

中期报告（未经审计）
截至 2022 年 6 月 30 日止期间

东亚联丰投资系列

东亚联丰亚洲债券及货币基金

东亚联丰亚太区多元收益基金

东亚联丰中国高收益入息基金

东亚联丰亚洲策略债券基金

注意: 此中期报告（未经审计）的摘要版本只适用于在此列示的子基金。



目录	页数
投资报告	1 – 32
全面收益表	33
资产负债表	34 – 35
基金份额持有人应占资产净值变动表	36 – 38
管理及行政	39

附注：

此中期财务报表（未经审计）已按照香港会计师公会颁布的所有适用的《香港财务报告准则》（此统称包含所有适用的个别《香港财务报告准则》、《香港会计准则》及诠释）、香港公认会计原则、《信托契约》（经修订及重述）的相关条文、以及由香港证券及期货事务监察委员会颁布的单位信托及互惠基金守则当中的相关条文编制。

所采纳的会计政策与年度财务报表的附注中所述的政策一致。

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)

投资组合

东亚联丰亚洲债券及货币基金

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (81.06%)			
债务证券 (79.98%)			
以美元计价 (79.98%)			
ABJA Investment Co Pte Ltd 5.95% 31 / 07 / 2024	4,000,000	4,115,828	1.32
Adani Green Energy Ltd 4.375% 08 / 09 / 2024	8,100,000	7,399,533	2.37
Adani Green Energy UP Ltd 6.25% 10 / 12 / 2024	5,050,000	4,858,432	1.56
ANZ New Zealand Int'l Ltd / London FRN 18 / 02 / 2025	1,500,000	1,482,980	0.48
Azure Power Energy Ltd 3.575% 19 / 08 / 2026	6,842,270	5,752,285	1.85
Azure Power Solar Energy Pvt Ltd 5.65% 24 / 12 / 2024	6,800,000	6,449,451	2.07
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 3.75% 30 / 03 / 2026	1,500,000	1,385,264	0.44
Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT 4.20% 23 / 01 / 2025	2,000,000	1,931,767	0.62
BOC Aviation Ltd 4.00% 25 / 01 / 2024	500,000	508,887	0.16
CA Magnum Holdings 5.375% 31 / 10 / 2026	1,700,000	1,503,357	0.48
Champion Path Holdings Ltd 4.85% 27 / 01 / 2028	1,200,000	715,809	0.23
China Oil & Gas Group Ltd 4.70% 30 / 06 / 2026	1,900,000	1,680,893	0.54
Chong Hing Bank Ltd 5.70% Perpetual Callable - 15 / 07 / 2024	5,600,000	5,732,571	1.84
Citigroup Inc FRN 24 / 05 / 2025	1,500,000	1,491,615	0.48
CNPC Global Capital Ltd 1.125% 23 / 06 / 2023	3,200,000	3,134,304	1.01
Delhi International Airport Ltd 6.125% 31 / 10 / 2026	2,100,000	1,922,673	0.62

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (81.06%) (续)			
债务证券 (79.98%) (续)			
以美元计价 (79.98%) (续)			
Export-Import Bank of China / The 2.75% 28 / 11 / 2022	700,000	700,729	0.23
Global Prime Capital Pte Ltd 5.50% 18 / 10 / 2023	6,400,000	6,405,074	2.05
GMR Hyderabad International Airport Ltd 4.75% 02 / 02 / 2026	1,700,000	1,582,921	0.51
GMR Hyderabad International Airport Ltd 5.375% 10 / 04 / 2024	5,500,000	5,414,331	1.74
Golden Eagle Retail Group Ltd 4.625% 21 / 05 / 2023	1,000,000	970,879	0.31
Greenko Dutch BV 3.85% 29 / 03 / 2026	3,201,000	2,756,794	0.88
Greenko Investment Co 4.875% 16 / 08 / 2023	1,500,000	1,476,107	0.47
Greenko Solar Mauritius Ltd 5.55% 29 / 01 / 2025	4,100,000	3,930,233	1.26
Greenko Solar Mauritius Ltd 5.95% 29 / 07 / 2026	3,800,000	3,476,438	1.11
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd 5.50% 06 / 04 / 2025	3,800,000	3,597,141	1.15
HPHT Finance 17 Ltd 2.75% 11 / 09 / 2022	1,400,000	1,410,210	0.45
Huarong Finance 2019 Co Ltd 2.50% 24 / 02 / 2023	3,000,000	2,974,468	0.95
IIFL Finance Ltd 5.875% 20 / 04 / 2023	6,800,000	6,747,346	2.16
India Airport Infra 6.25% 25 / 10 / 2025	3,500,000	3,175,264	1.02
India Green Energy Holdings 5.375% 29 / 04 / 2024	5,600,000	5,315,111	1.70
Indika Energy Capital III Pte Ltd 5.875% 09 / 11 / 2024	4,000,000	3,932,304	1.26

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (81.06%) (续)			
债务证券 (79.98%) (续)			
以美元计价 (79.98%) (续)			
Indonesia Government International Bond 5.375% 17 / 10 / 2023	3,000,000	3,115,016	1.00
Industrial & Commercial Bank of China Ltd 3.20% Perpetual Callable - 24 / 09 / 2026	900,000	860,933	0.28
JPMorgan Chase & Co 3.845% 14 / 06 / 2025	1,500,000	1,489,674	0.48
JSW Steel Ltd 5.375% 04 / 04 / 2025	5,600,000	5,254,086	1.69
Korea Western Power Co Ltd 3.75% 07 / 06 / 2023	2,000,000	2,013,240	0.65
LMIRT Capital Pte Ltd 7.25% 19 / 06 / 2024	7,200,000	6,361,104	2.04
LMIRT Capital Pte Ltd 7.50% 09 / 02 / 2026	450,000	393,810	0.13
Medco Oak Tree Pte Ltd 7.375% 14 / 05 / 2026	2,000,000	1,840,357	0.59
Medco Platinum Road Pte Ltd 6.75% 30 / 01 / 2025	12,800,000	12,295,840	3.94
Melco Resorts Finance Ltd 4.875% 06 / 06 / 2025	2,700,000	2,035,518	0.65
MGM China Holdings Ltd 5.25% 18 / 06 / 2025	2,100,000	1,626,399	0.52
MGM China Holdings Ltd 5.375% 15 / 05 / 2024	1,500,000	1,281,072	0.41
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.527% 13 / 09 / 2023	1,200,000	1,195,654	0.38
Mizuho Bank Ltd 2.95% 17 / 10 / 2022	700,000	704,680	0.23
Mizuho Financial Group Inc 2.601% 11 / 09 / 2022	1,000,000	1,007,777	0.32
Mizuho Financial Group Inc FRN 22 / 05 / 2026	1,500,000	1,466,682	0.47

