

汇丰投资信托基金 — 汇丰亚洲债券基金

2021年中期报告



HSBC Global Asset Management
汇丰 环球投资管理

汇丰亚洲债券基金
(汇丰投资信托基金之子基金)

2021 年中期报告

目录

	页数
财务状况表	1
全面收益表	3
份额持有人应占资产净值变动表	5
现金流量表	11
投资组合报表	12
投资组合变动表	39
金融衍生工具明细表	40
业绩表现记录	43
收益分配表	50
行政	53

财务状况表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

	2021 年 1 月 31 日 美元	2020 年 7 月 31 日 美元
资产		
以公允价值计入损益账的金融资产	2,661,069,057	2,330,095,730
应收利息	26,321,274	21,556,524
应收申购款	18,498,544	30,848,886
应收经纪商款项	21,259,559	33,803,884
其他应收款	2,200,000	-
现金和现金等价物	19,530,665	5,693,797
	<u>2,748,879,099</u>	<u>2,421,998,821</u>
负债		
以公允价值计入损益账的金融负债	482,792	46,033
应付赎回款	20,749,286	8,312,968
应付经纪商款项	37,088,486	52,731,316
应付税项	32,306	29,914
应付分配	5,908,644	11,805,635
其他应付款	3,854,249	2,060,903
	<u>68,115,763</u>	<u>74,986,769</u>
份额持有人应占资产净值	<u>2,680,763,336</u>	<u>2,347,012,052</u>
相当于： 金融负债	<u>2,680,763,336</u>	<u>2,347,012,052</u>
	份额	份额
已发行份额总数		
- AC 类 - 美元	995,636	881,152
- AM 类 - 港元	488,463,381	410,066,197
- AM 类 - 美元	156,253,874	146,435,936
- AMH 类 - 澳元	19,812,493	18,254,481
- AMH 类 - 欧元	1,621,975	1,267,208
- AMH 类 - 人民币	7,019,146	-
- BC 类 - 港元	59,959	18,177
- BC 类 - 人民币	150,336	135,142
- BC 类 - 美元	354,709	132,675
- BCH 类 - 人民币	736,390	503,277
- BM2 类 - 港元	352,799	69,178
- BM2 类 - 人民币	340,666	356,996

财务状况表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

	2021 年 1 月 31 日 份额	2020 年 7 月 31 日 份额
已发行份额总数 (续)		
- BM2 类 - 美元	539,898	334,134
- BM3H 类 - 澳元	93,303	69,668
- BM3H 类 - 人民币	1,869,889	725,894
- IC 类 - 美元	4,481,691	6,880,001
- ID 类 - 美元	12,592,716	2,790,102
- IM 类 - 美元	100,000	-
- ZD 类 - 美元	10,523,184	9,603,488
	美元	美元
份额净值		
- AC 类 - 美元	15.306	15.033
- AM 类 - 港元	1.350	1.348
- AM 类 - 美元	9.485	9.467
- AMH 类 - 澳元	7.654	7.147
- AMH 类 - 欧元	11.976	11.633
- AMH 类 - 人民币	1.570	-
- BC 类 - 港元	1.374	1.350
- BC 类 - 人民币	1.503	1.479
- BC 类 - 美元	10.757	10.566
- BCH 类 - 人民币	1.693	1.519
- BM2 类 - 港元	1.348	1.345
- BM2 类 - 人民币	1.476	1.474
- BM2 类 - 美元	10.520	10.502
- BM3H 类 - 澳元	8.030	7.492
- BM3H 类 - 人民币	1.621	1.497
- IC 类 - 美元	15.820	15.502
- ID 类 - 美元	10.800	10.584
- IM 类 - 美元	10.166	-
- ZD 类 - 美元	11.214	10.959

附注：中期报告执行与本子基金年度报告相同的会计政策和计算方法。

全面收益表

汇丰亚洲债券基金

截至 2021 年 1 月 31 日止期间

	2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日 美元	2019 年 8 月 1 日至 2020 年 1 月 31 日 美元
利息收入	2,202	90,527
股息收入	21,233	-
以公允价值计入损益账的金融工具的收益净值	70,532,519	90,982,813
外汇收入净值	175,027	31,400
其他收入	59,242	59,359
收入总额	70,790,223	91,164,099
管理费 ^{附注 2}	11,945,693	9,774,719
交易费用 ^{附注 1}	11,152	7,412
受托人费用 ^{附注 1}	905,682	736,971
基金注册登记机构费用 ^{附注 1}	85,800	65,706
审计师酬金	7,787	11,744
律师费及专业人员费用 ^{附注 1}	25,355	19,902
保管费、银行手续费及杂费 ^{附注 1}	111,513	107,704
总经营开支	13,092,982	10,724,158
税前经营净利润	57,697,241	80,439,941
退税/(税项)	29,443	(45,009)
收益分配前经营净利润	57,726,684	80,394,932
向份额持有人作出收益分配	(36,730,246)	(34,338,979)
本月份额持有人应占资产净值增加	20,996,438	46,055,953

全面收益表

汇丰亚洲债券基金

截至 2021 年 1 月 31 日止期间

附注 1: 在分别截至 2021 年和 2020 年 1 月 31 日止的期间, 除支付给受托人/关联人士的受托人费用和基金注册登记机构费用外, 支付给受托人/关联人士的其他相关款项如下:

	2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日 美元	2019 年 8 月 1 日至 2020 年 1 月 31 日 美元
交易费用	8,182	5,368
律师费及专业人员费用	914	7,473
保管费、银行手续费及杂费	104,639	100,271

附注 2: 在分别截至 2021 年和 2020 年 1 月 31 日止的期间, 除支付给管理人的管理费外, 未向管理人/关联人士支付任何其他款项。

份额持有人应占资产净值变动表

汇丰亚洲债券基金

截至 2021 年 1 月 31 日止期间

	2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日 美元	2019 年 8 月 1 日至 2020 年 1 月 31 日 美元
期初余额	2,347,012,052	2,215,954,265
份额持有人应占资产净值增加	20,996,438	46,055,953
份额认/申购 (不含均衡)		
- AC 类 - 美元	2,001,902	435,687
- AM 类 - 港元	326,729,644	176,237,038
- AM 类 - 美元	492,771,961	271,535,038
- AMH 类 - 澳元	57,161,464	34,650,640
- AMH 类 - 欧元	7,577,034	2,838,201
- AMH 类 - 人民币	11,113,090	-
- BC 类 - 港元	64,442	-
- BC 类 - 人民币	240,915	-
- BC 类 - 美元	2,575,250	-
- BCH 类 - 人民币	878,474	-
- BM2 类 - 港元	383,984	-
- BM2 类 - 人民币	528,046	-
- BM2 类 - 美元	2,564,530	-
- BM3H 类 - 澳元	231,351	-
- BM3H 类 - 人民币	2,024,955	-
- IC 类 - 美元	6,756,781	3,217,407
- ID 类 - 美元	104,541,869	90,219
- IM 类 - 美元	1,000,000	-
- ZD 类 - 美元	14,445,990	2,547,983
份额赎回 (不含均衡)		
- AC 类 - 美元	(279,475)	(4,064,271)
- AM 类 - 港元	(220,948,130)	(243,573,756)
- AM 类 - 美元	(399,505,597)	(392,181,907)
- AMH 类 - 澳元	(46,441,093)	(46,727,405)
- AMH 类 - 欧元	(3,438,705)	(4,611,839)
- AMH 类 - 人民币	(13,200)	-
- BC 类 - 港元	(7,906)	-
- BC 类 - 人民币	(221,038)	-
- BC 类 - 美元	(220,801)	-
- BCH 类 - 人民币	(524,974)	-
- BM2 类 - 人民币	(552,618)	-
- BM2 类 - 美元	(407,699)	-
- BM3H 类 - 澳元	(57,899)	-

份额持有人应占资产净值变动表

汇丰亚洲债券基金

截至 2021 年 1 月 31 日止期间

	2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日 美元	2019 年 8 月 1 日至 2020 年 1 月 31 日 美元
- BM3H 类 - 人民币	(211,381)	-
- IC 类 - 美元	(44,164,552)	(13,519,843)
- ZD 类 - 美元	(4,281,136)	(63,640,476)
认购和赎回均衡	439,368	(1,045,207)
	312,754,846	(277,812,491)
期末余额	2,680,763,336	1,984,197,727
	份额	份额
AC 类 - 美元份额		
期初份额数	881,152	715,027
发行份额数	133,130	32,305
赎回份额数	(18,646)	(288,300)
期末份额数	995,636	459,032
AM 类 - 港元份额		
期初份额数	410,066,197	433,423,891
发行份额数	242,767,029	134,611,851
赎回份额数	(164,369,845)	(185,697,361)
期末份额数	488,463,381	382,338,381
AM 类 - 美元份额		
期初份额数	146,435,936	138,915,808
发行份额数	52,219,914	29,578,077
赎回份额数	(42,401,976)	(42,606,917)
期末份额数	156,253,874	125,886,968

份额持有人应占资产净值变动表

汇丰亚洲债券基金

截至 2021 年 1 月 31 日止期间

	2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日 份额	2019 年 8 月 1 日至 2020 年 1 月 31 日 份额
AMH 类 - 澳元份额		
期初份额数	18,254,481	17,082,312
发行份额数	7,918,146	5,227,191
赎回份额数	(6,360,134)	(7,006,023)
期末份额数	<u>19,812,493</u>	<u>15,303,480</u>
AMH 类 - 欧元份额		
期初份额数	1,267,208	1,303,007
发行份额数	651,145	267,816
赎回份额数	(296,378)	(432,575)
期末份额数	<u>1,621,975</u>	<u>1,138,248</u>
AMH 类 - 人民币份额		
期初份额数	-	-
发行份额数	7,027,470	-
赎回份额数	(8,324)	-
期末份额数	<u>7,019,146</u>	<u>-</u>
BC 类 - 港元份额		
期初份额数	18,177	-
发行份额数	47,559	-
赎回份额数	(5,777)	-
期末份额数	<u>59,959</u>	<u>-</u>

份额持有人应占资产净值变动表

汇丰亚洲债券基金

截至 2021 年 1 月 31 日止期间

	2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日 份额	2019 年 8 月 1 日至 2020 年 1 月 31 日 份额
BC 类 - 人民币份额		
期初份额数	135,142	-
发行份额数	163,558	-
赎回份额数	(148,364)	-
期末份额数	<u>150,336</u>	<u>-</u>
BC 类 - 美元份额		
期初份额数	132,675	-
发行份额数	242,803	-
赎回份额数	(20,769)	-
期末份额数	<u>354,709</u>	<u>-</u>
BCH 类 - 人民币份额		
期初份额数	503,277	-
发行份额数	558,104	-
赎回份额数	(324,991)	-
期末份额数	<u>736,390</u>	<u>-</u>
BM2 类 - 港元份额		
期初份额数	69,178	-
发行份额数	283,621	-
赎回份额数	-	-
期末份额数	<u>352,799</u>	<u>-</u>

