

汇丰投资信托基金 – 汇丰亚洲高收益债券基金

2022年中期报告



HSBC Global Asset Management
汇丰 环球投资管理

汇丰亚洲高收益债券基金
(汇丰投资信托基金之子基金)

2022 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	12
投资组合报表	13
投资组合变动表	33
金融衍生工具明细表	34
业绩表现记录	39
收益分配表	47
行政	51

财务状况表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 年 1 月 31 日

	2022 年 1 月 31 日 美元	2021 年 7 月 31 日 美元
资产		
以公允价值计入损益账的金融资产	2,570,202,200	3,297,913,179
应收利息	39,740,324	45,417,040
应收申购款	6,161,666	43,087,028
应收经纪商款项	153,302,234	32,732,068
现金和现金等价物	9,748,769	16,683,270
	<u>2,779,155,193</u>	<u>3,435,832,585</u>
负债		
以公允价值计入损益账的金融负债	4,657,683	5,208,217
应付赎回款	15,558,560	18,897,097
应付经纪商款项	11,861,144	134,419,661
应付税项	32,473	32,016
应付分配	19,089,484	18,907,774
其他应付款	2,954,199	3,457,055
	<u>54,153,543</u>	<u>180,921,820</u>
份额持有人应占资产净值	<u>2,725,001,650</u>	<u>3,254,910,765</u>
相当于： 金融负债	<u>2,725,001,650</u>	<u>3,254,910,765</u>
	份额	份额
已发行份额总数		
- AC 类 - 港元	3,861,664	3,267,800
- AC 类 - 新加坡元	906,632	645,687
- AC 类 - 美元	12,069,542	12,097,403
- AM2 类 - 港元	381,122,633	407,323,743
- AM2 类 - 美元	139,530,694	144,825,462
- AM2 类 - 新加坡元	3,219,407	3,006,811
- AM3H 类 - 澳元	11,696,925	13,401,532
- AM3H 类 - 欧元	2,609,714	2,592,711
- AM3H 类 - 人民币	61,174,962	59,413,392
- AM3H 类 - 新加坡元	18,098,495	14,893,498
- BC 类 - 港元	1,605,277	1,756,413
- BC 类 - 人民币	5,621,523	4,806,117
- BC 类 - 美元	8,159,790	14,270,366

财务状况表 (续)

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 年 1 月 31 日

	2022 年 1 月 31 日 份额	2021 年 7 月 31 日 份额
已发行份额总数 (续)		
- BCH 类 - 人民币	24,802,252	34,999,692
- BM2 类 - 港元	4,851,948	4,814,479
- BM2 类 - 人民币	16,400,792	14,609,409
- BM2 类 - 美元	9,844,114	9,270,552
- BM3H 类 - 澳元	698,018	566,722
- BM3H 类 - 人民币	39,393,409	40,020,252
- IC 类 - 美元	24,885,886	15,804,919
- IM2 类 - 港元	47,894,739	47,894,739
- IM2 类 - 美元	18,205,363	11,967,405
- ZD2 类 - 美元	7,816,739	7,126,471
	美元	美元
份额净值		
- AC 类 - 港元	1.887	2.201
- AC 类 - 新加坡元	6.322	7.368
- AC 类 - 美元	14.680	17.114
- AM2 类 - 港元	0.988	1.208
- AM2 类 - 美元	7.681	7.199
- AM2 类 - 新加坡元	5.892	9.386
- AM3H 类 - 澳元	5.248	6.694
- AM3H 类 - 欧元	8.224	10.632
- AM3H 类 - 人民币	1.188	1.432
- AM3H 类 - 新加坡元	5.822	7.105
- BC 类 - 港元	1.212	1.413
- BC 类 - 人民币	1.322	1.541
- BC 类 - 美元	9.425	10.988
- BCH 类 - 人民币	1.542	1.750
- BM2 类 - 港元	1.083	1.324
- BM2 类 - 人民币	1.177	1.439
- BM2 类 - 美元	8.373	10.232
- BM3H 类 - 澳元	5.887	7.513
- BM3H 类 - 人民币	1.309	1.578
- IC 类 - 美元	10.447	12.154
- IM2 类 - 港元	1.007	1.228
- IM2 类 - 美元	7.903	9.638
- ZD2 类 - 美元	8.605	9.969

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

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2022 年 1 月 31 日止期间

	2021 年 8 月 1 日 至 2022 年 1 月 31 日 美元	2020 年 8 月 1 日 至 2021 年 1 月 31 日 美元
利息收入	1,646	3,861
股息收入	36,783	23,695
以公允价值计入损益账的金融工具的(亏损)/收益净值	(440,381,505)	104,447,934
外汇(亏损)/收入	(258,244)	269,707
其他收入	116,530	59,269
(亏损)/收入总额	(440,484,790)	104,804,466
管理费 ^{附注 2}	17,844,722	11,531,689
交易费用 ^{附注 1}	54,767	28,812
受托人费用 ^{附注 1}	1,076,764	663,642
基金注册登记机构费用 ^{附注 1}	152,841	150,707
审计师酬金	6,109	5,998
律师费及专业人员费用 ^{附注 1}	4,813	24,878
保管费、银行手续费及杂费 ^{附注 1}	129,949	115,873
总经营开支	19,269,965	12,521,599
税前经营净(亏损)/利润	(459,754,755)	92,282,867
税项	(5,060)	-
收益分配前经营净(亏损)/利润	(459,759,815)	92,282,867
向份额持有人作出收益分配	(109,205,595)	(51,153,192)
本期份额持有人应占资产净值(减少)/增加	(568,965,410)	41,129,675

全面收益表

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2022 年 1 月 31 日止期间

附注 1: 在分别截至 2022 年和 2021 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:

	2021 年 8 月 1 日 至 2022 年 1 月 31 日 美元	2020 年 8 月 1 日 至 2021 年 1 月 31 日 美元
交易费用	27,751	21,174
律师费及专业人员费用	560	914
保管费、银行手续费及杂费	128,041	97,267

附注 2: 在分别截至 2022 年和 2021 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

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2022 年 1 月 31 日止期间

	2021 年 8 月 1 日 至 2022 年 1 月 31 日 美元	2020 年 8 月 1 日 至 2021 年 1 月 31 日 美元
期初余额	3,254,910,765	1,320,576,135
本期份额持有人应占资产净值(减少)/增加	(568,965,410)	41,129,675
份额认/申购 (不含均衡)		
- AC 类 - 港元	2,356,021	9,603,877
- AC 类 - 新加坡元	2,218,333	1,030,247
- AC 类 - 美元	35,827,698	135,335,617
- AM2 类 - 港元	69,362,080	214,402,353
- AM2 类 - 美元	218,037,063	640,152,381
- AM2 类 - 新加坡元	3,673,536	14,726,576
- AM3H 类 - 澳元	8,782,044	64,949,438
- AM3H 类 - 欧元	3,124,794	20,658,578
- AM3H 类 - 人民币	14,634,981	40,420,282
- AM3H 类 - 新加坡元	27,591,503	63,743,307
- BC 类 - 港元	177,756	549,876
- BC 类 - 人民币	1,783,959	3,825,924
- BC 类 - 美元	10,567,571	17,212,991
- BCH 类 - 人民币	2,691,230	47,957,221
- BM2 类 - 港元	545,038	2,959,788
- BM2 类 - 人民币	4,234,635	14,862,323
- BM2 类 - 美元	14,220,338	36,245,741
- BM3H 类 - 澳元	1,082,306	1,422,987
- BM3H 类 - 人民币	9,467,772	25,963,317
- IC 类 - 美元	162,026,138	183,404,994
- IM2 类 - 美元	74,491,857	54,323,168
- ZD2 类 - 美元	8,220,325	4,570,659
份额赎回 (不含均衡)		
- AC 类 - 港元	(1,207,204)	(5,605,608)
- AC 类 - 新加坡元	(455,081)	(223,053)
- AC 类 - 美元	(36,787,725)	(18,320,943)
- AM2 类 - 港元	(100,163,186)	(87,627,477)
- AM2 类 - 美元	(266,326,156)	(219,832,140)
- AM2 类 - 新加坡元	(2,355,908)	(777,515)
- AM3H 类 - 澳元	(19,821,905)	(33,929,332)
- AM3H 类 - 欧元	(3,081,296)	(3,322,362)
- AM3H 类 - 人民币	(11,857,653)	(276,549)
- AM3H 类 - 新加坡元	(5,592,826)	(1,687,245)

份额持有人应占资产净值变动表

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2022 年 1 月 31 日止期间

	2021 年 8 月 1 日 至 2022 年 1 月 31 日 美元	2020 年 8 月 1 日 至 2021 年 1 月 31 日 美元
份额认购 (不含均衡) (续)		
- BC 类 - 港元	(365,247)	(195,454)
- BC 类 - 人民币	(659,286)	(902,921)
- BC 类 - 美元	(74,318,367)	(3,502,085)
- BCH 类 - 人民币	(18,509,891)	(5,151,687)
- BM2 类 - 港元	(461,741)	(123,977)
- BM2 类 - 人民币	(1,958,168)	(1,764,921)
- BM2 类 - 美元	(8,999,107)	(3,662,660)
- BM3H 类 - 澳元	(222,590)	(36,986)
- BM3H 类 - 人民币	(10,440,154)	(3,613,706)
- IC 类 - 美元	(65,124,021)	(57,315,754)
- IM2 类 - 美元	(18,569,840)	(16,408,644)
- ZD2 类 - 美元	(1,693,980)	(994,033)
认购和赎回均衡	12,910,649	12,089,629
	<u>39,056,295</u>	<u>1,145,136,222</u>
期末余额	<u>2,725,001,650</u>	<u>2,506,842,032</u>
	份额	份额
AC 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	3,267,800	2,037,022
期间发行份额数	1,175,503	4,494,552
期间赎回份额数	(581,639)	(3,134,786)
结转后期已发行份额数	<u>3,861,664</u>	<u>3,396,788</u>

