)

	东亚联丰中国高收益入息基金		东亚联丰亚洲策略债券基金	
	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
<u>A 类别累积</u>				
份额发行数量	-	-	44,518.15	41,081.57
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	-	-	12.24	12.36
<u>A 类别累积对冲(欧元)</u>				
份额发行数量	-	-	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	-	-	-	-
<u>A 类别累积对冲(人民币)</u>				
份额发行数量	-	-	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	-	-	-	-
<u>A 类别分派</u>				
份额发行数量	1,589,258.40	1,793,047.90	3,008,786.87	5,003,090.09
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	9.02	9.56	9.68	10.01
<u>A 类别分派(港元)</u>				
份额发行数量	2,218,678.66	2,199,162.85	2,549,775.47	3,018,521.13
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	11.63	12.33	12.49	12.91
<u>A 类别分派对冲(澳元)</u>				
份额发行数量	2,218,678.66	2,199,162.85	2,549,775.47	3,018,521.13
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	11.63	12.33	12.49	12.91
<u>A 类别分派对冲(欧元)</u>				
份额发行数量	-	-	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	-	-	-	-
<u>A 类别分派对冲 (新西兰元)</u>				
份额发行数量	-	-	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	-	-	-	-
<u>A 类别分派对冲(人民币)</u>				
份额发行数量	581,616.14	458,129.79	942,680.90	1,200,553.64
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	13.71	14.47	14.75	15.18
<u>H 类别分派(港元)</u>				
份额发行数量	-	-	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	-	-	-	-
<u>I 类别累积</u>				
份额发行数量	-	-	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	-	-	-	-
<u>I 类别分派(港元)</u>				
份额发行数量	-	-	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	-	-	-	-

⁽²⁾ 根据基金说明书，每份额资产净值四舍五入至两个小数位。

权益变动表 / 基金份额持有人应占资产净额变动表
截至 2021 年 6 月 30 日止期间 (未经审计)

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金	
	2021 美元	2020 美元	2021 美元	2020 美元
于 1 月 1 日 / 成立日期的结余	849,279,450	936,195,961	275,026,181	348,898,386
与所有者的交易并直接计入权益/ 与基金份额持有人的交易				
年内 / 期内认购/申购基金份额	217,123,130	375,324,615	16,368,364	51,103,195
年内 / 期内赎回基金份额	(222,161,210)	(508,769,765)	(46,847,928)	(65,302,606)
与所有者 / 基金份额持有人的交易总额	(5,038,080)	(133,445,150)	(30,479,564)	(14,199,411)
年内 (损失) / 利润及全面收益总额	(15,891,699)	(120,831,880)	(773,093)	(36,925,708)
于 6 月 30 日的结余	828,349,671	681,918,931	243,773,524	297,773,267

	东亚联丰中国高收益入息基金		东亚联丰亚洲策略债券基金	
	2021 美元	2020 美元	2021 美元	2020 美元
于 1 月 1 日 / 成立日期的结余	55,476,340	59,442,011	128,317,540	159,326,421
与所有者的交易并直接计入权益/ 与基金份额持有人的交易				
年内 / 期内认购/申购基金份额	9,177,817	11,999,968	14,087,478	49,194,340
年内 / 期内赎回基金份额	(10,000,819)	(14,608,060)	(46,092,579)	(72,508,093)
与所有者 / 基金份额持有人的交易总额	(823,002)	(2,608,092)	(32,005,101)	(23,313,753)
年内 (损失) / 利润及全面收益总额	(3,169,068)	(3,484,003)	(4,330,626)	(2,833,209)
于 6 月 30 日的结余	51,484,270	53,349,916	91,981,813	133,179,459

权益变动表 / 基金份额持有人应占资产净额变动表

截至 2021 年 6 月 30 日止期间 (未经审计) (续)

