

中期报告（未经审计）

截至 2026 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	
－ 投资组合	1 - 35
－ 投资组合变动表	36 - 38
全面收益表	39 - 40
资产负债表	41 - 45
基金份额持有人应占资产净值变动表	46 - 51
管理及行政	52

附注：

此中期财务报表（未经审计）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》（经修订及重述）的相关条文、以及由香港证券及期货事务监察委员会颁布的单位信托及互惠基金守则当中的相关条文编制。

所采用的会计政策与年度财务报表的财务报表附注所述者一致。

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (101.43%)			
债务证券 (101.43%)			
以港元计价 (0.64%)			
XtalPi Holdings Ltd 0.00% 26/01/2027	12,000,000	1,500,112	0.64
以人民币计价 (0.38%)			
ZTE Corp 0.00% 05/08/2030	6,000,000	884,763	0.38
以美元计价 (100.41%)			
AC Energy Finance International Ltd 5.10% Perpetual Callable - 25/11/2026	700,000	564,851	0.24
Adani Green Energy UP Ltd / Prayatna Developers Pvt Ltd / Parampujya Solar Energy 6.70% 12/03/2042	939,778	942,340	0.40
Adani Renewable Energy RJ Ltd/Kodangal Solar Parks Pvt Ltd/Wardha Solar Maharash 4.625% 15/10/2039	1,574,625	1,353,129	0.58
Alibaba Group Holding Ltd 0.00% 15/09/2032	1,550,000	1,386,707	0.59
Axis Bank Ltd/Gandhinagar 6.875% Perpetual Callable - 30/12/2031	1,200,000	1,206,469	0.51
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 7.15% Perpetual Callable - 22/10/2031	800,000	810,131	0.35
Biocon Biologics Global PLC 6.67% 09/10/2029	2,650,000	2,709,314	1.16
Cas Capital No 2 Ltd 6.25% Perpetual Callable - 13/01/2031	1,650,000	1,707,926	0.73
Champion MTN Ltd 2.95% 15/06/2030	700,000	623,757	0.27

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (101.43%)（续）			
债务证券 (101.43%)（续）			
以美元计价 (100.41%)（续）			
Champion Path Holdings Ltd 4.85% 27/01/2028	1,300,000	1,288,634	0.55
China Oil & Gas Group Ltd 7.00% 04/02/2029	700,000	704,153	0.30
City of Ulaanbaatar Mongolia 7.75% 21/08/2027	1,200,000	1,259,215	0.54
CMOC Capital Ltd 0.00% 24/01/2027	600,000	586,044	0.25
Continuum Green Energy India Pvt / Co-Issuers 7.50% 26/06/2033	1,251,450	1,288,457	0.55
CS Treasury Management Services B Ltd 7.00% 05/12/2031	1,836,000	1,864,064	0.80
CS Treasury Management Services P Ltd 9.00% Perpetual Callable - 05/12/2026	3,643,323	3,779,219	1.61
Development Bank of Mongolia LLC 6.90% 02/07/2031	1,200,000	1,189,188	0.51
Development Bank of Mongolia LLC 8.50% 03/07/2028	3,250,000	3,509,278	1.50
Fortune Star BVI Ltd 6.80% 09/09/2029	1,500,000	1,516,748	0.65
Fortune Star BVI Ltd 8.50% 19/05/2028	2,050,000	2,127,504	0.91
Franshion Brilliant Ltd 4.25% 23/07/2029	1,300,000	1,229,232	0.52
Garuda Indonesia Persero Tbk PT 6.50% 28/12/2031	2,078,171	1,817,198	0.78
GC Treasury Center Co Ltd 6.50% Perpetual Callable - 10/09/2030	1,300,000	1,295,686	0.55
GC Treasury Center Co Ltd 7.125% Perpetual Callable - 10/03/2035	1,050,000	1,066,694	0.46
GLP China Holdings Ltd 7.75% 30/04/2029	650,000	565,495	0.24
GLP Pte Ltd 7.865% Perpetual Callable - 17/11/2026	1,600,000	931,666	0.40
GLP Pte Ltd 9.75% 20/05/2028	2,000,000	1,724,188	0.74

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (101.43%) (续)			
债务证券 (101.43%) (续)			
以美元计价 (100.41%) (续)			
Gohl Capital Holdings Ltd 7.625% Perpetual Callable - 29/10/2031	2,800,000	2,749,605	1.17
Gohl Capital Holdings Ltd 8.30% Perpetual Callable - 29/04/2036	1,050,000	1,030,958	0.44
Golomt Bank 7.95% 14/05/2029	2,300,000	2,340,593	1.00
Greenko Power II Ltd 4.30% 13/12/2028	1,901,375	1,823,742	0.78
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd 7.25% 27/09/2028	3,004,250	3,087,259	1.32
Greentown China Holdings Ltd 7.00% 19/05/2029	500,000	492,093	0.21
Greentown China Holdings Ltd 8.45% 24/02/2028	1,300,000	1,351,064	0.58
HDFC Bank Ltd 3.70% Perpetual Callable - 25/08/2026	500,000	504,137	0.21
IIFL Finance Ltd 7.60% 10/09/2029	2,600,000	2,630,611	1.12
IIFL Finance Ltd 8.75% 24/07/2028	1,350,000	1,445,202	0.62
Indika Energy Tbk PT 8.75% 07/05/2029	1,250,000	1,281,781	0.55
IRB Infrastructure Developers Ltd 7.11% 11/03/2032	1,600,000	1,658,536	0.71
JAPFA Pte Ltd 7.95% 12/05/2031	800,000	809,929	0.35
Jinkai Investment Holdings Ltd 0.00% 05/02/2031	700,000	631,190	0.27
JSW Hydro Energy Ltd 4.125% 18/05/2031	1,592,125	1,491,148	0.64
JSW Steel Ltd 5.05% 05/04/2032	1,450,000	1,420,513	0.61
Karoon USA Finance Inc 10.50% 14/05/2029	2,400,000	2,508,668	1.07
Lenovo Group Ltd 0.00% 25/06/2033	400,000	385,944	0.16
Li & Fung Ltd 5.25% Perpetual Callable - 03/11/2026	400,000	231,135	0.10

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (101.43%) (续)			
债务证券 (101.43%) (续)			
以美元计价 (100.41%) (续)			
Li & Fung Ltd 8.375% 05/02/2029	1,100,000	1,159,956	0.49
Longfor Group Holdings Ltd 3.85% 13/01/2032	1,000,000	754,127	0.32
Longfor Group Holdings Ltd 3.95% 16/09/2029	1,800,000	1,529,407	0.65
Longfor Group Holdings Ltd 4.50% 16/01/2028	1,150,000	1,096,634	0.47
Medco Cypress Tree Pte Ltd 8.625% 19/05/2030	2,450,000	2,583,017	1.10
Medco Maple Tree Pte Ltd 8.96% 27/04/2029	550,000	576,405	0.25
Melco Resorts Finance Ltd 5.375% 04/12/2029	3,500,000	3,426,679	1.46
Melco Resorts Finance Ltd 6.50% 24/09/2033	1,250,000	1,249,792	0.53
Melco Resorts Finance Ltd 7.625% 17/04/2032	2,350,000	2,446,123	1.04
MGM China Holdings Ltd 6.25% 15/05/2033	1,100,000	1,089,169	0.46
MGM China Holdings Ltd 7.125% 26/06/2031	1,250,000	1,294,674	0.55
Modernland Overseas Pte Ltd 6.00% 30/04/2027	37,146	12,351	0.00
Mong Duong Finance Holdings BV 5.125% 07/05/2029	452,362	450,887	0.19
Mongolian Mining Corp 8.44% 03/04/2030	2,800,000	2,918,919	1.25
Mongolian Mortgage Corp Hfc LLC 11.50% 18/01/2027	900,000	963,746	0.41
Muangthai Capital PCL 6.875% 30/09/2028	750,000	767,159	0.33
Muangthai Capital PCL 7.55% 21/07/2030	1,200,000	1,260,715	0.54

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (101.43%) (续)			
债务证券 (101.43%) (续)			
以美元计价 (100.41%) (续)			
Muthoot Finance Ltd 5.75% 04/08/2030	1,800,000	1,805,399	0.77
Muthoot Finance Ltd 6.375% 02/03/2030	2,300,000	2,347,870	1.00
Muthoot Finance Ltd 6.375% 23/04/2029	1,500,000	1,522,218	0.65
New Metro Global Ltd 11.80% 09/03/2029	500,000	496,271	0.21
New World China Land Ltd 4.75% 23/01/2027	900,000	889,711	0.38
Nickel Industries Ltd 9.00% 30/09/2030	3,100,000	3,253,574	1.39
NWD Finance BVI Ltd 10.131% Perpetual Callable - 01/08/2026	850,000	824,636	0.35
NWD Finance BVI Ltd 12.179% Perpetual Callable - 01/08/2026	2,550,000	2,382,389	1.02
NWD Finance BVI Ltd 4.125% Perpetual Callable - 10/03/2028	900,000	739,314	0.32
NWD Finance BVI Ltd 6.25% Perpetual Callable - 07/09/2026	1,400,000	899,304	0.38
NWD MTN Ltd 4.125% 18/07/2029	1,500,000	1,317,161	0.56
NWD MTN Ltd 4.50% 19/05/2030	1,000,000	837,760	0.36
NWD MTN Ltd 8.625% 08/02/2028	650,000	652,041	0.28
Pakistan Global Sukuk Programme Co Ltd 7.95% 31/01/2029	2,550,000	2,707,146	1.16
Pakistan Government International Bond 6.875% 05/12/2027	2,050,000	2,077,891	0.89
Pakistan Government International Bond 6.975% 24/04/2029	1,200,000	1,217,701	0.52
Pakistan Government International Bond 7.375% 08/04/2031	4,050,000	4,151,952	1.77
Pakistan Government International Bond 7.875% 31/03/2036	750,000	766,430	0.33
Pakistan Government International Bond 8.875% 08/04/2051	2,250,000	2,318,967	0.99