份额持有人应占资产净值变动表

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2022 年 1 月 31 日止期间

	2021 年 8 月 1 日 至 2022 年 1 月 31 日 份额	2020 年 8 月 1 日 至 2021 年 1 月 31 日 份额
AC 类 - 新加坡元份额		
结转前期已发行份额数	645,687	385,052
期间发行份额数	332,043	903,105
期间赎回份额数	(71,098)	(794,513)
结转后期已发行份额数	906,632	493,644
AC 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	12,097,403	3,782,132
期间发行份额数	2,308,085	14,155,745
期间赎回份额数	(2,335,946)	(6,912,799)
结转后期已发行份额数	12,069,542	11,025,078
AM2 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	407,323,743	217,821,625
期间发行份额数	62,116,543	165,783,244
期间赎回份额数	(88,317,653)	(68,157,295)
结转后期已发行份额数	381,122,633	315,447,574
AM2 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	144,825,462	78,274,841
期间发行份额数	25,086,301	85,462,186
期间赎回份额数	(30,381,069)	(43,972,455)
结转后期已发行份额数	139,530,694	119,764,572
AM2 类 - 新加坡元份额		
结转前期已发行份额数	3,006,811	972,369
期间发行份额数	549,916	5,516,528
期间赎回份额数	(337,320)	(3,728,748)
结转后期已发行份额数	3,219,407	2,760,149

份额持有人应占资产净值变动表

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2022 年 1 月 31 日止期间

	2021 年 8 月 1 日 至 2022 年 1 月 31 日 份额	2020 年 8 月 1 日 至 2021 年 1 月 31 日 份额
AM3H 类 - 澳元份额		
结转前期已发行份额数	13,401,532	7,770,816
期间发行份额数	1,428,964	10,199,178
期间赎回份额数	(3,133,571)	(5,805,910)
结转后期已发行份额数	11,696,925	12,164,084
AM3H 类 - 欧元份额		
结转前期已发行份额数	2,592,711	866,649
期间发行份额数	343,035	2,331,762
期间赎回份额数	(326,032)	(810,942)
结转后期已发行份额数	2,609,714	2,387,469
AM3H 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	59,413,392	782,818
期间发行份额数	10,776,342	26,627,408
期间赎回份额数	(9,014,772)	(996,579)
结转后期已发行份额数	61,174,962	26,413,647
AM3H 类 - 新加坡元份额		
结转前期已发行份额数	14,893,498	1,444,992
期间发行份额数	4,052,175	19,042,401
期间赎回份额数	(847,178)	(11,159,768)
结转后期已发行份额数	18,098,495	9,327,625
BC 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	1,756,413	264,097
期间发行份额数	129,168	382,972
期间赎回份额数	(280,304)	(135,658)
结转后期已发行份额数	1,605,277	511,411

份额持有人应占资产净值变动表

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2022 年 1 月 31 日止期间

	2021 年 8 月 1 日 至 2022 年 1 月 31 日 份额	2020 年 8 月 1 日 至 2021 年 1 月 31 日 份额
BC 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	4,806,117	1,505,713
期间发行份额数	1,292,215	2,455,954
期间赎回份额数	(476,809)	(579,661)
结转后期已发行份额数	5,621,523	3,382,006
BC 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	14,270,366	679,618
期间发行份额数	959,495	1,554,478
期间赎回份额数	(7,070,071)	(314,274)
结转后期已发行份额数	8,159,790	1,919,822
BCH 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	34,999,692	3,225,705
期间发行份额数	1,671,465	28,719,496
期间赎回份额数	(11,868,905)	(2,997,738)
结转后期已发行份额数	24,802,252	28,947,463
BM2 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	4,814,479	498,478
期间发行份额数	430,480	2,076,060
期间赎回份额数	(393,011)	(85,140)
结转后期已发行份额数	4,851,948	2,489,398
BM2 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	14,609,409	2,302,092
期间发行份额数	3,291,494	9,537,238
期间赎回份额数	(1,500,111)	(1,126,027)
结转后期已发行份额数	16,400,792	10,713,303

份额持有人应占资产净值变动表

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2022 年 1 月 31 日止期间

	2021 年 8 月 1 日 至 2022 年 1 月 31 日 份额	2020 年 8 月 1 日 至 2021 年 1 月 31 日 份额
BM2 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	9,270,552	1,773,087
期间发行份额数	1,523,290	3,286,530
期间赎回份额数	(949,728)	(328,342)
结转后期已发行份额数	9,844,114	4,731,275
BM3H 类 - 澳元份额		
结转前期已发行份额数	566,722	115,350
期间发行份额数	162,328	181,440
期间赎回份额数	(31,032)	(4,535)
结转后期已发行份额数	698,018	292,255
BM3H 类 - 人民币份额		
结转前期已发行份额数	40,020,252	5,160,101
期间发行份额数	6,435,288	15,539,693
期间赎回份额数	(7,062,131)	(2,121,762)
结转后期已发行份额数	39,393,409	18,578,032
IC 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	15,804,919	3,609,632
期间发行份额数	15,755,708	16,618,231
期间赎回份额数	(6,674,741)	(5,632,910)
结转后期已发行份额数	24,885,886	14,594,953
IM2 类 - 港元份额		
结转前期已发行份额数	47,894,739	-
期间发行份额数	-	-
期间赎回份额数	-	-
结转后期已发行份额数	47,894,739	-

份额持有人应占资产净值变动表

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2022 年 1 月 31 日止期间

	2021 年 8 月 1 日 至 2022 年 1 月 31 日 份额	2020 年 8 月 1 日 至 2021 年 1 月 31 日 份额
IM2 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	11,967,405	1,207,991
期间发行份额数	8,222,843	5,657,488
期间赎回份额数	(1,984,885)	(1,995,077)
结转后期已发行份额数	<u>18,205,363</u>	<u>4,870,402</u>
ZD2 类 - 美元份额		
结转前期已发行份额数	7,126,471	441,592
期间发行份额数	887,488	431,313
期间赎回份额数	(197,220)	(94,475)
结转后期已发行份额数	<u>7,816,739</u>	<u>778,430</u>

现金流量表

汇丰亚洲高收益债券基金

截至 2022 年 1 月 31 日止期间

	2021 年 8 月 1 日 至 2022 年 1 月 31 日 美元	2020 年 8 月 1 日 至 2021 年 1 月 31 日 美元
经营活动		
已收利息	1,548	3,528
已收股息	36,783	23,695
已付管理费	(18,327,379)	(10,528,677)
已付受托人费用	(1,102,049)	(604,354)
购买投资的付款	(4,474,187,354)	(4,016,331,072)
出售投资的所得款项(包括已收投资的息票利息)	4,531,001,986	2,965,126,080
存放于经纪商的保证金存款	(7,487,561)	(1,578,384)
已付税项	(4,603)	2,378
其他已付经营开支	(485,107)	(162,866)
经营活动产生/(使用)的现金净额	29,446,264	(1,064,049,672)
融资活动		
份额发行所得款项 (含均衡)	734,362,768	1,582,130,820
份额赎回付款 (含均衡)	(661,719,648)	(462,086,619)
已付分配	(109,023,885)	(48,277,165)
融资活动 (使用)/产生的现金净额	(36,380,765)	1,071,767,036
现金和现金等价物(减少)/增加净额	(6,934,501)	7,717,364
期初现金和现金等价物	16,683,270	8,335,277
期末现金和现金等价物	9,748,769	16,052,641

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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			
澳大利亚			
PERENTI FINANCE PTY LTD 6.5% 2025 年 10 月 7 日	18,307,000	18,800,374	0.69
WESTPAC BANKING CORP 浮息永续债券 2049 年 12 月 29 日	3,000,000	3,055,110	0.11
		<u>21,855,484</u>	<u>0.80</u>
百慕大			
中油燃气集团 4.7% 2026 年 6 月 30 日	8,522,000	8,591,028	0.32
中油燃气集团有限公司 5.5% 2023 年 1 月 25 日	3,656,000	3,692,158	0.13
HOPSON DEVELOPMENT HLDGS 7% 2024 年 5 月 18 日	1,901,000	1,553,155	0.06
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS 6.8% 2023 年 12 月 28 日	2,210,000	1,878,831	0.07
STAR ENERGY CO ISSUE 4.85% 2038 年 10 月 14 日	17,703,000	18,570,624	0.68
		<u>34,285,796</u>	<u>1.26</u>
英属维尔京群岛			
CAS CAPITAL NO1 LTD 4% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	2,710,000	2,703,632	0.10
CHAMPION PATH HOLDINGS 4.85% 2028 年 1 月 27 日	7,341,000	6,333,007	0.23
CHAMPION SINCERITY HL 浮息永续债券 2049 年 12 月 31 日	2,000,000	1,999,000	0.07
CHEUNG KONG INFRASTRUCURE FINANCE BV 4% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	3,122,000	2,965,838	0.11
中国橡胶资本有限公司 3.90% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	4,289,000	4,321,125	0.16

