

中期报告（未经审计）

截至 2017 年 6 月 30 日止的期间

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

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 - 13
表现报告	14
全面收益表	15
资产负债表	16-17
权益变动表/基金份额持有人应占资产净值变动表	18
管理及行政	19

投资报告

于 2017 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 (96.39%)			
债务证券 (96.39%)			
以印度卢比计价 (1.09%)			
NTPC Ltd 7.25% 03/05/2022	160,000,000	2,536,849	0.78
NTPC Ltd 7.375% 10/08/2021	60,000,000	1,001,844	0.31
以印度尼西亚盾计价(2.03%)			
Indonesia Treasury Bond 7.00% 15/05/2027	43,098,000,000	3,301,664	1.02
Indonesia Treasury Bond 7.50% 15/08/2032	42,000,000,000	3,278,167	1.01
以马来西亚令吉计价 (1.02%)			
Malaysia Government Bond 3.58% 28/09/2018	14,000,000	3,302,483	1.02
以人民币计价 (0.47%)			
New World China Land Ltd 5.50% 06/02/2018	10,000,000	1,510,933	0.47
以美元计价 (91.78%)			
ABJA Investment Co Pte Ltd 5.95% 31/07/2024	3,200,000	3,453,878	1.07
Agile Group Holdings Ltd 8.25% Perpetual Callable-18/07/2018	2,000,000	2,096,788	0.65
Agile Group Holdings Ltd 9.00% 21/05/2020	1,000,000	1,084,900	0.34
Alam Synergy Pte LTD 6.625% 24/04/2022	2,600,000	2,614,898	0.81
Alam Synergy Pte LTD 6.95% 27/03/2020	2,500,000	2,582,818	0.80
APL Realty Holdings Pte Ltd 5.95% 02/06/2024	3,150,000	3,060,613	0.95
Baoxin Auto Finance I Ltd 8.75% Perpetual Callable-15/12/2019	8,500,000	8,933,066	2.76
Bukit Makmur Mandiri Utama PT 7.75% 13/02/2022	1,500,000	1,579,377	0.49
Central Plaza Development Ltd 8.375% Perpetual Callable-08/04/2018	1,000,000	1,044,689	0.32
Chalco Hong Kong Investment Co Ltd 4.25% Perpetual Callable-07/11/2021	1,500,000	1,526,939	0.47
Chalico Hong Kong Corp Ltd 5.70% Perpetual Callable-15/01/2020	700,000	745,290	0.23
China Aoyuan Property Group Ltd 10.875% 26/05/2018	1,700,000	1,795,426	0.56
China Aoyuan Property Group Ltd 6.35% 11/01/2020	1,600,000	1,649,754	0.51
China Aoyuan Property Group Ltd 6.525% 25/04/2019	3,500,000	3,581,244	1.11
China Evergrande Group 7.00% 23/03/2020	3,900,000	4,011,016	1.24
China Evergrande Group 7.50% 28/06/2023	6,300,000	6,098,998	1.89
China Evergrande Group 8.25% 23/03/2022	5,000,000	5,216,142	1.61
China Evergrande Group 8.75% 28/06/2025	3,000,000	2,924,127	0.90
China SCE Property Holdings Ltd 10.00% 02/07/2020	4,000,000	4,538,729	1.40
China SCE Property Holdings Ltd 5.875% 10/03/2022	2,500,000	2,436,911	0.75
China Aoyuan Property Group Ltd 6.35% 11/01/2020	1,600,000	1,649,754	0.51
China Aoyuan Property Group Ltd 6.525% 25/04/2019	3,500,000	3,581,244	1.11
China Evergrande Group 7.00% 23/03/2020	3,900,000	4,011,016	1.24
China Evergrande Group 7.50% 28/06/2023	6,300,000	6,098,998	1.89
China Evergrande Group 8.25% 23/03/2022	5,000,000	5,216,142	1.61
China Evergrande Group 8.75% 28/06/2025	3,000,000	2,924,127	0.90
China SCE Property Holdings Ltd 10.00% 02/07/2020	4,000,000	4,538,729	1.40