份额持有人应占资产净值变动表

汇丰亚洲债券基金

截至 2021 年 1 月 31 日止期间

	2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日 份额	2019 年 8 月 1 日至 2020 年 1 月 31 日 份额
BM2 类 - 人民币份额		
期初份额数	356,996	-
发行份额数	357,823	-
赎回份额数	(374,153)	-
期末份额数	340,666	-
BM2 类 - 美元份额		
期初份额数	334,134	-
发行份额数	244,281	-
赎回份额数	(38,517)	-
期末份额数	539,898	-
BM3H 类 - 澳元份额		
期初份额数	69,668	-
发行份额数	30,879	-
赎回份额数	(7,244)	-
期末份额数	93,303	-
BM3H 类 - 人民币份额		
期初份额数	725,894	-
发行份额数	1,276,534	-
赎回份额数	(132,539)	-
期末份额数	1,869,889	-

份额持有人应占资产净值变动表

汇丰亚洲债券基金

截至 2021 年 1 月 31 日止期间

	2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日 份额	2019 年 8 月 1 日至 2020 年 1 月 31 日 份额
IC 类 - 美元份额		
期初份额数	6,880,001	5,039,654
发行份额数	436,484	221,520
赎回份额数	(2,834,794)	(930,164)
期末份额数	<u>4,481,691</u>	<u>4,331,010</u>
ID 类 - 美元份额		
期初份额数	2,790,102	2,687,607
发行份额数	9,899,947	8,791
赎回份额数	(97,333)	-
期末份额数	<u>12,592,716</u>	<u>2,696,398</u>
IM 类 - 美元份额		
期初份额数	-	-
发行份额数	100,000	-
赎回份额数	-	-
期末份额数	<u>100,000</u>	<u>-</u>
ZD 类 - 美元份额		
期初份额数	9,603,488	13,287,653
发行份额数	1,312,852	239,458
赎回份额数	(393,156)	(5,990,501)
期末份额数	<u>10,523,184</u>	<u>7,536,610</u>

现金流量表

汇丰亚洲债券基金

截至 2021 年 1 月 31 日止期间

	2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日 美元	2019 年 8 月 1 日至 2020 年 1 月 31 日 美元
经营活动		
已收利息	2,677	89,326
已收股息	21,233	-
已付管理费	(11,750,572)	(10,030,135)
已付受托人费用	(890,094)	(759,782)
购买投资的付款	(1,938,335,799)	(740,657,467)
出售投资的所得款项	1,671,405,246	1,098,846,038
存放于经纪商的保证金存款	(937,226)	(327,002)
退税/已付税项	31,835	(45,200)
其他已付经营开支/已收经营收入	(624,700)	171,862
经营活动(使用)/产生的现金净额	(281,077,400)	347,287,640
融资活动		
份额发行所得款项 (含均衡)	1,046,962,476	504,945,115
份额赎回付款 (含均衡)	(709,420,971)	(785,232,344)
已付分配	(42,627,237)	(42,257,209)
融资活动产生/(使用)的现金净额	294,914,268	(322,544,438)
现金和现金等价物增加净额	13,836,868	24,743,202
期初现金和现金等价物	5,693,797	5,053,071
期末现金和现金等价物	19,530,665	29,796,273

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

	持有量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
金融资产			
债务证券			
债券			
上市投资			
百慕大			
中油燃气集团有限公司 5.5% 2023 年 1 月 25 日	5,325,000	5,500,672	0.21
华润燃气控股有限公司 4.5% 2022 年 4 月 5 日	6,000,000	6,226,980	0.23
		<u>11,727,652</u>	<u>0.44</u>
英属维尔京群岛			
AMIPEACE LTD 1.5% 2025 年 10 月 22 日	10,000,000	9,968,800	0.37
蓝星金融控股有限公司 3.5% 2021 年 9 月 30 日	5,000,000	5,046,950	0.19
CAS CAPITAL NO1 LTD 2049 年 12 月 31 日	7,880,000	7,879,842	0.29
CASTLE PEAK POWER FINANCE COMPANY LTD 2.2% 2030 年 6 月 22 日	4,841,000	4,900,109	0.18
CELESTIAL DYNASTY LTD 4.25% 2029 年 6 月 27 日	7,048,000	7,301,446	0.27
CELESTIAL MILES LTD 5.75% 永续债券	4,000,000	4,222,880	0.16
CHAMPION PATH HOLDINGS 4.5% 2026 年 1 月 27 日	6,190,000	6,357,873	0.24
CHAMPION PATH HOLDINGS 4.85% 2028 年 1 月 27 日	10,028,000	10,256,739	0.38
创光投资有限公司 4.375% 2027 年 12 月 21 日	4,000,000	4,568,120	0.17
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 1.875% 2026 年 1 月 20 日	1,566,000	1,584,620	0.06
CHINA CINDA FINANCE (2017) I LTD 4.1% 2024 年 3 月 9 日	9,000,000	9,750,240	0.36
中国华电海外 2049 年 12 月 31 日	2,551,000	2,612,428	0.10
中国华电海外发展管理有限公司 4% 永续债券	3,500,000	3,640,385	0.14

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券	持有量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (续)			
英属维尔京群岛 (续)			
中国华能集团 (香港) 财资管理控股有限公司 2.4% 2022 年 12 月 10 日	1,500,000	1,536,495	0.06
中国华能集团 (香港) 财资管理控股有限公司 3% 2029 年 12 月 10 日	7,028,000	7,399,078	0.28
中铁迅捷有限公司 3.25% 2026 年 7 月 28 日	5,500,000	5,909,530	0.22
CHINA SOUTHERN POWER GRID INTERNATIONAL FINANCE BVI 2018 CO LTD 4.25% 2028 年 9 月 18 日	4,007,000	4,634,176	0.17
CICC HK FINANCE 2016 中期票据 1.625% 2024 年 1 月 26 日	23,898,000	23,934,086	0.89
CICC HK FINANCE 2016 中期票据 1.75% 2023 年 8 月 10 日	2,417,000	2,432,541	0.09
CICC HK FINANCE 2016 中期票据 2% 2026 年 1 月 26 日	7,883,000	7,927,854	0.30
CLP POWER HONG KONG FINANCING LTD 2.125% 2030 年 6 月 30 日	6,000,000	6,089,520	0.23
CLP POWER HONG KONG FINANCING LTD 2.5% 2035 年 6 月 30 日	5,600,000	5,706,120	0.21
CMHI FINANCE (BVI) CO LTD 4.375% 2023 年 8 月 6 日	3,261,000	3,498,596	0.13
中国华能集团香港财资 2049 年 12 月 29 日	2,974,000	3,003,829	0.11
中国华能集团香港财资 2049 年 12 月 31 日	3,770,000	3,810,565	0.14
CNOOC FINANCE 2013 LTD 4.25% 2043 年 5 月 9 日	3,000,000	3,238,770	0.12
CONEMPRY RUIDNG DEVELOPMENT 1.875% 2025 年 9 月 17 日	3,967,000	4,018,373	0.15
CONEMPRY RUIDNG DEVELOPMENT 2.625% 2030 年 9 月 17 日	1,199,000	1,218,064	0.04
中远财务有限责任公司 4% 2022 年 12 月 3 日	11,550,000	12,099,087	0.45
EASTERN CREATION II INVESTMENT HOLDINGS LTD 4.15% 2021 年 12 月 4 日	6,000,000	6,155,640	0.23
EASTERN CREATION II INVESTMET 1% 2023 年 9 月 10 日	11,807,000	11,772,878	0.44
怡略有限公司 11.75% 2023 年 8 月 2 日	1,613,000	1,629,807	0.06
怡略有限公司 5.75% 2022 年 1 月 13 日	2,000,000	1,927,240	0.07

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券 上市投资 (续)	持有量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
英属维尔京群岛 (续)			
ELECT GLOBAL INVESTMENT LTD 4.85% 永 续债券 2049 年 12 月 31 日	2,152,000	2,197,149	0.08
新興清洁能源国际投资有限公司 7.5% 2021 年 2 月 27 日	1,539,000	1,542,601	0.06
FORTUNE STAR (BVI) LTD 6.75% 2023 年 7 月 2 日	3,000,000	3,173,520	0.12
FORTUNE STAR (BVI) LTD 6.85% 2024 年 7 月 2 日	4,000,000	4,261,600	0.16
FORTUNE STAR BVI LTD 5.05% 2027 年 1 月 27 日	9,472,000	9,521,065	0.35
FORTUNE STAR BVI LTD 5.95% 2025 年 10 月 19 日	8,439,000	8,869,727	0.33
FORTUNE STAR BVI LTD 5.95% 2023 年 1 月 29 日	5,000,000	5,160,550	0.19
方兴光耀有限公司 4% 2024 年 6 月 21 日	1,500,000	1,556,910	0.06
恒健国际投资有限公司 1.875% 2025 年 6 月 23 日	4,205,000	4,233,300	0.16
HKT CAPITAL NO 2 LTD 3.625% 2025 年 4 月 2 日	7,000,000	7,576,940	0.28
HKT CAPITAL NO.5 LTD 3.25% 2029 年 9 月 30 日	6,400,000	6,842,368	0.25
HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD 2.25% 2030 年 6 月 9 日	6,877,000	7,007,113	0.26
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4% 永续 债券 2049 年 12 月 29 日	5,000,000	5,101,350	0.19
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4% 永续 债券 2049 年 12 月 29 日	5,600,000	5,727,120	0.21
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4.25% 2027 年 11 月 7 日	5,686,000	6,349,727	0.24
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4.75% 2027 年 4 月 27 日	5,000,000	5,683,050	0.21
HUARONG FINANCE 2019 3.625% 2030 年 9 月 30 日	2,500,000	2,602,000	0.10
HUARONG FINANCE 2019 2049 年 12 月 31 日	2,600,000	2,686,294	0.10
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.375% 2030 年 2 月 24 日	8,000,000	8,156,640	0.30
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.75% 2024 年 5 月 29 日	2,780,000	2,951,943	0.11
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.875% 2029 年 11 月 13 日	5,000,000	5,291,900	0.20