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金	
	2021	2020	2021	2020
A 类别 累积 (美元)				
年初已发行份额数目	3,482,472.51	5,397,059.34	165,799.86	247,975.61
年内已发行份额	2,849,767.74	765,234.73	22,223.49	103,624.34
年内已赎回份额	(2,086,121.15)	(2,257,495.31)	(19,310.42)	(150,887.08)
年末已发行份额数目	<u>4,246,119.10</u>	<u>3,904,798.76</u>	<u>168,712.93</u>	<u>200,712.87</u>
A 类别 累积 对冲 (欧元)				
年初已发行份额数目	2,808,804.66	4,104,636.82	5,000.00	5,000.00
年内已发行份额	1,789,929.50	3,521,327.71	-	-
年内已赎回份额	(1,085,745.40)	(6,054,330.16)	-	-
年末已发行份额数目	<u>3,512,988.76</u>	<u>1,571,634.37</u>	<u>5,000.00</u>	<u>5,000.00</u>
A 类别 累积 对冲(人民币)				
年初已发行份额数目	4,949,959.43	14,757,492.04	3,431.52	122,419.06
年内已发行份额	1,833,640.14	6,621,222.19	1,111.33	1,636.39
年内已赎回份额	(1,054,830.13)	(13,452,206.02)	(456.79)	(1,286.08)
年末已发行份额数目	<u>5,728,769.44</u>	<u>7,926,508.21</u>	<u>4,086.06</u>	<u>122,769.37</u>
A 类别 分派 (美元)				
年初已发行份额数目	9,595,008.07	8,829,416.17	6,738,741.01	8,127,409.68
年内已发行份额	1,364,788.49	1,968,201.05	204,511.32	548,295.39
年内已赎回份额	(2,563,469.10)	(2,009,960.24)	(1,015,902.05)	(1,490,528.73)
年末已发行份额数目	<u>8,396,327.46</u>	<u>8,787,656.98</u>	<u>5,927,350.28</u>	<u>7,185,176.34</u>
A 类别 分派 (港币)				
年初已发行份额数目	-	-	8,040,349.33	10,126,098.28
年内已发行份额	-	-	482,988.29	2,317,548.22
年内已赎回份额	-	-	(1,162,097.48)	(2,383,999.02)
年末已发行份额数目	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>7,361,240.14</u>	<u>10,059,647.48</u>
A 类别 分派 对冲 (澳元)				
年初已发行份额数目	1,130,949.32	1,307,036.60	6,093,295.42	9,565,708.94
年内已发行份额	408,094.24	585,064.55	380,490.92	558,862.80
年内已赎回份额	(338,685.55)	(776,346.22)	(1,491,433.34)	(1,761,556.08)
年末已发行份额数目	<u>1,200,358.01</u>	<u>1,115,754.93</u>	<u>4,982,353.00</u>	<u>8,363,015.66</u>

权益变动表 / 基金份额持有人应占资产净额变动表
截至 2021 年 6 月 30 日止期间 (未经审计) (续)

	东亚联丰中国高收益入息基金		东亚联丰亚洲策略债券基金	
	2021	2020	2021	2020
A 类别 累积 (美元)				
年初已发行份额数目	-	-	41,081.57	30,909.88
年内已发行份额	-	-	3,436.58	2,524.88
年内已赎回份额	-	-	-	-
年末已发行份额数目	-	-	44,518.15	33,434.76
A 类别 累积 对冲 (欧罗)				
年初已发行份额数目	-	-	-	-
年内已发行份额	-	-	-	-
年内已赎回份额	-	-	-	-
年末已发行份额数目	-	-	-	-
A 类别 累积 对冲(人民币)				
年初已发行份额数目	-	-	-	-
年内已发行份额	-	-	-	-
年内已赎回份额	-	-	-	-
年末已发行份额数目	-	-	-	-
A 类别 分派 (美元)				
年初已发行份额数目	1,793,047.90	1,712,694.66	5,003,090.09	3,144,445.62
年内已发行份额	338,982.62	585,306.48	302,356.22	2,637,074.14
年内已赎回份额	(542,772.12)	(497,714.99)	(2,296,659.44)	(902,919.74)
年末已发行份额数目	1,589,258.40	1,800,286.15	3,008,786.87	4,878,600.02
A 类别 分派 (港币)				
年初已发行份额数目	2,199,162.85	2,685,653.81	3,018,521.13	5,978,179.08
年内已发行份额	301,919.74	333,472.69	476,124.90	1,437,312.76
年内已赎回份额	(282,403.93)	(832,105.74)	(944,870.56)	(3,457,813.55)
年末已发行份额数目	2,218,678.66	2,187,020.76	2,549,775.47	3,957,678.29
A 类别 分派 对冲 (澳元)				
年初已发行份额数目	667,563.62	372,481.85	2,826,210.53	3,532,296.58
年内已发行份额	123,320.95	373,731.15	517,336.55	817,975.40
年内已赎回份额	(256,143.49)	(63,864.23)	(913,212.13)	(1,365,692.47)
年末已发行份额数目	534,741.08	682,348.77	2,430,334.95	2,984,579.51

权益变动表 / 基金份额持有人应占资产净额变动表

截至 2021 年 6 月 30 日止期间 (未经审计) (续)