截至 2017 年 6 月 30 日止期间

投资报告

于 2017 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 (96.39%) (续)			
债务证券 (96.39%) (续)			
以美元计价 (91.78%) (续)			
China SCE Property Holdings Ltd 5.875% 10/03/2022	2,500,000	2,436,911	0.75
China South City Holdings Ltd 6.75% 13/09/2021	2,000,000	1,993,080	0.62
Chinalco Capital Holdings Ltd 4.25% 21/04/2022	2,500,000	2,532,035	0.78
CIFI Holdings Group Co Ltd 7.75% 05/06/2020 Callable-05/06/2018	3,000,000	3,184,552	0.99
Country Garden Holdings Co Ltd 7.875% 27/05/2019 Callable-27/05/2017	3,000,000	3,137,842	0.97
Dianjian Haiyu Ltd 3.50% Perpetual Callable- 14/06/2022	1,000,000	998,373	0.31
Dr Peng Holding HongKong Ltd 5.05% 01/06/2020	1,000,000	1,003,368	0.31
Fantasia Holdings Group Co Ltd 11.50% 01/06/2018	2,600,000	2,742,151	0.85
Fantasia Holdings Group Co Ltd 5.50% 12/06/2018	2,900,000	2,889,444	0.89
Future Land Development Holdings Ltd 5.00% 16/02/2020	2,000,000	2,012,240	0.62
Future Land Development Holdings Ltd 6.25% 12/11/2017	3,250,000	3,294,028	1.02
Golden Eagle Retail Group Ltd 4.625% 21/05/2023	6,800,000	6,304,680	1.95
Golden Legacy Pte Ltd 8.25% 07/06/2021	3,400,000	3,638,408	1.13
GOME Electrical Appliances Holding Ltd 5.00% 10/03/2020	3,500,000	3,564,003	1.10
Greenland Global Investment Ltd 4.00% 20/06/2018	2,800,000	2,802,156	0.87
Guorui Properties Ltd 7.00% 21/03/2020	3,100,000	3,124,070	0.97
Honghua Group Ltd 7.45% 25/09/2019	3,250,000	3,408,459	1.05
HPCL-Mittal Energy Ltd 5.25% 28/04/2027	1,600,000	1,659,468	0.51
HT Global IT Solutions Holdings Ltd 7.00% 14/07/2021 Callable-14/07/2018	1,000,000	1,082,192	0.33
Indika Energy Capital II Pte Ltd 6.875% 10/04/2022	5,500,000	5,452,253	1.69
Indo Energy Finance II BV 6.375% 24/01/2023	5,000,000	4,797,560	1.48
Jababeka International BV 6.50% 05/10/2023 Callable-05/10/2020	5,000,000	5,242,139	1.62
Japfa Comfeed Indonesia Tbk PT 5.50% 31/03/2022	3,300,000	3,326,871	1.03
JSW Steel Ltd 4.75% 12/11/2019	3,250,000	3,317,390	1.03
JSW Steel Ltd 5.25% 13/04/2022	2,000,000	2,044,422	0.63
Kaisa Group Holdings Ltd 7.25% 30/06/2020	6,772,000	6,796,863	2.10
Kaisa Group Holdings Ltd 7.56% 30/06/2020	889	887	-
Kaisa Group Holdings Ltd 7.56% 31/12/2020	564	562	-
Kaisa Group Holdings Ltd 7.56% 31/12/2021	733	732	-
Kaisa Group Holdings Ltd 7.875% 30/06/2021	1,500,000	1,504,603	0.47
Kaisa Group Holdings Ltd 8.50% 30/06/2022	4,349,000	4,361,334	1.35
Kaisa Group Holdings Ltd 9.375% 30/06/2024	3,843,000	3,869,941	1.20
KWG Property Holding Ltd 8.25% 05/08/2019	2,200,000	2,360,508	0.73

投资报告

于 2017 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 (96.39%) (续)			
债务证券 (96.39%) (续)			
以美元计价 (91.78%) (续)			
KWG Property Holding Ltd 8.975% 14/01/2019	2,500,000	2,701,260	0.84
Lai Sun International Finance 2012 Ltd 5.70% 18/01/2018	1,200,000	1,243,006	0.38
Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia 3.875% 06/04/2024	2,900,000	2,965,422	0.92
Logan Property Holdings Co Ltd 5.25% 23/02/2023	2,000,000	1,878,903	0.58
Logan Property Holdings Co Ltd 9.75% 08/12/2017	2,400,000	2,461,870	0.76
Marble II Pte Ltd 5.30% 20/06/2022	2,000,000	2,008,719	0.62
Marquee Land Pte Ltd 9.75% 05/08/2019 Callable- 05/08/2017	881,000	961,472	0.30
Melco Resorts Finance Ltd 4.875% 06/06/2025	3,100,000	3,119,268	0.97
Modernland Overseas Pte Ltd 6.95% 13/04/2024	3,100,000	3,119,556	0.97
Moon Wise Global Ltd 9.00% Perpetual Callable- 28/01/2019	2,000,000	2,195,700	0.68
Myriad International Holdings BV 4.85% 06/07/2027	750,000	750,000	0.23
New Rose Investments Ltd 4.50% 19/01/2020	2,100,000	2,161,215	0.67
Pacific Emerald Pte Ltd 9.75% 25/07/2018 Callable- 13/02/2017	3,550,000	3,793,920	1.17
Pakuwon Prima Pte Ltd 5.00% 14/02/2024	2,900,000	2,927,602	0.91
Parkson Retail Group Ltd 4.50% 03/05/2018	7,100,000	7,081,043	2.19
PB International BV 7.625% 26/01/2022	4,500,000	4,824,449	1.49
Pelabuhan Indonesia II PT 4.25% 05/05/2025	1,000,000	1,022,381	0.32
Pelabuhan Indonesia III Persero PT 4.875% 01/10/2024	2,500,000	2,695,769	0.83
Pertamina Persero PT 6.45% 30/05/2044	1,500,000	1,712,691	0.53
Perusahaan Gas Negara Persero Tbk 5.125% 16/05/2024	2,700,000	2,919,716	0.90
Perusahaan Listrik Negara PT 4.125% 15/05/2027	1,500,000	1,481,401	0.46
Perusahaan Listrik Negara PT 5.25% 24/10/2042	2,000,000	2,023,302	0.63
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 4.875% 15/09/2021 Callable-15/09/2019	3,100,000	2,976,757	0.92
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 7.625% 26/11/2018	2,700,000	2,802,042	0.87
Pratama Agung Pte Ltd 6.25% 24/02/2020 Callable- 24/02/2018	1,000,000	1,063,349	0.33
Prime Bloom Holdings Ltd 7.50% 19/12/2019	3,000,000	3,036,090	0.94
RKI Overseas Finance 2016 A Ltd 5.00% 09/08/2019	3,000,000	3,057,337	0.95
RKI Overseas Finance 2017 A Ltd 7.00% Perpetual Callable-23/06/2022	2,800,000	2,748,524	0.85
Rural Electrification Corp Ltd 3.875% 07/07/2027	2,000,000	1,985,260	0.61
Saka Energi Indonesia PT 4.45% 05/05/2024	2,000,000	2,024,004	0.63
Shimao Property Holdings Ltd 4.75% 03/07/2022	3,500,000	3,492,685	1.08