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021年1月31日

债券 上市投资 (续)	持有量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
英属维尔京群岛 (续)			
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 4.5% 2029年5月29日	10,314,000	11,372,113	0.42
HUARONG FINANCE II 2049年12月29日	2,600,000	2,608,112	0.10
HUARONG FINANCE II 4.875% 2026年11 月22日	5,000,000	5,712,450	0.21
HUARONG FINANCE II CO LTD 5% 2025年 11月19日	10,000,000	11,290,300	0.42
HYSAN MTN LTD 2.875% 2027年6月2日	9,500,000	10,164,525	0.38
INVENTIVE GLOBAL INVESTMENT LTD 1.65% 2025年9月3日	5,000,000	4,990,200	0.19
INVENTIVE GLOBAL INVESTMENTS LTD 1.5% 2023年7月15日	9,296,000	9,331,046	0.35
JGSH PHILIPPINES LTD 4.125% 2030年7 月9日	7,409,000	7,837,833	0.29
JOY TREASURE ASSETS HOLDINGS 1.875% 2025年11月17日	2,461,000	2,483,641	0.09
JOY TREASURE ASSETS HOLDINGS 2.75% 2030年11月17日	2,400,000	2,403,504	0.09
JOY TREASURE ASSETS HOLDINGS INC 3.5% 2029年9月24日	2,000,000	2,123,280	0.08
LAI FUNG BONDS (2018) LTD 5.65% 2023年 1月18日	5,325,000	5,073,074	0.19
LTC GB LTD 2.75% 2021年5月26日	5,000,000	5,022,350	0.19
NAN FUNG TREASURY III 5% 永续债券 2049 年12月31日	4,116,000	4,165,639	0.16
NAN FUNG TREASURY LTD 3.625% 2030年 8月27日	2,808,000	2,841,752	0.11
新城环球有限公司 4.8% 2024年12月15日	8,406,000	8,489,892	0.32
NWD FINANCE (BVI) LTD 4.8% 永续债券 2049年12月29日	6,584,000	6,453,834	0.24
NWD FINANCE (BVI) LTD 5.75% 永续债券 2049年12月29日	3,700,000	3,722,718	0.14
NWD FINANCE (BVI) LTD 6.25% 永续债券 2049年12月31日	2,500,000	2,590,325	0.10
PANTHER VENTURES LTD 3.5% 永续债券 2049年12月31日	5,000,000	4,797,250	0.18
PCCW-HKT CAPITAL NO.5 LTD 3.75% 2023 年3月8日	6,000,000	6,312,060	0.24

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券 上市投资 (续)	持有量	市场价 值 美元	占资产 净值百 分比
英属维尔京群岛 (续)			
RADIANCE CAPITAL INVESTMENT LTD 11.75% 2021 年 10 月 31 日	3,400,000	3,560,820	0.13
RADIANCE CAPITAL INVESTMENT 10.5% 2022 年 1 月 16 日	1,811,000	1,889,779	0.07
RADIANCE CAPITAL INVESTMENTS LTD 8.8% 2023 年 9 月 17 日	5,422,000	5,668,050	0.21
RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 6% 2025 年 9 月 4 日	3,279,000	3,396,880	0.13
RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 6.7% 2024 年 9 月 30 日	3,318,000	3,528,826	0.13
RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 7.875% 2023 年 2 月 1 日	2,123,000	2,212,400	0.08
RKPF OVERSEAS 2020 A LTD 5.2% 2026 年 1 月 12 日	6,517,000	6,529,122	0.24
RONGSHI INTERNATIONAL FINANCE LTD 3.75% 2029 年 5 月 21 日	5,000,000	5,570,000	0.21
RONGXINGDA DEVELOPMENT BVI LTD 8% 2022 年 4 月 24 日	2,191,000	2,084,605	0.08
SF HOLDING INVESTMENT LTD 2.875% 2030 年 2 月 20 日	17,000,000	17,794,750	0.66
SHANGHAI PORT GROUP (BVI) DEVELOPMENT CO LTD 3.375% 2029 年 6 月 18 日	6,000,000	6,495,900	0.24
SHANGHAI PORT GROUP BV 1.5% 2025 年 7 月 13 日	5,300,000	5,317,225	0.20
SHANGHAI PORT GROUP BVI DEVELOPMENT 2 CO LTD 2.375% 2030 年 7 月 13 日	3,000,000	3,019,770	0.11
SIHC INTERNATIONAL CAPITAL LTD 3.95% 2021 年 9 月 26 日	4,846,000	4,920,386	0.18
SIHC INTERNATIONAL CAPITAL LTD 4.35% 2023 年 9 月 26 日	5,310,000	5,670,815	0.21
中国石化资本 2013 3.125% 2023 年 4 月 24 日	10,000,000	10,439,000	0.39
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT (2018) LTD 2.15% 2025 年 5 月 13 日	2,000,000	2,062,300	0.08
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT (2018) LTD 2.7% 2030 年 5 月 13 日	12,000,000	12,393,240	0.46
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT (2018) LTD 2.95% 2029 年 8 月 8 日	5,000,000	5,282,300	0.20

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券 上市投资 (续)	持有量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
英属维尔京群岛 (续)			
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 2016 LTD 2.75% 2026 年 9 月 29 日	5,000,000	5,343,300	0.20
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 2016 LTD 4.25% 2046 年 5 月 3 日	5,000,000	5,879,200	0.22
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 2017 LTD 4.25% 2047 年 4 月 12 日	1,700,000	2,005,898	0.07
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 4.875% 2042 年 5 月 17 日	12,000,000	15,035,520	0.56
SPIC MTN COMPANY LTD 1.625% 2025 年 7 月 27 日	6,049,000	6,078,882	0.23
STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT (2016) LTD 3.5% 2027 年 5 月 4 日	8,000,000	9,009,280	0.34
STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT (2016) LTD 4.25% 2028 年 5 月 2 日	3,000,000	3,488,400	0.13
STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT (2016) LTD 零% 2030 年 8 月 5 日	10,000,000	9,665,500	0.36
STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT 4.85% 2044 年 5 月 7 日	3,000,000	3,997,320	0.15
SUNNY EXPRESS ENTERPRISES CORP 2.625% 2025 年 4 月 23 日	3,000,000	3,119,160	0.12
SUNNY EXPRESS ENTERPRISES CORP 3.35% 永续债券	1,015,000	1,031,656	0.04
SUNNY EXPRESS ENTERPRISES CORP 3.5% 2022 年 3 月 21 日	1,635,000	1,676,627	0.06
UHI CAPITAL LTD 3% 2024 年 6 月 12 日	1,500,000	1,568,265	0.06
VIGOROUS CHAMPION INTERNATIONAL LTD 3.625% 2024 年 5 月 28 日	2,240,000	2,369,494	0.09
VIGOROUS CHAMPION INTERNATIONAL LTD 4.375% 2023 年 9 月 10 日	6,000,000	6,424,260	0.24
盈德气体投资有限公司 6.25% 2023 年 1 月 19 日	5,000,000	5,144,000	0.19
YONGDA INVESTMENT LTD 2.25% 2025 年 6 月 16 日	7,000,000	7,139,650	0.27
YUNDA HOLDING INVESTMENT LTD 2.25% 2025 年 8 月 19 日	9,066,000	9,096,915	0.34
		<u>628,220,941</u>	<u>23.43</u>

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券	持有量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (续)			
加拿大			
NEXEN ENERGY ULC 5.875% 2035 年 3 月 10 日	9,729,000	12,326,157	0.46
开曼群岛			
AC ENERGY FINANCE INTERNATIONAL LTD 5.1% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	7,000,000	7,240,030	0.27
雅居乐集团控股有限公司 6.05% 2025 年 10 月 13 日	5,345,000	5,532,877	0.21
雅居乐集团控股有限公司 7.75% 永续债券	1,562,000	1,614,655	0.06
雅居乐集团控股有限公司 7.75% 永续债券	4,313,000	4,511,700	0.17
阿里巴巴集团控股有限公司 3.4% 2027 年 12 月 6 日	10,600,000	11,764,728	0.44
阿里巴巴集团控股有限公司 4.2% 2047 年 12 月 6 日	8,000,000	9,473,840	0.35
阿里巴巴集团控股有限公司 4.5% 2034 年 11 月 28 日	10,000,000	12,075,800	0.45
CCBL (CAYMAN) 1 CORPORATION LTD 1.99% 2025 年 7 月 21 日	8,595,000	8,687,482	0.32
CDBL FUNDING 1 3% 2023 年 4 月 24 日	1,836,000	1,900,444	0.07
CDBL FUNDING 2 3% 2022 年 8 月 1 日	5,000,000	5,124,700	0.19
建业地产股份有限公司 7.25% 2024 年 8 月 13 日	3,000,000	2,916,180	0.11
建业地产股份有限公司 7.65% 2023 年 8 月 27 日	2,529,000	2,562,433	0.10
CHAMPION MTN LTD 2.95% 2030 年 6 月 15 日	4,500,000	4,607,415	0.17
中国奥园集团股份有限公司 5.98% 2025 年 8 月 18 日	3,067,000	3,142,326	0.12
中国奥园集团股份有限公司 6.35% 2024 年 2 月 8 日	1,400,000	1,457,918	0.05
中国奥园集团股份有限公司 8.5% 2022 年 1 月 23 日	6,706,000	6,858,562	0.26

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券	持有量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (续)			
开曼群岛 (续)			
中国奥园地产集团股份有限公司 7.5% 2021 年 5 月 10 日	4,000,000	4,039,200	0.15
中国宏桥集团有限公司 7.125% 2022 年 7 月 22 日	600,000	586,500	0.02
中国蒙牛乳业有限公司 1.875% 2025 年 6 月 17 日	12,500,000	12,607,875	0.47
中国蒙牛乳业有限公司 3% 2024 年 7 月 18 日	4,932,000	5,170,857	0.19
CHINA OVERSEAS FINANCE (CAYMAN) VIII LTD 3.05% 2029 年 11 月 27 日	10,000,000	10,219,900	0.38
CHINA OVERSEAS FINANCE (CAYMAN) VIII LTD 3.45% 2029 年 7 月 15 日	2,357,000	2,476,500	0.09
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN LTD 4.75% 2028 年 4 月 26 日	6,000,000	6,787,440	0.25
CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS FINANCE IV (CAYMAN) LTD 4.875% 2021 年 6 月 1 日	1,088,000	1,097,944	0.04
华润置地有限公司 3.75% 2024 年 8 月 26 日	656,000	704,728	0.03
华润置地有限公司 3.75% 永续债券	10,000,000	10,288,100	0.38
华润置地有限公司 4.125% 2029 年 2 月 26 日	787,000	868,541	0.03
中骏集团控股有限公司 5.875% 2022 年 3 月 10 日	1,609,000	1,629,563	0.06
中骏集团控股有限公司 6% 2026 年 2 月 4 日	3,601,000	3,567,583	0.13
中骏集团控股有限公司 7% 2025 年 5 月 2 日	9,506,000	9,957,535	0.37
中骏集团控股有限公司 7.25% 2023 年 4 月 19 日	7,000,000	7,286,020	0.27
旭辉控股 (集团) 有限公司 5.95% 2025 年 10 月 20 日	4,000,000	4,306,600	0.16
CK HUTCHISON INTERNATIONAL (19) (II) LTD 2.75% 2029 年 9 月 6 日	8,000,000	8,528,480	0.32
CK HUTCHISON INTERNATIONAL (20) LTD 2.5% 2030 年 5 月 8 日	10,000,000	10,473,700	0.39
CK HUTCHISON INTERNATIONAL (20) LTD 3.375% 2050 年 5 月 8 日	1,500,000	1,671,795	0.06