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (101.43%) (续)			
债务证券 (101.43%) (续)			
以美元计价 (100.41%) (续)			
Petron Corp 7.35% Perpetual Callable - 22/08/2028	1,150,000	1,189,804	0.51
Piramal Finance Ltd 7.80% 29/01/2028	950,000	1,000,914	0.43
Renew Treasury Ifsc Pvt Ltd 6.50% 02/02/2031	1,450,000	1,477,743	0.63
ReNew Wind Energy AP2 / ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries 4.50% 14/07/2028	2,850,000	2,817,125	1.20
SAEL/SPREPL/SSSPL/JGPEPL/SKRE PL/UBEPL 7.80% 31/07/2031	679,725	715,422	0.31
Sammaan Capital Ltd 7.50% 16/10/2030	1,400,000	1,440,369	0.62
Sammaan Capital Ltd 8.95% 28/08/2028	650,000	696,188	0.30
Sammaan Capital Ltd 9.70% 03/07/2027	750,000	807,608	0.34
San Miguel Global Power Holdings Corp 8.125% Perpetual Callable - 02/12/2029	1,448,000	1,451,627	0.62
San Miguel Global Power Holdings Corp 8.375% Perpetual Callable - 20/10/2030	1,000,000	1,032,755	0.44
San Miguel Global Power Holdings Corp 8.75% Perpetual Callable - 12/06/2029	1,500,000	1,563,710	0.67
San Miguel Global Power Holdings Corp 8.875% Perpetual Callable - 17/03/2031	1,002,000	1,007,833	0.43
Seazen Group Ltd 11.88% 26/06/2028	2,000,000	1,978,460	0.84
Shui On Development Holding Ltd 9.75% 26/01/2029	3,500,000	3,690,642	1.58
SJM International Ltd 6.50% 15/01/2031	850,000	832,653	0.36

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (101.43%) (续)			
债务证券 (101.43%) (续)			
以美元计价 (100.41%) (续)			
SoftBank Group Corp 6.875% Perpetual Callable - 19/07/2027	1,300,000	1,339,010	0.57
SoftBank Group Corp 7.625% 29/04/2061	700,000	684,706	0.29
Sorik Marapi Geothermal Power PT 7.75% 05/08/2031	1,819,935	1,889,731	0.81
Sri Lanka Government International Bond 3.10% 15/01/2030	2,800,000	2,881,828	1.23
Sri Lanka Government International Bond 3.35% 15/03/2033	4,600,000	4,456,452	1.90
Sri Lanka Government International Bond 3.60% 15/02/2038	3,750,000	3,827,175	1.63
Sri Lanka Government International Bond 3.60% 15/05/2036	2,450,000	2,472,148	1.06
Sri Lanka Government International Bond 3.60% 15/06/2035	3,200,000	2,672,768	1.14
Sri Lanka Government International Bond 4.00% 15/04/2028	1,643,000	1,601,998	0.68
Standard Chartered PLC 4.30% Perpetual Callable - 19/08/2028	3,750,000	3,667,488	1.57
Standard Chartered PLC 4.75% Perpetual Callable - 14/01/2031	2,550,000	2,455,025	1.05
Standard Chartered PLC 7.00% Perpetual Callable - 08/06/2033	2,050,000	2,072,657	0.89
Standard Chartered PLC 7.00% Perpetual Callable - 14/11/2035	2,050,000	2,089,973	0.89
Standard Chartered PLC 7.625% Perpetual Callable - 16/01/2032	2,800,000	3,046,786	1.30
Standard Chartered PLC 7.875% Perpetual Callable - 08/03/2030	1,400,000	1,510,864	0.65
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd 6.75% 24/04/2033	542,250	556,664	0.24

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (101.43%) (续)			
债务证券 (101.43%) (续)			
以美元计价 (100.41%) (续)			
State Bank JSC 8.90% 25/09/2028	1,000,000	1,029,613	0.44
Studio City Co Ltd 6.125% 15/05/2031	1,000,000	998,966	0.43
Studio City Finance Ltd 5.00% 15/01/2029	6,100,000	5,981,206	2.55
Thaioil Treasury Center Co Ltd 6.10% Perpetual Callable - 15/01/2031	1,350,000	1,368,141	0.58
Trade & Development Bank of Mongolia LLC 8.50% 23/12/2027	2,100,000	2,123,350	0.91
Tsetsens Mining And Energy LLC 11.375% 05/02/2031	2,050,000	2,247,788	0.96
UPL Corp Ltd 4.50% 08/03/2028	450,000	443,441	0.19
UPL Corp Ltd 4.625% 16/06/2030	1,950,000	1,814,898	0.78
Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 3.50% 12/11/2029	700,000	304,734	0.13
Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 3.975% 09/11/2027	2,000,000	913,803	0.39
Vedanta Resources Finance II PLC 10.25% 03/06/2028	1,000,000	1,033,902	0.44
Vedanta Resources Finance II PLC 10.875% 17/09/2029	4,300,000	4,712,356	2.01
Vedanta Resources Finance II PLC 11.25% 03/12/2031	1,650,000	1,855,227	0.79
Vedanta Resources Finance II PLC 7.00% 13/07/2032	1,100,000	1,097,866	0.47
Vedanta Resources Finance II PLC 7.375% 13/07/2034	1,800,000	1,792,998	0.77
Vedanta Resources Finance II PLC 7.75% 13/07/2037	2,700,000	2,687,904	1.15
Vedanta Resources Finance II PLC 9.125% 15/10/2032	1,300,000	1,407,294	0.60
Vedanta Resources Finance II PLC 9.475% 24/07/2030	2,250,000	2,510,666	1.07

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (101.43%) (续)			
债务证券 (101.43%) (续)			
以美元计价 (100.41%) (续)			
Vedanta Resources Finance II PLC 9.85% 24/04/2033	2,000,000	2,224,444	0.95
Wanda Properties Global Co Ltd 12.75% 05/02/2028	3,550,000	3,758,308	1.61
West China Cement Ltd 9.90% 04/12/2028	2,450,000	2,178,601	0.93
Wynn Macau Ltd 5.125% 15/12/2029	4,800,000	4,696,837	2.01
Wynn Macau Ltd 6.75% 15/02/2034	4,000,000	4,081,760	1.74
Yinson Bergenia Production BV 8.498% 31/01/2045	1,480,050	1,640,198	0.70
Yinson Boronia Production BV 8.947% 31/07/2042	1,360,041	1,552,592	0.66
债务证券总额		237,478,784	101.43

标的资产	交易对手	合约数量	公允价 值 美元	占净资产净 值百分比
债券期货 (-0.04%)				
美国 (-0.04%)				
US 10Yr Note (CBT) Future 21/09/26	US Treasury 10 Year Note	花旗银行, 香 港	(56) (30,594)	(0.02)
US Ultra Bond (CBT) Future 21/09/26	US Ultra Bond (CBT) Future	花旗银行, 香 港	(16) (52,999)	(0.02)
债券期货总额			(83,593)	(0.04)

投资报告

于 2026 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)

	交易对手		未平仓合约的 名义金额	公允价值 美元	占净资产 净值百分 比
上市/挂牌投资 (101.43%) (续)					
信贷违约掉期 (0.04%)					
ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED~L48~ 65 4,200,000.00 USD 10/02/2025 20/12/2029	花旗银行, 香 港	美元	4,200,000	50,076	0.02
CCFAMC IV CO LTD~L48~ 80 3,500,000.00 USD 18/08/2025 20/06/2030	花旗银行, 香 港	美元	3,500,000	(9,036)	(0.00)
JOY TRSR ASSETS HLD~L48~ 85 4,000,000.00 USD 25/09/2025 29/09/2025	花旗银行, 香 港	美元	4,000,000	31,328	0.01
SK HYNIX INC~L48~ 96 2,600,000.00 USD 05/06/2026 20/06/2031	花旗银行, 香 港	美元	2,600,000	30,339	0.01
信贷违约掉期总额				102,707	0.04
投资总额				237,497,898	101.43

投资报告

于 2026 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)

标的资产	交易对手	未平仓合约的 名义金额	公允价值 美元	占净资产 产净值 百分比
外汇远期合约 (0.13%)				
买入 澳元/卖出 美元	花旗银行, 香港	澳元 3,444,168	12,781	0.00
买入 澳元/卖出 美元	花旗银行, 香港	澳元 4,600,000	14,926	0.01
买入 欧元/卖出 美元	花旗银行, 香港	欧元 1,394	13	0.00
买入 欧元/卖出 美元	花旗银行, 香港	欧元 1,000,000	5,728	0.00
买入 印度尼西亚盾/卖出 美元	花旗银行, 香港	印度尼西亚盾 25,000,000,000	(970)	(0.00)
买入 印度尼西亚盾/卖出 美元	花旗银行, 香港	印度尼西亚盾 25,000,000,000	2,935	0.00
买入 墨西哥比绍/卖出 美元	花旗银行, 香港	墨西哥比绍 25,000,000	5,346	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人民币 5,497	3	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人民币 11,000,000	4,376	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人民币 196,815,092	111,707	0.05
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人民币 273,225,379	155,046	0.07
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人民币 16,961	4	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人民币 87,934	29	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人民币 197,808	57	0.00
买入 韩元/卖出 美元	花旗银行, 香港	韩元 2,200,000,000	(45,902)	(0.02)

投资报告

于 2026 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)