投资报告

于 2017 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 (96.39%) (续)			
债务证券 (96.39%) (续)			
以美元计价 (91.78%) (续)			
Shui On Development Holding Ltd 6.40% Perpetual Callable-20/06/2022	1,000,000	1,001,696	0.31
Sinochem Offshore Capital Co Ltd 3.124% 24/05/2022	1,000,000	1,001,771	0.31
Sri Lanka Government International Bond 5.75% 18/01/2022	500,000	529,542	0.16
Sri Lanka Government International Bond 6.20% 11/05/2027	500,000	503,851	0.16
STATS ChipPAC Pte Ltd 8.50% 24/11/2020	4,000,000	4,288,144	1.33
Studio City Co Ltd 5.875% 30/11/2019	2,500,000	2,657,998	0.82
Studio City Finance Ltd 8.50% 01/12/2020 Callable- 13/02/2017	1,300,000	1,361,117	0.42
Sunac China Holdings Ltd 8.75% 05/12/2019	1,000,000	1,057,969	0.33
Theta Capital Pte Ltd 6.75% 31/10/2026 Callable- 31/10/2021	2,500,000	2,514,944	0.78
Theta Capital Pte Ltd 7.00% 11/04/2022 Callable- 11/04/2018	4,000,000	4,226,902	1.31
Times Property Holdings Ltd 6.25% 23/01/2020	1,200,000	1,238,617	0.38
Vedanta Resources PLC 6.00% 31/01/2019	3,450,000	3,591,646	1.11
Vedanta Resources PLC 6.375% 30/07/2022	2,900,000	2,974,210	0.92
Vedanta Resources PLC 7.125% 31/05/2023	3,100,000	3,204,661	0.99
Vedanta Resources PLC 8.25% 07/06/2021	7,400,000	8,095,304	2.50
West China Cement Ltd 6.50% 11/09/2019	3,800,000	3,995,058	1.24
Xinhu BVI Holding Co Ltd 6.00% 01/03/2020	4,350,000	4,412,031	1.37
Yancoal International Resources Development Co Ltd 5.75% Perpetual Callable-13/04/2020	3,500,000	3,591,309	1.11
Yanlord Land HK Co Ltd 5.875% 23/01/2022	1,500,000	1,586,527	0.49
Yuzhou Properties Co Ltd 6.00% 25/01/2022	1,500,000	1,533,510	0.47
Yuzhou Properties Co Ltd 6.00% 25/10/2023	1,500,000	1,494,705	0.46
Yuzhou Properties Co Ltd 9.00% 08/12/2019 Callable-08/12/2017	5,000,000	5,311,200	1.64
Zoomlion HK SPV Co Ltd 6.125% 20/12/2022	3,800,000	3,828,050	1.18
债务证券总额		<u>311,589,632</u>	<u>96.39</u>
投资总额		<u>311,589,632</u>	<u>96.39</u>
投资总额, 按成本计算		<u>303,045,673</u>	

投资报告

于 2017 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(95.02%)			
股票(23.08%)			
澳大利亚 (3.40%)			
Commonwealth Bank of Australia	76,354	4,849,375	0.99
Ramsay Health Care Ltd	86,015	4,849,369	0.99
Star Entertainment Grp Ltd	1,794,958	6,939,186	1.42
中国 (2.17%)			
Industrial & Commercial Bank of China Ltd	15,729,000	10,598,212	2.17
香港 (4.12%)			
BOC Hong Kong Holdings Ltd	2,741,500	13,116,700	2.68
Shimao Property Holdings Ltd	4,099,000	7,015,039	1.44
印度尼西亚 (0.52%)			
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	5,127,600	2,528,548	0.52
马来西亚 (1.30%)			
Sime Darby Bhd	2,862,100	6,334,062	1.30
新加坡 (0.60%)			
DBS Group Holdings Ltd	194,600	2,929,920	0.60
台湾 (10.97%)			
Cathay Financial Holding Co Ltd	5,871,000	9,649,869	1.97
Chunghwa Telecom Co Ltd	4,945,000	17,556,154	3.59
CTBC Financial Holding Co Ltd	7,354,000	4,810,786	0.98
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2,282,000	15,603,367	3.19
Vanguard International Semiconductor Corp	3,093,000	6,080,236	1.24
股票总额		112,860,823	23.08