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券	持有量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (续)			
开曼群岛 (续)			
碧桂园控股 3.3% 2031 年 1 月 12 日	5,237,000	5,251,611	0.20
碧桂园控股 3.875% 2030 年 10 月 22 日	3,710,000	3,856,990	0.14
碧桂园控股有限公司 5.125% 2027 年 1 月 14 日	1,888,000	2,036,076	0.08
碧桂园控股有限公司 6.15% 2025 年 9 月 17 日	1,257,000	1,398,840	0.05
碧桂园控股有限公司 7.25% 2026 年 4 月 8 日	3,000,000	3,394,290	0.13
碧桂园控股有限公司 零% 2030 年 8 月 6 日	1,758,000	1,896,777	0.07
花样年控股集团 6.95% 2021 年 12 月 17 日	1,601,000	1,597,366	0.06
花样年控股集团 7.95% 2022 年 7 月 5 日	5,000,000	4,965,900	0.19
花样年控股集团 9.875% 2023 年 10 月 19 日	5,000,000	4,921,850	0.18
花样年控股集团有限公司 11.875% 2023 年 6 月 1 日	1,828,000	1,905,087	0.07
花样年控股集团有限公司 9.25% 2023 年 7 月 28 日	1,819,000	1,787,131	0.07
阜丰集团有限公司 5.875% 2021 年 8 月 28 日	1,280,000	1,308,736	0.05
绿地香港控股有限公司 6% 2021 年 7 月 17 日	1,141,000	1,130,126	0.04
海底捞国际控股 2.15% 2026 年 1 月 14 日	6,444,000	6,490,203	0.24
健合 (H&H) 国际控股有限公司 5.625% 2024 年 10 月 24 日	1,875,000	1,963,819	0.07
宏华集团有限公司 6.375% 2022 年 8 月 1 日	2,341,000	2,303,731	0.09
HONGKONG LAND FINANCE (CAYMAN ISLANDS) COMPANY LTD 2.875% 2030 年 5 月 27 日	9,000,000	9,501,300	0.35
HPHT FINANCE (19) LTD 2.875% 2024 年 11 月 5 日	8,000,000	8,396,240	0.31
HUTCHISON WHAMPOA INTERNATIONAL 14 LTD 3.625% 2024 年 10 月 31 日	2,000,000	2,212,600	0.08

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券	持有量	市场价 值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (续)			
开曼群岛 (续)			
京东商城电子商务有限公司 3.375% 2030 年 1 月 14 日	5,000,000	5,422,350	0.20
京东商城电子商务有限公司 3.875% 2026 年 4 月 29 日	8,897,000	9,893,197	0.37
佳兆业集团控股有限公司 11.5% 2023 年 1 月 30 日	6,213,000	6,451,082	0.24
佳兆业集团控股有限公司 11.95% 2022 年 10 月 22 日	5,025,000	5,286,451	0.20
佳兆业集团控股有限公司 8.5% 2022 年 6 月 30 日	1,200,000	1,213,044	0.05
合景泰富集团控股 5.95% 2025 年 8 月 10 日	5,000,000	5,058,800	0.19
合景泰富集团控股 6.3% 2026 年 2 月 13 日	3,581,000	3,656,774	0.14
龙光集团有限公司 4.85% 2026 年 12 月 14 日	5,321,000	5,425,238	0.20
龙光集团有限公司 5.25% 2025 年 10 月 19 日	3,503,000	3,644,591	0.14
龙光集团有限公司 5.75% 2025 年 1 月 14 日	3,000,000	3,154,410	0.12
龙湖集团控股有限公司 4.5% 2028 年 1 月 16 日	3,000,000	3,349,260	0.12
美团 2.125% 2025 年 10 月 28 日	2,418,000	2,471,510	0.09
MELCO RESORTS FINANCE LTD 5.625% 2027 年 7 月 17 日	4,000,000	4,194,240	0.16
MELCO RESORTS FINANCE LTD 5.75% 2028 年 7 月 21 日	7,024,000	7,445,791	0.28
美高梅中国控股有限公司 5.25% 2025 年 6 月 18 日	2,000,000	2,078,700	0.08
美高梅中国控股有限公司 5.375% 2024 年 5 月 15 日	3,000,000	3,094,080	0.12
美高梅中国控股有限公司 5.875% 2026 年 5 月 15 日	2,000,000	2,109,680	0.08
当代置业 (中国) 有限公司 11.95% 2024 年 3 月 4 日	385,000	388,996	0.01
新东方教育科技 2.125% 2025 年 7 月 2 日	12,272,000	12,214,812	0.46
宝龙地产 5.95% 2025 年 4 月 30 日	5,039,000	5,179,790	0.19

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券	持有量	市场价 值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (续)			
开曼群岛 (续)			
宝龙地产 6.25% 2024 年 8 月 10 日	3,724,000	3,856,984	0.14
宝龙地产控股有限公司 6.95% 2023 年 7 月 23 日	4,808,000	5,022,581	0.19
宝龙地产控股有限公司 7.125% 2022 年 11 月 8 日	5,000,000	5,204,000	0.19
弘阳地产集团 7.3% 2025 年 1 月 13 日	2,093,000	2,112,381	0.08
力高地产集团 8.5% 2021 年 8 月 19 日	1,391,000	1,398,678	0.05
力高地产集团 9.9% 2024 年 2 月 17 日	4,726,000	4,629,306	0.17
弘阳地产集团有限公司 9.7% 2023 年 4 月 16 日	3,691,000	3,893,780	0.15
融信中国 7.1% 2025 年 1 月 25 日	9,288,000	9,168,278	0.34
融信中国控股有限公司 11.25% 2021 年 8 月 22 日	758,000	782,794	0.03
融信中国控股有限公司 8.75% 2022 年 10 月 25 日	6,978,000	7,182,386	0.27
融信中国控股有限公司 零% 2024 年 8 月 5 日	3,268,000	3,246,431	0.12
融信中国控股有限公司 8.1% 2023 年 6 月 9 日	6,200,000	6,344,584	0.24
金沙中国有限公司 3.8% 2026 年 1 月 8 日	1,088,000	1,152,856	0.04
金沙中国有限公司 4.375% 2030 年 6 月 18 日	4,520,000	4,973,085	0.19
金沙中国有限公司 4.6% 2023 年 8 月 8 日	2,374,000	2,541,794	0.09
金沙中国有限公司 5.125% 2025 年 8 月 8 日	8,000,000	8,978,320	0.33
金沙中国有限公司 5.4% 2028 年 8 月 8 日	14,253,000	16,506,827	0.62
新城控股集团股份有限公司 6% 2024 年 8 月 12 日	2,663,000	2,806,482	0.10
新城控股集团股份有限公司 6.45% 2022 年 6 月 11 日	1,787,000	1,841,772	0.07
世茂集团控股有限公司 3.45% 2031 年 1 月 11 日	4,212,000	4,272,695	0.16

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

	持有量	市场价 值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资 (续)			
开曼群岛 (续)			
世茂房地产控股有限公司 5.6% 2026 年 7 月 15 日	2,487,000	2,738,212	0.10
瑞安房地产有限公司 5.75% 2023 年 11 月 12 日	2,500,000	2,551,050	0.10
新力控股 (集团) 有限公司 8.5% 2022 年 1 月 24 日	4,591,000	4,574,243	0.17
SUN HUNG KAI PROPERTIES (CAPITAL MARKET) LTD 2.75% 2030 年 5 月 13 日	5,000,000	5,231,250	0.20
SUN HUNG KAI PROPERTIES (CAPITAL MARKET) LTD 2.875% 2030 年 1 月 21 日	7,740,000	8,172,434	0.30
SUN HUNG KAI PROPERTIES (CAPITAL MARKET) LTD 3.75% 2029 年 2 月 25 日	3,000,000	3,349,800	0.13
融创中国控股有限公司 5.95% 2024 年 4 月 26 日	6,706,000	6,713,175	0.25
融创中国控股有限公司 6.5% 2026 年 1 月 26 日	5,353,000	5,299,095	0.20
融创中国控股有限公司 7.35% 2021 年 7 月 19 日	2,000,000	2,028,560	0.08
融创中国控股有限公司 8.35% 2023 年 4 月 19 日	10,000,000	10,482,100	0.39
腾讯控股有限公司 2.39% 2030 年 6 月 3 日	10,000,000	10,124,300	0.38
腾讯控股有限公司 3.595% 2028 年 1 月 19 日	10,000,000	10,962,400	0.41
腾讯控股有限公司 3.925% 2038 年 1 月 19 日	4,500,000	5,035,545	0.19
腾讯控股有限公司 3.975% 2029 年 4 月 11 日	20,000,000	22,546,000	0.84
腾讯音乐娱乐集团 2% 2030 年 9 月 3 日	7,610,000	7,469,367	0.28
时代中国控股有限公司 6.6% 2023 年 3 月 2 日	5,000,000	5,112,400	0.19
时代中国控股有限公司 6.75% 2023 年 7 月 16 日	10,000,000	10,469,100	0.39
TINGYI (C.I.) HOLDING CORP 1.625% 2025 年 9 月 24 日	5,000,000	4,986,050	0.19
永利澳门有限公司 5.5% 2026 年 1 月 15 日	9,519,000	9,838,648	0.37
永利澳门有限公司 5.625% 2028 年 8 月 26 日	2,310,000	2,389,048	0.09

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券	持有量	市场价 值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (续)			
开曼群岛 (续)			
禹洲集团 6.35% 2027 年 1 月 13 日	3,320,000	3,301,607	0.12
禹洲集团 7.85% 2026 年 8 月 12 日	1,757,000	1,870,854	0.07
禹洲地产股份有限公司 7.375% 2026 年 1 月 13 日	3,000,000	3,154,500	0.12
禹洲地产股份有限公司 7.9% 2021 年 5 月 11 日	3,000,000	3,035,520	0.11
正荣地产集团 5.95% 2021 年 11 月 18 日	2,215,000	2,221,224	0.08
正荣地产集团 6.63% 2026 年 1 月 7 日	4,348,000	4,336,608	0.16
正荣地产集团 8.3% 2023 年 9 月 15 日	2,250,000	2,361,218	0.09
正荣地产集团 9.15% 2023 年 5 月 6 日	1,770,000	1,870,784	0.07
正荣地产集团有限公司 5.6% 2021 年 2 月 28 日	2,906,000	2,907,976	0.11
正荣地产集团有限公司 8.35% 2024 年 3 月 10 日	6,500,000	6,845,670	0.26
正荣地产集团有限公司 9.15% 2022 年 3 月 8 日	3,500,000	3,600,625	0.13
中梁控股 9.5% 2022 年 7 月 29 日	3,194,000	3,250,470	0.12
中梁控股集团有限公司 11.5% 2021 年 9 月 26 日	2,667,000	2,726,767	0.10
中升集团 3% 2026 年 1 月 13 日	1,125,000	1,149,503	0.04
		628,413,537	23.44
中国内地			
中国农业发展银行 2.85% 2025 年 8 月 11 日	7,310,000	1,136,493	0.04
中国农业发展银行 3.25% 2025 年 10 月 27 日	18,300,000	2,889,949	0.11
中国农业发展银行 3.8% 2030 年 10 月 27 日	84,850,000	13,766,021	0.51
中国银行 5% 2024 年 11 月 13 日	10,000,000	11,257,600	0.42