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (81.06%) (续)			
债务证券 (79.98%) (续)			
以美元计价 (79.98%) (续)			
Muthoot Finance Ltd 4.40% 02 / 09 / 2023	7,270,000	7,173,196	2.30
Muthoot Finance Ltd 6.125% 31 / 10 / 2022	5,500,000	5,555,817	1.78
National Australia Bank Ltd FRN 12 / 01 / 2027	2,000,000	1,958,693	0.63
Perenti Finance Pty Ltd 6.50% 07 / 10 / 2025	2,800,000	2,725,063	0.87
Periama Holdings LLC / DE 5.95% 19 / 04 / 2026	7,000,000	6,387,220	2.05
Pertamina Persero PT 4.30% 20 / 05 / 2023	3,000,000	3,020,212	0.97
POSCO Holdings Inc 2.375% 12 / 11 / 2022	1,470,000	1,470,386	0.47
ReNew Power Pvt Ltd 5.875% 05 / 03 / 2027	7,000,000	6,557,149	2.10
Shinhan Bank Co Ltd 3.875% 05 / 11 / 2023	3,400,000	3,442,662	1.10
Shriram Transport Finance Co Ltd 4.40% 13 / 03 / 2024	500,000	468,610	0.15
Shriram Transport Finance Co Ltd 5.10% 16 / 07 / 2023	6,600,000	6,496,017	2.08
Shriram Transport Finance Co Ltd 5.95% 24 / 10 / 2022	7,300,000	7,320,247	2.35
State Grid Overseas Investment 2013 Ltd 3.125% 22 / 05 / 2023	2,390,000	2,398,474	0.77
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc FRN 14 / 01 / 2027	2,500,000	2,429,143	0.78
Tencent Holdings Ltd 2.985% 19 / 01 / 2023	400,000	404,505	0.13
Theta Capital Pte Ltd 8.125% 22 / 01 / 2025	7,100,000	6,390,677	2.05

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (81.06%) (续)			
债务证券 (79.98%) (续)			
以美元计价 (79.98%) (续)			
United States Treasury Bill 0.00% 05 / 07 / 2022	3,000,000	2,999,662	0.96
United States Treasury Bill 0.00% 12 / 07 / 2022	3,000,000	2,999,131	0.96
United States Treasury Bill 0.00% 15 / 06 / 2023	3,000,000	2,921,911	0.94
Vedanta Resources Finance II PLC 13.875% 21 / 01 / 2024	2,450,000	2,356,769	0.76
Vedanta Resources Finance II PLC 8.00% 23 / 04 / 2023	4,000,000	3,417,924	1.10
Vedanta Resources Ltd 6.375% 30 / 07 / 2022	8,000,000	8,168,717	2.62
Vedanta Resources Ltd 7.125% 31 / 05 / 2023	4,000,000	3,311,607	1.06
Woori Bank 4.25% Perpetual Callable - 04 / 10 / 2024	3,500,000	3,408,898	1.09
Woori Bank 4.75% 30 / 04 / 2024	2,000,000	2,039,137	0.65
Yanlord Land HK Co Ltd 6.75% 23 / 04 / 2023	300,000	287,643	0.09

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (81.06%) (续)			
债务证券 (79.98%) (续)			
以美元计价 (79.98%) (续)			
Yanlord Land HK Co Ltd 6.80% 27 / 02 / 2024	1,507,000	1,330,880	0.43
Yes Bank Ifsc Banking Unit Branch 3.75% 06 / 02 / 2023	5,105,000	5,121,612	1.64
债务证券总额		<u>249,434,803</u>	<u>79.98</u>

标的资产	交易对手	未平仓合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
------	------	----------------	------------	--------------

债券期指 (-0.03%)

美国 (-0.03%)

US 10Yr Note Future 21 / 09 / 2022	花旗银行,香港	(31)	(63,465)	(0.03)
US 2Yr Note (CBT) 30 / 09 / 2022	花旗银行,香港	(7)	(8,586)	(0.00)
US 5Yr Note (CBT) Future 30 / 09 / 2022	花旗银行,香港	(173)	(9,989)	(0.00)
债券期指总额			<u>(82,040)</u>	<u>(0.03)</u>

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	持有股份 / 份额 / 面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (81.06%) (续)			
投资基金 (1.11%)			
香港 (1.11%)			
东亚联丰中国高收益入息基金 – A 类别 美元(分派)单位	579,901	3,462,010	1.11
投资基金总额		<u>3,462,010</u>	<u>1.11</u>
投资总额		<u>252,814,773</u>	<u>81.06</u>

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

标的资产	交易对手	未平仓合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
外汇远期合约(-0.07%)				
买入 澳元 / 卖出 美元	花旗银行,香港	澳元 4,480,861	(18,524)	(0.01)
买入 欧元 / 卖出 美元	花旗银行,香港	欧元 2,765,672	(27,339)	(0.01)
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 20,000,000	26,281	0.01
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 109,764,912	(36,809)	(0.01)
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 458,403,763	(153,722)	(0.05)
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 5,902	(3)	(0.00)
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 428,118	(206)	(0.00)
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 12,044	(5)	(0.00)
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 17,426	-	0.00
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 4,990	-	0.00
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 3,005,259	23,459	0.01
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 3,135,492	(24,707)	(0.01)
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 2,970,647	(10,673)	(0.00)
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 20,228	14	0.00
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 289	-	0.00