投资报告

于 2017 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(95.02%) (续)			
债务证券 (55.91%)			
以港元计价(0.34%)			
National Australia Bank Ltd 3.73% 17/05/2026 Callable-17/05/2021	13,000,000	1,684,602	0.34
以印度卢比计价 (0.65%)			
NTPC Ltd 7.25% 03/05/2022	180,000,000	2,853,955	0.58
NTPC Ltd 7.375% 10/08/2021	20,000,000	333,948	0.07
以印度尼西亚盾计价 (1.48%)			
Indonesia Treasury Bond 7.00% 15/05/2027	64,000,000,000	4,902,930	1.00
Indonesia Treasury Bond 7.50% 15/08/2032	30,000,000,000	2,341,548	0.48
以马来西亚令吉计价 (1.01%)			
Malaysia Government Bond 3.58% 28/09/2018	21,000,000	4,953,725	1.01
以人民币计价(0.80%)			
New World China Land Ltd 5.50% 06/02/2018	13,000,000	1,964,213	0.40
Ocean Wealth II Ltd 5.50% 08/06/2019	13,000,000	1,948,829	0.40
以新加坡元计价(0.15%)			
Hotel Properties Ltd 4.65% Perpetual Callable- 05/05/2022	1,000,000	744,280	0.15
以美元计价 (51.48%)			
ABJA Investment Co Pte Ltd 5.95% 31/07/2024	3,000,000	3,238,011	0.66
Agile Group Holdings Ltd 8.25% Perpetual Callable- 18/07/2018	1,500,000	1,572,591	0.32
Agile Group Holdings Ltd 9.00% 21/05/2020	2,000,000	2,169,800	0.44
Alam Synergy Pte LTD 6.625% 24/04/2022	3,000,000	3,017,190	0.62
Alam Synergy Pte LTD 6.95% 27/03/2020	2,050,000	2,117,911	0.43
APL Realty Holdings Pte Ltd 5.95% 02/06/2024	3,150,000	3,060,613	0.63
AusNet Services Holdings Pte Ltd 5.75% 17/03/2076 Callable-01/03/2021	600,000	656,755	0.13
Baidu Inc 3.625% 06/07/2027	1,000,000	985,770	0.20
Baoxin Auto Finance I Ltd 8.75% Perpetual Callable- 15/12/2019	4,000,000	4,203,796	0.86
Bukit Makmur Mandiri Utama PT 7.75% 13/02/2022	1,000,000	1,052,918	0.22
Central Plaza Development Ltd 7.125% Perpetual Callable-12/02/2019	2,000,000	2,118,959	0.43
Chalco Hong Kong Investment Co Ltd 4.25% Perpetual Callable-07/11/2021	1,500,000	1,526,939	0.31
Chalieco Hong Kong Corp Ltd 5.7% Perpetual Callable-15/01/2020	700,000	745,290	0.15
China Aoyuan Property Group Ltd 10.875% 26/05/2018	1,500,000	1,584,199	0.32
China Aoyuan Property Group Ltd 6.35% 11/01/2020	2,000,000	2,062,192	0.42
China Aoyuan Property Group Ltd 6.525% 25/04/2019	1,700,000	1,739,461	0.36