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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)			
ENN CLEAN ENERGY 3.375% 12 MAY 2026 年 12 月 31 日	4,524,000	4,471,295	0.16
FLOURISH CENTURY HOLDINGS LTD 6.6% 2022 年 2 月 4 日	8,000,000	2,201,440	0.08
FORTUNE STAR BVI LTD 5% 2026 年 5 月 18 日	7,223,000	6,661,195	0.24
FORTUNE STAR BVI LTD 5.05% 2027 年 1 月 27 日	16,472,000	15,009,286	0.55
FORTUNE STAR BVI LTD 5.95% 2025 年 10 月 19 日	17,808,000	17,458,073	0.64
FORTUNE STAR BVI LTD 5.95% 2023 年 1 月 29 日	10,600,000	10,548,590	0.39
FORTUNE STAR BVI LTD 6.75% 2023 年 7 月 2 日	462,000	462,037	0.02
FORTUNE STAR BVI LTD 6.85% 2024 年 7 月 2 日	16,071,000	16,095,910	0.59
FPC RESOURCES 4.375% 2027 年 9 月 11 日	8,202,000	8,580,768	0.31
GREENLAND GLB INVST 5.875% 03 JULY 2024 年 12 月 31 日	1,363,000	1,077,942	0.04
GREENLAND GLB INVST 6.125% 2023 年 4 月 22 日	1,218,000	991,367	0.04
GREENLAND GLB INVST 6.75% 2022 年 4 月 21 日	802,000	725,401	0.03
GREENLAND GLB INVST 6.75% 2023 年 9 月 26 日	487,000	395,644	0.01
GREENLAND GLB INVST 7.25% 2022 年 3 月 12 日	500,000	482,820	0.02
GREENLAND GLB INVST 7.25% 2025 年 1 月 22 日	2,046,000	1,595,041	0.06
HUARONG FINANCE 2017 CO 3.75% 2022 年 4 月 27 日	17,730,000	17,753,936	0.65
HUARONG FINANCE 2017 CO 4% 永续债券 2049 年 12 月 29 日	17,266,000	17,230,777	0.63
HUARONG FINANCE 2017 CO FRN 2022 年 4 月 27 日	2,400,000	2,397,504	0.09
HUARONG FINANCE 2019 3.375% 2022 年 5 月 29 日	2,580,000	2,581,961	0.09
JGSH PHILIPPINES LTD 4.125% 2030 年 7 月 9 日	2,854,000	2,918,015	0.11
LS FINANCE 2017 LTD 4.8% 2026 年 6 月 18 日	13,786,000	13,019,498	0.48
新城环球有限公司 5% 2022 年 8 月 8 日	500,000	422,860	0.02

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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)			
新城环球有限公司 4.625% 2025 年 10 月 15 日	6,286,000	4,375,873	0.16
新城环球有限公司 4.8% 2024 年 12 月 15 日	7,775,000	5,657,479	0.21
新城环球有限公司 6.8% 2023 年 8 月 5 日	1,285,000	1,003,636	0.04
NWD FINANCE (BVI) LTD 4.125% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	12,842,000	12,513,758	0.46
NWD FINANCE (BVI) LTD 4.8% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	1,170,000	1,090,077	0.04
NWD FINANCE (BVI) LTD 6.25% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	9,494,000	9,621,125	0.35
RADIANCE CAPITAL INVESTMENT 8.8% 2023 年 9 月 17 日	4,368,000	4,040,618	0.15
RKP OVERSEAS FINANCE 2016 A LTD 7.95% 永续债券 2022 年 2 月 17 日	1,778,000	1,400,620	0.05
RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 5.9% 2025 年 3 月 5 日	13,671,000	12,036,632	0.44
RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 6% 2025 年 9 月 4 日	11,041,000	9,678,761	0.35
RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 6.7% 2024 年 9 月 30 日	3,000,000	2,701,290	0.10
RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 7.875% 2023 年 2 月 1 日	5,923,000	5,699,229	0.21
RKPF OVERSEAS 2019 E LTD 7.75% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	2,667,000	2,098,796	0.08
RKPF OVERSEAS 2020 A LTD 5.125% 2026 年 7 月 26 日	11,237,000	9,579,543	0.35
RKPF OVERSEAS 2020 A LTD 5.2% 2026 年 1 月 12 日	19,785,000	16,870,867	0.62
新城控股集团股份有限公司 7.5% 2022 年 3 月 20 日	7,700,000	7,504,959	0.28
STAR ENERGY GEOTHERMAL WAYANG WINDU LTD 6.75% 2033 年 4 月 24 日	4,000,000	3,590,642	0.13
STUDIO CITY FINANCE LTD 5% 2029 年 1 月 15 日	8,257,000	7,181,608	0.26

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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)			
STUDIO CITY FINANCE LTD 6% 2025 年 7 月 15 日	3,710,000	3,540,639	0.13
SUN HUNG KAI & CO BVI 5% 2026 年 9 月 7 日	6,250,000	6,307,500	0.23
万达地产海外 6.875% 2023 年 7 月 23 日	6,031,000	5,705,628	0.21
万达地产海外 7.25% 2022 年 4 月 28 日	8,153,000	8,051,577	0.30
		<u>301,654,819</u>	<u>11.07</u>
开曼群岛			
AC ENERGY FINANCE INTERNATIONAL LTD 5.1% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	6,733,000	6,822,751	0.25
ACEN FINANCE LTD 4% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	9,427,000	9,085,271	0.33
雅居乐集团控股有限公司 8.375% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	5,402,000	1,433,205	0.05
安东油田服务集团 7.5% 2022 年 12 月 2 日	17,767,000	16,792,302	0.62
AYC FINANCE LTD 3.9% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	10,055,000	9,439,936	0.35
AYC FINANCE LTD 4.85% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	841,000	846,265	0.03
CAR INC 8.875% 2022 年 5 月 10 日	18,971,000	18,875,955	0.69
CAR INC 9.75% 2024 年 3 月 31 日	15,223,000	15,042,303	0.55
中国宏桥集团有限公司 6.25% 2024 年 6 月 8 日	760,000	752,187	0.03
中国宏桥集团有限公司 7.125% 2022 年 7 月 22 日	17,554,000	17,642,472	0.65
中国宏桥集团有限公司 7.375% 2023 年 5 月 2 日	254,000	256,492	0.01
中骏集团控股有限公司 5.875% 2022 年 3 月 10 日	5,000,000	4,877,650	0.18
中骏集团控股有限公司 5.95% 2024 年 9 月 29 日	7,395,000	5,441,463	0.20

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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)			
中骏集团控股有限公司 6% 2026 年 2 月 4 日	12,945,000	8,883,247	0.33
中骏集团控股有限公司 7% 2025 年 5 月 2 日	23,507,000	16,593,121	0.61
中骏集团控股有限公司 7.25% 2023 年 4 月 19 日	2,638,000	2,115,254	0.08
中骏集团控股有限公司 7.375% 2024 年 4 月 9 日	14,210,000	10,875,197	0.40
旭辉控股 (集团) 有限公司 5.375% 永续债券 2049 年 12 月 29 日	682,000	644,606	0.02
旭辉控股集团 4.375% L 2027 年 4 月 12 日	6,917,000	5,821,278	0.21
旭辉控股集团 4.45% 2026 年 8 月 17 日	8,000,000	6,807,600	0.25
旭辉控股集团 4.8% 2028 年 5 月 17 日	17,179,000	14,322,991	0.53
旭辉控股集团 5.25% 2026 年 5 月 13 日	2,550,000	2,201,007	0.08
旭辉控股集团 5.5% 2023 年 1 月 23 日	1,800,000	1,743,786	0.06
旭辉控股集团 5.85% 2023 年 8 月 19 日	20,000,000	2,898,844	0.11
旭辉控股集团 5.95% 2025 年 10 月 20 日	15,200,000	13,440,296	0.49
旭辉控股集团 6% 2025 年 7 月 16 日	13,233,000	11,788,221	0.43
旭辉控股集团 6.45% 2024 年 11 月 7 日	2,300,000	2,104,109	0.08
COUNTRY GARDEN HLDGS 4.75% 2023 年 1 月 17 日	5,090,000	4,843,135	0.18
COUNTRY GARDEN HLDGS 5.125% 2025 年 1 月 17 日	10,000,000	8,679,600	0.32
COUNTRY GARDEN HLDGS 6.5% 2024 年 4 月 8 日	5,925,000	5,355,963	0.20
COUNTRY GARDEN HLDGS 7.25% 2026 年 4 月 8 日	5,914,000	5,184,981	0.19
COUNTRY GARDEN HOLDINGS 4.2% 2026 年 2 月 6 日	3,000,000	2,467,080	0.09
COUNTRY GARDEN HOLDINGS 5.625% 2026 年 12 月 15 日	2,000,000	1,690,700	0.06