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

标的资产	交易对手	未平仓合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
外汇远期合约(-0.07%)(续)				
买入美元/卖出人民币	花旗银行,香港	美元 201,376	486	0.00
买入美元/卖出人民币	花旗银行,香港	美元 44,721	(27)	(0.00)
买入美元/卖出人民币	花旗银行,香港	美元 7,720	2	0.00
外汇远期合约总额			<u>(221,773)</u>	<u>(0.07)</u>
其他净资产			<u>59,267,206</u>	<u>19.01</u>
净资产总额			<u>311,860,206</u>	<u>100.00</u>
投资总额,按成本计算			<u>260,297,795</u>	

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金

	持有股份 / 份额 / 面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (94.16%)			
股票 (46.05%)			
澳大利亚 (8.47%)			
Aristocrat Leisure Ltd	66,949	1,582,768	1.08
Macquarie Group Ltd	29,627	3,351,563	2.28
NEXTDC Ltd	192,885	1,411,262	0.96
Northern Star Resources Ltd	201,747	948,922	0.65
OZ Minerals Ltd	69,530	849,147	0.58
Santos Ltd	840,552	4,288,801	2.92
中国 (2.92%)			
Kweichow Moutai Co Ltd - A	4,900	1,494,658	1.02
Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd - A	147,122	1,386,467	0.93
Yunnan Energy New Material Co Ltd - A	38,264	1,429,433	0.97
香港 (16.93%)			
Alibaba Group Holding Ltd	383,800	5,473,108	3.73
Aluminum Corp of China Ltd - H	1,672,000	632,837	0.43
BYD Co Ltd - H	36,500	1,460,567	0.99
China Merchants Bank Co Ltd - H	882,000	5,901,017	4.02
Ganfeng Lithium Co Ltd - H	198,400	2,183,247	1.49
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	30,300	1,490,489	1.01
JD.com Inc	55,100	1,775,120	1.21
SITC International Holdings Co Ltd	1,274,000	3,604,303	2.46
Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd - H	1,245,600	2,330,256	1.59

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份 / 份额 / 面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (94.16%) (续)			
股票 (46.05%) (续)			
印度 (5.37%)			
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd	143,118	1,217,958	0.83
Bajaj Finance Ltd	11,888	812,979	0.55
HDFC Bank Ltd	68,684	1,172,417	0.80
Larsen & Toubro Ltd	56,115	1,107,268	0.75
Reliance Industries Ltd	109,152	3,587,686	2.44
印度尼西亚 (3.14%)			
Astra International Tbk PT	2,262,300	1,006,127	0.69
Bank Mandiri Persero Tbk PT	3,994,700	2,125,201	1.45
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	5,256,300	1,464,350	1.00
菲律宾 (0.97%)			
International Container Terminal Services Inc	426,690	1,427,879	0.97
新加坡 (3.53%)			
DBS Group Holdings Ltd	66,600	1,420,341	0.97
Singapore Telecommunications Ltd	1,056,000	1,919,725	1.31
United Overseas Bank Ltd	97,500	1,839,029	1.25
台湾 (3.11%)			
ASE Technology Holding Co Ltd	525,000	1,348,979	0.92
Globalwafers Co Ltd	62,000	944,588	0.64
MediaTek Inc	50,000	1,094,722	0.75
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	73,000	1,168,645	0.80

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份 / 份额 / 面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (94.16%) (续)			
股票 (46.05%) (续)			
美国 (1.61%)			
CrowdStrike Holdings Inc	13,996	<u>2,359,166</u>	<u>1.61</u>
股票总额		<u>67,611,025</u>	<u>46.05</u>
投资基金 (44.34%)			
香港 (43.13%)			
东亚联丰亚洲债券及货币基金 – A 类别 美元(分派)单位	55,388	526,190	0.36
东亚联丰亚洲债券及货币基金 – I 类别 美元(累积)单位	228,658	2,078,498	1.42
东亚联丰亚洲机会基金 – A 类别美元 (分派)单位	2,006,104	21,445,247	14.61
东亚联丰亚太区债券基金	4,126,332	39,241,413	26.74
中国 (1.21%)			
东亚联丰中国多元化一号私募证券投资 基金	9,998,261	<u>1,774,935</u>	<u>1.21</u>
投资基金总额		<u>65,066,283</u>	<u>44.34</u>

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份 / 份额 / 面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (94.16%) (续)			
房地产投资信托基金 (3.77%)			
澳大利亚 (1.62%)			
Goodman Group	193,845	2,378,028	1.62
美国 (2.15%)			
Prologis Inc	26,814	3,154,667	2.15
房地产投资信托基金总额		<u>5,532,695</u>	<u>3.77</u>
投资总额		<u>138,210,003</u>	<u>94.16</u>

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

标的资产	交易对手	未平仓合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
外汇远期合约 (-0.17%)				
买入 澳元 / 卖出 美元	花旗银行,香港	澳元 21,852,307	(90,359)	(0.06)
买入 欧元 / 卖出 美元	花旗银行,香港	欧元 43,193	(427)	(0.00)
买入 欧元 / 卖出 美元	花旗银行,香港	欧元 37,737	(373)	(0.00)
买入 新西兰元 / 卖出 美元	花旗银行,香港	新西兰元 7,681,196	(72,165)	(0.05)
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 100	-	0.00
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 5,500,000	7,227	0.00
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 243,534,300	(81,667)	(0.06)
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 387,852	(130)	(0.00)
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 20,350	(10)	(0.00)
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 2,000	(1)	(0.00)
买入 美元 / 卖出 澳元	花旗银行,香港	美元 2,117	11	0.00
买入 美元 / 卖出 澳元	花旗银行,香港	美元 42,235	(7)	(0.00)
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 826,446	6,451	0.00
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 742,662	(2,668)	(0.00)
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 19,513	14	0.00

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

标的资产	交易对手	未平仓合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
外汇远期合约 (-0.17%)(续)				
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 4,770	14	0.00
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 145,837	352	0.00
外汇远期合约总额			<u>(233,738)</u>	<u>(0.17)</u>
其他净资产			<u>8,801,405</u>	<u>6.01</u>
净资产总额			<u>146,777,670</u>	<u>100.00</u>
投资总额, 按成本计算			<u>147,936,764</u>	