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金	
	2021	2020	2021	2020
A 类别分派 对冲 (欧罗)				
年初已发行份额数目	-	-	5,198.92	12,418.39
年内已发行份额	-	-	-	-
年内已赎回份额	-	-	-	(7,219.47)
	-	-	-	-
年末已发行份额数目	-	-	5,198.92	5,198.92
A 类别 分派 对冲 (新西兰元)				
年初已发行份额数目	-	-	1,613,700.68	2,207,344.32
年内已发行份额	-	-	117,318.00	105,622.65
年内已赎回份额	-	-	(252,332.57)	(360,458.88)
	-	-	-	-
年末已发行份额数目	-	-	1,478,686.11	1,952,508.09
A 类别 分派 对冲 (人民币)				
年初已发行份额数目	6,946,417.72	7,506,051.11	4,370,275.33	4,629,872.66
年内已发行份额	2,864,386.52	1,410,757.08	369,232.46	1,181,868.45
年内已赎回份额	(1,322,848.98)	(2,200,029.57)	(870,240.15)	(791,932.12)
	-	-	-	-
年末已发行份额数目	8,487,955.26	6,716,778.62	3,869,267.64	5,019,808.99
H 类别 分派 (港币)				
年初已发行份额数目	74,602,737.85	85,813,348.84	-	-
年内已发行份额	15,315,457.27	12,969,611.36	-	-
年内已赎回份额	(12,460,765.80)	(23,757,784.21)	-	-
	-	-	-	-
年末已发行份额数目	77,457,429.32	75,025,175.99	-	-
I 类别累积				
年初已发行份额数目	4,682,492.42	7,563,520.08	-	-
年内已发行份额	889,099.85	6,100,360.46	-	-
年内已赎回份额	(791,952.91)	(11,111,308.06)	-	-
	-	-	-	-
年末已发行份额数目	4,779,639.36	2,552,572.48	-	-
I 类别分派 (港币)				
年初已发行份额数目	21,450,028.23	5,868,816.66	-	-
年内已发行份额	-	7,548,707.43	-	-
年内已赎回份额	(5,099,356.33)	(1,596,328.44)	-	-
	-	-	-	-
年末已发行份额数目	16,350,671.90	11,821,195.65	-	-

权益变动表 / 基金份额持有人应占资产净额变动表
截至 2021 年 6 月 30 日止期间 (未经审计) (续)

	东亚联丰中国高收益入息基金		东亚联丰亚洲策略债券基金	
	2021	2020	2021	2020
A 类别分派 对冲 (欧罗)				
年初已发行份额数目	-	-	-	-
年内已发行份额	-	-	-	-
年内已赎回份额	-	-	-	-
	-	-	-	-
年末已发行份额数目	-	-	-	-
A 类别 分派 对冲 (新西兰元)				
年初已发行份额数目	-	-	-	-
年内已发行份额	-	-	-	-
年内已赎回份额	-	-	-	-
	-	-	-	-
年末已发行份额数目	-	-	-	-
A 类别 分派 对冲 (人民币)				
年初已发行份额数目	458,129.79	458,651.25	1,200,553.64	1,908,476.24
年内已发行份额	160,581.83	30,008.70	87,899.61	65,060.54
年内已赎回份额	(37,095.48)	(28,828.05)	(345,772.35)	(793,191.84)
	-	-	-	-
年末已发行份额数目	581,616.14	459,831.90	942,680.90	1,180,344.94
H 类别 分派 (港币)				
年初已发行份额数目	-	-	-	-
年内已发行份额	-	-	-	-
年内已赎回份额	-	-	-	-
	-	-	-	-
年末已发行份额数目	-	-	-	-
I 类别累积				
年初已发行份额数目	-	-	-	-
年内已发行份额	-	-	-	-
年内已赎回份额	-	-	-	-
	-	-	-	-
年末已发行份额数目	-	-	-	-
I 类别分派 (港币)				
年初已发行份额数目	-	-	-	-
年内已发行份额	-	-	-	-
年内已赎回份额	-	-	-	-
	-	-	-	-
年末已发行份额数目	-	-	-	-

管理及行政

受托人兼基金登记机构

东亚银行 (信托) 有限公司
香港九龙观塘道 418 号
创纪之城五期
东亚银行中心 32 楼

基金管理人

东亚联丰投资管理有限公司
香港德辅道中 10 号
东亚银行大厦 5 楼

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

法律顾问

的近律师行
香港中环遮打道 18 号
历山大厦 5 楼