标的资产	交易对手	未平仓合约的名义 金额	公允价值 美元	占净资产 净值 百分比
外汇远期合约 (0.13%) (续)				
买入 美元/卖出 印度尼西 亚盾	花旗银行, 香 港	美元 1,424,574	26,325	0.01
买入 美元/卖出 印度尼西 亚盾	花旗银行, 香 港	美元 1,411,560	13,310	0.01
买入 美元/卖出 印度尼西 亚盾	花旗银行, 香 港	美元 1,390,720	(3,280)	(0.00)
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行, 香 港	美元 39,587	(34)	(0.00)
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行, 香 港	美元 44,988	(38)	(0.00)
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行, 香 港	美元 371,318	(1,611)	(0.00)
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行, 香 港	美元 29,524	(60)	(0.00)
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行, 香 港	美元 63,604	(162)	(0.00)
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行, 香 港	美元 217,781	(498)	(0.00)
买入 美元/卖出 韩元	花旗银行, 香 港	美元 1,431,174	11,162	0.00
外汇远期合约总额			311,193	0.13
其他净资产			(3,670,013)	(1.56)
净资产总额			234,139,078	100.00
投资总额, 按成本计算			227,621,285	

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (96.62%)			
股票 (42.31%)			
澳大利亚 (3.64%)			
BHP Group Ltd	74,339	3,059,222	2.01
Lynas Rare Earths Ltd	34,480	431,413	0.28
NexGen Energy Ltd	57,435	557,074	0.37
Orica Ltd	56,932	933,998	0.62
Santos Ltd	64,285	321,109	0.21
Yancoal Australia Ltd	60,598	230,483	0.15
中国 (2.97%)			
China Tungsten And Hightech Materials Co Ltd - A	35,900	506,239	0.33
Grace Fabric Technology Co Ltd - A	20,900	816,942	0.54
Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd - A	35,000	773,992	0.51
Montage Technology Co Ltd - A	16,297	744,026	0.49
Suzhou TFC Optical Communication Co Ltd - A	10,220	455,715	0.30
WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd - A	22,000	495,228	0.33
Yantai Jereh Oilfield Services Group Co Ltd - A	32,000	718,917	0.47
香港 (4.00%)			
AIA Group Ltd	60,200	548,492	0.36
China Construction Bank Corp - H	622,000	640,082	0.42
China Hongqiao Group Ltd	145,000	370,912	0.25
CIG Shanghai Co Ltd - H	22,500	432,956	0.29
CMOC Group Ltd - H	105,000	203,251	0.13
Contemporary Amperex Technology Co Ltd - H	10,000	895,176	0.59
Jiangxi Copper Co Ltd - H	117,000	461,314	0.30

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (96.62%) (续)			
股票 (42.31%) (续)			
香港 (4.00%) (续)			
Kingboard Laminates Holdings Ltd	46,000	581,597	0.38
PetroChina Co Ltd - H	498,000	538,514	0.36
Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H	58,000	377,568	0.25
Yankuang Energy Group Co Ltd - H	326,000	459,358	0.30
Zijin Gold International Co Ltd	15,700	177,180	0.12
Zijin Mining Group Co Ltd - H	110,000	384,339	0.25
印度 (0.50%)			
Apollo Hospitals Enterprise Ltd	5,223	479,036	0.31
Bharat Electronics Ltd	64,847	282,101	0.19
韩国 (13.67%)			
Doosan Enerbility Co Ltd	13,034	730,231	0.48
Hanwha Aerospace Co Ltd	1,312	842,596	0.56
HD Hyundai Electric Co Ltd	801	502,529	0.33
HD Hyundai Heavy Industries Co Ltd	1,634	624,362	0.41
KB Financial Group Inc	3,120	320,195	0.21
KIWOOM Securities Co Ltd	1,049	232,237	0.15
RFHIC Corp	10,799	440,518	0.29
Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	700	986,764	0.65
Samsung Electronics Co Ltd	33,613	7,246,301	4.77
SK hynix Inc	4,209	7,199,252	4.74
SK Square Co Ltd	716	784,255	0.52
Tokai Carbon Korea Co Ltd	4,853	853,571	0.56
新加坡 (2.16%)			
AEM Holdings Ltd	160,700	1,320,686	0.87
DBS Group Holdings Ltd	13,000	657,312	0.43
Singapore Technologies Engineering Ltd	162,200	1,302,917	0.86

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (96.62%) (续)			
股票 (42.31%) (续)			
台湾 (9.01%)			
Accton Technology Corp	15,000	1,174,808	0.77
ASE Technology Holding Co Ltd	63,000	1,344,790	0.89
Asia Vital Components Co Ltd	12,000	951,147	0.63
ASPEED Technology Inc	2,000	1,035,589	0.68
Bizlink Holding Inc	17,000	1,021,934	0.67
Delta Electronics Inc	27,000	1,652,736	1.09
Elite Material Co Ltd	7,000	1,184,382	0.78
Global Unichip Corp	2,000	304,179	0.20
MediaTek Inc	11,000	1,465,803	0.96
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	11,000	832,175	0.55
Unimicron Technology Corp	14,000	470,237	0.31
Winbond Electronics Corp	225,000	1,465,567	0.96
Yageo Corp	22,000	787,286	0.52
菲律宾 (1.18%)			
International Container Terminal Services Inc	123,970	1,797,881	1.18
美国 (5.18%)			
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd - ADR	16,474	7,867,488	5.18
股票总额		64,275,962	42.31

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产 净值 百分比
上市/挂牌投资 (96.62%) (续)			
债务证券 (6.52%)			
以美元计价 (6.52%)			
AIA Group Ltd 4.95% 30/03/2035	1,300,000	1,307,361	0.86
Alibaba Group Holding Ltd 2.125% 09/02/2031	750,000	681,594	0.45
Alibaba Group Holding Ltd 5.25% 26/05/2035	200,000	205,653	0.13
CK Hutchison International 24 Ltd 5.50% 26/04/2034	500,000	522,465	0.34
CK Hutchison International 25 Ltd 4.25% 26/09/2030	700,000	698,954	0.46
Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd 2.25% 15/07/2031	600,000	542,523	0.36
HPHT Finance 25 Ltd 5.00% 21/02/2030	430,000	438,456	0.29
LG Electronics Inc 5.625% 24/04/2029	500,000	516,084	0.34
Marubeni Corp 5.383% 01/04/2035	200,000	207,156	0.14
Meituan 4.625% 02/10/2029	700,000	700,486	0.46
MTR Corp CI Ltd 4.875% Perpetual Callable - 24/09/2030	450,000	451,979	0.30
Panasonic Holdings Corp 5.302% 16/07/2034	500,000	521,365	0.34
SK hynix Inc 4.25% 11/09/2028	700,000	704,225	0.46
SK hynix Inc 4.375% 11/09/2030	280,000	280,464	0.18
Sumitomo Corp 5.35% 03/07/2034	500,000	524,326	0.35
Swire Pacific MTN Financing Ltd 4.625% 28/08/2032	700,000	713,063	0.47
Tencent Holdings Ltd 2.39% 03/06/2030	750,000	697,117	0.46
United States Treasury Note/Bond 3.375% 30/11/2027	200,000	198,373	0.13
债务证券总额		9,911,644	6.52

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产 净值 百分比
上市/挂牌投资 (96.62%) (续)			
投资基金 (47.79%)			
香港 (47.79%)			
东亚联丰亚洲机会基金- ADU 类别	17,303	440,357	0.29
东亚联丰亚洲机会基金- NDU 类别	2,741,572	45,071,451	29.67
东亚联丰亚洲策略债券基金- NDU 类别	2,780,506	27,082,131	17.83
投资基金总额		72,593,939	47.79
投资总额		146,781,545	96.62

投资报告

于 2026 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)

标的资产	交易对手	未平仓合约的名义 金额	公允价值 美元	占净资产 净值 百分比
外汇远期合约(0.16%)				
买入 澳元/卖出 美元	花旗银行, 香港	澳元 16,161,608	59,960	0.04
买入 欧元/卖出 美元	花旗银行, 香港	欧元 4,110	37	0.00
买入 新西兰元/卖出 美元	花旗银行, 香港	新 西 兰 元 7,656,284	39,935	0.03
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人民币 60,975,343	34,633	0.02
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人民币 654,820	51	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人民币 326,758	193	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人 民 币 188,196,464	106,816	0.07
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人民币 1,176	-	-
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人民币 77,345	20	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人民币 1,000	-	-
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人民币 369,791	121	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人民币 51,639	15	0.00

投资报告

于 2026 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)

标的资产	交易对手	未平仓合约的名义 金额	公允价值 美元	占净资产 净值 百分比
外汇远期合约(0.16%) (续)				
买入 美元/卖出 澳元	花旗银行, 香港	美元 44,200	(136)	0.00
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行, 香港	美元 59,686	(51)	0.00
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行, 香港	美元 571,697	(2,481)	0.00
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行, 香港	美元 13,673	(31)	0.00
外汇远期合约总额			<u>239,082</u>	<u>0.16</u>
其他净资产			<u>4,891,509</u>	<u>3.22</u>
净资产总额			<u>151,912,136</u>	<u>100.00</u>
投资总额, 按成本计算			<u>108,607,016</u>	