截至 2017 年 6 月 30 日止期间

投资报告

于 2017 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(95.02%) (续)			
债务证券 (55.91%) (续)			
以美元计价 (51.48%) (续)			
China Evergrande Group 8.25% 23/03/2022	2,000,000	2,086,457	0.43
China Evergrande Group 8.75% 28/06/2025	3,000,000	2,924,128	0.60
China SCE Property Holdings Ltd 10.00% 02/07/2020	3,000,000	3,404,047	0.70
China SCE Property Holdings Ltd 5.875% 10/03/2022	500,000	487,382	0.10
China South City Holdings Ltd 6.75% 13/09/2021	2,000,000	1,993,080	0.41
Chinalco Capital Holdings Ltd 4.25% 21/04/2022	3,000,000	3,038,442	0.62
CIFI Holdings Group Co Ltd 7.75% 05/06/2020 Callable-05/06/2018	3,000,000	3,184,552	0.65
CNRC Capitale Ltd 3.90% Perpetual Callable- 02/06/2022	700,000	706,357	0.14
Country Garden Holdings Co Ltd 7.50% 09/03/2020 Callable-09/03/2020	1,700,000	1,822,867	0.37
Country Garden Holdings Co Ltd 7.875% 27/05/2019 Callable-27/05/2017	5,000,000	5,229,738	1.07
CSCEC Finance Cayman II Ltd 3.50% 05/07/2027	2,000,000	1,965,160	0.40
Dah Sing Bank Ltd 4.25% 30/11/2026 Callable 30/11/2026	1,000,000	1,024,390	0.21
Dianjian Haiyu Ltd 3.50% Perpetual Callable- 14/06/2022	1,000,000	998,373	0.20
Dr Peng Holding HongKong Ltd 5.05% 01/06/2020	1,000,000	1,003,368	0.21
Fantasia Holdings Group Co Ltd 11.50% 01/06/2018	1,600,000	1,687,477	0.35
Fantasia Holdings Group Co Ltd 5.50% 12/06/2018	2,900,000	2,889,444	0.59
Far East Horizon Ltd 4.35% Perpetual Callable- 14/06/2022	500,000	503,762	0.10
Future Land Development Holdings Ltd 5.00% 16/02/2020	2,000,000	2,012,240	0.41
Future Land Development Holdings Ltd 6.25% 12/11/2017	2,000,000	2,027,094	0.41
Golden Eagle Retail Group Ltd 4.625% 21/05/2023	1,000,000	927,159	0.19
Golden Legacy Pte Ltd 8.25% 07/06/2021	2,500,000	2,675,300	0.55
GOME Electrical Appliances Holding Ltd 5.00% 10/03/2020	5,300,000	5,396,919	1.10
Greenland Global Investment Ltd 4.00% 20/06/2018	3,000,000	3,002,310	0.61
HeSteel Hong Kong Co Ltd 4.25% 07/04/2020	2,200,000	2,194,889	0.45
Honghua Group Ltd 7.45% 25/09/2019	1,500,000	1,573,135	0.32
HPCL-Mittal Energy Ltd 5.25% 28/04/2027	2,000,000	2,074,335	0.42
Indika Energy Capital II Pte Ltd 6.875% 10/04/2022	3,700,000	3,667,879	0.75
Indo Energy Finance II BV 6.375% 24/01/2023	2,350,000	2,254,853	0.46
Industrial & Commercial Bank of China Ltd 2.308% 19/01/2019	1,900,000	1,919,154	0.39
Jababeka International BV 6.50% 05/10/2023 Callable-05/10/2020	3,150,000	3,302,548	0.68

截至 2017 年 6 月 30 日止期间

投资报告

于 2017 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(95.02%) (续)			
债务证券 (55.91%) (续)			
以美元计价 (51.48%) (续)			
Japfa Comfeed Indonesia Tbk PT 5.50% 31/03/2022	1,700,000	1,713,843	0.35
JSW Steel Ltd 4.75% 12/11/2019	3,500,000	3,572,573	0.73
JSW Steel Ltd 5.25% 13/04/2022	2,000,000	2,044,422	0.42
Kaisa Group Holdings Ltd 7.25% 30/06/2020	4,700,000	4,717,256	0.97
Kaisa Group Holdings Ltd 7.875% 30/06/2021	1,000,000	1,003,069	0.21
Kaisa Group Holdings Ltd 8.50% 30/06/2022	2,500,000	2,507,090	0.51
Kaisa Group Holdings Ltd 9.375% 30/06/2024	1,500,000	1,510,516	0.31
KWG Property Holding Ltd 8.25% 05/08/2019	1,000,000	1,072,958	0.22
KWG Property Holding Ltd 8.975% 14/01/2019	2,500,000	2,701,260	0.55
Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia 3.875% 06/04/2024	3,900,000	3,987,981	0.82
Logan Property Holdings Co Ltd 5.25% 23/02/2023	2,000,000	1,878,903	0.38
Logan Property Holdings Co Ltd 9.75% 08/12/2017	1,400,000	1,436,091	0.29
Marble II Pte Ltd 5.30% 20/06/2022	4,000,000	4,017,438	0.82
Marquee Land Pte Ltd 9.75% 05/08/2019 Callable- 05/08/2017	469,000	511,839	0.10
Melco Resorts Finance Ltd 4.875% 06/06/2025	3,100,000	3,119,268	0.64
Modernland Overseas Pte Ltd 6.95% 13/04/2024	3,100,000	3,119,556	0.64
Moon Wise Global Ltd 9.00% Perpetual Callable- 28/01/2019	2,000,000	2,195,700	0.45
Myriad International Holdings BV 4.85% 06/07/2027	750,000	750,000	0.15
New World China Land Ltd 5.375% 06/11/2019	1,000,000	1,059,232	0.22
OVPH Ltd 5.875% Perpetual Callable-01/03/2021	2,500,000	2,643,108	0.54
Pacific Emerald Pte Ltd 9.75% 25/07/2018 Callable- 13/02/2017	2,100,000	2,244,291	0.46
Pakuwon Prima Pte Ltd 5.00% 14/02/2024	1,100,000	1,110,470	0.23
Parkson Retail Group Ltd 4.50% 03/05/2018	4,000,000	3,989,320	0.82
PB International BV 7.625% 26/01/2022	1,300,000	1,393,730	0.29
Pelabuhan Indonesia III Persero PT 4.875% 01/10/2024	2,000,000	2,156,615	0.44
Perusahaan Gas Negara Persero Tbk 5.125% 16/05/2024	4,000,000	4,324,651	0.88
Perusahaan Listrik Negara PT 5.25% 24/10/2042	1,500,000	1,517,476	0.31
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 4.875% 15/09/2021 Callable-15/09/2019	2,100,000	2,016,513	0.41
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 7.625% 26/11/2018	2,500,000	2,594,483	0.53
Pratama Agung Pte Ltd 6.25% 24/02/2020 Callable- 24/02/2018	2,000,000	2,126,697	0.44