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券	持有量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (续)			
中国内地 (续)			
国银金融租赁股份有限公司 2030 年 9 月 28 日	7,500,000	7,714,200	0.29
中国广核电力股份有限公司 3.55% 2022 年 7 月 24 日	3,900,000	605,425	0.02
中国 (政府) 1.2% 2030 年 10 月 21 日	2,918,000	2,881,933	0.11
中国建设银行 4.2% 2030 年 9 月 14 日	46,000,000	7,116,387	0.27
中国建设银行股份有限公司 (香港分行) 零% 2025 年 8 月 4 日	3,000,000	3,009,540	0.11
中国建设银行股份有限公司 2.45% 2030 年 6 月 24 日	27,000,000	27,666,630	1.03
国家开发银行 4.88% 2028 年 2 月 9 日	70,000,000	11,752,011	0.44
中国石油天然气集团有限公司 2.75% 2023 年 3 月 23 日	19,300,000	2,946,169	0.11
中华人民共和国 (政府) 3.16% 2023 年 6 月 27 日	20,000,000	3,155,154	0.12
中华人民共和国 (政府) 3.38% 2024 年 11 月 21 日	12,000,000	1,922,042	0.07
中华人民共和国 (政府) 4.1% 2022 年 6 月 26 日	30,000,000	4,764,959	0.18
中国工商银行 2049 年 12 月 31 日	12,000,000	12,283,920	0.46
中国工商银行股份有限公司 4.875% 2025 年 9 月 21 日	10,000,000	11,393,800	0.43
上海国际港务集团 3.38% 2022 年 3 月 14 日	23,000,000	3,564,598	0.13
首钢集团有限公司 4% 2024 年 5 月 23 日	6,000,000	6,393,000	0.24
四川省铁路产业投资集团有限责任公司 3.8% 2022 年 6 月 27 日	2,903,000	2,978,768	0.11
西安城市基础设施建设投资集团有限公司 4% 2022 年 6 月 24 日	1,948,000	1,986,142	0.07
		<u>141,184,741</u>	<u>5.27</u>

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券	持有量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (续)			
香港特别行政区			
友邦保险集团有限公司 3.2% 2040 年 9 月 16 日	5,468,000	5,708,865	0.21
香港机场管理局 1.625% 2031 年 2 月 4 日	6,845,000	6,773,264	0.25
香港机场管理局 2.625% 2051 年 2 月 4 日	5,233,000	5,313,745	0.20
东亚银行有限公司 2049 年 12 月 31 日	5,574,000	5,937,648	0.22
茂欣有限公司 2.2% 2030 年 10 月 21 日	8,914,000	8,715,753	0.33
中广核国际有限公司 3.75% 2027 年 12 月 11 日	4,000,000	4,343,360	0.16
中铝国际香港有限公司 5% 永续债券	5,950,000	6,048,056	0.23
中信银行 (国际) 有限公司 7.1% 永续债券	4,000,000	4,382,560	0.16
华南城控股 10.75% 2023 年 4 月 11 日	3,157,000	2,997,477	0.11
创兴银行有限公司 零% 永续债券	3,991,000	4,092,691	0.15
招商国际租赁 1.875% 2025 年 8 月 12 日	2,805,000	2,792,742	0.10
招商国际租赁 2% 2026 年 2 月 4 日	6,241,000	6,238,504	0.23
招商国际租赁 2.75% 2030 年 8 月 12 日	1,646,000	1,625,606	0.06
中国农化 (香港) 峰桥有限公司 3.375% 2024 年 6 月 19 日	1,500,000	1,530,735	0.06
中国农化 (香港) 峰桥有限公司 4.875% 2025 年 3 月 14 日	10,000,000	10,703,000	0.40
雄亚投资有限公司 1.5% 2023 年 11 月 18 日	2,719,000	2,720,224	0.10
工银国际租赁财务有限公司 1.75% 2025 年 8 月 25 日	8,000,000	8,048,640	0.30
工银国际租赁财务有限公司 3.65% 2022 年 3 月 5 日	5,000,000	5,132,250	0.19
万科地产香港有限公司 3.15% 2025 年 5 月 12 日	6,029,000	6,318,814	0.24
万科地产香港有限公司 3.5% 2029 年 11 月 12 日	3,500,000	3,718,330	0.14

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券	持有量	市场价 值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (续)			
香港特别行政区 (续)			
万科地产香港有限公司 3.975% 2027 年 11 月 9 日	4,195,000	4,641,180	0.17
万科地产香港有限公司 5.35% 2024 年 3 月 11 日	12,500,000	13,863,375	0.52
WESTWOOD GRP HOLDING LTD 2.8% 2026 年 1 月 20 日	10,000,000	10,126,500	0.38
阳光城嘉世国际有限公司 6.8% 2021 年 3 月 11 日	5,375,000	5,384,191	0.20
阳光城嘉世国际有限公司 7.5% 2025 年 2 月 17 日	2,348,000	2,390,804	0.09
阳光城嘉世国际有限公司 9.5% 2021 年 4 月 3 日	2,620,000	2,641,851	0.10
仁恒地产 (香港) 有限公司 6.75% 2023 年 4 月 23 日	1,500,000	1,563,930	0.06
仁恒地产 (香港) 有限公司 6.8% 2024 年 2 月 27 日	4,693,000	4,953,555	0.19
		<u>148,707,650</u>	<u>5.55</u>
印度			
ADANI GREEN ENERGY (UP) LTD 6.25% 2024 年 12 月 10 日	6,725,000	7,496,223	0.28
BANK OF BARODA/LONDON 3.875% 2024 年 4 月 4 日	3,000,000	3,179,580	0.12
印度进出口银行 2.25% 2031 年 1 月 13 日	11,627,000	11,247,378	0.42
GMR HYDERABAD INTERNATIONAL 4.75% 2026 年 2 月 2 日	3,439,000	3,438,759	0.13
INDIAN OIL CORPN LTD 4.75% 2024 年 1 月 16 日	2,200,000	2,381,698	0.09
JSW STEEL LTD 5.25% 2022 年 4 月 13 日	2,576,000	2,648,025	0.10
MUTHOOT FINANCE LTD 6.125% 2022 年 10 月 31 日	3,194,000	3,352,327	0.12
NTPC LTD 3.75% 2024 年 4 月 3 日	11,115,000	11,738,218	0.44
NTPC LTD 4.25% 2026 年 2 月 26 日	7,200,000	7,860,096	0.29
NTPC LTD 4.375% 2024 年 11 月 26 日	3,700,000	4,027,931	0.15
NTPC LTD 4.75% 2022 年 10 月 3 日	6,000,000	6,321,120	0.24

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券 上市投资 (续)	持有量	市场价 值 美元	占资产 净值百 分比
印度 (续)			
OIL INDIA LTD 5.125% 2029 年 2 月 4 日	15,000,000	17,152,800	0.64
ONGC VIDESH LTD 4.625% 2024 年 7 月 15 日	12,000,000	13,130,280	0.49
POWER FINANCE CORP LTD 3.35% 2031 年 5 月 16 日	10,111,000	10,174,598	0.38
POWER FINANCE CORPORATION LTD 4.5% 2029 年 6 月 18 日	10,000,000	10,902,900	0.41
REC LTD 3.5% 2024 年 12 月 12 日	10,000,000	10,572,600	0.39
RELIANCE INDUSTRIES 6.25% 2040 年 10 月 19 日	4,500,000	6,338,475	0.24
RELIANCE INDUSTRIES LTD 3.667% 2027 年 11 月 30 日	6,432,000	7,254,460	0.27
RELIANCE INDUSTRIES LTD 5.4% 2022 年 2 月 14 日	11,525,000	12,048,696	0.45
RENEW CLEAN ENERGY PVT LTD 6.67% 2024 年 3 月 12 日	550,000	580,893	0.02
RENEW POWER PVT LTD 6.45% 2022 年 9 月 27 日	9,000,000	9,372,510	0.35
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE 4.4% 2024 年 3 月 13 日	18,451,000	18,369,816	0.68
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE COMPANY LTD 5.1% 2023 年 7 月 16 日	3,500,000	3,554,845	0.13
		<u>183,144,228</u>	<u>6.83</u>
印度尼西亚			
ADARO INDONESIA PT 4.25% 2024 年 10 月 31 日	3,320,000	3,440,449	0.13
BANK MANDIRI (PERSERO) TBK PT 3.75% 2024 年 4 月 11 日	8,620,000	9,163,750	0.34
BANK RAKYAT INDONESIA (PERSERO) TBK PT 3.95% 2024 年 3 月 28 日	4,064,000	4,363,639	0.16
BANK RAKYAT INDONESIA (PERSERO) TBK PT 4.625% 2023 年 7 月 20 日	2,974,000	3,202,284	0.12
BANK TABUNGAN NEGARA (PERSERO) TBK PT 4.2% 2025 年 1 月 23 日	10,000,000	10,184,300	0.38
BAYAN RESOURCES TBK PT 6.125% 2023 年 1 月 24 日	8,200,000	8,432,388	0.32

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券 上市投资 (续)	持有量	市场价值 美元	占资产 净值百 分比
印度尼西亚 (续)			
BUKIT MAKMUR MANDIRI UTA 7.75% 2026 年 2 月 10 日	5,288,000	5,220,155	0.20
印度尼西亚 (共和国) 3.05% 2051 年 3 月 12 日	11,765,000	11,844,884	0.44
印度尼西亚 (共和国) 3.35% 2071 年 3 月 12 日	2,979,000	3,035,482	0.11
印度尼西亚 (共和国) 3.85% 2030 年 10 月 15 日	3,000,000	3,472,500	0.13
印度尼西亚 (共和国) 4.45% 2070 年 4 月 15 日	10,000,000	12,267,300	0.46
印度尼西亚 (共和国) 4.75% 2047 年 7 月 18 日	7,300,000	9,062,658	0.34
印度尼西亚 (共和国) 7.75% 2038 年 1 月 17 日	15,000,000	23,617,200	0.88
印度尼西亚 (共和国) 8.5% 2035 年 10 月 12 日	6,000,000	9,840,240	0.37
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM (PERSERO) PT 5.45% 2030 年 5 月 15 日	7,000,000	8,293,250	0.31
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM (PERSERO) PT 5.8% 2050 年 5 月 15 日	2,500,000	3,047,275	0.11
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM (PERSERO) PT 6.757% 2048 年 11 月 15 日	1,500,000	2,008,965	0.08
印度尼西亚共和国 (政府) 3.4% 2029 年 9 月 18 日	5,000,000	5,549,500	0.21
印度尼西亚共和国 (政府) 3.7% 2049 年 10 月 30 日	5,000,000	5,514,350	0.21
PERTAMINA (PERSERO) PT 3.65% 2029 年 7 月 30 日	835,000	922,700	0.04
PERTAMINA (PERSERO) PT 4.15% 2060 年 2 月 25 日	10,600,000	11,078,484	0.41
PERTAMINA (PERSERO) PT 4.175% 2050 年 1 月 21 日	10,000,000	10,738,600	0.40
PERTAMINA (PERSERO) PT 5.625% 2043 年 5 月 20 日	4,000,000	4,934,160	0.18
PERTAMINA (PERSERO) PT 6.45% 2044 年 5 月 30 日	20,500,000	27,688,325	1.03
PERTAMINA (PERSERO) PT 6.5% 2048 年 11 月 7 日	10,000,000	13,964,200	0.52
PERTAMINA (PERSERO) PT 6.5% 2041 年 5 月 27 日	4,000,000	5,341,080	0.20