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰中国高收益入息基金

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (90.93%)			
债务证券 (90.89%)			
以港元计价 (1.24%)			
Henderson Land MTN Ltd 2.20% 05 / 03 / 2023	3,000,000	381,962	1.24
以人民币计价 (7.32%)			
PBOC International Note 2.70% 23 / 02 / 2023	6,000,000	904,311	2.93
PBOC International Note 2.75% 24 / 08 / 2022	9,000,000	1,355,956	4.39
以美元计价 (82.33%)			
Adani Green Energy Ltd 4.375% 08 / 09 / 2024	600,000	548,114	1.78
Bank of China Ltd 3.60% Perpetual Callable - 04 / 03 / 2025	2,000,000	1,991,880	6.45
Bank of Communications Co Ltd 3.80% Perpetual Callable - 18 / 11 / 2025	1,300,000	1,306,291	4.23
Bank of Communications Hong Kong Ltd 3.725% Perpetual Callable - 03 / 03 / 2025	1,100,000	1,096,920	3.55
Champion Path Holdings Ltd 4.85% 27 / 01 / 2028	200,000	119,302	0.39
China Hongqiao Group Ltd 7.125% 22 / 07 / 2022	600,000	619,919	2.01

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰中国高收益入息基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (90.93%) (续)			
债务证券 (90.89%) (续)			
以美元计价 (82.33%) (续)			
China Hongqiao Group Ltd 7.375% 02 / 05 / 2023	800,000	800,933	2.59
China Oil & Gas Group Ltd 4.70% 30 / 06 / 2026	250,000	221,170	0.72
Chong Hing Bank Ltd 5.70% Perpetual Callable - 15 / 07 / 2024	850,000	870,122	2.82
ENN Clean Energy International Investment Ltd 3.375% 12 / 05 / 2026	1,600,000	1,467,558	4.75
FWD Group Ltd 5.75% 09 / 07 / 2024	1,400,000	1,426,099	4.62
Gemdale Ever Prosperity Investment Ltd 4.95% 26 / 07 / 2022	600,000	603,500	1.95
Golden Eagle Retail Group Ltd 4.625% 21 / 05 / 2023	1,700,000	1,650,494	5.35
Greenko Investment Co 4.875% 16 / 08 / 2023	200,000	196,814	0.64
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd 5.50% 06 / 04 / 2025	500,000	473,308	1.53
IIFL Finance Ltd 5.875% 20 / 04 / 2023	500,000	496,128	1.61
Indika Energy Capital III Pte Ltd 5.875% 09 / 11 / 2024	200,000	196,615	0.64
Industrial & Commercial Bank of China Ltd 3.20% Perpetual Callable - 24 / 09 / 2026	1,250,000	1,195,740	3.87
JSW Steel Ltd 5.375% 04 / 04 / 2025	200,000	187,646	0.61
Korea Western Power Co Ltd 3.75% 07 / 06 / 2023	282,000	283,867	0.92

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰中国高收益入息基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (90.93%) (续)			
债务证券 (90.89%) (续)			
以美元计价 (82.33%) (续)			
Medco Platinum Road Pte Ltd 6.75% 30 / 01 / 2025	200,000	192,123	0.62
Melco Resorts Finance Ltd 4.875% 06 / 06 / 2025	200,000	150,779	0.49
National Australia Bank Ltd FRN 12 / 01 / 2027	350,000	342,771	1.11
NWD MTN Ltd 4.375% 30 / 11 / 2022	2,300,000	2,313,058	7.49
Shriram Transport Finance Co Ltd 5.10% 16 / 07 / 2023	500,000	492,123	1.59
SmarTone Finance Ltd 3.875% 08 / 04 / 2023	800,000	804,819	2.61
State Grid Overseas Investment 2013 Ltd 3.125% 22 / 05 / 2023	400,000	401,418	1.30
Vedanta Resources Finance II PLC 8.00% 23 / 04 / 2023	400,000	341,792	1.11
Vedanta Resources Ltd 6.375% 30 / 07 / 2022	700,000	714,763	2.32
Vedanta Resources Ltd 7.125% 31 / 05 / 2023	550,000	455,346	1.47
Woori Bank 4.75% 30 / 04 / 2024	300,000	305,871	0.99
Yancoal International Resources Development Co Ltd 3.50% 04 / 11 / 2023	1,100,000	1,091,268	3.53
Yankuang Group Cayman Ltd 4.00% 16 / 07 / 2023	1,300,000	1,335,832	4.33

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰中国高收益入息基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (90.93%) (续)			
债务证券 (90.89%) (续)			
以美元计价 (82.33%) (续)			
Yanlord Land HK Co Ltd 6.75% 23 / 04 / 2023	200,000	191,762	0.62
Yanlord Land HK Co Ltd 6.80% 27 / 02 / 2024	600,000	529,879	1.72
债务证券总额		<u>28,058,253</u>	<u>90.89</u>

标的资产	交易对手	未平仓合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
债券期指 (0.04%)				
美国 (0.04%)				
US 5YR Note (CBT) Future 30 / 09 / 22	花旗银行, 香港	(23)	13,196	0.04
债券期指总额			<u>13,196</u>	<u>0.04</u>
投资总额			<u>28,071,449</u>	<u>90.93</u>

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰中国高收益入息基金(续)

标的资产	交易对手	未平仓合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
外汇远期合约 (-0.10%)				
买入 澳元 / 卖出 美元	花旗银行,香港	澳元 2,932,321	(12,122)	(0.04)
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 2,000,000	2,628	0.01
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 445,466	(149)	(0.00)
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 28,887,135	(9,687)	(0.03)
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 4,628	(1)	0.00
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 300,526	2,346	0.01
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 295,801	(2,331)	(0.01)
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 2,076,541	(10,383)	(0.04)

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰中国高收益入息基金(续)

标的资产	交易对手	未平仓合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
外汇远期合约 (-0.10%) (续)				
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 297,065	(1,067)	(0.00)
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 2,665	(2)	(0.00)
外汇远期合约总额			<u>(30,768)</u>	<u>(0.10)</u>
其他净资产			<u>2,830,935</u>	<u>9.17</u>
净资产总额			<u>30,871,616</u>	<u>100.00</u>
投资总额, 按成本计算			<u>28,837,536</u>	