截至 2017 年 6 月 30 日止期间

投资报告

于 2017 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(95.02%) (续)			
债务证券 (55.91%) (续)			
以美元计价 (51.48%) (续)			
Prime Bloom Holdings Ltd 7.50% 19/12/2019	1,500,000	1,518,045	0.31
Proven Glory Capital Ltd 4.00% 21/02/2027	1,500,000	1,524,232	0.31
Proven Honour Capital Ltd 4.125% 06/05/2026	1,000,000	1,023,342	0.21
QBE Insurance Group Ltd 6.75% 02/12/2044 Callable-02/12/2024	2,000,000	2,232,215	0.46
RKI Overseas Finance 2016 A Ltd 5.00% 09/08/2019	1,400,000	1,426,757	0.29
RKI Overseas Finance 2017 A Ltd 7.00% Perpetual Callable-23/06/2022	2,800,000	2,748,524	0.56
Rural Electrification Corp Ltd 3.875% 07/07/2027	1,000,000	992,630	0.20
Saka Energi Indonesia PT 4.45% 05/05/2024	3,000,000	3,036,007	0.62
Shimao Property Holdings Ltd 4.75% 03/07/2022	4,000,000	3,991,640	0.82
Shimao Property Holdings Ltd 8.375% 10/02/2022 Callable-10/02/2019	2,300,000	2,608,458	0.53
Shui On Development Holding Ltd 6.40% Perpetual Callable-20/06/2022	2,000,000	2,003,391	0.41
Sinochem Offshore Capital Co Ltd 3.124% 24/05/2022	2,000,000	2,003,542	0.41
Sri Lanka Government International Bond 5.75% 18/01/2022	500,000	529,542	0.11
Sri Lanka Government International Bond 6.20% 11/05/2027	500,000	503,851	0.10
STATS ChipPAC Pte Ltd 8.50% 24/11/2020	2,500,000	2,680,090	0.55
Studio City Co Ltd 5.875% 30/11/2019	1,500,000	1,594,799	0.33
Studio City Co Ltd 7.25% 30/11/2021	2,000,000	2,185,926	0.45
Studio City Finance Ltd 8.50% 01/12/2020 Callable- 13/02/2017	700,000	732,909	0.15
Sunac China Holdings Ltd 8.75% 05/12/2019	1,500,000	1,586,954	0.32
TBG Global Pte Ltd 5.25% 10/02/2022 Callable- 10/02/2019	1,500,000	1,586,359	0.32
Theta Capital Pte Ltd 6.75% 31/10/2026 Callable- 31/10/2021	2,500,000	2,514,944	0.51
Theta Capital Pte Ltd 7.00% 11/04/2022 Callable- 11/04/2018	4,500,000	4,755,265	0.97
Times Property Holdings Ltd 6.25% 23/01/2020	2,400,000	2,477,233	0.51
Vedanta Resources plc 6.00% 31/01/2019	2,950,000	3,071,117	0.63
Vedanta Resources plc 6.375% 30/07/2022	2,000,000	2,051,179	0.42
Vedanta Resources plc 7.125% 31/05/2023	2,500,000	2,584,404	0.53
Vedanta Resources plc 8.25% 07/06/2021	3,000,000	3,281,880	0.67
West China Cement Ltd 6.50% 11/09/2019	3,000,000	3,153,993	0.65
Xinhu BVI Holding Co Ltd 6.00% 01/03/2020	2,550,000	2,586,363	0.53

投资报告

于 2017 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(95.02%) (续)			
债务证券 (55.91%) (续)			
以美元计价 (51.48%) (续)			
Yancoal International Resources Development Co Ltd 5.75% Perpetual Callable-13/04/2020	2,500,000	2,565,221	0.52
Yanlord Land HK Co Ltd 5.875% 23/01/2022	2,000,000	2,115,369	0.43
Yuzhou Properties Co Ltd 6.00% 25/01/2022	2,000,000	2,044,680	0.42
Yuzhou Properties Co Ltd 9.00% 08/12/2019 Callable-08/12/2017	3,800,000	4,036,512	0.83
Zoomlion HK SPV Co Ltd 6.125% 20/12/2022	1,000,000	1,007,382	0.21
债务证券总额		<u>273,504,297</u>	<u>55.91</u>
投资基金 (14.78%)			
澳大利亚 (2.68%)			
Sydney Airport	1,232,181	6,701,074	1.37
Transurban Group	705,925	6,405,706	1.31
香港 (12.10%)			
BEA Union Investment - Asia Pacific Investment Grade Bond Fund -Class BAH	390,000	4,978,375	1.02
BEA Union Investment Asia Pacific Equity Dividend Fund - Class ADU	3,926,228	41,343,181	8.46
BEA Union Investment Asian Bond and Currency Fund - Class ADU	55,388	789,279	0.16
BEA Union Investment Global Flexi Allocation Fund - Class ADU	229,379	2,530,050	0.52
HKT Trust & HKT Ltd	7,227,000	9,461,384	1.94
投资基金总额		<u>72,209,049</u>	<u>14.78</u>