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券 上市投资 (续)	持有量	市场价 值 美元	占资产 净值百 分比
印度尼西亚 (续)			
PERUSAHAAN LISTRIK 4.125% 2027 年 5 月 15 日	1,000,000	1,105,390	0.04
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 5.25% 2042 年 10 月 24 日	4,000,000	4,642,160	0.17
PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA (PERSERO) PT 3% 2030 年 6 月 30 日	3,500,000	3,604,790	0.14
PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA (PERSERO) PT 4% 2050 年 6 月 30 日	13,000,000	13,309,010	0.50
PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA (PERSERO) PT 5.375% 2029 年 1 月 25 日	5,000,000	5,991,550	0.22
PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA (PERSERO) PT 5.45% 2028 年 5 月 21 日	3,000,000	3,593,370	0.13
PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA (PERSERO) PT 6.15% 2048 年 5 月 21 日	15,000,000	19,612,800	0.73
PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 6.25% 2049 年 1 月 25 日	2,510,000	3,328,938	0.12
PT PELABUHAN INDO II 4.25% 2025 年 5 月 5 日	4,000,000	4,376,640	0.16
PT PERTAMINA (PERSERO) SER REGS (REG) 3.1% 2030 年 1 月 22 日	10,000,000	10,630,800	0.40
印度尼西亚共和国 (政府) 5.95% 2046 年 1 月 8 日	7,000,000	10,008,320	0.37
		<u>296,431,886</u>	<u>11.06</u>

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

	持有量	市场价 值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资 (续)			
卢森堡			
SPIC LUXEMBOURG LATIN AMERICA RENEWABLE ENERGY INVESTMENT COMPANY SARL 4.65% 2023 年 10 月 30 日	9,000,000	9,733,050	0.36
马来西亚			
AXIATA SPV5 LABUAN LTD 3.064% 2050 年 8 月 19 日	7,000,000	6,937,980	0.26
PETRONAS CAPITAL LTD 3.5% 2030 年 4 月 21 日	4,000,000	4,512,040	0.17
PETRONAS CAPITAL LTD 4.5% 2045 年 3 月 18 日	3,000,000	3,904,470	0.15
PETRONAS CAPITAL LTD 4.55% 2050 年 4 月 21 日	5,500,000	7,105,175	0.26
RHB BANK BHD 3.766% 2024 年 2 月 19 日	9,000,000	9,703,800	0.36
		<u>32,163,465</u>	<u>1.20</u>
毛里求斯			
AZURE POWER ENERGY LTD 5.5% 2022 年 11 月 3 日	2,871,000	2,944,326	0.11
AZURE POWER SOLAR ENERGY PVT LTD 5.65% 2024 年 12 月 24 日	10,000,000	10,659,200	0.40
GREENKO INVESTMENT CO 4.875% 2023 年 8 月 16 日	5,200,000	5,316,636	0.20

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

	持有量	市场价 值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资 (续)			
毛里求斯 (续)			
INDIA GREEN ENERGY HOLDING 5.375% 2024 年 4 月 29 日	3,518,000	3,715,606	0.14
NETWORK I2I LTD 5.65% 永续债券	5,954,000	6,330,352	0.23
		<u>28,966,120</u>	<u>1.08</u>
蒙古			
蒙古开发银行 7.25% 2023 年 10 月 23 日	1,723,000	1,882,757	0.07
蒙古国际债券 5.125% 2026 年 4 月 7 日	644,000	690,812	0.03
		<u>2,573,569</u>	<u>0.10</u>
荷兰			
DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV 4.5% 2021 年 9 月 21 日	10,000,000	1,568,325	0.06
DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV 4.8% 2021 年 4 月 9 日	16,000,000	2,490,443	0.09
GREENKO DUTCH BV 4.875% 2022 年 7 月 24 日	3,000,000	3,022,440	0.11
LISTRINDO CAPITAL BV 4.95% 2026 年 9 月 14 日	5,000,000	5,197,650	0.20
MINEJESA CAPITAL BV 4.625% 2030 年 8 月 10 日	13,000,000	14,009,450	0.52
MINEJESA CAPITAL BV 5.625% 2037 年 8 月 10 日	4,000,000	4,381,440	0.16
ROYAL CAPITAL BV 4.875% 永续债券 2049 年 12 月 29 日	2,000,000	2,054,380	0.08
ROYAL CAPITAL BV 5% 永续债券	10,000,000	10,367,500	0.39
		<u>43,091,628</u>	<u>1.61</u>

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券	持有量	市场价 值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (续)			
菲律宾			
BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS 2.5% 2024 年 9 月 10 日	418,000	437,650	0.02
BDO UNIBANK INC 2.125% 2026 年 1 月 13 日	5,000,000	5,145,950	0.19
INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SERVICES INC 4.75% 2030 年 6 月 17 日	785,000	854,621	0.03
MANILA WATER COMPANY INC 4.375% 2030 年 7 月 30 日	3,000,000	3,056,370	0.11
METROPOLITAN BANK AND TRUST CO 2.125% 2026 年 1 月 15 日	2,500,000	2,558,200	0.09
菲律宾 (共和国) 9.5% 2030 年 2 月 2 日	5,000,000	8,220,150	0.31
菲律宾共和国 (政府) 2.95% 2045 年 5 月 5 日	10,000,000	10,365,200	0.39
菲律宾共和国 (政府) 3.7% 2041 年 3 月 1 日	8,000,000	9,122,880	0.34
菲律宾共和国 (政府) 3.95% 2040 年 1 月 20 日	10,000,000	11,749,600	0.44
PLDT INC 2.5% 2031 年 1 月 23 日	9,030,000	9,409,170	0.35
菲律宾共和国 (政府) 3.7% 2042 年 2 月 2 日	3,400,000	3,881,950	0.14
菲律宾共和国 2.65% 2045 年 12 月 10 日	10,000,000	9,927,700	0.37
SAN MIGUEL CORP 5.5% 永续债券	8,000,000	8,205,120	0.31
		<u>82,934,561</u>	<u>3.09</u>
新加坡			
ABJA INVESTMENT CO 5.45% 2028 年 1 月 24 日	10,255,000	10,741,395	0.40
ABJA INVESTMENT CO 5.95% 2024 年 7 月 31 日	1,724,000	1,852,214	0.07
中银航空租赁有限公司 2.625% 2030 年 9 月 17 日	9,549,000	9,491,324	0.35
中银航空租赁有限公司 2.75% 2023 年 12 月 2 日	6,256,000	6,481,216	0.24
中银航空租赁有限公司 3.25% 2025 年 4 月 29 日	5,000,000	5,291,550	0.20
中银航空租赁有限公司 3.5% 2023 年 1 月 31 日	5,000,000	5,203,100	0.19
COSL SINGAPORE CAPITAL LTD 4.5% 2025 年 7 月 30 日	1,134,000	1,250,791	0.05

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券	持有量	市场价 值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (续)			
新加坡 (续)			
星展集团控股有限公司 3.3% 永续债券	9,727,000	9,980,096	0.37
星展集团控股有限公司 4.52% 2028 年 12 月 11 日	7,000,000	7,646,520	0.29
INDIKA ENERGY CAPITAL IV 8.25% 2025 年 10 月 22 日	16,882,000	18,170,434	0.68
INDIKA ENERGY III PTE 5.875% 2024 年 11 月 9 日	5,001,000	5,109,372	0.19
JUBILANT PHARMA LTD 6% 2024 年 3 月 5 日	5,000,000	5,288,600	0.20
LLPL CAPITAL PTE LTD 6.875% 2039 年 2 月 4 日	5,938,000	6,745,804	0.25
MARBLE II PTE LTD 5.3% 2022 年 6 月 20 日	6,842,000	6,908,983	0.26
MEDCO OAK TREE PTE LTD 7.375% 2026 年 5 月 14 日	15,370,000	16,407,782	0.61
ONGC VIDESH VANKORNEFT PTE LTD 2.875% 2022 年 1 月 27 日	9,800,000	9,937,396	0.37
ONGC VIDESH VANKORNEFT PTE LTD 3.75% 2026 年 7 月 27 日	8,959,000	9,697,849	0.36
华侨银行 2030 年 9 月 10 日	4,388,000	4,443,289	0.17
华侨银行有限公司 4.25% 2024 年 6 月 19 日	4,097,000	4,506,536	0.17
PAKUWON PRIMA PTE LTD 5% 2024 年 2 月 14 日	7,604,000	7,774,482	0.29
PSA TREASURY PTE LTD 2.25% 2030 年 4 月 30 日	3,000,000	3,159,630	0.12
PSA TREASURY PTE LTD 2.5% 2026 年 4 月 12 日	8,500,000	9,110,725	0.34
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.25% 2051 年 4 月 6 日	2,500,000	2,451,750	0.09
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.5% 2070 年 10 月 6 日	5,500,000	5,384,995	0.20
TML HOLDINGS PTE LTD 5.5% 2024 年 6 月 3 日	4,578,000	4,666,996	0.17
大华银行有限公司 2031 年 3 月 16 日	9,911,000	9,991,081	0.37

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券	持有量	市场价 值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (续)			
新加坡 (续)			
大华银行有限公司 2.88% 2027 年 3 月 8 日	5,000,000	5,090,600	0.19
大华银行有限公司 3.5% 2026 年 9 月 16 日	3,500,000	3,551,240	0.13
		<u>196,335,750</u>	<u>7.32</u>
韩国			
国民银行 2.5% 2030 年 11 月 4 日	8,990,000	9,211,064	0.34
国民银行 4.35% 永续债券	5,582,000	5,910,389	0.22
国民银行 4.5% 2029 年 2 月 1 日	3,314,000	3,873,635	0.15
韩国开发银行 4.585% 2021 年 2 月 13 日	30,000,000	4,661,476	0.17
韩国外换银行 4.25% 2024 年 10 月 14 日	9,250,000	10,276,472	0.38
KOREA SOUTHERN POWER 0.75% 2026 年 1 月 27 日	7,560,000	7,525,678	0.28
新韩银行 3.75% 2027 年 9 月 27 日	5,000,000	5,577,300	0.21
新韩银行 3.875% 2026 年 3 月 24 日	10,000,000	11,191,200	0.42
新韩银行 4% 2029 年 4 月 23 日	4,075,000	4,642,322	0.17
新韩银行 4.5% 2028 年 3 月 26 日	8,000,000	9,222,560	0.35
SHINHAN CARD CO LTD 1.375% 2025 年 10 月 19 日	12,000,000	12,158,760	0.45
新韩金融集团 2030 年 2 月 5 日	5,000,000	5,323,450	0.20
新韩金融集团株式会社 1.35% 2026 年 1 月 10 日	2,000,000	2,025,680	0.08
SK HYNIX INC 2.375% 2031 年 1 月 19 日	4,506,000	4,546,239	0.17
友利银行 5.125% 2028 年 8 月 6 日	1,375,000	1,647,181	0.06
		<u>97,793,406</u>	<u>3.65</u>