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲策略债券基金

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (94.10%)			
债务证券 (65.72%)			
以美元计价 (65.72%)			
Adani Green Energy Ltd 4.375% 08 / 09 / 2024	300,000	274,057	0.59
Airport Authority 3.25% 12 / 01 / 2052	500,000	407,638	0.88
Alibaba Group Holding Ltd 4.00% 06 / 12 / 2037	700,000	609,894	1.32
Alibaba Group Holding Ltd 4.20% 06 / 12 / 2047	650,000	539,524	1.17
Azure Power Energy Ltd 3.575% 19 / 08 / 2026	192,740	162,036	0.35
Azure Power Solar Energy Pvt Ltd 5.65% 24 / 12 / 2024	300,000	284,535	0.62
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 3.75% 30 / 03 / 2026	200,000	184,702	0.40
Champion Path Holdings Ltd 4.85% 27 / 01 / 2028	200,000	119,301	0.26
China Construction Bank Corp 2.85% 21 / 01 / 2032	400,000	379,199	0.82
China Development Bank Financial Leasing Co Ltd 2.875% 28 / 09 / 2030	350,000	333,993	0.72
Chong Hing Bank Ltd 5.70% Perpetual Callable - 15 / 07 / 2024	1,000,000	1,023,673	2.22
CITIC Ltd 2.85% 25 / 02 / 2030	300,000	267,628	0.58
CITIC Ltd 3.50% 17 / 02 / 2032	200,000	183,320	0.40
CMB Wing Lung Bank Ltd 3.75% 22 / 11 / 2027	600,000	602,270	1.31

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲策略债券基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (94.10%) (续)			
债务证券 (65.72%) (续)			
以美元计价 (65.72%) (续)			
CNAC HK Finbridge Co Ltd 3.00% 22 / 09 / 2030	250,000	218,115	0.47
CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.125% 19 / 07 / 2027	1,100,000	1,090,807	2.37
CNOOC Finance 2013 Ltd 3.30% 30 / 09 / 2049	300,000	222,963	0.48
CNOOC Petroleum North America ULC 5.875% 10 / 03 / 2035	850,000	911,697	1.98
Dah Sing Bank Ltd 3.00% 02 / 11 / 2031	400,000	373,955	0.81
Foxconn Far East Ltd 3.00% 23 / 09 / 2026	250,000	241,647	0.52
Freeport Indonesia PT 5.315% 14 / 04 / 2032	450,000	415,772	0.90
Global Prime Capital Pte Ltd 5.50% 18 / 10 / 2023	200,000	200,159	0.43
GMR Hyderabad International Airport Ltd 5.375% 10 / 04 / 2024	200,000	196,885	0.43
Greenko Solar Mauritius Ltd 5.55% 29 / 01 / 2025	400,000	383,437	0.83
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd 5.50% 06 / 04 / 2025	500,000	473,308	1.03
Hanwha Energy USA Holdings Corp 4.125% 05 / 07 / 2025	200,000	200,820	0.44
Hanwha Life Insurance Co Ltd 3.379% 04 / 02 / 2032	400,000	372,611	0.81

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲策略债券基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (94.10%) (续)			
债务证券 (65.72%) (续)			
以美元计价 (65.72%) (续)			
HKT Capital No 6 Ltd 3.00% 18 / 01 / 2032	900,000	778,296	1.69
Hongkong Electric Finance Ltd 2.25% 09 / 06 / 2030	300,000	256,510	0.56
Huarong Finance 2017 Co Ltd 4.25% 07 / 11 / 2027	300,000	264,032	0.57
ICBCIL Finance Co Ltd FRN 20 / 11 / 2024	350,000	349,947	0.76
India Green Energy Holdings 5.375% 29 / 04 / 2024	250,000	237,282	0.51
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 4.75% 15 / 05 / 2025	200,000	200,174	0.43
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.45% 15 / 05 / 2030	1,650,000	1,563,431	3.39
Indonesia Government International Bond 4.75% 18 / 07 / 2047	600,000	565,852	1.23
JPMorgan Chase & Co 3.845% 14 / 06 / 2025	200,000	198,623	0.43
JSW Steel Ltd 5.375% 04 / 04 / 2025	200,000	187,646	0.41
KB Securities Co Ltd 2.125% 01 / 11 / 2026	500,000	456,451	0.99
Kodit Global 2022 The 1st Securitization Specialty Co Ltd 3.619% 27 / 05 / 2025	500,000	496,594	1.08
Korea Electric Power Corp 3.625% 14 / 06 / 2025	250,000	249,185	0.54
Korea Investment & Securities Co Ltd 2.125% 19 / 07 / 2026	700,000	643,645	1.40

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲策略债券基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (94.10%) (续)			
债务证券 (65.72%) (续)			
以美元计价 (65.72%) (续)			
Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp 4.125% 20 / 04 / 2027	900,000	892,634	1.94
Korea Western Power Co Ltd 4.125% 28 / 06 / 2025	200,000	200,797	0.44
LMIRT Capital Pte Ltd 7.25% 19 / 06 / 2024	250,000	220,872	0.48
Medco Platinum Road Pte Ltd 6.75% 30 / 01 / 2025	400,000	384,245	0.83
Mirae Asset Securities Co Ltd 2.625% 30 / 07 / 2025	350,000	336,067	0.73
Muang Thai Life Assurance PCL 3.552% 27 / 01 / 2037	400,000	369,934	0.80
New World China Land Ltd 4.75% 23 / 01 / 2027	200,000	197,659	0.43
NH Investment & Securities Co Ltd 1.875% 07 / 10 / 2026	200,000	181,571	0.39
NongHyup Bank 4.00% 06 / 01 / 2026	200,000	199,618	0.43
NongHyup Bank 4.25% 06 / 07 / 2027	200,000	199,864	0.43
Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 1.832% 10 / 09 / 2030	200,000	185,338	0.40
Perenti Finance Pty Ltd 6.50% 07 / 10 / 2025	200,000	194,647	0.42
Pertamina Persero PT 6.45% 30 / 05 / 2044	400,000	409,138	0.89