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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)			
COUNTRY GARDEN HOLDINGS 6.15% 2025 年 9 月 17 日	2,000,000	1,754,720	0.06
COUNTRY GARDEN HOLDINGS 8% 2024 年 1 月 27 日	10,000,000	9,194,900	0.34
德信中国控股有限公司 9.95% 2022 年 12 月 3 日	1,872,000	1,244,393	0.05
一嗨汽车租赁有限公司 7% 2026 年 9 月 21 日	3,895,000	3,335,951	0.12
一嗨汽车租赁有限公司 7.75% 2024 年 11 月 14 日	17,495,000	17,003,565	0.62
金鹰商贸集团有限公司 4.625% 2023 年 5 月 21 日	14,841,000	14,715,000	0.54
绿城中国控股 4.7% 2025 年 4 月 29 日	1,500,000	1,468,875	0.05
佳源国际控股有限公司 12.5% 2023 年 4 月 8 日	6,709,000	3,228,572	0.12
合景泰富集团控股有限公司 5.95% 2025 年 8 月 10 日	10,770,000	5,878,589	0.22
合景泰富集团控股有限公司 6% 2026 年 8 月 14 日	1,000,000	540,340	0.02
合景泰富集团控股有限公司 6% 2022 年 9 月 15 日	4,398,000	3,364,822	0.12
合景泰富集团控股有限公司 6.3% 2026 年 2 月 13 日	17,647,000	9,629,438	0.35
合景泰富集团控股有限公司 7.4% 2024 年 3 月 5 日	5,100,000	2,960,193	0.11
合景泰富集团控股有限公司 7.875% 2023 年 9 月 1 日	27,527,000	17,350,543	0.64
合景泰富地产控股有限公司 5.875% 2024 年 11 月 10 日	5,000,000	2,724,500	0.10
LINK FINANCE CAYMAN 2009 3.25% 2024 年 10 月 27 日	49,000,000	7,672,999	0.28
龙光集团有限公司 4.25% 2025 年 7 月 12 日	3,483,000	2,595,462	0.10
龙光集团有限公司 4.5% 2028 年 1 月 13 日	2,300,000	1,689,764	0.06
龙光集团有限公司 4.7% 2026 年 7 月 6 日	15,500,000	11,383,200	0.42
龙光集团有限公司 4.85% 2026 年 12 月 14 日	3,983,000	2,916,034	0.11
龙光集团有限公司 5.25% 2025 年 10 月 19 日	3,900,000	2,856,087	0.10

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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)			
龙光集团有限公司 5.75% 2025 年 1 月 14 日	5,350,000	4,090,182	0.15
龙光集团有限公司 5.25% 2023 年 2 月 23 日	3,000,000	2,430,660	0.09
龙光集团有限公司 6.5% 2023 年 7 月 16 日	5,900,000	4,709,793	0.17
龙光地产控股有限公司 6.9% 2024 年 6 月 9 日	5,600,000	4,306,624	0.16
龙湖地产 3.9% 2023 年 4 月 16 日	4,800,000	4,837,584	0.18
MELCO RESORTS FINANCE 4.875% 2025 年 6 月 6 日	4,876,000	4,774,384	0.18
MELCO RESORTS FINANCE 5.25% 2026 年 4 月 26 日	1,100,000	1,077,472	0.04
MELCO RESORTS FINANCE 5.375% 2029 年 12 月 4 日	8,959,000	8,509,885	0.31
MELCO RESORTS FINANCE 5.625% 2027 年 7 月 17 日	17,845,000	17,282,526	0.63
MELCO RESORTS FINANCE 5.75% 2028 年 7 月 21 日	19,865,000	19,205,879	0.70
美高梅中国控股有限公司 4.75% 2027 年 2 月 1 日	16,843,000	16,180,060	0.59
美高梅中国控股有限公司 5.25% 2025 年 6 月 18 日	3,500,000	3,462,270	0.13
美高梅中国控股有限公司 5.375% 2024 年 5 月 15 日	7,567,000	7,558,374	0.28
美高梅中国控股有限公司 5.875% 2026 年 5 月 15 日	3,190,000	3,189,872	0.12
当代置业 (中国) 有限公司 11.5% 2022 年 11 月 13 日	5,050,000	973,590	0.04
当代置业 (中国) 有限公司 11.8% 2022 年 2 月 26 日	3,400,000	659,464	0.02
当代置业 (中国) 有限公司 9.8% 2023 年 4 月 11 日	10,630,000	2,059,988	0.08
宝龙地产 3.9% 2022 年 4 月 13 日	14,000,000	13,160,980	0.48
宝龙地产 4% 2022 年 7 月 25 日	1,300,000	1,144,416	0.04

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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	13,161,000	10,329,806	0.38
宝龙地产 6.95% 2023 年 7 月 23 日	8,808,000	7,223,265	0.27
RADIANCE HOLDINGS GRP 7.8% 2024 年 3 月 20 日	8,184,000	6,713,417	0.25
弘阳地产集团 7.3% 2024 年 5 月 21 日	2,991,000	867,958	0.03
弘阳地产集团 9.5% 2023 年 9 月 20 日	5,183,000	1,505,143	0.06
力高地产集团 11% 2022 年 8 月 6 日	10,706,000	4,569,107	0.17
力高地产集团 9.9% 2024 年 2 月 17 日	5,120,000	2,417,408	0.09
弘阳地产集团有限公司 10.5% 2022 年 10 月 3 日	3,000,000	1,278,600	0.05
金沙中国有限公司 2031 年 8 月 8 日	710,000	637,736	0.02
金沙中国有限公司 2.3% 2027 年 3 月 8 日	3,704,000	3,364,751	0.12
金沙中国有限公司 5.4% 2028 年 8 月 8 日	20,000,000	20,760,000	0.76
新城发展控股有限公司 6.45% 2022 年 6 月 11 日	4,346,000	3,668,980	0.13
世茂集团控股有限公司 4.6% 2030 年 7 月 13 日	8,000,000	3,373,200	0.12
世茂集团控股有限公司 4.75% 2022 年 7 月 3 日	5,500,000	3,477,100	0.13
世茂集团控股有限公司 5.2% 2025 年 1 月 30 日	2,109,000	994,583	0.04
世茂集团控股有限公司 5.6% 2026 年 7 月 15 日	1,790,000	835,966	0.03
世茂集团控股有限公司 6.125% 2024 年 2 月 21 日	1,006,000	488,141	0.02
世茂集团控股有限公司 LT 3.45% 2031 年 1 月 11 日	3,000,000	1,234,920	0.05
世茂集团控股有限公司 5.2% 2027 年 1 月 16 日	4,000,000	1,759,360	0.06
瑞安房地产有限公司 5.5% 2026 年 6 月 29 日	10,549,000	9,452,853	0.35

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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)			
瑞安房地产有限公司 5.75% 2023 年 11 月 12 日	4,403,000	4,198,261	0.15
瑞安房地产有限公司 6.15% 2024 年 8 月 24 日	4,299,000	4,067,155	0.15
瑞安房地产有限公司 6.40% 永续债券 2065 年 12 月 20 日	4,500,000	4,298,760	0.16
融创中国控股有限公司 5.95% 2024 年 4 月 26 日	3,243,000	1,954,264	0.07
融创中国控股有限公司 6.5% 2023 年 7 月 9 日	15,899,000	9,742,589	0.36
融创中国控股有限公司 6.5% 2025 年 1 月 10 日	3,281,000	1,943,828	0.07
融创中国控股有限公司 6.5% 2026 年 1 月 26 日	7,525,000	4,467,893	0.16
融创中国控股有限公司 6.65% 2024 年 8 月 3 日	4,240,000	2,555,830	0.09
融创中国控股有限公司 6.8% 2024 年 10 月 20 日	14,489,000	8,731,506	0.32
融创中国控股有限公司 7% 09 JULY 2025 年 12 月 31 日	6,400,000	3,810,112	0.14
融创中国控股有限公司 7.5% 2024 年 2 月 1 日	10,194,000	6,156,972	0.23
融创中国控股有限公司 7.95% 2023 年 10 月 11 日	9,539,000	5,846,262	0.21
融创中国控股有限公司 8.35% 2023 年 4 月 19 日	19,100,000	11,994,609	0.44
永利澳门有限公司 4.875% 2024 年 10 月 1 日	1,250,000	1,189,813	0.04
永利澳门有限公司 5.625% 2028 年 8 月 26 日	10,773,000	9,830,255	0.36
永利澳门有限公司 SER REGS 5.5% 2027 年 10 月 1 日	1,433,000	1,324,608	0.05
永利澳门有限公司 SER REGS 5.5% 2026 年 1 月 15 日	21,672,000	20,504,313	0.75
禹洲集团 7.8125% 2023 年 1 月 21 日	2,917,450	660,190	0.02
禹洲地产股份有限公司 5.375% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	9,910,000	1,364,904	0.05

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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)			
禹洲地产股份有限公司 7.375% 2026 年 1 月 13 日	6,258,000	1,393,594	0.05
禹洲地产股份有限公司 7.7% 2025 年 2 月 20 日	6,402,000	1,441,474	0.05
禹洲地产股份有限公司 8.3% 2025 年 5 月 27 日	9,390,000	2,116,694	0.08
正荣地产集团 10.25% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	13,095,000	12,333,395	0.45
正荣地产集团 7.125% 2022 年 6 月 30 日	27,640,000	2,948,353	0.11
正荣地产集团 7.875% 2024 年 4 月 14 日	1,500,000	690,825	0.03
正荣地产集团 8.3% 2023 年 9 月 15 日	2,400,000	1,162,848	0.04
正荣地产集团 8.35% 2024 年 3 月 10 日	1,706,000	794,570	0.03
		<u>691,367,389</u>	<u>25.37</u>
中国内地			
中国内地 (政府) 2.69% 12 AUGUST 2026 年 12 月 31 日	50,000,000	7,955,486	0.29
国家开发银行 3.68% 2026 年 2 月 26 日	100,000,000	16,333,634	0.60
中国邮政储蓄银行浮息永续债券 2049 年 12 月 31 日	10,000,000	10,205,200	0.38
		<u>34,494,320</u>	<u>1.27</u>