投资报告

于 2017 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(95.02%) (续)			
房地产投资信托基金 (1.25%)			
澳大利亚 (1.25%)			
Stockland	1,820,026	6,100,743	1.25
房地产投资信托基金总额		6,100,743	1.25
投资总额		464,674,912	95.02
投资总额, 按成本计算		448,457,787	

投资报告

于 2017 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

	<i>占资产净值百分比</i>	
	<i>于 2017 年 6 月 30 日</i>	<i>于 2016 年 12 月 31 日</i>
债务证券		
印度卢比	1.09	-
印度尼西亚盾	2.03	-
马来西亚令吉	1.02	-
人民币	0.47	-
美元	91.78	97.22
	<hr/>	<hr/>
	96.39	97.22
	<hr/>	<hr/>

投资报告

于 2017 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 2017 年 6 月 30 日	于 2016 年 12 月 31 日
股票		
澳大利亚	3.40	11.40
中国	2.17	-
香港	4.12	-
印度尼西亚	0.52	-
爱尔兰	-	3.55
马来西亚	1.30	-
新加坡	0.60	1.96
台湾	10.97	2.90
泰国	-	6.67
债务证券		
港元	0.34	0.49
印度卢比	0.65	-
印度尼西亚盾	1.48	-
马来西亚令吉	1.01	-
人民币	0.80	-
新加坡元	0.15	-
美元	51.48	54.47
投资基金		
澳大利亚	2.68	-
香港	12.10	0.91
房地产投资信托基金		
澳大利亚	1.25	4.96
	<u>95.02</u>	<u>87.31</u>

表现报告

于 2017 年 6 月 30 日(未经审计)

基金支出比率 (“FER”)

子基金	FER(于 2016 年 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日期间)
-----	--

东亚联丰亚洲债券及货币基金

- A 类别累积	1.17%
- A 类别分派	1.17%
- A 类别分派对冲(澳元)	1.17%
- A 类别分派对冲(人民币)	1.17%
- H 类别分派 (港元)	1.17%

东亚联丰亚太区多元收益基金

- A 类别累积	1.41%
- A 类别分派	1.41%
- A 类别分派 (港元)	1.41%
- A 类别分派对冲(澳元)	1.41%
- A 类别分派对冲(新西兰元)	1.41%
- A 类别分派对冲(人民币)	1.41%

全面收益表

截至 2017 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	
	2017 美元	2016 美元	2017 美元	2016 美元
收入				
股息收入	-	-	3,725,110	3,407,651
银行存款利息	2,430	1,044	24,474	26,414
其他收入	-	34,988	202,977	48,326
	<u>2,430</u>	<u>36,032</u>	<u>3,952,561</u>	<u>3,482,391</u>
开支				
投资管理费	1,461,691	677,929	2,502,829	1,639,356
受托人费用	182,711	84,741	312,854	204,919
保管费及银行费用	11,933	7,115	28,401	17,282
审计师酬金	4,900	4,935	4,900	4,935
基金登记机构费用	35,562	23,844	44,922	34,167
印刷及出版费用	5,709	5,250	8,097	10,819
监管费	895	3,580	1,006	579
营运前开支	-	-	-	-
法律及专业服务费用	52	1,481	290	156
交易成本	206	4,173	1,071,590	533,249
借贷利息	54	19	8	-
其他营运费用	715	-	715	-
	<u>1,704,428</u>	<u>813,067</u>	<u>3,975,612</u>	<u>2,445,462</u>
计算投资及外汇 (亏损) / 收益净额前的年内 / 期内 (亏损) / 收益净额	<u>(1,701,998)</u>	<u>(777,035)</u>	<u>(23,051)</u>	<u>1,036,929</u>
投资及外汇 (亏损) / 收益净额				
投资的已变现收益 / (亏损) 净额	15,612,921	6,928,352	18,724,608	9,528,065
投资的未变现 (亏损) / 收益变动净额	(695,511)	6,858,293	7,846,693	7,518,135
汇兑 (亏损) / 收益	<u>(8,349)</u>	<u>(56,322)</u>	<u>6,206,986</u>	<u>2,797,308</u>
	<u>14,909,061</u>	<u>13,730,323</u>	<u>32,778,287</u>	<u>19,843,508</u>
计算融资成本前的亏损 / (利润)	13,207,063	12,953,288	32,755,236	20,880,437
向基金份额持有人作出 收益分配	<u>(5,213,948)</u>	<u>(2,829,650)</u>	<u>(14,077,052)</u>	<u>(9,252,799)</u>
税前 (亏损) / 利润	7,993,115	10,123,638	18,678,184	11,627,638
税项	<u>(3,285)</u>	<u>(3,195)</u>	<u>(345,792)</u>	<u>(401,811)</u>
年内 / 期内 (亏损) / 利润及总全面收入	<u>7,989,830</u>	<u>10,120,443</u>	<u>18,332,392</u>	<u>11,225,827</u>