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲策略债券基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (94.10%) (续)			
债务证券 (65.72%) (续)			
以美元计价 (65.72%) (续)			
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.40% 06 / 06 / 2027	500,000	499,223	1.08
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.70% 06 / 06 / 2032	750,000	741,430	1.61
Perusahaan Listrik Negara PT 5.45% 21 / 05 / 2028	500,000	508,563	1.10
Philippine Government International Bond 5.00% 13 / 01 / 2037	400,000	409,921	0.89
PTT PCL 5.875% 03 / 08 / 2035	800,000	860,634	1.87
ReNew Power Pvt Ltd 5.875% 05 / 03 / 2027	250,000	234,184	0.51
SF Holding Investment 2021 Ltd 3.00% 17 / 11 / 2028	1,050,000	957,366	2.08
Shinhan Card Co Ltd 2.50% 27 / 01 / 2027	600,000	557,235	1.21
Sinochem Offshore Capital Co Ltd 2.375% 23 / 09 / 2031	650,000	531,164	1.15
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd 4.00% 13 / 09 / 2047	300,000	261,384	0.57
Tencent Holdings Ltd 3.68% 22 / 04 / 2041	300,000	244,003	0.53
Tencent Holdings Ltd 3.975% 11 / 04 / 2029	250,000	239,773	0.52

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲策略债券基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (94.10%) (续)			
债务证券 (65.72%) (续)			
以美元计价 (65.72%) (续)			
Tencent Holdings Ltd 4.525% 11 / 04 / 2049	250,000	222,721	0.48
Thaioil Treasury Center Co Ltd 2.50% 18 / 06 / 2030	300,000	241,684	0.52
United Overseas Bank Ltd 3.863% 07 / 10 / 2032	600,000	582,128	1.26
Vedanta Resources Finance II PLC 8.00% 23 / 04 / 2023	500,000	427,241	0.93
Vedanta Resources Ltd 6.375% 30 / 07 / 2022	500,000	510,545	1.11
Vedanta Resources Ltd 7.125% 31 / 05 / 2023	500,000	413,951	0.90
Wheelock MTN BVI Ltd 2.375% 25 / 01 / 2026	600,000	569,821	1.24
Yanlord Land HK Co Ltd 6.75% 23 / 04 / 2023	200,000	191,762	0.42
债务证券总额		30,298,731	65.72

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲策略债券基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (94.10%) (续)			
投资基金 (28.42%)			
香港 (28.42%)			
东亚联丰亚洲债券及货币基金 – I 类别			
美元(累积)单位	101,744	924,854	2.01
东亚联丰亚太区债券基金	1,280,639	12,178,878	26.41
投资基金总额		<u>13,103,732</u>	<u>28.42</u>

标的资产	交易对手	未平仓合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
------	------	----------------	------------	--------------

债券期指 (-0.04%)

美国 (-0.04%)

US 10Yr Note Future 21 / 09 / 2022	花旗银行,香港	(4)	7,281	0.02
US 2Yr Note (CBT) 30 / 09 / 2022	花旗银行,香港	(1)	1,367	0.00
US 5Yr Note (CBT) Future 30 / 09 / 2022	花旗银行,香港	(43)	(28,444)	(0.06)
债券期指总额			<u>(19,796)</u>	<u>(0.04)</u>
投资总额			<u>43,382,667</u>	<u>94.10</u>

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲策略债券基金(续)

标的资产	交易对手	未平仓合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
外汇远期合约 (-0.09%)				
买入 澳元 / 卖出 美元	花旗银行,香港	澳元 7,759,994	(32,080)	(0.07)
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 3,000,000	3,942	0.01
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 475,331	(159)	(0.00)
买入 人民币 / 卖出 美元	花旗银行,香港	人民币 46,645,063	(15,642)	(0.03)
买入 美元 / 卖出 澳元	花旗银行,香港	美元 9,733	92	0.00
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 450,789	3,518	0.01
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 443,702	(3,496)	(0.01)
买入 美元 / 卖出 人民币	花旗银行,香港	美元 445,597	(1,601)	(0.00)
外汇远期合约总额			<u>(45,426)</u>	<u>(0.09)</u>
其他净资产			<u>2,763,517</u>	<u>5.99</u>
净资产总额			<u>46,100,758</u>	<u>100.00</u>
投资总额, 按成本计算			<u>46,466,117</u>	

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合变动表

东亚联丰亚洲债券及货币基金

	占资产净值百分比	
	于2022年 6月30日	于2021年 6月30日
债务证券		
人民币	-	1.72
美元	79.98	94.00
债券期指		
美国	(0.03)	(0.04)
投资基金		
香港	1.11	0.24
外汇远期合约	<u>(0.07)</u>	<u>0.10</u>
	<u>80.99</u>	<u>96.02</u>

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合变动表(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金

	占资产净值百分比	
	于2022年 6月30日	于2021年 6月30日
股票		
澳大利亚	8.47	11.86
中国	2.92	0.73
香港	16.93	3.85
印度	5.37	2.70
印度尼西亚	3.14	-
韩国	-	0.94
菲律宾	0.97	-
新加坡	3.53	-
台湾	3.11	3.80
泰国	-	1.15
美国	1.61	1.43
债务证券		
人民币	-	2.15
美元	-	21.50
合订证券		
澳大利亚	-	2.16
投资基金		
香港	43.13	31.95
中国	1.21	-
房地产投资信托基金		
澳大利亚	1.62	3.47
新加坡	-	5.63
美国	2.15	3.69
债券期指		
美国	-	(0.03)
外汇远期合约		
	(0.17)	0.31
	<u>93.99</u>	<u>97.29</u>

投资报告

于2022年6月30日(未经审计)(续)

投资组合变动表(续)

东亚联丰中国高收益入息基金

	占资产净值百分比	
	于2022年 6月30日	于2021年 6月30日
债务证券		
港元	1.24	-
人民币	7.32	-
美元	82.33	96.50
债券期指		
美国	0.04	(0.04)
外汇远期合约	(0.10)	0.17
	<u>90.83</u>	<u>96.63</u>

东亚联丰亚洲策略债券基金

	占资产净值百分比	
	于2022年 6月30日	于2021年 6月30日
债务证券		
人民币	-	1.03
美元	65.72	70.44
投资基金		
香港	28.42	25.81
债券期指		
美国	(0.04)	(0.02)
外汇远期合约	(0.09)	0.28
	<u>94.01</u>	<u>97.54</u>