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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			
香港机场管理局 2.5% 12 JANUARY 2032 年 12 月 31 日	11,715,000	11,668,491	0.43
东亚银行有限公司 5.825% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	7,432,000	7,703,342	0.28
中信银行国际浮息永续债券 2049 年 12 月 31 日	3,500,000	3,784,760	0.14
华南城控股 10.75% 2023 年 4 月 11 日	3,200,000	2,442,720	0.09
华南城控股 10.875% 2022 年 10 月 26 日	9,830,000	8,042,414	0.30
华南城控股 11.5% 2022 年 8 月 12 日	1,340,000	1,113,165	0.04
华南城控股 11.95% 2023 年 2 月 9 日	1,000,000	769,470	0.03
华南城控股 7.25% 2022 年 11 月 20 日	2,300,000	1,840,345	0.07
创兴银行有限公司 3.876% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	9,789,000	10,102,542	0.37
创兴银行有限公司 5.50% 2027 年 7 月 26 日	4,000,000	4,011,640	0.15
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3.7% 2050 年 9 月 22 日	4,430,000	4,269,856	0.16
大新银行有限公司浮息 2031 年 11 月 2 日	2,375,000	2,371,390	0.09
FEC FINANCE LTD 5.1% 2024 年 1 月 21 日	6,395,000	6,402,994	0.23
金地永隆 4.95% 2024 年 8 月 12 日	6,369,000	6,280,344	0.23
香港特别行政区 (政府) 3% 2026 年 11 月 30 日	22,120,000	3,503,551	0.13
联想集团有限公司 5.875% 2025 年 4 月 24 日	3,500,000	3,805,690	0.14
万科地产香港 3.45% 2024 年 5 月 25 日	54,610,000	8,322,722	0.30
阳光城嘉世国际 8.25% 2023 年 11 月 25 日	7,264,000	1,602,293	0.06
阳光城嘉世国际 9.25% 2023 年 4 月 15 日	4,860,000	1,079,309	0.04
阳光城嘉世国际 10.25% 2022 年 9 月 15 日	11,330,000	2,237,562	0.08

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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)			
香港特别行政区 (续)			
仁恒地产 (香港) 有限公司 5.125% 2026 年 5 月 20 日	6,245,000	5,870,550	0.21
仁恒地产 (香港) 有限公司 6.75% 2023 年 4 月 23 日	1,000,000	995,750	0.04
		<u>98,220,900</u>	<u>3.61</u>
印度			
10 RENEW POWER SUBSIDIARY 4.5% 2028 年 7 月 14 日	12,470,000	11,888,275	0.44
ADANI GREEN ENERGY (UP) LTD 6.25% 2024 年 12 月 10 日	14,210,000	15,117,593	0.55
ADANIREN KODSOPAR WARSOM 4.625% 2039 年 10 月 15 日	7,207,000	6,526,952	0.24
AXIS BANK GIFT CITY 浮息永续债券 2049 年 12 月 31 日	16,121,000	15,677,189	0.58
BANK OF BARODA/LONDON 3.875% 2024 年 4 月 4 日	366,000	376,021	0.01
德里国际机场 6.45% 2029 年 6 月 4 日	1,386,000	1,309,313	0.05
GMR HYDERABAD INTERNATIONAL 4.25% 2027 年 10 月 27 日	1,022,000	954,405	0.03
GMR HYDERABAD INTERNATIONAL 4.75% 2026 年 2 月 2 日	3,700,000	3,596,696	0.13
GMR HYDERABAD INTERNATIONAL 5.375% 2024 年 4 月 10 日	1,700,000	1,723,086	0.06
HDFC BANK LTD 浮息永续债券 2049 年 12 月 31 日	25,863,000	25,099,007	0.92
HPCL-MITTAL ENERGY LTD 5.25% 2027 年 4 月 28 日	9,211,000	9,310,110	0.34
HPCL-MITTAL ENERGY LTD 5.45% 2026 年 10 月 22 日	3,672,000	3,745,807	0.14
JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125% 2031 年 5 月 18 日	23,030,000	20,810,507	0.76
JSW INFRASTRUCTURE 4.95% 2029 年 1 月 21 日	9,224,000	8,976,151	0.33
JSW STEEL LTD 5.375% 2025 年 4 月 4 日	10,000,000	10,283,600	0.38
JSW STEEL LTD 5.95% 2024 年 4 月 18 日	12,705,000	13,190,458	0.48

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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)			
印度 (续)			
MANAPPURAM FINANCE LTD 5.9% 2023 年 1 月 13 日	18,028,000	18,228,652	0.67
MUTHOOT FINANCE LTD 6.125% 2022 年 10 月 31 日	15,227,000	15,434,239	0.57
RENEW POWER PVT LTD 5.875% 2027 年 3 月 5 日	1,713,000	1,735,834	0.06
SHRIRAM TRANSPORT FIN 4.15% 2025 年 7 月 18 日	13,124,000	12,707,969	0.47
SHRIRAM TRANSPORT FIN 5.95% 2022 年 10 月 24 日	19,270,000	19,475,611	0.71
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE 4.4% 2024 年 3 月 13 日	2,700,000	2,673,864	0.10
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE 5.1% 2023 年 7 月 16 日	10,900,000	10,970,741	0.40
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE 5.7% 2022 年 2 月 27 日	5,650,000	5,655,763	0.21
TATA MOTORS LTD 5.875% 2025 年 5 月 20 日	2,222,000	2,336,411	0.09
YES BANK IFSC BANKING 3.75% 2023 年 2 月 6 日	15,299,000	15,128,110	0.56
		<u>252,932,364</u>	<u>9.28</u>
印度尼西亚			
ALAM SUTERA REALTY TBK 6.25% 2025 年 11 月 2 日	6,416,000	4,967,973	0.18
ALAM SUTERA REALTY TBK FRN 2024 年 5 月 2 日	7,800,000	6,555,666	0.24
BUKIT MAKMUR MANDIRI UTA 7.75% 2026 年 2 月 10 日	5,716,000	5,491,761	0.20
GAJAH TUNGGAL TB 8.95% 2026 年 6 月 23 日	7,000,000	5,727,890	0.21
INDOFOOD CBP SUKSES MAKM 3.541% 2032 年 4 月 27 日	7,421,000	7,120,450	0.26
INDOFOOD CBP SUKSES MAKM 4.745% 2051 年 6 月 9 日	7,000,000	6,622,560	0.24
印度尼西亚 (共和国) 4.35% 2048 年 1 月 11 日	35,000,000	37,338,000	1.37

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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)			
印度尼西亚 (续)			
印度尼西亚 (共和国) 4.625% 2043 年 4 月 15 日	3,750,000	4,114,275	0.15
印度尼西亚 (共和国) 4.75% 2047 年 7 月 18 日	7,429,000	8,354,356	0.31
印度尼西亚 (共和国) 5.25% 2047 年 1 月 8 日	18,000,000	21,498,840	0.79
印度尼西亚 (共和国) 5.25% 2042 年 1 月 17 日	35,000,000	41,186,600	1.51
印度尼西亚 (共和国) 5.35% 2049 年 2 月 11 日	5,000,000	6,096,350	0.22
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM (PERSERO) PT 6.757% 2048 年 11 月 15 日	15,000,000	17,663,250	0.65
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM 5.45% 2030 年 5 月 15 日	10,000,000	10,940,300	0.40
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM 5.8% 2050 年 5 月 15 日	12,100,000	12,845,239	0.47
JAPFA COMFEED TBK PT 5.375% 2026 年 3 月 23 日	12,730,000	13,070,146	0.48
LISTRINDO CAPITAL BV 4.95% 2026 年 9 月 14 日	9,292,000	9,396,721	0.35
PERTAMINA PERSERO 5.625% 20 MAY 2043 年 12 月 31 日	10,000,000	11,027,000	0.41
PERTAMINA SER REGS 6.5PCT 2041 年 5 月 27 日	16,359,000	20,017,036	0.74
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 4.375% 2050 年 2 月 5 日	2,934,000	2,747,779	0.10
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 5.25% 2047 年 5 月 15 日	35,000,000	36,298,850	1.33
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR 5.375% 2029 年 1 月 25 日	10,000,000	11,079,300	0.41
PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA (PERSERO) PT 6.15% 2048 年 5 月 21 日	8,609,000	9,888,900	0.36
PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 5.25% 2042 年 10 月 24 日	10,000,000	10,445,300	0.38
PT ADARO INDONESIA 4.25% 2024 年 10 月 31 日	23,669,000	24,021,668	0.88
PT PAKUWON JATI 4.875% 2028 年 4 月 29 日	28,485,000	28,697,783	1.05

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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)			
印度尼西亚 (续)			
PT PERTAMINA (PERSERO) 4.15% 2060 年 2 月 25 日	9,000,000	8,318,700	0.31
SAKA ENERGI INDONESIA PT 4.45% 2024 年 5 月 5 日	19,978,000	19,470,159	0.72
		<u>401,002,852</u>	<u>14.72</u>
泽西岛			
中国西部水泥有限公司 4.95% 2026 年 7 月 8 日	14,881,000	13,882,336	0.51
		<u>13,882,336</u>	<u>0.51</u>
毛里求斯			
AZURE POWER ENERGY LTD 3.575% 19 AUGUST 2026 年 12 月 31 日	26,576,000	26,106,934	0.96
CA MAGNUM HOLDINGS 5.375% 31 OCTOBER 2026 年 12 月 31 日	15,508,000	15,857,085	0.58
CLEAN RENEWABLE POWER 4.25% 2027 年 3 月 25 日	4,989,000	4,932,974	0.18
GREENKO INVESTMENT CO 4.875% 2023 年 8 月 16 日	10,000,000	10,063,600	0.37
GREENKO POWER II LTD 4.3% 2028 年 12 月 13 日	6,000,000	5,818,260	0.21
INDIA CLEAN ENERGY HOLDINGS 4.5% 2027 年 4 月 18 日	9,409,000	9,114,875	0.33
INDIA CLEANTECH ENERGY 4.7% 2026 年 8 月 10 日	2,400,000	2,382,864	0.09
INDIA GREEN ENERGY HOLDING 5.375% 2024 年 4 月 29 日	2,639,000	2,678,479	0.10
NETWORK I2I LTD 3.975% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	5,158,000	5,081,693	0.19