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (98.81%)			
债务证券 (98.82%)			
以澳元计价 (0.92%)			
APA Infrastructure Ltd 6.772% 28/04/2056	3,000,000	2,145,645	0.55
AusNet Services Holdings Pty Ltd 6.187% 12/02/2055	1,000,000	711,132	0.19
NBN Co Ltd 5.85% 19/03/2036	500,000	357,008	0.09
NSW Electricity Networks Finance Pty Ltd 6.296% 20/11/2055	500,000	342,172	0.09
以欧元计价 (1.91%)			
CK Hutchison Group Telecom Finance SA 1.50% 17/10/2031	2,490,000	2,605,554	0.67
Fortune Star BVI Ltd 5.875% 20/11/2030	1,125,000	1,269,969	0.33
Foxconn Singapore Pte Ltd 3.125% 04/11/2031	3,100,000	3,528,750	0.91
以港元计价 (0.58%)			
XtalPi Holdings Ltd 0.00% 26/01/2027	18,000,000	2,250,167	0.58
以人民币计价 (3.00%)			
Alibaba Group Holding Ltd 3.50% 28/11/2044	4,000,000	630,172	0.16
China Mengniu Dairy Co Ltd 2.30% 30/07/2035	19,900,000	2,893,736	0.74
Chubb INA Holdings LLC 3.05% 06/08/2055	5,000,000	719,231	0.18
Huafa 2024 I Co Ltd 3.05% 17/10/2028	10,000,000	1,445,711	0.37
Huafa 2024 I Co Ltd 6.00% Perpetual Callable - 30/06/2027	9,000,000	1,381,831	0.36
Sunny Optical Technology Group Co Ltd 2.15% 07/07/2031	7,000,000	1,033,949	0.27
Temasek Financial I Ltd 2.05% 30/07/2035	4,000,000	589,398	0.15

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (98.81%) (续)			
债务证券 (98.82%) (续)			
以人民币计价 (3.00%) (续)			
Temasek Financial I Ltd 2.55%			
30/07/2055	3,000,000	422,206	0.11
Tencent Holdings Ltd 3.10% 23/09/2055	10,000,000	1,498,784	0.39
ZTE Corp 0.00% 05/08/2030	7,000,000	1,032,223	0.27
以英镑计价 (1.79%)			
CK Hutchison Group Telecom Finance			
SA 2.625% 17/10/2034	1,800,000	1,927,970	0.50
GE Capital UK Funding Unlimited Co			
5.875% 18/01/2033	1,800,000	2,553,912	0.66
HSBC Holdings PLC 5.813% 22/05/2033	1,800,000	2,460,651	0.63
以美元计价 (90.62%)			
AAC Technologies Holdings Inc 3.75%			
02/06/2031	4,760,000	4,485,685	1.16
ABJA Investment Co Pte Ltd 5.45%			
24/01/2028	2,418,000	2,491,237	0.64
Adani International Container Terminal			
Pvt Ltd 3.00% 16/02/2031	5,402,000	5,056,506	1.30
Adani Ports & Special Economic Zone			
Ltd 5.00% 02/08/2041	2,975,000	2,681,024	0.69
Adani Renewable Energy RJ			
Ltd/Kodangal Solar Parks Pvt			
Ltd/Wardha Solar Maharash 4.625%			
15/10/2039	2,382,125	2,047,041	0.53
Adani Transmission Step-One Ltd 4.25%			
21/05/2036	4,133,215	3,767,931	0.97
AIA Group Ltd 3.20% 16/09/2040	1,450,000	1,136,747	0.29
Alibaba Group Holding Ltd 0.00%			
15/09/2032	2,350,000	2,102,427	0.54
Alibaba Group Holding Ltd 2.70%			
09/02/2041	5,650,000	4,222,132	1.09

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (98.81%) (续)			
债务证券 (98.82%) (续)			
以美元计价 (90.62%) (续)			
Alibaba Group Holding Ltd 3.25% 09/02/2061	5,500,000	3,563,722	0.92
Australian Metcoal Financing Pty Ltd 6.25% 22/10/2031	300,000	309,351	0.08
Australian Metcoal Financing Pty Ltd 6.75% 22/04/2034	2,800,000	2,934,001	0.76
Axiata SPV2 Bhd 2.163% 19/08/2030	5,300,000	4,843,940	1.25
Axis Bank Ltd/Gandhinagar 6.875% Perpetual Callable - 30/12/2031	800,000	804,313	0.21
Bangkok Bank PCL/Hong Kong 3.466% 23/09/2036	5,900,000	5,427,559	1.40
Bangkok Bank PCL/Hong Kong 5.50% 21/09/2033	450,000	468,291	0.12
Bangkok Bank PCL/Hong Kong 6.056% 25/03/2040	650,000	673,887	0.17
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 7.15% Perpetual Callable - 22/10/2031	700,000	708,865	0.18
Biocon Biologics Global PLC 6.67% 09/10/2029	500,000	511,191	0.13
BPRL International Singapore Pte Ltd 4.375% 18/01/2027	300,000	305,142	0.08
Bright Galaxy International Ltd 3.25% 15/07/2026	400,000	405,490	0.10
Bright Galaxy International Ltd 6.30% 20/04/2029	2,350,000	2,423,120	0.62
Cathaylife Singapore Pte Ltd 5.50% 29/04/2041	2,550,000	2,548,119	0.66
Central Plaza Development Ltd 6.80% 07/04/2029	1,150,000	1,168,120	0.30
Central Plaza Development Ltd 7.15% 21/03/2028	800,000	822,561	0.21
Champion MTN Ltd 2.95% 15/06/2030	500,000	445,541	0.12

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (98.81%) (续)			
债务证券 (98.82%) (续)			
以美元计价 (90.62%) (续)			
Chang Development International Ltd 6.25% 26/03/2028	450,000	467,191	0.12
Chang Development International Ltd 6.80% 25/06/2027	750,000	765,708	0.20
Chengdu ETDZ State-owned Investment Group Co Ltd 6.50% 18/11/2027	300,000	301,342	0.08
China Cinda Finance 2014 II Ltd 5.20% 05/12/2029	750,000	760,917	0.20
China Great Wall International Holdings V Ltd 2.375% 18/08/2030	350,000	321,407	0.08
China Great Wall International Holdings V Ltd 2.875% 23/11/2026	200,000	199,103	0.05
China Ping An Insurance Overseas Holdings Ltd 6.125% 16/05/2034	1,200,000	1,283,732	0.33
Chongqing International Logistics Hub Park Construction Co Ltd 6.50% 12/09/2027	400,000	415,480	0.11
Cikarang Listrindo Tbk PT 5.65% 12/03/2035	2,550,000	2,584,494	0.67
City of Ulaanbaatar Mongolia 7.75% 21/08/2027	200,000	209,869	0.05
CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.75% 19/06/2049	700,000	639,893	0.17
CS Treasury Management Services B Ltd 7.00% 05/12/2031	1,147,500	1,165,040	0.30
CS Treasury Management Services P Ltd 9.00% Perpetual Callable - 05/12/2026	2,173,724	2,254,804	0.58
Dai-ichi Life Insurance Co Ltd 6.20% Perpetual Callable - 16/01/2035	3,400,000	3,564,753	0.92
Danantara Investment Management PT 5.95% 18/06/2036	2,000,000	2,004,817	0.52
Delhi International Airport Ltd 6.45% 04/06/2029	50,000	51,652	0.01

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (98.81%) (续)			
债务证券 (98.82%) (续)			
以美元计价 (90.62%) (续)			
Development Bank of Mongolia LLC 6.90% 02/07/2031	800,000	792,792	0.20
Development Bank of Mongolia LLC 8.50% 03/07/2028	1,200,000	1,295,733	0.33
Development Bank of the Philippines 2.375% 11/03/2031	2,350,000	2,132,829	0.55
Elect Global Investments Ltd 4.85% Perpetual Callable - 03/08/2026	1,000,000	773,905	0.20
Elect Global Investments Ltd 7.20% Perpetual Callable - 11/09/2030	2,750,000	2,955,508	0.76
First Abu Dhabi Bank PJSC 5.875% Perpetual Callable - 28/05/2031	3,050,000	3,057,306	0.79
Fortune Star BVI Ltd 5.05% 27/01/2027	200,000	202,713	0.05
Freeport Indonesia PT 6.20% 14/04/2052	2,100,000	2,098,217	0.54
FWD Group Holdings Ltd 5.252% 22/09/2030	2,050,000	2,069,912	0.53
FWD Group Holdings Ltd 7.635% 02/07/2031	1,050,000	1,183,427	0.30
FWD Group Holdings Ltd 7.784% 06/12/2033	1,600,000	1,826,857	0.47
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 2.16% 31/03/2034	5,278,960	4,740,295	1.22
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 2.94% 30/09/2040	2,631,621	2,208,540	0.57
Garuda Indonesia Persero Tbk PT 6.50% 28/12/2031	1,443,174	1,261,943	0.32
GC Treasury Center Co Ltd 7.125% Perpetual Callable - 10/03/2035	900,000	914,309	0.24
GLP Pte Ltd 7.865% Perpetual Callable - 17/11/2026	700,000	407,604	0.10
Gohl Capital Holdings Ltd 7.625% Perpetual Callable - 29/10/2031	1,200,000	1,178,402	0.30