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

债券	持有量	市场价 值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (续)			
斯里兰卡			
斯里兰卡民主社会主义共和国 (政府) 5.75% 2023 年 4 月 18 日	1,000,000	664,050	0.03
斯里兰卡民主社会主义共和国 (政府) 5.875% 2022 年 7 月 25 日	7,765,000	5,481,469	0.20
		<u>6,145,519</u>	<u>0.23</u>
泰国			
盘谷银行大众有限公司 (香港分行) 3.733% 2034 年 9 月 25 日	9,000,000	9,455,850	0.35
盘古银行大众有限公司 (香港分行) 2049 年 12 月 31 日	9,000,000	9,499,230	0.35
开泰银行大众有限公司 (香港分行) 3.343% 2031 年 10 月 2 日	10,000,000	10,503,600	0.39
开泰银行大众有限公司香港 2049 年 12 月 31 日	7,364,000	7,763,202	0.29
MINOR INTERNATIONAL PCL 3.1% 永续债券	10,193,000	10,312,870	0.39
MINOR INTERNATIONAL PCL 4.661% 永续债 券	2,500,000	2,549,150	0.10
PTTEP TREASURY CENTER CO LTD 2.587% 2027 年 6 月 10 日	2,545,000	2,696,529	0.10
SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC COMPANY LIMITED (CAYMAN ISLANDS BRANCH) 3.9% 2024 年 2 月 11 日	3,500,000	3,785,705	0.14
TMB BANK PUBLIC COMPANY LTD (CAYMAN ISLANDS BRANCH) 4.9% 永续债 券	6,270,000	6,290,064	0.23
		<u>62,856,200</u>	<u>2.34</u>

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

	持有量	市场价 值 美元	占资产 净值百 分比
债券			
上市投资 (续)			
美国			
PERIAMA HOLDINGS LLC 5.95% 2026 年 4 月 19 日	13,771,000	<u>14,646,560</u>	<u>0.55</u>
未上市但有报价的投资			
英属维尔京群岛			
WHARF REIC FINANCE BVI LTD 3.7% 2025 年 7 月 16 日	35,000,000	<u>5,550,263</u>	<u>0.21</u>
开曼群岛			
新鸿基地产发展有限公司 3.2% 2027 年 8 月 14 日	45,000,000	<u>7,036,015</u>	<u>0.26</u>
香港特别行政区			
HKCG FINANCE LTD 3% 2023 年 10 月 30 日	70,000,000	10,910,357	0.40
HKCG FINANCE LTD 4.45% 2021 年 9 月 26 日	20,000,000	3,136,401	0.12
		<u>14,046,758</u>	<u>0.52</u>
债务证券 (合计)		<u>2,654,029,656</u>	<u>99.00</u>

投资组合报表

汇丰亚洲债券基金

2021 年 1 月 31 日

	持有量	市场价 值 美元	占资产 净值百 分比
单位信托			
上市投资			
爱尔兰			
汇丰美元流动性基金 Y*	4,704,807	4,704,807	0.18
未上市但有报价的投资			
香港特别行政区			
HSBC ALL CHINA BOND ZC-USD	150,000	1,825,050	0.07
单位信托 (合计)		6,529,857	0.25
衍生资产			
外币远期合同		509,544	0.02
金融资产合计		2,661,069,057	99.27
金融负债			
衍生负债			
外币远期合同		(482,792)	(0.02)
金融负债总额		(482,792)	(0.02)
净投资总额			
(投资成本合计: 2,556,755,635 美元)		2,660,586,265	99.25
其他资产净值		20,177,071	0.75
资产净值总额		2,680,763,336	100.00

* 投资基金未在香港获得认可，不向香港公众发行。

投资组合变动表

汇丰亚洲债券基金

2020年8月1日至2021年1月31日期间

	占资产净 值百分比 2021年1月31 日	占资产净 值百分比 2020年7月31 日
金融资产		
债务证券		
债券		
上市投资	98.01	94.52
未上市但有报价的投资	0.99	3.57
债务证券 (合计)	<u>99.00</u>	<u>98.09</u>
单位信托		
上市投资	0.18	-
未上市但有报价的投资	0.07	1.15
单位信托 (合计)	<u>0.25</u>	<u>1.15</u>
衍生资产		
外币远期合同	0.02	0.03
金融负债		
衍生负债		
外币远期合同	(0.02)	-
总投资	<u>99.25</u>	<u>99.27</u>
其他资产净值	<u>0.75</u>	<u>0.73</u>
资产净值总额	<u>100.00</u>	<u>100.00</u>

金融衍生工具明细表

汇丰亚洲债券基金

2021年1月31日

外币远期合同

2021年1月31日，本基金持有的未平仓外币远期合同如下：

货币/ 买入金额	货币/ 卖出金额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
金融资产：				
440,000,000 元离岸人民币	67,903,330 美元	2021年2月26日	法国东方汇理银行	280,837
25,309 美元	32,840 澳元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	109
68,663,497 元离岸人民币	10,570,979 美元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	69,392
232,568 元离岸人民币	35,761 美元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	279
16,090,969 欧元	19,526,986 美元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	31,426
8,307,584 元离岸人民币	1,278,981 美元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	8,396
399 元离岸人民币	61 美元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	-
4,056 美元	5,263 澳元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	17
19,795,871 元离岸人民币	3,047,642 美元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	20,006
333,208 美元	430,100 澳元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	3,171

金融衍生工具明细表

汇丰亚洲债券基金

2021年1月31日

外币远期合同

货币/ 买入金额	货币/ 卖出金额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
金融资产：				
24,500 元离岸人 民币	3,779 美元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	17
284,286 美元	233,546 欧元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	413
98 元离岸人民币	15 美元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	-
5,162 美元	6,715 澳元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	9
15,789 元离岸人 民币	2,426 美元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	21
2,395 元离岸人民 币	368 美元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	3
19,600 元离岸人 民币	3,012 美元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	26
420,750 元离岸 人民币	64,867 美元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	334
158,408 欧元	192,130 美元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	414
105,000,000 新加 坡元	79,022,826 美 元	2021年3月31日	法国东方汇理银行	94,674
				<u>509,544</u>

金融衍生工具明细表

汇丰亚洲债券基金

2021年1月31日

外币远期合同

货币/ 买入金额	货币/卖出金额	结算日期	交易对手	公允价值 美元
金融负债：				
200,123,616 澳元	154,044,553 美元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	(479,896)
983,891 澳元	757,347 美元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	(2,359)
	242,584 元离			
37,418 美元	岸人民币	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	(174)
20 澳元	15 美元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	-
389,402 美元	507,689 澳元	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	(173)
	38,446 元离岸			
5,927 美元	人民币	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	(31)
	197,118 元离			
30,388 美元	岸人民币	2021年2月26日	汇丰市场财资服务	(159)
				(482,792)

业绩表现记录

汇丰亚洲债券基金

(a) 价格纪录 (交易份额净值)

AC 类 - 港元份额				
年份	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2011	9.996	10.160	10.270	10.480
2012	6.567	10.301	6.770	10.620
AC 类 - 美元份额				
年份	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2011	9.970	10.180	10.280	10.490
2012	9.573	10.823	9.869	11.158
2013	10.369	11.442	10.968	11.796
2014	10.638	11.737	10.967	12.100
2015	10.695	12.224	12.057	12.602
2016	11.925	12.874	12.294	13.272
2017	12.416	13.028	13.028	13.420
2018	12.724	13.193	13.118	13.601
2019	12.699	14.007	12.730	14.007
2020	12.991	15.093	12.991	15.093
2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日	13.436	15.364	13.436	15.364
AM 类 - 港元份额				
年份	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2011	9.940	10.100	10.240	10.410
2012	9.409	10.287	9.700	10.605
2013	9.791	10.561	10.094	10.888
2014	9.687	10.300	9.987	10.619
2015	10.131	10.418	10.441	10.743
2016	9.990	10.502	10.300	10.828
2017	10.000	10.560	10.300	10.886
2018	9.762	10.413	10.060	10.734
2019	9.565	10.234	9.587	10.234
2020	9.493	10.591	9.493	10.591
2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日	9.493	10.591	9.493	10.591

业绩表现记录

年份	AM 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2011	8.800	9.220	9.080	9.520
2012	8.493	9.314	8.756	9.602
2013	8.860	9.555	9.134	9.851
2014	8.770	9.335	9.041	9.624
2015	9.176	9.439	9.460	9.731
2016	9.049	9.508	9.329	9.802
2017	9.049	9.566	9.263	9.862
2018	8.738	9.362	9.008	9.652
2019	8.585	9.187	8.601	9.187
2020	8.599	9.575	8.599	9.575
2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日	8.599	9.575	8.599	9.575

年份	AMH 类 - 澳元份额			
	买入		卖出	
	最低 澳元	最高 澳元	最低 澳元	最高 澳元
2013	9.239	10.026	9.525	10.336
2014	9.194	9.823	9.478	10.127
2015	9.700	10.026	10.000	10.337
2016	9.564	10.035	9.860	10.344
2017	9.546	10.095	9.793	10.407
2018	9.229	9.890	9.514	10.195
2019	9.067	9.687	9.082	9.687
2020	9.048	10.100	9.048	10.100
2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日	9.048	10.100	9.048	10.100

年份	AMH 类 - 欧元份额			
	买入		卖出	
	最低 欧元	最高 欧元	最低 欧元	最高 欧元
2013	9.391	10.138	9.681	10.452
2014	9.295	9.861	9.582	10.166
2015	9.715	10.030	10.016	10.341
2016	9.567	10.026	9.864	10.336
2017	9.512	10.080	9.724	10.392
2018	9.116	9.807	9.398	10.111
2019	8.958	9.567	8.969	9.567
2020	8.927	9.975	8.927	9.975
2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日	8.927	9.975	8.927	9.975

业绩表现记录

AMH 类 - 人民币份额				
年份	买入		卖出	
	最低人民币	最高人民币	最低人民币	最高人民币
2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日	10.000	10.231	10.000	10.231
BC 类 - 港元份额				
年份	买入		卖出	
	最低港元	最高港元	最低港元	最高港元
2020	9.974	10.500	9.974	10.500
2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日	9.974	10.692	9.974	10.692
BC 类 - 人民币份额				
年份	买入		卖出	
	最低人民币	最高人民币	最低人民币	最高人民币
2020	9.999	10.404	9.999	10.404
2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日	9.605	10.406	9.605	10.406
BC 类 - 美元份额				
年份	买入		卖出	
	最低美元	最高美元	最低美元	最高美元
2020	9.951	10.607	9.951	10.607
2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日	9.951	10.798	9.951	10.798