全面收益表

截至2021年6月30日止期间(未经审计)

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金		东亚联丰中国高收益入息基金		东亚联丰亚洲策略债券基金	
	2022 美元	2021 美元	2022 美元	2021 美元	2022 美元	2021 美元	2022 美元	2021 美元
收入								
股息收入	113,780	-	1,684,844	935,850	-	-	-	-
银行存款利息	4,777	1,308	3,227	347	71	81	491	176
其他投资收入	24,934	47,780	304,132	328,072	215	1,050	35,072	35,849
投资的净变现利润/(亏损)	(33,679,738)	27,581,067	(9,109,690)	3,686,464	(4,717,710)	1,862,134	(1,930,011)	2,169,734
投资的未变现(亏损)/利润的净变动	(19,178,821)	(18,638,439)	(25,358,850)	5,451,169	(204,801)	(2,438,406)	(4,220,472)	(3,093,866)
外汇(亏损)/利润	(44,176)	(164,595)	(3,886,019)	(1,120,189)	(135,404)	(5,398)	(19,472)	(17,856)
投资收入总额	(52,759,244)	8,827,121	(36,362,356)	9,281,713	(5,057,629)	(580,539)	(6,134,392)	(905,963)
支出								
投资管理费	2,157,935	4,244,392	1,214,650	1,774,108	199,232	321,848	260,272	538,845
受托人费用	245,701	519,988	130,141	190,083	24,904	40,231	32,534	67,356
保管费及银行费用	17,025	40,124	14,611	13,706	2,277	4,993	3,889	8,129
审计师酬金	5,314	5,687	5,314	5,687	5,314	5,687	5,314	5,687
基金登记机构费用	43,112	76,030	26,651	32,645	8,301	13,309	12,934	21,658
印刷及出版费用	-	9,718	-	2,877	-	630	-	1,112
监管费	3,000	580	3,000	579	-	579	-	-
法律及专业服务费用	10,794	11,516	2,576	11,516	575	47	933	47
交易成本	13,791	15,281	385,962	251,654	1,009	960	1,726	2,047
利息费用	1,236	3,073	282	29	199	27	408	102
其他营运费用	40,285	73,661	21,336	29,232	3,188	4,054	5,358	10,405
	2,538,193	5,000,050	1,804,523	2,312,116	244,999	392,365	323,368	655,388
计算融资成本前的利润 / (亏损)	(55,297,437)	3,827,071	(38,166,879)	6,969,597	(5,302,628)	(972,904)	(6,457,760)	(1,561,351)
向基金份额持有人作出收益分配	(8,784,654)	(19,709,986)	(5,423,313)	(7,674,496)	(1,203,188)	(2,196,270)	(1,243,757)	(2,767,896)
税前 (亏损) / 利润	(64,082,091)	(15,882,915)	(43,590,192)	(704,899)	(6,505,816)	(3,169,174)	(7,701,517)	(4,329,247)
税项 (包括预扣税)	-	(8,784)	(132,042)	(68,194)	-	106	-	(1,379)
年内 (损失) / 利润及全面收益总额	(64,082,091)	(15,891,699)	(43,722,234)	(773,093)	(6,505,816)	(3,169,068)	(7,701,517)	(4,330,626)

资产负债表于2021年6月30日(未经审计)

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金		东亚联丰中国高收益入息基金		东亚联丰亚洲策略债券基金	
	2022年6月30日 美元	2021年12月31日 美元	2022年6月30日 美元	2021年12月31日 美元	2022年6月30日 美元	2021年12月31日 美元	2022年6月30日 美元	2021年12月31日 美元
资产								
投资	252,814,773	515,353,228	138,210,003	194,364,753	28,071,449	34,701,798	43,382,667	59,882,219
应收外汇远期合约款项	-	554,132	-	621,439	-	61,895	-	173,687
应收股息	-	-	394,397	205,026	-	-	-	-
出售投资应收款项	10,127,746	133,669	79,378	740,479	-	61,070	1,354,340	72,198
认购基金份额的应收款项	81,460	128,176	15	37,258	-	61,187	-	8,907
其他应收款项	-	-	-	-	-	-	-	-
从经纪的应收款项	3,467	1,317	46,852	52,800	-	-	5,145	7,257
银行结余	1,749,338	1,005,861	388,699	223,660	162,350	112,715	216,159	100,690
资产总值	<u>52,451,237</u>	<u>21,060,785</u>	<u>8,413,705</u>	<u>6,440,499</u>	<u>2,761,832</u>	<u>1,124,474</u>	<u>3,088,016</u>	<u>1,651,731</u>
资产	<u>317,228,021</u>	<u>538,237,168</u>	<u>147,533,049</u>	<u>202,685,914</u>	<u>30,995,631</u>	<u>36,123,139</u>	<u>48,046,327</u>	<u>61,896,689</u>
负债								
赎回基金份额的应付款项	2,780,164	195,497	190,146	1,225,019	46,404	27,503	344,853	170,148
应付外汇远期合约款项	221,773	-	233,738	-	30,768	-	45,426	-
应付购入投资款项	2,011,068	133,432	42,251	735,944	-	61,187	1,498,292	72,018
应计费用及其他应付款项	<u>354,810</u>	<u>622,392</u>	<u>289,244</u>	<u>329,255</u>	<u>46,843</u>	<u>59,636</u>	<u>56,998</u>	<u>80,466</u>
负债总值 (不包括基金份额持有人应占的资产净值)	<u>5,367,815</u>	<u>951,321</u>	<u>755,379</u>	<u>2,290,218</u>	<u>124,015</u>	<u>148,326</u>	<u>1,945,569</u>	<u>322,632</u>
基金份额持有人应占的资产净值								
金融负债	<u>311,860,206</u>	<u>537,285,847</u>	<u>146,777,670</u>	<u>200,395,696</u>	<u>30,871,616</u>	<u>35,974,813</u>	<u>46,100,758</u>	<u>61,574,057</u>
权益	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>

资产负债表于2021年6月30日(未经审计)(续)