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (98.81%) (续)			
债务证券 (98.82%) (续)			
以美元计价 (90.62%) (续)			
Gohl Capital Holdings Ltd 8.30% Perpetual Callable - 29/04/2036	1,500,000	1,472,797	0.38
Golomt Bank 7.95% 14/05/2029	1,000,000	1,017,649	0.26
Great Eastern Life Assurance Co Ltd 5.398% Perpetual Callable - 22/01/2032	6,500,000	6,656,138	1.71
Greenko Power II Ltd 4.30% 13/12/2028	394,625	378,512	0.10
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd 7.25% 27/09/2028	591,000	607,330	0.16
HKT Capital Ltd 5.125% 10/06/2036	3,300,000	3,268,022	0.84
Hong Kong JY Flower Ltd 8.50% 20/08/2026	300,000	309,216	0.08
Hongkong International Qingdao Co Ltd 5.40% 09/04/2028	2,500,000	2,553,925	0.66
Hongkong International Qingdao Co Ltd 5.75% 12/09/2027	1,200,000	1,234,260	0.32
Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd 5.25% 14/07/2033	600,000	628,677	0.16
HSBC Holdings PLC 6.75% Perpetual Callable - 18/11/2032	2,400,000	2,436,774	0.63
HSBC Holdings PLC 7.00% Perpetual Callable - 24/09/2035	2,500,000	2,614,703	0.67
Huangshi State-owned Assets Management Co Ltd 7.00% 24/10/2027	200,000	203,936	0.05
IIFL Finance Ltd 7.60% 10/09/2029	1,400,000	1,416,483	0.36
IIFL Finance Ltd 8.75% 24/07/2028	500,000	535,260	0.14
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT 4.745% 09/06/2051	4,875,000	3,973,172	1.02
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT 4.805% 27/04/2052	1,100,000	904,444	0.23
Indonesia Asahan Aluminium PT / Mineral Industri Indonesia Persero PT 5.45% 15/05/2030	1,450,000	1,471,930	0.38

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (98.81%) (续)			
债务证券 (98.82%) (续)			
以美元计价 (90.62%) (续)			
Indonesia Asahan Aluminium PT / Mineral Industri Indonesia Persero PT 5.80% 15/05/2050	5,300,000	5,045,553	1.30
Indonesia Asahan Aluminium PT / Mineral Industri Indonesia Persero PT 6.53% 15/11/2028	200,000	208,485	0.05
Indonesia Asahan Aluminium PT / Mineral Industri Indonesia Persero PT 6.757% 15/11/2048	500,000	530,012	0.14
IOI Investment L Bhd 3.375% 02/11/2031	3,580,000	3,302,447	0.85
JAPFA Pte Ltd 7.95% 12/05/2031	1,200,000	1,214,893	0.31
Jinkai Investment Holdings Ltd 0.00% 05/02/2031	1,200,000	1,082,040	0.28
JSW Hydro Energy Ltd 4.125% 18/05/2031	1,930,875	1,808,413	0.47
JSW Infrastructure Ltd 4.95% 21/01/2029	1,700,000	1,721,913	0.44
Karoon USA Finance Inc 10.50% 14/05/2029	1,100,000	1,149,806	0.30
Kioxia Holdings Corp 6.625% 24/07/2033	3,250,000	3,506,010	0.90
Kuaishou Technology 4.75% 22/01/2036	5,200,000	5,099,896	1.31
Lenovo Group Ltd 0.00% 25/06/2033	600,000	578,916	0.15
LG Energy Solution Ltd 5.875% 02/04/2036	8,000,000	8,213,074	2.11
LG Energy Solution Ltd FRN 02/04/2031	1,400,000	1,429,786	0.37
Majapahit Holding BV 7.875% 29/06/2037	1,000,000	1,143,656	0.29
Medco Maple Tree Pte Ltd 8.96% 27/04/2029	250,000	262,002	0.07
Mega Advance Investments Ltd 6.375% 12/05/2041	4,500,000	4,943,867	1.27
Meiji Yasuda Life Insurance Co 6.10% 11/06/2055	2,000,000	2,032,778	0.52

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产 净值 百分比
上市/挂牌投资 (98.81%) (续)			
债务证券 (98.82%) (续)			
以美元计价 (90.62%) (续)			
Meituan 5.125% 05/11/2035	7,800,000	7,597,997	1.96
Melco Resorts Finance Ltd 5.375% 04/12/2029	300,000	293,715	0.08
Melco Resorts Finance Ltd 6.50% 24/09/2033	1,900,000	1,899,684	0.49
Melco Resorts Finance Ltd 7.625% 17/04/2032	350,000	364,316	0.09
Minejesa Capital BV 4.625% 10/08/2030	5,029,750	5,053,413	1.30
Minejesa Capital BV 5.625% 10/08/2037	5,450,000	5,322,695	1.37
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 6.35% Perpetual Callable - 15/01/2036	2,500,000	2,571,876	0.66
Mong Duong Finance Holdings BV 5.125% 07/05/2029	547,597	545,810	0.14
Mongolian Mining Corp 8.44% 03/04/2030	950,000	990,348	0.26
MTR Corp CI Ltd 5.625% Perpetual Callable - 24/09/2035	7,300,000	7,537,350	1.94
Muangthai Capital PCL 6.875% 30/09/2028	300,000	306,864	0.08
Muangthai Capital PCL 7.55% 21/07/2030	1,750,000	1,838,542	0.47
Nanyang Commercial Bank Ltd 6.00% 06/08/2034	2,200,000	2,301,347	0.59
New World China Land Ltd 4.75% 23/01/2027	600,000	593,140	0.15
Nickel Industries Ltd 9.00% 30/09/2030	1,700,000	1,784,218	0.46
Nippon Life Insurance Co 6.50% 30/04/2055	1,900,000	2,015,090	0.52
NWD Finance BVI Ltd 12.179% Perpetual Callable - 01/08/2026	1,300,000	1,214,551	0.31
NWD MTN Ltd 4.125% 18/07/2029	1,500,000	1,317,161	0.34
NWD MTN Ltd 4.50% 19/05/2030	600,000	502,656	0.13

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (98.81%) (续)			
债务证券 (98.82%) (续)			
以美元计价 (90.62%) (续)			
Pakistan Global Sukuk Programme Co Ltd 7.95% 31/01/2029	1,400,000	1,486,276	0.38
Pakistan Government International Bond 7.375% 08/04/2031	1,000,000	1,025,173	0.26
Pakistan Government International Bond 8.875% 08/04/2051	1,000,000	1,030,652	0.27
Panther Ventures Ltd 3.50% Perpetual Callable - 01/08/2026	4,200,000	2,490,999	0.64
Panther Ventures Ltd 3.80% Perpetual Callable - 03/08/2026	3,406,000	2,202,414	0.57
Pertamina Persero PT 4.15% 25/02/2060	275,000	205,938	0.05
Pertamina Persero PT 4.70% 30/07/2049	325,000	276,823	0.07
Pertamina Persero PT 6.45% 30/05/2044	450,000	461,603	0.12
Pertamina Persero PT 6.50% 27/05/2041	1,550,000	1,616,028	0.42
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 5.25% 15/05/2047	600,000	524,777	0.14
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 5.25% 24/10/2042	300,000	270,330	0.07
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 5.45% 03/02/2036	3,800,000	3,737,701	0.96
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 6.15% 21/05/2048	3,000,000	2,903,080	0.75
Petronas Capital Ltd 5.34% 03/04/2035	1,700,000	1,771,236	0.46
Phoenix Lead Ltd 4.85% Perpetual Callable - 23/08/2026	900,000	762,556	0.20
Piramal Finance Ltd 7.80% 29/01/2028	400,000	421,437	0.11
PLDT Inc 3.45% 23/06/2050	6,500,000	4,562,588	1.17
Posco International Corp 5.125% 29/06/2031	4,000,000	3,992,499	1.03

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (98.81%) (续)			
债务证券 (98.82%) (续)			
以美元计价 (90.62%) (续)			
Power Finance Corp Ltd 3.35% 16/05/2031	4,100,000	3,806,143	0.98
Power Finance Corp Ltd 5.32% 30/06/2031	2,000,000	2,013,636	0.52
QIC Cayman Ltd 6.15% Perpetual Callable - 10/04/2031	3,300,000	3,345,317	0.86
Reliance Industries Ltd 3.75% 12/01/2062	2,950,000	2,131,446	0.55
Reliance Industries Ltd 4.875% 10/02/2045	550,000	515,325	0.13
Reliance Industries Ltd 6.25% 19/10/2040	1,300,000	1,428,167	0.37
ReNew Wind Energy AP2 / ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries 4.50% 14/07/2028	950,000	939,042	0.24
RLGH Finance Bermuda Ltd 6.875% Perpetual Callable - 19/05/2032	2,500,000	2,527,152	0.65
SAEL/SPREPL/SSSPL/JGPEPL/SKREP L/UBEPL 7.80% 31/07/2031	271,890	286,169	0.07
Sammaan Capital Ltd 7.50% 16/10/2030	400,000	411,534	0.11
Sands China Ltd 2.85% 08/03/2029	900,000	860,459	0.22
Sands China Ltd 3.25% 08/08/2031	7,200,000	6,634,942	1.71
Sands China Ltd 4.375% 18/06/2030	400,000	388,560	0.10
Sands China Ltd 5.40% 08/08/2028	1,000,000	1,029,050	0.26
Sarana Multi Infrastruktur PT 5.00% 13/05/2031	2,600,000	2,584,183	0.67
Science City Guangzhou Investment Group Co Ltd 5.75% 22/04/2027	900,000	917,497	0.24
Shriram Finance Ltd 6.15% 03/04/2028	4,700,000	4,844,635	1.25
SJM International Ltd 6.50% 15/01/2031	600,000	587,755	0.15
SoftBank Group Corp 6.875% Perpetual Callable - 19/07/2027	900,000	927,007	0.24
SoftBank Group Corp 7.625% 29/04/2061	600,000	586,891	0.15