业绩表现记录

BCH 类 - 人民币份额				
年份	买入		卖出	
	最低人民币	最高人民币	最低人民币	最高人民币
2020	10.000	10.642	10.000	10.642
2020年8月1日至2021年1月31日	10.000	10.941	10.000	10.941
BM2 类 - 港元份额				
年份	买入		卖出	
	最低港元	最高港元	最低港元	最高港元
2020	9.985	10.483	9.985	10.483
2020年8月1日至2021年1月31日	9.985	10.531	9.985	10.531
BM2 类 - 人民币份额				
年份	买入		卖出	
	最低人民币	最高人民币	最低人民币	最高人民币
2020	10.000	10.395	10.000	10.395
2020年8月1日至2021年1月31日	9.459	10.395	9.459	10.395
BM2 类 - 美元份额				
年份	买入		卖出	
	最低美元	最高美元	最低美元	最高美元
2020	9.951	10.558	9.951	10.558
2020年8月1日至2021年1月31日	9.951	10.606	9.951	10.606
BM3H 类 - 澳元份额				
年份	买入		卖出	
	最低澳元	最高澳元	最低澳元	最高澳元
2020	10.000	10.504	10.000	10.504
2020年8月1日至2021年1月31日	10.000	10.550	10.000	10.550
BM3H 类 - 人民币份额				
年份	买入		卖出	
	最低人民币	最高人民币	最低人民币	最高人民币
2020	9.977	10.515	9.977	10.515
2020年8月1日至2021年1月31日	9.977	10.549	9.977	10.549

业绩表现记录

年份	IC 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2011	10.000	10.070	10.000	10.070
2012	9.474	10.753	9.474	10.753
2013	10.613	11.407	10.613	11.407
2014	10.623	11.781	10.623	11.781
2015	11.739	12.310	11.739	12.310
2016	12.030	13.038	12.030	13.038
2017	12.596	13.255	12.596	13.255
2018	12.991	13.429	12.991	13.429
2019	12.994	14.379	12.994	14.379
2020	13.302	15.564	13.302	15.564
2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日	13.833	15.879	13.833	15.879

年份	ID 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2011	9.450	10.100	9.460	10.100
2012	9.150	10.395	9.150	10.395
2013	9.655	10.594	9.655	10.594
2014	9.443	10.523	9.443	10.523
2015	10.003	10.541	10.003	10.541
2016	9.903	10.759	9.903	10.759
2017	10.057	10.573	10.057	10.573
2018	9.648	10.296	9.648	10.296
2019	9.578	10.594	9.578	10.594
2020	9.805	11.024	9.805	11.024
2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日	9.813	11.024	9.813	11.024

业绩表现记录

年份	IM 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日	9.989	10.229	9.989	10.229

年份	ZD 类 - 美元份额			
	买入		卖出	
	最低 美元	最高 美元	最低 美元	最高 美元
2011	9.490	10.200	9.500	10.200
2012	9.245	10.533	9.247	10.533
2013	9.844	10.785	9.844	10.785
2014	9.634	10.723	9.634	10.723
2015	10.246	10.789	10.246	10.789
2016	10.152	11.060	10.156	11.060
2017	10.386	10.957	10.386	10.957
2018	9.986	10.678	9.986	10.678
2019	9.928	11.026	9.928	11.026
2020	10.173	11.469	10.173	11.469
2020 年 8 月 1 日至 2021 年 1 月 31 日	10.189	11.469	10.189	11.469

业绩表现记录

(b) 总资产净值 (按《香港财务报告准则》计算)

	2021年1月31日 美元	2020 美元	2019 美元	2018 美元
总资产净值	2,680,763,336	2,347,012,052	2,215,954,265	1,815,778,109

(c) 份额净值 (按《香港财务报告准则》计算)

	计价 货币	2021年1月31 日	2020	2019	2018
份额净值					
- AC 类 - 美元	美元	15.306	15.033	14.007	12.808
- AM 类 - 港元	港元	10.468	10.447	10.215	9.788
- AM 类 - 美元	美元	9.485	9.467	9.162	8.760
- AMH 类 - 澳元	澳元	10.466	9.966	9.671	9.253
- AMH 类 - 欧元	欧元	9.858	9.838	9.563	9.146
- AMH 类 - 人民币	人民币	10.113	-	-	-
- BC 类 - 港元	港元	10.654	10.459	-	-
- BC 类 - 人民币	人民币	9.682	10.324	-	-
- BC 类 - 美元	美元	10.757	10.566	-	-
- BCH 类 - 人民币	人民币	10.906	10.603	-	-
- BM2 类 - 港元	港元	10.452	10.426	-	-
- BM2 类 - 人民币	人民币	9.508	10.285	-	-
- BM2 类 - 美元	美元	10.520	10.502	-	-
- BM3H 类 - 澳元	澳元	6.610	10.447	-	-
- BM3H 类 - 人民币	人民币	10.442	10.445	-	-
- IC 类 - 美元	美元	15.820	15.502	14.379	13.089
- ID 类 - 美元	美元	10.800	10.584	10.200	9.648
- IM 类 - 美元	美元	10.166	-	-	-
- ZD 类 - 美元	美元	11.214	10.959	10.554	9.986

收益分配表

汇丰亚洲债券基金

AM 类 - 港元份额	除息日期	付款日期	每份额分配 港元	分配总额 港元
第 1 次分配	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0278	12,235,938
第 2 次分配	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0274	12,605,572
第 3 次分配	2020年10月30日	2020年11月10日	0.0275	13,017,842
第 4 次分配	2020年11月30日	2020年12月9日	0.0290	13,955,996
第 5 次分配	2020年12月31日	2021年1月12日	0.0295	13,799,188
第 6 次分配	2021年1月29日	2021年2月9日	0.0270	13,176,823

AM 类 - 美元份额	除息日期	付款日期	每份额分配 美元	分配总额 美元
第 1 次分配	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0252	3,913,555
第 2 次分配	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0248	3,924,389
第 3 次分配	2020年10月30日	2020年11月10日	0.0249	3,997,167
第 4 次分配	2020年11月30日	2020年12月9日	0.0263	4,208,578
第 5 次分配	2020年12月31日	2021年1月12日	0.0268	4,198,250
第 6 次分配	2021年1月29日	2021年2月9日	0.0245	3,832,658

AMH 类 - 澳元份 额	除息日期	付款日期	每份额分配 澳元	分配总额 澳元
第 1 次分配	2020年8月31日	2020年9月9日	0.025	448,503
第 2 次分配	2020年9月30日	2020年10月13日	0.025	448,363
第 3 次分配	2020年10月30日	2020年11月10日	0.025	496,444
第 4 次分配	2020年11月30日	2020年12月9日	0.026	531,054
第 5 次分配	2020年12月31日	2021年1月12日	0.027	521,882
第 6 次分配	2021年1月29日	2021年2月9日	0.025	354,547

AMH 类 - 欧元份 额	除息日期	付款日期	每份额分配 欧元	分配总额 欧元
第 1 次分配	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0193	26,459
第 2 次分配	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0192	26,834
第 3 次分配	2020年10月30日	2020年11月10日	0.0193	28,022
第 4 次分配	2020年11月30日	2020年12月9日	0.0205	30,794
第 5 次分配	2020年12月31日	2021年1月12日	0.0204	30,701
第 6 次分配	2021年1月29日	2021年2月9日	0.0112	18,166

收益分配表

汇丰亚洲债券基金

AMH 类 - 人民币 份额	除息日期	付款日期	每份额分配 人民币	分配总额 人民币
第 1 次分配	2020年8月31日	2020年9月9日	-	-
第 2 次分配	2020年9月30日	2020年10月13日	-	-
第 3 次分配	2020年10月30日	2020年11月10日	-	-
第 4 次分配	2020年11月30日	2020年12月9日	0.0491	33
第 5 次分配	2020年12月31日	2021年1月12日	0.0548	1,323
第 6 次分配	2021年1月29日	2021年2月9日	0.0452	308,416
BM2 类 - 港元份 额	除息日期	付款日期	每份额分配 港元	分配总额 港元
第 1 次分配	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0278	3,998
第 2 次分配	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0273	5,982
第 3 次分配	2020年10月30日	2020年11月10日	0.0274	7,299
第 4 次分配	2020年11月30日	2020年12月9日	0.0290	9,736
第 5 次分配	2020年12月31日	2021年1月12日	0.0295	10,335
第 6 次分配	2021年1月29日	2021年2月9日	0.0270	9,526
BM2 类 - 人民币 份额	除息日期	付款日期	每份额分配 人民币	分配总额 人民币
第 1 次分配	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0274	11,817
第 2 次分配	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0264	13,655
第 3 次分配	2020年10月30日	2020年11月10日	0.0263	14,439
第 4 次分配	2020年11月30日	2020年12月9日	0.0274	16,328
第 5 次分配	2020年12月31日	2021年1月12日	0.0274	11,021
第 6 次分配	2021年1月29日	2021年2月9日	0.0248	8,257
BM2 类 - 美元份 额	除息日期	付款日期	每份额分配 美元	分配总额 美元
第 1 次分配	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0280	11,001
第 2 次分配	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0275	12,738
第 3 次分配	2020年10月30日	2020年11月10日	0.0276	14,879
第 4 次分配	2020年11月30日	2020年12月9日	0.0292	16,040
第 5 次分配	2020年12月31日	2021年1月12日	0.0297	15,918
第 6 次分配	2021年1月29日	2021年2月9日	0.0272	14,683

收益分配表

汇丰亚洲债券基金

BM3H 类 - 澳元 份额	除息日期	付款日期	每份额分配 澳元	分配总额 澳元
第 1 次分配	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0262	2,208
第 2 次分配	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0258	2,468
第 3 次分配	2020年10月30日	2020年11月10日	0.0261	2,608
第 4 次分配	2020年11月30日	2020年12月9日	0.0272	2,723
第 5 次分配	2020年12月31日	2021年1月12日	0.0267	2,633
第 6 次分配	2021年1月29日	2021年2月9日	0.0187	1,745

BM3H 类 - 人民 币份额	除息日期	付款日期	每份额分配 人民币	分配总额 人民币
第 1 次分配	2020年8月31日	2020年9月9日	0.0465	35,162
第 2 次分配	2020年9月30日	2020年10月13日	0.0475	48,153
第 3 次分配	2020年10月30日	2020年11月10日	0.0530	67,301
第 4 次分配	2020年11月30日	2020年12月9日	0.0505	78,764
第 5 次分配	2020年12月31日	2021年1月12日	0.0564	102,918
第 6 次分配	2021年1月29日	2021年2月9日	0.0464	86,763

IM2 类 - 美元份额	除息日期	付款日期	每份额分配 美元	分配总额 美元
第 1 次分配	2020年8月31日	2020年9月9日	-	-
第 2 次分配	2020年9月30日	2020年10月13日	-	-
第 3 次分配	2020年10月30日	2020年11月10日	-	-
第 4 次分配	2020年11月30日	2020年12月9日	0.0282	2,820
第 5 次分配	2020年12月31日	2021年1月12日	0.0287	2,870
第 6 次分配	2021年1月29日	2021年2月9日	0.0262	2,620

行政

管理人

汇丰投资基金 (香港) 有限公司
香港中环
皇后大道中 1 号
汇丰总行大厦

管理人董事

鲍国贤(2020 年 8 月 28 日辞任)
巴培卓
马浩德
谭振邦
刘嘉燕

投资顾问

汇丰环球投资管理 (香港) 有限公司
香港中环
皇后大道中 1 号
汇丰总行大厦

保管人、受托人和基金注册登记机构

汇丰机构信托服务 (亚洲) 有限公司
香港中环
皇后大道中 1 号
汇丰总行大厦

审计师

毕马威会计师事务所
香港中环
遮打道 10 号
太子大厦 8 楼