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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)			
UPL CORP LTD 5.25% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	3,324,000	3,304,920	0.12
		<u>85,341,684</u>	<u>3.13</u>
蒙古			
蒙古开发银行 7.25% 2023 年 10 月 23 日	1,508,000	1,584,380	0.06
蒙古国际债券 3.5% 2027 年 7 月 7 日	4,117,000	3,853,348	0.14
蒙古国际债券 4.45% 2031 年 12 月 31 日	3,887,000	3,638,776	0.13
蒙古国际债券 5.125% 2026 年 4 月 7 日	4,548,000	4,618,767	0.17
蒙古国际债券 5.625% 2023 年 5 月 1 日	979,000	1,001,419	0.04
		<u>14,696,690</u>	<u>0.54</u>
荷兰			
ICTSI TREASURY BV 3.5% 2031 年 11 月 16 日	10,000,000	9,861,700	0.36
JABABEKA INTERNATIONAL 6.5% 2023 年 10 月 5 日	22,333,000	20,364,346	0.75
MINEJESA CAPITAL BV 4.625% 2030 年 8 月 10 日	4,544,000	4,467,616	0.16
ROYAL CAPITAL BV 4.875% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	2,000,000	2,065,320	0.08
ROYAL CAPITAL BV 5% 永续债券 2049 年 12 月 29 日	9,463,000	9,924,321	0.36
		<u>46,683,303</u>	<u>1.71</u>

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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)			
巴基斯坦			
巴基斯坦 (共和国) 6% 2026 年 4 月 8 日	16,607,000	16,045,517	0.59
巴基斯坦 (共和国) 7.375% 2031 年 4 月 8 日	21,146,000	19,881,258	0.73
巴基斯坦 (共和国) 8.25% 2024 年 4 月 15 日	1,500,000	1,572,150	0.06
巴基斯坦 (共和国) 8.25% 2025 年 9 月 30 日	11,316,000	11,946,075	0.44
巴基斯坦 (共和国) 8.875% 2051 年 4 月 8 日	10,000,000	9,337,700	0.34
巴基斯坦伊斯兰共和国 (政府) 6.875% 2027 年 12 月 5 日	3,124,000	3,044,244	0.11
		<u>61,826,944</u>	<u>2.27</u>
菲律宾			
DEV BANK PHILIPPINES 2.375% 2031 年 3 月 11 日	8,000,000	7,500,240	0.27
GLOBE TELECOM INC 浮息永续债券 2049 年 12 月 31 日	19,658,000	19,734,470	0.72
INTERNATIONAL CONTAINER 4.75% 2030 年 6 月 17 日	9,184,000	9,879,963	0.36
PETRON CORP 5.95% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	7,475,000	7,561,710	0.28
菲律宾共和国 2.65% 2045 年 12 月 10 日	20,000,000	17,724,600	0.65
菲律宾共和国 3.2% 06 JULY 2046 年 7 月 6 日	23,000,000	21,969,370	0.81
菲律宾 2.95% 2045 年 5 月 5 日	20,000,000	18,482,200	0.68
		<u>102,852,553</u>	<u>3.77</u>

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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			
ABJA INVESTMENT CO 4.45% 2023 年 7 月 24 日	2,750,000	2,830,630	0.10
ABJA INVESTMENT CO 4.95% 2023 年 5 月 3 日	8,250,000	6,258,932	0.23
ABJA INVESTMENT CO 5.45% 2028 年 1 月 24 日	21,182,000	22,573,446	0.83
ABJA INVESTMENT CO 5.95% 2024 年 7 月 31 日	23,835,000	25,456,733	0.93
AEV INTERNATIONAL PTE 4.2% 2030 年 1 月 16 日	10,324,000	10,426,208	0.38
CONTINUUM ENERGY LEVANTE 4.5% 2027 年 2 月 9 日	8,543,000	8,407,281	0.31
INDIKA ENERGY CAPITAL IV 8.25% 2025 年 10 月 22 日	29,384,000	29,653,745	1.09
INDIKA ENERGY III PTE 5.875% 2024 年 11 月 9 日	26,697,000	26,553,637	0.98
LLPL CAPITAL PTE LTD 6.875% 2039 年 2 月 4 日	13,066,000	12,893,417	0.47
LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.25% 2024 年 6 月 19 日	8,697,000	8,728,396	0.32
LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.5% 2026 年 2 月 9 日	6,933,000	6,953,244	0.26
MEDCO BELL PTE LTD 6.375% 2027 年 1 月 30 日	20,561,000	20,003,386	0.73
MEDCO LAUREL TREE 6.95% 2028 年 11 月 12 日	925,000	898,526	0.03
MEDCO OAK TREE PTE LTD 7.375% 2026 年 5 月 14 日	25,766,000	26,241,640	0.96
MEDCO PLATINUM ROAD PTE LTD 6.75% 2025 年 1 月 30 日	12,060,000	12,163,234	0.45
THETA CAPITAL PTE LTD 6.75% 2026 年 10 月 31 日	37,608,000	36,595,969	1.34
THETA CAPITAL PTE LTD 8.125% 2025 年 1 月 22 日	22,947,000	23,657,210	0.87
TML HOLDINGS PTE LTD 4.35% 2026 年 6 月 9 日	16,312,000	16,195,206	0.60
TML HOLDINGS PTE LTD 5.5% 2024 年 6 月 3 日	12,985,000	13,389,093	0.49
		<u>309,879,933</u>	<u>11.37</u>

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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)			
泰国			
BANGKOK BANK PCL/HK 浮息永续债券 2049 年 12 月 31 日	13,562,000	13,852,091	0.51
KASIKORNBANK PCL HK 5.275% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	11,398,000	11,744,499	0.43
KRUNG THAI BANK/CAYMAN 4.4% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	12,704,000	12,609,482	0.46
TMB THANACHART BANK 4.90% 永续债券 2049 年 12 月 31 日	540,000	537,257	0.02
		<u>38,743,329</u>	<u>1.42</u>
英国			
VEDANTA RESOURCES 13.875% 2024 年 1 月 21 日	8,150,000	8,505,095	0.31
VEDANTA RESOURCES 8.95% 2025 年 3 月 11 日	14,363,000	13,703,882	0.51
VEDANTA RESOURCES LTD 6.375% 2022 年 7 月 30 日	22,300,000	22,112,234	0.81
VEDANTA RESOURCES LTD 8% 2023 年 4 月 23 日	3,757,000	3,613,295	0.13
		<u>47,934,506</u>	<u>1.76</u>
美国			
PERIAMA HOLDINGS LLC/DE 5.95% 2026 年 4 月 19 日	9,969,000	10,318,613	0.38
		<u>10,318,613</u>	<u>0.38</u>
债务证券 (合计)		<u>2,567,973,815</u>	<u>94.24</u>

投资组合报表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 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			
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	1,848,900	0.07
单位信托 (合计)		<u>1,848,900</u>	<u>0.07</u>
衍生资产			
外币远期合同		<u>379,485</u>	<u>0.01</u>
金融资产合计		<u>2,570,202,200</u>	<u>94.32</u>
金融负债			
衍生负债			
外币远期合同		(3,028,208)	(0.11)
期货合同		<u>(1,629,475)</u>	<u>(0.06)</u>
金融负债总额		<u>(4,657,683)</u>	<u>(0.17)</u>
净投资总额			
(投资成本合计: 2,805,051,046 美元)		<u>2,565,544,517</u>	<u>94.15</u>
其他资产净值		<u>159,457,133</u>	<u>5.85</u>
资产净值总额		<u>2,725,001,650</u>	<u>100.00</u>

投资组合变动表

汇丰亚洲高收益债券基金

2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日期间

	占资产净值百分比 2022 年 1 月 31 日	占资产净值百分比 2021 年 7 月 31 日
金融资产		
债务证券		
债券		
上市投资	94.24	94.58
未上市但有报价的投资	-	2.64
债务证券 (合计)	94.24	97.22
单位信托		
上市投资	-	3.97
未上市但有报价的投资	0.07	0.06
单位信托 (合计)	0.07	4.03
衍生资产		
外币远期合同	0.01	0.07
金融负债		
衍生负债		
外币远期合同	(0.11)	(0.16)
期货合同	(0.06)	-
总投资	94.15	101.16
其他资产净值	5.85	(1.16)
资产净值总额	100.00	100.00

金融衍生工具明细表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 年 1 月 31 日

外币远期合同

2022 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：				
108,000,000元 离岸人民币	16,859,408美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	41,865
31,419,804美元	200,000,000元 离岸人民币	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	101,390
47,172美元	299,528元离岸 人民币	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	296
459,735美元	2,916,034元离 岸人民币	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	3,387
71,347美元	452,547元离岸 人民币	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	526
33,011美元	44,395新加坡元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	183
862,700美元	1,204,744澳元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	13,826
17,001,949美元	108,000,000元 离岸人民币	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	100,442
131,836美元	835,209元离岸 人民币	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	1,129
596,697美元	802,564新加坡 元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	3,220
18,540,691美元	118,000,000元 离岸人民币	2022年3月31日	汇丰市场财资服务 香港	108,693
521,849新加坡元	385,694美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	201

金融衍生工具明细表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 年 1 月 31 日

外币远期合同 (续)