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (98.81%) (续)			
债务证券 (98.82%) (续)			
以美元计价 (90.62%) (续)			
Sorik Marapi Geothermal Power PT 7.75% 05/08/2031	1,213,290	1,259,820	0.32
Sri Lanka Government International Bond 3.10% 15/01/2030	900,000	926,302	0.24
Sri Lanka Government International Bond 3.35% 15/03/2033	1,950,000	1,889,148	0.49
Sri Lanka Government International Bond 3.60% 15/02/2038	1,450,000	1,479,841	0.38
Sri Lanka Government International Bond 3.60% 15/05/2036	1,500,000	1,513,560	0.39
Sri Lanka Government International Bond 4.00% 15/04/2028	583,000	568,451	0.15
Standard Chartered PLC 2.678% 29/06/2032	3,050,000	2,736,548	0.70
Standard Chartered PLC 5.243% 13/01/2037	5,100,000	5,146,804	1.33
Standard Chartered PLC 7.00% Perpetual Callable - 08/06/2033	1,950,000	1,971,552	0.51
Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4.85% 14/10/2038	3,700,000	3,534,438	0.91
State Bank JSC 8.90% 25/09/2028	400,000	411,845	0.11
Studio City Co Ltd 6.125% 15/05/2031	1,000,000	998,966	0.26
Studio City Finance Ltd 5.00% 15/01/2029	1,050,000	1,029,552	0.27
Studio City Finance Ltd 6.50% 15/01/2028	200,000	205,786	0.05
Sumitomo Life Insurance Co 5.875% 10/09/2055	2,600,000	2,640,156	0.68
Summit Digitel Infrastructure Ltd 2.875% 12/08/2031	350,000	319,200	0.08
Tata Capital Ltd 5.389% 21/07/2028	3,200,000	3,295,716	0.85
Tencent Holdings Ltd 3.24% 03/06/2050	850,000	588,056	0.15
Tencent Holdings Ltd 3.68% 22/04/2041	1,300,000	1,099,596	0.28
Tencent Holdings Ltd 3.84% 22/04/2051	3,700,000	2,854,069	0.73

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产 净值 百分比
上市/挂牌投资 (98.81%) (续)			
债务证券 (98.82%) (续)			
以美元计价 (90.62%) (续)			
Tencent Holdings Ltd 3.925% 19/01/2038	1,050,000	965,446	0.25
Thaioil Treasury Center Co Ltd 6.10% Perpetual Callable - 15/01/2031	1,000,000	1,013,438	0.26
Trade & Development Bank of Mongolia LLC 8.50% 23/12/2027	1,200,000	1,213,343	0.31
Tsetsens Mining And Energy LLC 11.375% 05/02/2031	1,550,000	1,699,547	0.44
UPL Corp Ltd 4.625% 16/06/2030	750,000	698,038	0.18
Varanasi Aurangabad Nh-2 Tollway Pvt Ltd 5.90% 28/02/2034	2,985,000	3,115,328	0.80
Vedanta Resources Finance II PLC 10.25% 03/06/2028	250,000	258,476	0.07
Vedanta Resources Finance II PLC 10.875% 17/09/2029	900,000	986,307	0.25
Vedanta Resources Finance II PLC 11.25% 03/12/2031	300,000	337,314	0.09
Vedanta Resources Finance II PLC 7.00% 13/07/2032	950,000	948,157	0.24
Vedanta Resources Finance II PLC 7.375% 13/07/2034	1,200,000	1,195,332	0.31
Vedanta Resources Finance II PLC 7.75% 13/07/2037	3,100,000	3,086,112	0.79
Vedanta Resources Finance II PLC 9.475% 24/07/2030	300,000	334,755	0.09
Vedanta Resources Finance II PLC 9.85% 24/04/2033	1,500,000	1,668,333	0.43
West China Cement Ltd 9.90% 04/12/2028	900,000	800,303	0.21
Woori Bank 5.125% 06/08/2028	200,000	205,402	0.05
Woori Bank 6.375% Perpetual Callable - 24/07/2029	7,300,000	7,760,937	2.00
Wynn Macau Ltd 5.125% 15/12/2029	900,000	880,657	0.23

投资报告

于 2026 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	市价 美元	占净资产净值 百分比
上市/挂牌投资 (98.81%) (续)			
债务证券 (98.82%) (续)			
以美元计价 (90.62%) (续)			
Wynn Macau Ltd 6.75% 15/02/2034	2,300,000	2,347,012	0.60
债务证券总额		383,742,819	98.82

标的资产				占净资产净值百分比	
	交易对手	合约数量	公允价值 美元		
债券期货 (-0.03%)					
美国 (-0.03%)					
US 10Yr Note (CBT) Future 21/09/26	US Treasury 10 Year Note	花旗银行, 香港	(244)	(57,141)	(0.02)
US Ultra Bond (CBT) Future 21/09/26	US Ultra Bond (CBT) Future	花旗银行, 香港	(44)	(50,188)	(0.01)
债券期货总额			(107,329)	(0.03)	

投资报告

于 2026 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)

	交易对手	未平仓合约的名义 金额	公允价值 美元	占净资产 净值 百分比
上市/挂牌投资 (98.81%) (续)				
信贷违约掉期 (0.02%)				
ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED~L48~ 46 600,000.00 USD 10/02/2025 20/12/2029	花旗银行, 香 港	美元 600,000	7,154	0.00
ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED~L48~ 60 3,000,000.00 USD 19/08/2025 20/06/2030	花旗银行, 香 港	美元 3,000,000	35,768	0.01
CCFAMC IV CO LTD~L48~ 59 2,500,000.00 USD 18/08/2025 20/06/2030	花旗银行, 香 港	美元 2,500,000	(6,454)	(0.00)
SK HYNIX INC~L48~ 71 4,700,000.00 USD 05/06/2026 20/06/2031	花旗银行, 香 港	美元 4,700,000	54,843	0.01
信贷违约掉期总额			91,311	0.02
投资总额			383,726,801	98.81

投资报告

于 2026 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)

标的资产	交易对手	未平仓合约的名义金额	公允价值 美元	占净 资产 净值 百分 比
外汇远期合约(0.17%)				
买入 澳元/卖出 美元	花旗银行, 香港	澳元 4,113,050	15,264	0.00
		智利比绍		
买入 智利比绍/卖出 美元	花旗银行, 香港	2,200,000,000	(75,115)	(0.02)
		智利比绍		
买入 智利比绍/卖出 美元	花旗银行, 香港	2,200,000,000	(14,301)	(0.00)
买入 印度尼西亚盾/卖出 美元	花旗银行, 香港	印度尼西亚盾 90,000,000,000	10,566	0.00
买入 墨西哥比绍/卖出 美元	花旗银行, 香港	墨西哥比绍 90,000,000	19,244	0.00
买入 新西兰元/卖出 美元	花旗银行, 香港	新西兰元 8,200,000	35,143	0.01
买入 菲律宾比绍/卖出 美元	花旗银行, 香港	菲律宾比绍 150,000,000	218	0.00
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	人民币 34,610,082	19,671	0.00
		人民币		
买入 人民币/卖出 美元	花旗银行, 香港	1,086,952,638	616,340	0.16
买入 泰铢/卖出 美元	花旗银行, 香港	泰铢 80,000,000	877	0.00
买入 美元/卖出 澳元	花旗银行, 香港	美元 3,445,035	(16,941)	(0.00)
买入 美元/卖出 英镑	花旗银行, 香港	美元 6,597,901	(38,200)	(0.01)
买入 美元/卖出 智利比绍	花旗银行, 香港	美元 2,385,238	438	0.00
买入 美元/卖出 欧元	花旗银行, 香港	美元 5,824,474	(14,169)	(0.00)
买入 美元/卖出 欧元	花旗银行, 香港	美元 1,480,823	(7,395)	(0.00)

投资报告

于 2026 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)

标的资产	交易对手	未平仓合约的名义金 额	公允价值 美元	占净 资产 净值 百分 比
外汇远期合约(0.17%) (续)				
买入 美元/卖出 印度尼西亚 亚盾	花旗银行, 香港	美元 5,128,468	94,768	0.02
买入 美元/卖出 印度尼西亚 亚盾	花旗银行, 香港	美元 5,006,592	(11,808)	(0.00)
买入 美元/卖出 菲律宾比 绍	花旗银行, 香港	美元 2,434,670	(9,580)	(0.00)
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行, 香港	美元 4,268,662	(12,376)	(0.00)
买入 美元/卖出 人民币	花旗银行, 香港	美元 150,182	(382)	(0.00)
买入 美元/卖出 泰铢	花旗银行, 香港	美元 2,453,611	32,891	0.01
外汇远期合约总额			645,153	0.17
其他净资产			3,979,018	1.02
净资产总额			388,350,972	100.00
投资总额, 按成本计算			380,357,114	

投资报告

于 2026 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

	占净资产净值百分比	
	于 2026 年 6 月 30 日	于 2025 年 12 月 31 日
债务证券		
港元	0.64	1.03
欧元	—	0.52
人民币	0.38	0.28
美元	100.41	97.49
债券期货		
美国	(0.04)	(0.00)
信贷违约掉期	0.04	(0.00)
外汇远期合约	0.13	0.14
	<u>101.56</u>	<u>99.46</u>

投资报告

于 2026 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

	占净资产净值百分比	
	于 2026 年 6 月 30 日	于 2025 年 12 月 31 日
股票		
澳大利亚	3.64	4.11
中国	2.97	1.05
香港	4.00	8.49
印度	0.50	1.62
韩国	13.67	8.38
新加坡	2.16	1.76
台湾	9.01	11.43
菲律宾	1.18	0.99
美国	5.18	1.41
债务证券		
美元	6.52	6.94
投资基金		
香港	47.79	49.38
房地产投资信托基金		
澳大利亚	—	0.63
外汇远期合约	0.16	0.01
	<u>96.78</u>	<u>96.20</u>

投资报告

于 2026 年 6 月 30 日（未经审计）（续）

投资组合变动表（续）

东亚联丰亚洲策略债券基金

	占净资产净值百分比	
	于 2026 年 6 月 30 日	于 2025 年 12 月 31 日
债务证券		
澳元	0.92	—
欧元	1.91	1.42
港元	0.58	0.90
人民币	3.00	2.44
英镑	1.79	0.46
美元	90.62	94.25
债券期货		
美国	(0.03)	0.02
信贷违约掉期	0.02	(0.00)
外汇远期合约	0.17	0.06
	<u>98.98</u>	<u>99.55</u>