资产负债表

于 2017 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	
	2017 年 6 月 30 日 美元	2016 年 12 月 31 日 美元	2017 年 6 月 30 日 美元	2016 年 12 月 31 日 美元
资产				
投资	311,589,632	239,944,787	464,674,912	301,124,742
应收外汇远期合同款项	90,568	-	685,883	37,517
应收股息	-	-	1,992,732	824,269
出售投资应收款项	5,712,580	1,679,441	16,333,452	27,241,223
认购基金份额的应收款项	2,117,425	485,659	5,237,675	489,652
其他应收款项	-	-	55,299	3,063
从经纪的应收款项	206,432	-	205,573	-
银行结余	12,708,621	12,794,251	22,745,192	48,362,658
资产总值	<u>332,425,258</u>	<u>254,904,138</u>	<u>511,930,718</u>	<u>378,083,124</u>
负债				
赎回基金份额的应付款项	2,163,323	6,024,758	2,152,128	869,136
应付外汇远期合同款项	-	145,185	-	-
应付购入投资款项	6,742,360	1,676,314	20,234,759	31,887,576
税项	3,282	-	3,974	-
应计费用及其他应付款项	313,310	259,731	709,406	417,278
银行透支	-	-	-	-
负债总值 (不包括基金份额持有人应占的资产净额)	<u>9,222,275</u>	<u>8,105,988</u>	<u>23,100,267</u>	<u>33,173,990</u>
基金份额持有人应占的资产净额				
金融负债	<u>323,202,983</u>	<u>246,798,150</u>	<u>488,830,451</u>	<u>344,909,134</u>
权益	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>

附注: 子基金现使用买入/卖出价计算金融资产及负债, 即符合 HKFRS 13 的公平价值的计量原则。采纳 HKFRS 13 不会对子基金的资产及负债的公允价值计量与之前的期间有任何实质影响。在财务报表中的资产净值(“资产净值”)有别于资产负债表当天用作计价用途的资产净值(“交易资产净值”), 这是因为在基金说明书中关于计算交易资产净值的原则与 HKFRSs 要求的财务报告原则不同。下列对比提供了有关差异的详细内容:

	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	
	2017 年 6 月 30 日 美元	2016 年 12 月 31 日 美元	2017 年 6 月 30 日 美元	2016 年 12 月 31 日 美元
在财务报表中报告的资产净值	323,202,983	246,798,150	488,830,451	344,909,134
在计算投资价值时使用最新的买/卖定价	<u>830,397</u>	<u>863,405</u>	<u>1,182,028</u>	<u>887,472</u>
买卖资产净值	<u>324,033,380</u>	<u>247,661,555</u>	<u>490,012,479</u>	<u>345,796,606</u>

资产负债表

于 2017 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	
	2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日	2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
A 类别累积				
份额发行数量	5,781,454.59	4,563,332.12	692,542.48	441,503.73
财务报告中每份额资产净值 ⁽⁵⁾	22.32	21.40	12.99	12.17
A 类别分派				
份额发行数量	6,912,602.02	4,708,385.02	11,038,278.37	8,356,247.45
财务报告中每份额资产净值 ⁽⁵⁾	14.21	14.00	10.77	10.40
A 类别分派(港元)				
份额发行数量	-	-	15,473,915.93	11,155,144.57
财务报告中每份额资产净值 ⁽⁵⁾	-	-	13.86	13.39
A 类别分派对冲(澳元)				
份额发行数量	259,306.92	134,850.10	8,364,825.61	5,959,042.47
财务报告中每份额资产净值 ⁽⁵⁾	8.22	7.72	7.03	6.49
A 类别分派对冲(新西兰元)				
份额发行数量	-	-	2,737,182.11	1,868,085.74
财务报告中每份额资产净值 ⁽⁵⁾	-	-	6.75	6.30
A 类别分派对冲(人民币)				
份额发行数量	2,033,077.64	2,616,977.71	4,825,554.57	3,951,095.94
财务报告中每份额资产净值 ⁽⁵⁾	16.42	15.55	14.30	13.31
H 类别分派(港元)				
份额发行数量	41,175,286.45	28,711,011.93	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽⁵⁾	1.46	1.44	-	-

⁽⁵⁾ 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 2017 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	
	2017 美元	2016 美元	2017 美元	2016 美元
于 1 月 1 日 / 成立日期的结余	246,798,150	105,956,167	344,909,134	260,610,661
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	128,511,350	81,389,266	308,972,382	122,661,668
年内 / 期内赎回基金份额	(60,096,347)	(35,241,621)	(183,383,457)	(108,579,483)
与所有者 / 基金份额持有人的交易总额	68,415,003	46,147,645	125,588,925	14,082,185
年内 / 期内 (亏损) / 利润及总全面收入	7,989,830	10,120,443	18,332,392	11,225,827
于 6 月 30 日的结余	323,202,983	162,224,255	488,830,451	285,918,673

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