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 (续):				
1,568美元	10,001元离岸人民币	2022年2月28日	汇丰市场财资服务香港	3
19,548美元	124,701元离岸人民币	2022年2月28日	汇丰市场财资服务香港	33
69,950澳元	48,930美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务香港	357
64,497新加坡元	47,567美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务香港	127
48,242美元	68,416澳元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务香港	35
710,642美元	1,007,824澳元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务香港	520
1,309,483美元	8,347,021元离岸人民币	2022年2月28日	汇丰市场财资服务香港	3,223
450,385美元	2,877,938元离岸人民币	2022年2月28日	汇丰市场财资服务香港	7
873,237美元	5,579,949元离岸人民币	2022年2月28日	汇丰市场财资服务香港	13
591,301美元	3,778,388元离岸人民币	2022年2月28日	汇丰市场财资服务香港	9
				379,485

金融衍生工具明细表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 年 1 月 31 日

外币远期合同 (续)

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 (续):				
474,474,195元 离岸人民币	74,727,571美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(475,506)
340,199,332元 离岸人民币	53,579,879美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(340,939)
255,622,753元 离岸人民币	40,259,444美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(256,179)
50,180元离岸 人民币	7,904美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(51)
92,580元离岸 人民币	14,582美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(94)
89,717,770澳元	64,328,808美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(1,112,781)
5,924,374澳元	4,247,853美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(73,481)
228,460澳元	163,103美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(2,128)
21澳元	15美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	0
24,250元离岸 人民币	3,819美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(24)
19,530,032欧元	22,059,523美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(155,702)
145,588,260新加 坡元	108,265,552美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(606,570)
29,400澳元	21,054美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(338)

金融衍生工具明细表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 年 1 月 31 日

外币远期合同 (续)

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 (续):				
1,006,000元 离岸人民币	158,670美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(1,238)
9,980元离岸 人民币	1,575美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(14)
109,370澳元	77,128美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(65)
1,607,298元 离岸人民币	251,903美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(372)
6,958元离岸 人民币	1,092美元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(3)
104美元	149澳元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(1)
247,734美元	221,583欧元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(782)
1,206,362美元	1,633,999新加坡元	2022年2月28日	汇丰市场财资服务 香港	(1,940)
				<u>(3,028,208)</u>

金融衍生工具明细表

汇丰亚洲高收益债券基金

2022 年 1 月 31 日

期货

2022 年 1 月 31 日，本基金持有的期货合同如下：

描述	标的资产	合同规模	名义市场价值	状态	交易对手	公允价值 美元
金融负债：						
US 10YR NOTE (CBT) 22/03/2022	芝加哥商品 交易所	1,000	(130,528,125)	卖空	汇丰银行	(498,719)
US ULTRA BOND CBT 22/03/2022	芝加哥商品 交易所	1,000	(113,362,500)	卖空	汇丰银行	(1,130,756)
						<u>(1,629,475)</u>

业绩表现记录

汇丰亚洲高收益债券基金

(a) 价格纪录 (交易份额净值)

年份	AC 类 - 港元份额			
	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2012	8.871	10.994	9.268	11.603
2013	10.997	12.136	11.606	12.808
2014	11.103	12.670	11.447	13.062
2015	11.948	12.793	12.610	13.502
2016	12.188	13.968	12.863	14.742
2017	13.684	15.013	14.592	15.848
2018	14.112	14.999	14.897	15.829
2019	14.059	15.891	14.059	15.891
2020	13.860	17.050	13.860	17.050
2021	16.880	17.875	16.880	17.875
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	14.243	17.472	14.243	17.472

年份	AC 类 - 新加坡元份额			
	买入		卖出	
	最低 新加坡元	最高 新加坡元	最低 新加坡元	最高 新加坡元
2012	10.001	10.823	10.555	11.423
2013	10.729	11.897	11.323	12.556
2014	11.137	12.386	11.482	12.770
2015	12.313	13.648	12.995	14.404
2016	13.388	14.895	14.130	15.270
2017	14.652	16.149	15.426	17.044
2018	15.418	15.854	16.271	16.733
2019	-	-	-	-
2020	8.773	10.163	8.773	10.163
2021	9.977	10.381	9.977	10.381
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	8.270	10.219	8.270	10.219

业绩表现记录

年份	AC 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
2012	8.765	11.021	9.251	11.632
2013	11.024	12.156	11.635	12.830
2014	11.128	12.702	11.473	13.095
2015	11.970	12.825	12.633	13.536
2016	12.217	13.993	12.894	14.768
2017	13.706	14.952	14.465	15.780
2018	13.980	14.903	14.755	15.729
2019	13.957	15.790	13.957	15.790
2020	13.927	17.156	13.927	17.156
2021	16.931	17.927	16.931	17.927
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	14.223	17.466	14.223	17.466

年份	AM2 类 - 港元份额			
	买入		卖出	
	最低 港元	最高 港元	最低 港元	最高 港元
2012	8.650	10.344	9.129	10.917
2013	9.920	10.903	10.474	11.507
2014	9.800	10.553	10.104	10.880
2015	9.664	10.593	10.199	11.180
2016	9.445	10.304	9.968	10.875
2017	9.943	10.382	10.260	10.957
2018	9.450	10.378	9.976	10.956
2019	9.209	9.952	9.209	10.213
2020	8.361	10.150	8.361	10.150
2021	9.388	10.173	9.388	10.173
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	7.526	9.585	7.526	9.585

年份	AM2 类 - 新加坡元份额			
	买入		卖出	
	最低 新加坡元	最高 新加坡元	最低 新加坡元	最高 新加坡元
2020	9.995	10.616	9.995	10.616
2021	9.748	10.653	9.748	10.653
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	7.777	9.984	7.777	9.984

业绩表现记录

年份	AM2 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
2012	8.635	10.367	9.113	10.941
2013	9.945	10.920	10.496	11.525
2014	9.821	10.584	10.125	10.912
2015	9.686	10.624	10.223	11.213
2016	9.449	10.327	9.973	10.899
2017	9.964	10.405	10.204	10.982
2018	9.354	10.329	9.872	10.901
2019	9.139	9.885	9.139	10.113
2020	8.381	10.121	8.381	10.121
2021	9.386	10.200	9.386	10.200
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	7.509	9.570	7.509	9.570
年份	AM3H 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
2014	9.887	10.281	10.193	10.599
2015	9.391	10.319	9.911	10.891
2016	9.176	10.052	9.684	10.609
2017	9.690	10.123	9.953	10.684
2018	9.131	10.075	9.637	10.634
2019	8.917	9.634	8.917	9.872
2020	8.131	9.871	8.131	9.871
2021	9.110	9.897	9.110	9.897
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日2	7.278	9.288	7.278	9.288
年份	AM3H 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
2014	10.009	10.334	10.319	10.654
2015	9.418	10.374	9.940	10.949
2016	9.117	9.918	9.622	10.468
2017	9.544	9.993	9.736	10.547
2018	8.884	9.849	9.376	10.394
2019	8.668	9.417	8.668	9.601
2020	8.000	9.646	8.000	9.646
2021	8.966	9.722	8.966	9.722
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	7.167	9.139	7.167	9.139

业绩表现记录

AM3H 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	8.324	10.000	8.324	10.000
2021	9.257	10.094	9.257	10.094
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	7.412	9.448	7.412	9.448
AM3H 类 - 新加坡元份额				
年份	买入		卖出	
	最低 新加坡元	最高 新加坡元	最低 新加坡元	最高 新加坡元
2020	10.000	10.312	10.000	10.312
2021	9.621	10.455	9.621	10.455
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	7.697	9.809	7.697	9.809
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	10.000	10.979	10.000	10.979
2021	10.835	11.478	10.835	11.478
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	9.149	11.218	9.149	11.218
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	10.000	10.830	10.000	10.830
2021	9.964	10.858	9.964	10.858
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	8.141	10.189	8.141	10.189
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	10.000	11.015	10.000	11.015
2021	10.871	11.511	10.871	11.511
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	9.132	11.215	9.132	11.215

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	11.106	10.000	11.106
2021	10.967	11.788	10.967	11.788
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	9.523	11.566	9.523	11.566
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	10.000	10.981	10.000	10.981
2021	10.286	11.152	10.286	11.152
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	8.251	10.507	8.251	10.507
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	10.835	10.000	10.835
2021	9.300	10.803	9.300	10.803
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	7.316	9.510	7.316	9.510
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	10.000	10.952	10.000	10.952
2021	10.232	11.120	10.232	11.120
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	8.186	10.432	8.186	10.432
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	9.885	10.918	9.885	10.918
2021	10.220	11.087	10.220	11.087
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	8.167	10.419	8.167	10.419

业绩表现记录

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	9.985	10.956	9.985	10.956
2021	10.199	11.117	10.199	11.117
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	8.176	10.416	8.176	10.416
IC 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	9.947	10.175	10.498	10.739
2012	8.778	11.074	9.264	11.688
2013	11.077	11.940	11.691	12.602
2017	9.799	10.728	10.425	11.322
2018	10.019	10.728	10.574	11.322
2019	10.071	10.378	10.629	10.953
2020	9.840	12.136	9.840	12.136
2021	11.985	12.711	11.985	12.711
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	10.120	12.409	10.120	12.409
ID2 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	10.060	10.148	10.060	10.148
2021	-	-	-	-
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	-	-	-	-
IM2 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
2021	9.543	10.121	9.543	10.121
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	7.667	9.748	7.667	9.748

业绩表现记录

年份	IM2 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	8.561	10.334	8.561	10.334
2021	9.638	10.454	9.638	10.454
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	7.726	9.830	7.726	9.830