全面收益表
截至 2026 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	
	2026 美元	2025 美元	2026 美元	2025 美元
收入				
股息收入	-	-	1,124,073	978,713
银行存款利息	93,705	156,928	12,695	23,630
其他投资收入	382	7,762	10,503	257,341
投资的净变现利润/(亏损)	17,679,126	7,324,517	15,153,690	4,294,265
投资的未变现(亏损)/利润的净变动	(4,713,299)	1,760,630	23,168,090	2,109,595
外汇((亏损)/利润)	(30,411)	(74,665)	(644,555)	857,005
投资收入总额	13,029,503	9,175,172	38,824,496	8,520,549
支出				
投资管理费	1,678,922	1,652,040	858,574	597,777
受托人费用	152,476	154,803	88,845	64,047
保管费及银行费用	16,728	17,482	14,067	11,201
审计师酬金	7,225	5,918	7,225	5,918
基金登记机构费用	35,688	35,136	22,830	19,255
基金产品设立前费用	-	-	-	-
行政服务费	77,224	18,489	35,261	8,536
印刷及出版费用	-	2,018	94	498
监管费	313	981	659	789
法律及专业服务费用	1,096	6,616	1,425	4,873
交易成本	2,215	1,436	116,902	126,946
利息费用	3,381	1,320	338	1,955
其他营运费用	28,236	32,344	12,478	8,567
	2,003,504	1,928,583	1,158,698	850,362
计算融资成本前的利润	11,025,999	7,246,589	37,665,798	7,670,187
向单位持有人分派	(8,597,393)	(9,729,075)	(3,432,701)	(2,233,941)
税前(亏损)/利润	2,428,606	(2,482,486)	34,233,097	5,436,246
税项(包括预扣税)	-	-	(36,203)	(53,379)
年内(损失)/利润及全面收益总额	2,428,606	(2,482,486)	34,196,894	5,382,867

全面收益表
截至 2026 年 6 月 30 日止期间 (未经审计) (续)

	东亚联丰 亚洲策略债券基金	
	2026 美元	2025 美元
收入		
股息收入	-	128
银行存款利息	98,865	44,725
其他投资收入	847	4,916
投资的净变现利润/(亏损)	15,705,000	1,149,282
投资的未变现(亏损)/利润的净变动	(6,026,759)	1,909,690
外汇((亏损)/利润)	196,122	(29,756)
投资收入总额	9,974,075	3,078,985
支出		
投资管理费	2,375,074	424,428
受托人费用	296,884	53,054
保管费及银行费用	27,011	9,283
审计师酬金	8,385	5,918
基金登记机构费用	50,843	18,323
基金产品设立前费用	-	-
行政服务费	118,625	5,977
印刷及出版费用	-	550
监管费	960	702
法律及专业服务费用	1,150	937
交易成本	13,397	1,304
利息费用	3,530	322
其他营运费用	50,830	4,236
	2,946,689	525,034
计算融资成本前的利润	7,027,386	2,553,951
向单位持有人分派	(3,849,618)	(1,001,831)
税前 (亏损) / 利润	3,177,768	1,552,120
税项 (包括预扣税)	-	-
年内 (损失) / 利润及全面收益总额	3,177,768	1,552,120

资产负债表 于 2026 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	
	2026 年 6 月 30 日 美元	2025 年 12 月 31 日 美元	2026 年 6 月 30 日 美元	2025 年 12 月 31 日 美元
资产				
投资	237,497,898	338,769,969	146,781,545	90,932,440
应收外汇远期合约款项	311,193	488,059	239,082	9,258
应收股息	—	—	120,890	45,807
出售投资应收款项	6,604,921	7,528,937	8,095,737	1,893,813
认购基金份额的应收款项	151,175	535,435	644,591	35,052
银行利息的应收款项	122	—	—	—
其他应收款项	—	—	569	31,817
从经纪的应收款项	376,674	417,355	6,947	6,787
银行结余	3,444,707	3,805,581	5,252,625	4,033,444
资产总值	248,386,690	351,545,336	161,141,986	96,988,418
负债				
赎回基金份额的应付款项	1,450,639	5,953,870	746,131	375,075
应付外汇远期合约款项	—	—	—	—
应付购入投资款项	12,460,561	3,965,606	8,214,073	1,893,812
应计费用及其他应付款项	336,412	501,590	269,646	192,021
负债总值 (不包括基金份额持有人应占的资产净值)	14,247,612	10,421,066	9,229,850	2,460,908
归属于单位持有人的净资产				
金融负债	234,139,078	341,124,270	151,912,136	94,527,510

资产负债表于 2026 年 6 月 30 日（未经审计）（续）

	东亚联丰 亚洲策略债券基金	
	2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	美元	美元
资产		
投资	383,726,801	408,664,957
应收外汇远期合约款项	645,153	255,909
应收股息	-	-
出售投资应收款项	7,920,964	80,072
认购基金份额的应收款项	-	1,890,893
银行利息的应收款项	642	-
其他应收款项	-	-
从经纪的应收款项	1,422,421	955,786
银行结余	10,058,915	1,756,011
资产总值	403,774,896	413,603,628
负债		
赎回基金份额的应付款项	898,192	2,229,186
应付外汇远期合约款项	-	-
应付购入投资款项	13,991,875	79,900
应计费用及其他应付款项	533,857	548,664
负债总值 (不包括基金份额持有人应占的资产净值)	15,423,924	2,857,750
归属于单位持有人的净资产		
金融负债	388,350,972	410,745,878

资产负债表于 2026 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	
	2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日	2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
<u>A 类别累积 (美元)</u>				
份额发行数量	794,137.30	783,800.57	199,824.99	74,950.95
财务报告中每份额资产净值(1)	25.10	24.28	22.33	16.40
<u>A 类别累积 (人民币)</u>				
份额发行数量	633,491.39	1,268,504.49	—	—
财务报告中每份额资产净值(1)	14.96	14.47	—	—
<u>A 类别累积对冲 (欧元)</u>				
份额发行数量	142.51	142.51	—	—
财务报告中每份额资产净值(1)	11.32	11.36	—	—
<u>A 类别累积对冲 (人民币)</u>				
份额发行数量	1,996,881.38	3,202,555.92	346,905.51	17,451.38
财务报告中每份额资产净值(1)	15.10	14.41	24.25	17.55
<u>A 类别分派 (美元)</u>				
份额发行数量	3,324,958.52	3,957,415.37	3,881,795.89	3,828,469.28
财务报告中每份额资产净值(1)	8.40	8.46	11.05	8.37
<u>A 类别分派 (港元)</u>				
份额发行数量	—	—	3,729,356.63	2,950,118.02
财务报告中每份额资产净值(1)	—	—	14.24	10.78
<u>A 类别分派 (人民币)</u>				
份额发行数量	3,011,423.93	5,887,913.83	—	—
财务报告中每份额资产净值(1)	13.20	13.31	—	—
<u>A 类别分派对冲 (澳元)</u>				
份额发行数量	606,970.73	667,020.12	1,934,380.65	2,301,227.93
财务报告中每份额资产净值(1)	4.05	3.92	5.81	4.24
<u>A 类别分派对冲 (欧元)</u>				
份额发行数量	—	—	393.90	393.90
财务报告中每份额资产净值(1)	—	—	11.83	9.21
<u>A 类别分派对冲 (新西兰元)</u>				
份额发行数量	—	—	877,491.26	644,084.07
财务报告中每份额资产净值(1)	—	—	4.92	3.79
<u>A 类别分派对冲 (人民币)</u>				
份额发行数量	4,371,030.21	6,880,106.88	2,006,417.04	1,669,908.06
财务报告中每份额资产净值(1)	9.12	8.97	13.67	10.10
<u>H 类别分派 (港元)</u>				
份额发行数量	51,284,795.95	54,593,413.54	—	—
财务报告中每份额资产净值(1)	0.86	0.87	—	—
<u>I 类别累积</u>				
份额发行数量	19,305.35	19,305.35	—	—
财务报告中每份额资产净值(1)	11.62	11.22	—	—
<u>I 类别分派 (港元)</u>				
份额发行数量	2,288,010.83	3,929,799.48	—	—
财务报告中每份额资产净值(1)	8.16	8.20	—	—

资产负债表 于 2026 年 6 月 30 日 (未经审计) (续)

	东亚联丰 亚洲策略债券基金	
<u>A 类别累积 (美元)</u>		
份额发行数量	47,545.66	73,493.76
财务报告中每份额资产净值(1)	12.84	12.72
<u>A 类别累积 (人民币)</u>		
份额发行数量	7,011,992.87	14,737,394.44
财务报告中每份额资产净值(1)	14.89	14.75
<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(1)	-	-
<u>A 类别累积对冲 (人民币)</u>		
份额发行数量	11,090,212.20	5,264,345.78
财务报告中每份额资产净值(1)	14.31	13.97
<u>A 类别分派 (美元)</u>		
份额发行数量	2,585,905.19	2,728,776.92
财务报告中每份额资产净值(1)	7.48	7.65
<u>A 类别分派 (港元)</u>		
份额发行数量	7,286,615.02	7,526,101.88
财务报告中每份额资产净值(1)	9.63	9.85
<u>A 类别分派 (人民币)</u>		
份额发行数量	-	-
财务报告中每份额资产净值(1)	-	-
<u>A 类别分派对冲 (澳元)</u>		
份额发行数量	576,081.97	833,618.31
财务报告中每份额资产净值(1)	4.74	4.66
<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(1)	-	-
<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(1)	-	-
<u>A 类别分派对冲 (人民币)</u>		
份额发行数量	487,255.53	488,334.19
财务报告中每份额资产净值(1)	10.42	10.39
<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(1)	-	-
<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(1)	-	-
<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(1)	-	-