年份	ZD2 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
2017	9.711	10.684	10.388	11.276
2018	9.629	10.720	10.163	11.314
2019	9.382	10.703	9.382	10.703
2020	8.975	11.096	8.975	11.096
2021	9.969	11.023	9.969	11.023
2021 年 8 月 1 日至 2022 年 1 月 31 日	8.334	10.185	8.334	10.185

(b) 总资产净值 (按《香港财务报告准则》计算)

	2022年1月31日 美元	2021 美元	2020 美元	2019 美元
总资产净值	2,725,001,650	3,254,910,765	1,320,576,135	866,003,184

(c) 份额净值 (按《香港财务报告准则》计算)

	计价 货币	2022年1月 31日	2021	2020	2019
份额净值					
- AC 类 - 港元	港元	14.714	17.104	16.973	15.891
- AC 类 - 新加坡元	新加坡元	8.548	9.977	10.082	-
- AC 类 - 美元	美元	14.680	17.114	17.072	15.782
- AM2 类 - 港元	港元	7.704	9.388	9.928	9.910
- AM2 类 - 美元	美元	7.681	9.386	9.950	9.832
- AM2 类 - 新加坡元	新加坡元	7.967	9.748	10.473	无
- AM3H 类 - 澳元	澳元	7.449	9.107	9.667	9.589
- AM3H 类 - 欧元	欧元	7.336	8.966	9.507	9.379

业绩表现记录

	计价 货币	2022年1月 31日	2021	2020	2019
份额净值 (续)					
- AM3H 类 - 人民币	人民币	7.578	9.257	9.862	无
- AM3H 类 - 新加坡元	新加坡元	7.872	9.621	10.213	无
- BC 类 - 港元	港元	9.451	10.981	10.925	无
- BC 类 - 人民币	人民币	8.433	9.963	10.729	无
- BC 类 - 美元	美元	9.425	10.988	10.962	无
- BCH 类 - 人民币	人民币	9.837	11.313	11.055	无
- BM2 类 - 港元	港元	8.446	10.286	10.875	无
- BM2 类 - 人民币	人民币	7.509	9.300	10.674	无
- BM2 类 - 美元	美元	8.373	10.232	10.848	无
- BM3H 类 - 澳元	澳元	8.356	10.220	10.813	无
- BM3H 类 - 人民币	人民币	8.352	10.200	10.836	无
- IC 类 - 美元	美元	10.447	12.154	12.076	-
- IM2 类 - 港元	港元	7.852	9.543	-	-
- IM2 类 - 美元	美元	7.903	9.638	10.180	10.027
- ZD2 类 - 美元	美元	8.605	9.969	10.400	10.088

收益分配表

汇丰亚洲高收益债券基金

AM2 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	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0671	27,203,364
第 2 次分配	2021年9月30日	2021年10月11日	0.0572	21,714,822
第 3 次分配	2021年10月29日	2021年11月9日	0.0692	26,948,313
第 4 次分配	2021年11月30日	2021年12月2日	0.0661	25,562,393
第 5 次分配	2021年12月31日	2022年1月11日	0.0693	26,389,178
第 6 次分配	2022年1月31日	2022年2月14日	0.0699	26,639,871

AM2 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	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0671	9,666,850
第 2 次分配	2021年9月30日	2021年10月12日	0.0571	7,959,459
第 3 次分配	2021年10月29日	2021年11月9日	0.0691	9,722,823
第 4 次分配	2021年11月30日	2021年12月2日	0.0661	9,370,978
第 5 次分配	2021年12月31日	2022年1月11日	0.0691	9,682,873
第 6 次分配	2022年1月31日	2022年2月14日	0.0696	9,710,254

AM2 类 - 新加坡元 份额	除息日期	付款日期	每份额分配 新加坡元	分配总额 新加坡元
第 1 次分配	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0696	207,723
第 2 次分配	2021年9月30日	2021年10月11日	0.0589	174,453
第 3 次分配	2021年10月29日	2021年11月9日	0.0720	218,921
第 4 次分配	2021年11月30日	2021年12月2日	0.0683	212,817
第 5 次分配	2021年12月31日	2022年1月11日	0.0726	225,898
第 6 次分配	2022年1月31日	2022年2月14日	0.0720	231,869

AM3H 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	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0634	807,629
第 2 次分配	2021年9月30日	2021年10月11日	0.0538	656,897
第 3 次分配	2021年10月29日	2021年11月9日	0.0656	774,171
第 4 次分配	2021年11月30日	2021年12月2日	0.0627	738,309
第 5 次分配	2021年12月31日	2022年1月11日	0.0651	766,626
第 6 次分配	2022年1月31日	2022年2月14日	0.0657	768,488

收益分配表收益分配表

汇丰亚洲高收益债券基金

AM3H 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	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0585	150,964
第 2 次分配	2021年9月30日	2021年10月11日	0.0494	125,730
第 3 次分配	2021年10月29日	2021年11月9日	0.0613	151,880
第 4 次分配	2021年11月30日	2021年12月2日	0.0582	151,048
第 5 次分配	2021年12月31日	2022年1月11日	0.0591	154,603
第 6 次分配	2022年1月31日	2022年2月16日	0.0596	155,539

AM3H 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	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0885	5,288,365
第 2 次分配	2021年9月30日	2021年10月15日	0.0762	4,762,065
第 3 次分配	2021年10月29日	2021年11月9日	0.0890	5,425,966
第 4 次分配	2021年11月30日	2021年12月2日	0.0830	5,188,367
第 5 次分配	2021年12月31日	2022年1月11日	0.0824	5,124,353
第 6 次分配	2022年1月31日	2022年2月15日	0.0830	5,107,377

AM3H 类 - 新加坡元

份额	除息日期	付款日期	每份额分配 新加坡元	分配总额 新加坡元
第 1 次分配	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0685	1,100,454
第 2 次分配	2021年9月30日	2021年10月11日	0.0588	967,905
第 3 次分配	2021年10月29日	2021年11月9日	0.0712	1,209,876
第 4 次分配	2021年11月30日	2021年12月2日	0.0686	1,210,526
第 5 次分配	2021年12月31日	2022年1月11日	0.0717	1,279,222
第 6 次分配	2022年1月31日	2022年2月14日	0.0723	1,307,400

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	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0735	361,871
第 2 次分配	2021年9月30日	2021年10月13日	0.0626	317,023
第 3 次分配	2021年10月29日	2021年11月9日	0.0759	380,083
第 4 次分配	2021年11月30日	2021年12月2日	0.0725	361,419
第 5 次分配	2021年12月31日	2022年1月11日	0.0759	367,537
第 6 次分配	2022年1月31日	2022年2月14日	0.0765	371,174

收益分配表收益分配表

汇丰亚洲高收益债券基金

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	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0664	971,269
第 2 次分配	2021年9月30日	2021年10月13日	0.0565	824,059
第 3 次分配	2021年10月29日	2021年11月9日	0.0684	1,025,774
第 4 次分配	2021年11月30日	2021年12月2日	0.0648	1,014,076
第 5 次分配	2021年12月31日	2022年1月11日	0.0675	1,049,029
第 6 次分配	2022年1月31日	2022年2月15日	0.0678	1,111,974

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	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0731	680,960
第 2 次分配	2021年9月30日	2021年10月13日	0.0623	580,516
第 3 次分配	2021年10月29日	2021年11月9日	0.0753	702,841
第 4 次分配	2021年11月30日	2021年12月2日	0.0720	685,140
第 5 次分配	2021年12月31日	2022年1月11日	0.0753	705,975
第 6 次分配	2022年1月31日	2022年2月14日	0.0759	747,168

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	31 August 2021	2021年9月9日	0.0712	40,781
	30 September 2021	2021年10月13日		
第 2 次分配			0.0603	34,248
第 3 次分配	29 October 2021	2021年11月9日	0.0736	43,434
第 4 次分配	30 November 2021	2021年12月2日	0.0703	43,751
第 5 次分配	31 December 2021	2022年1月11日	0.0730	46,632
第 6 次分配	31 January 2022	2022年2月14日	0.0737	51,444

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	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0976	3,897,866
第 2 次分配	2021年9月30日	2021年10月13日	0.0839	3,293,466
第 3 次分配	2021年10月29日	2021年11月9日	0.0982	3,844,254
第 4 次分配	2021年11月30日	2021年12月2日	0.0915	3,680,184
第 5 次分配	2021年12月31日	2022年1月11日	0.0908	3,605,646
第 6 次分配	2022年1月31日	2022年2月15日	0.0915	3,604,497

收益分配表收益分配表

汇丰亚洲高收益债券基金

IM2 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	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0682	3,266,421
第 2 次分配	2021年9月30日	2021年10月11日	0.0581	2,782,684
第 3 次分配	2021年10月29日	2021年11月9日	0.0704	3,371,790
第 4 次分配	2021年11月30日	2021年12月9日	0.0673	3,223,316
第 5 次分配	2021年12月31日	2022年1月11日	0.0705	3,376,579
第 6 次分配	2022年1月31日	2022年2月14日	0.0711	3,405,316
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	2021年8月31日	2021年9月9日	0.0689	960,795
第 2 次分配	2021年9月30日	2021年10月12日	0.0587	811,805
第 3 次分配	2021年10月29日	2021年11月9日	0.0710	986,339
第 4 次分配	2021年11月30日	2021年12月2日	0.0679	1,229,894
第 5 次分配	2021年12月31日	2022年1月11日	0.0710	1,287,872
第 6 次分配	2022年1月31日	2022年2月14日	0.0716	1,300,785

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

陈宝枝
刘嘉燕
叶士奇
何慧芬 (2021 年 11 月 19 日委任)
谭振邦 (2021 年 11 月 19 日委任)

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