资产负债表 于 2026 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	
	2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日	2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
<u>N 类别分派</u>				
份额发行数量	126,696.72	126,696.72	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽¹⁾	9.80	9.81	-	-
	东亚联丰 亚洲策略债券基金			
	2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日		
<u>N 类别分派</u>				
份额发行数量	2,780,506.24	1,494,271.34		
财务报告中每份额资产净值 ⁽¹⁾	9.74	9.91		

⁽¹⁾ 根据说明书，每单位资产净值向下调整至小数点后两位。

基金份额持有人应占资产净值变动表
截至 2026 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	
	2026 美元	2025 美元	2026 美元	2025 美元
于 1 月 1 日的结余	341,124,270	182,449,483	94,527,510	88,507,268
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 / 期内认购基金份额	40,428,287	229,388,750	58,293,656	1,836,273
年内 / 期内赎回基金份额	(149,842,085)	(64,465,539)	(35,105,924)	(7,013,973)
与所有者 / 基金份额持有人的交易总额	(109,413,798)	164,923,211	23,187,732	(5,177,700)
年内 (损失) / 利润及全面收益总额	2,428,606	(2,482,486)	34,196,894	5,382,867
于 6 月 30 日的结余	234,139,078	344,890,208	151,912,136	88,712,435

	东亚联丰 亚洲策略债券基金	
	2026 美元	2025 美元
于 1 月 1 日的结余	410,745,878	47,967,768
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 / 期内认购基金份额	212,657,623	167,781,923
年内 / 期内赎回基金份额	(238,230,297)	(46,744,504)
与所有者 / 基金份额持有人的交易总额	(25,572,674)	121,037,419
年内 (损失) / 利润及全面收益总额	3,177,768	1,552,120
于 6 月 30 日的结余	388,350,972	170,557,307

基金份额持有人应占资产净值变动表
截至 2026 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	
	2026	2025	2026	2025
A 类别累积 (美元)				
年初已发行份额数目	783,800.57	850,218.77	74,950.95	96,352.54
年内已发行份额	208,843.20	299,831.87	155,359.14	8.42
年内已赎回份额	(198,506.47)	(258,030.55)	(30,485.10)	(4,383.89)
年末已发行份额数目	794,137.30	892,020.09	199,824.99	91,977.07
A 类别累积 (人民币)				
年初已发行份额数目	1,268,504.49	-	-	-
年内已发行份额	440,238.98	757,612.57	-	-
年内已赎回份额	(1,075,252.08)	(43,836.30)	-	-
年末已发行份额数目	633,491.39	713,776.27	-	-
A 类别累积对冲 (欧元)				
年初已发行份额数目	142.51	5,142.51	-	5,000.00
年内已发行份额	-	-	-	-
年内已赎回份额	-	(5,000.00)	-	(5,000.00)
年末已发行份额数目	142.51	142.51	-	-
A 类别累积对冲 (人民币)				
年初已发行份额数目	3,202,555.92	1,065,224.08	17,451.38	8,245.14
年内已发行份额	1,131,992.74	3,515,850.96	811,782.06	12,316.75
年内已赎回份额	(2,337,667.28)	(2,494,057.03)	(482,327.93)	(4,401.50)
年末已发行份额数目	1,996,881.38	2,087,018.01	346,905.51	16,160.39
A 类别分派 (美元)				
年初已发行份额数目	3,957,415.37	3,651,045.69	3,828,469.28	3,993,520.39
年内已发行份额	227,653.55	548,868.26	550,543.11	31,448.04
年内已赎回份额	(860,110.40)	(199,962.24)	(497,216.50)	(130,037.69)
年末已发行份额数目	3,324,958.52	3,999,951.71	3,881,795.89	3,894,930.74
A 类别分派 (港元)				
年初已发行份额数目	-	-	2,950,118.02	3,422,268.23
年内已发行份额	-	-	1,541,055.12	151,723.07
年内已赎回份额	-	-	(761,816.51)	(411,010.34)
年末已发行份额数目	-	-	3,729,356.63	3,162,980.96
A 类别分派 (人民币)				
年初已发行份额数目	5,887,913.83	-	-	-
年内已发行份额	97,813.59	7,368,342.09	-	-
年内已赎回份额	(2,974,303.49)	(293,784.35)	-	-
年末已发行份额数目	3,011,423.93	7,074,557.74	-	-

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

	东亚联丰 亚洲策略债券基金 2026	2025
A 类别累积 (美元)		
年初已发行份额数目	73,493.76	16,475.21
年内已发行份额	11,862.97	45,848.29
年内已赎回份额	(37,811.07)	(18,471.88)
年末已发行份额数目	47,545.66	43,851.62
A 类别累积 (人民币)		
年初已发行份额数目	14,737,394.44	1,185,073.35
年内已发行份额	4,111,056.27	7,483,184.80
年内已赎回份额	(11,836,457.84)	(2,060,887.73)
年末已发行份额数目	7,011,992.87	6,607,370.42
A 类别累积对冲 (欧元)		
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 类别累积对冲 (人民币)		
年初已发行份额数目	5,264,345.78	292,955.87
年内已发行份额	9,333,036.04	1,401,031.75
年内已赎回份额	(3,507,169.62)	(1,246,654.38)
年末已发行份额数目	11,090,212.20	447,333.24
A 类别分派 (美元)		
年初已发行份额数目	2,728,776.92	1,177,985.25
年内已发行份额	431,520.53	2,545,328.22
年内已赎回份额	(574,392.26)	(24,474.81)
年末已发行份额数目	2,585,905.19	3,698,838.66
A 类别分派 (港元)		
年初已发行份额数目	7,526,101.88	1,350,684.15
年内已发行份额	419,188.60	2,641,552.63
年内已赎回份额	(658,675.46)	(135,075.29)
年末已发行份额数目	7,286,615.02	3,857,161.49
A 类别分派 (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	-	-

基金份额持有人应占资产净值变动表
截至 2026 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	
	2026	2025	2026	2025
A 类别分派对冲 (澳元)				
年初已发行份额数目	667,020.12	460,476.28	2,301,227.93	2,570,968.47
年内已发行份额	11,049.01	203,113.60	194,575.06	-
年内已赎回份额	(71,098.40)	(38,099.77)	(561,422.34)	(150,305.43)
年末已发行份额数目	606,970.73	625,490.11	1,934,380.65	2,420,663.04
A 类别分派对冲 (欧元)				
年初已发行份额数目	-	-	393.90	5,393.90
年内已发行份额	-	-	-	-
年内已赎回份额	-	-	-	(5,000.00)
年末已发行份额数目	-	-	393.90	393.90
A 类别分派对冲 (新西兰元)				
年初已发行份额数目	-	-	644,084.07	595,112.79
年内已发行份额	-	-	315,844.74	216.90
年内已赎回份额	-	-	(82,437.55)	(44,040.90)
年末已发行份额数目	-	-	877,491.26	551,288.79
A 类别分派对冲 (人民币)				
年初已发行份额数目	6,880,106.88	4,953,469.10	1,669,908.06	2,007,059.16
年内已发行份额	95,541.62	5,023,785.34	777,556.73	9,338.54
年内已赎回份额	(2,604,618.29)	(714,162.05)	(441,047.75)	(171,657.91)
年末已发行份额数目	4,371,030.21	9,263,092.39	2,006,417.04	1,844,739.79
H 类别分派 (港元)				
年初已发行份额数目	54,593,413.54	49,680,420.21	-	-
年内已发行份额	9,263,969.32	10,283,457.52	-	-
年内已赎回份额	(12,572,586.91)	(9,429,144.66)	-	-
年末已发行份额数目	51,284,795.95	50,534,733.07	-	-
I 类别累积				
年初已发行份额数目	19,305.35	70,124.01	-	-
年内已发行份额	-	411,462.88	-	-
年内已赎回份额	-	(459,031.54)	-	-
年末已发行份额数目	19,305.35	22,555.35	-	-
I 类别分派 (港元)				
年初已发行份额数目	3,929,799.48	3,161,159.48	-	-
年内已发行份额	-	-	-	-
年内已赎回份额	(1,641,788.65)	-	-	-
年末已发行份额数目	2,288,010.83	3,161,159.48	-	-

基金份额持有人应占资产净值变动表

截至 2026 年 6 月 30 日止期间 (未经审计) (续)

	东亚联丰 亚洲策略债券基金	
	2026	2025
A 类别分派对冲 (澳元)		
年初已发行份额数目	833,618.31	501,853.58
年内已发行份额	26,400.00	-
年内已赎回份额	(283,936.34)	(56,760.16)
年末已发行份额数目	576,081.97	445,093.42
A 类别分派对冲 (欧元)		
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 (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	488,334.19	341,487.47
年内已发行份额	17,567.14	-
年内已赎回份额	(18,645.80)	(14,510.68)
年末已发行份额数目	487,255.53	326,976.79
H 类别分派 (港元)		
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	-	-
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	-	-

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

N 类别分派	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	
	2026	2025	2026	2025
年初已发行份额数目	126,696.72	-	-	-
年内已发行份额	-	-	-	-
年内已赎回份额	-	-	-	-
年末已发行份额数目	126,696.72	-	-	-

N 类别分派	东亚联丰 亚洲策略债券基金	
	2026	2025
年初已发行份额数目	1,494,271.34	-
年内已发行份额	1,286,234.90	-
年内已赎回份额	-	-
年末已发行份额数目	2,780,506.24	-

管理及行政

受托人及登记处

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