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金		东亚联丰中国高收益入息基金 ⁽¹⁾		东亚联丰亚洲策略债券基金 ⁽¹⁾	
	2022年6月30日	2021年12月31日	2022年6月30日	2021年12月31日	2022年6月30日	2021年12月31日	2022年6月30日	2021年12月31日
A 类别累积 (美元)								
份额发行数量	1,789,080.17	4,001,673.28	121,310.36	122,196.13	-	-	20,081.14	37,909.59
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	20.26	22.71	11.85	14.53	-	-	10.60	11.81
A 类别累积对冲 (欧元)								
份额发行数量	318,836.65	1,018,433.49	5,000.00	5,000.00	-	-	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	8.91	10.95	8.57	11.53	-	-	-	-
A 类别累积对冲 (人民币)								
份额发行数量	1,207,298.43	5,114,040.70	4,008.70	4,224.38	5,000.00	5,000.00	5,000.00	5,000.00
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	13.76	16.08	14.62	18.70	13.07	15.75	13.60	15.82
A 类别分派 (港元)								
份额发行数量	-	-	5,597,306.61	6,011,686.05	2,039,816.67	2,055,506.61	1,835,797.55	2,086,528.51
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	-	-	9.42	11.88	7.70	9.21	10.33	11.77
A 类别分派 (美元)								
份额发行数量	5,878,465.77	7,048,562.65	5,075,548.26	5,297,878.14	1,505,062.80	1,216,563.94	1,870,032.59	2,111,129.08
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	9.50	11.00	7.31	9.22	5.97	7.14	8.02	9.14
A 类别分派对冲 (澳元)								
份额发行数量	644,945.78	920,834.94	3,747,513.68	4,070,624.44	513,125.84	521,630.91	992,195.24	1,258,542.14
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	4.62	5.66	3.93	5.29	3.79	4.79	5.12	6.19
A 类别分派对冲 (欧元)								
份额发行数量	-	-	5,198.92	5,198.92	-	-	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	-	-	7.29	10.04	-	-	-	-
A 类别分派对冲 (新西兰元)								
份额发行数量	-	-	1,305,134.39	1,479,320.82	-	-	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	-	-	3.63	5.06	-	-	-	-
A 类别分派对冲 (人民币)								
份额发行数量	6,167,180.91	6,905,278.42	3,744,070.33	3,847,976.67	473,910.75	520,845.79	573,262.20	662,879.23
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	10.87	13.27	9.56	12.75	8.74	11.04	11.77	14.15
H 类别分派 (港元)								
份额发行数量	61,175,637.23	66,957,107.37	-	-	-	-	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	0.97	1.13	-	-	-	-	-	-
I 类别累积								
份额发行数量	690,722.34	2,296,514.92	-	-	-	-	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	9.09	10.13	-	-	-	-	-	-
I 类别分派 (港元)								
份额发行数量	7,082,643.56	7,582,643.56	-	-	-	-	-	-
财务报告中每份额资产净值 ⁽²⁾	9.04	10.45	-	-	-	-	-	-

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

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金		东亚联丰中国高收益入息基金		东亚联丰亚洲策略债券基金	
	2022 美元	2021 美元	2022 美元	2021 美元	2022 美元	2021 美元	2022 美元	2021 美元
于 1 月 1 日 / 成立日期的结余	537,285,847	849,279,450	200,395,696	275,026,181	35,974,813	55,476,340	61,574,057	128,317,540
与所有者的交易并直接计入权益/ 与基金份额持有人的交易								
年内 / 期内认购基金份额	30,854,232	217,123,130	3,792,468	16,368,364	4,525,339	9,177,817	637	14,087,478
年内 / 期内赎回基金份额	(192,197,782)	(222,161,210)	(13,688,260)	(46,847,928)	(3,122,720)	(10,000,819)	(7,772,419)	(46,092,579)
与所有者 / 基金份额持有人的交易总额	(161,343,550)	(5,038,080)	(9,895,792)	(30,479,564)	1,402,619	(823,002)	(7,771,782)	(32,005,101)
年内 (损失) / 利润及全面收益总额	(64,082,091)	(15,891,699)	(43,722,234)	(773,093)	(6,505,816)	(3,169,068)	(7,701,517)	(4,330,626)
于 6 月 30 日的结余	311,860,206	828,349,671	146,777,670	243,773,524	30,871,616	51,484,270	46,100,758	91,981,813

基金份额持有人应占资产净额变动表

截至 2021 年 6 月 30 日止期间 (未经审计) (续)

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金		东亚联丰中国高收益入息基金 ⁽¹⁾		东亚联丰亚洲策略债券基金 ⁽¹⁾	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
A 类别累积 (美元)								
年初已发行份额数目	4,001,673.28	3,482,472.51	122,196.13	165,799.86	-	-	37,909.59	41,081.57
年内已发行份额	845,379.37	2,849,767.74	134.90	22,223.49	-	-	-	3,436.58
年内已赎回份额	(3,057,972.48)	(2,086,121.15)	(1,020.67)	(19,310.42)	-	-	(17,828.45)	-
年末已发行份额数目	<u>1,789,080.17</u>	<u>4,246,119.10</u>	<u>121,310.36</u>	<u>168,712.93</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>20,081.14</u>	<u>44,518.15</u>
A 类别累积对冲 (欧元)								
年初已发行份额数目	1,018,433.49	2,808,804.66	5,000.00	5,000.00	-	-	-	-
年内已发行份额	104,602.51	1,789,929.50	-	-	-	-	-	-
年内已赎回份额	(804,199.35)	(1,085,745.40)	-	-	-	-	-	-
年末已发行份额数目	<u>318,836.65</u>	<u>3,512,988.76</u>	<u>5,000.00</u>	<u>5,000.00</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>
A 类别累积对冲 (人民币)								
年初已发行份额数目	5,114,040.70	4,949,959.43	4,224.38	3,431.52	5,000.00	-	5,000.00	-
年内已发行份额	6,250.50	1,833,640.14	2,613.83	1,111.33	-	-	-	-
年内已赎回份额	(3,912,992.77)	(1,054,830.13)	(2,829.51)	(456.79)	-	-	-	-
年末已发行份额数目	<u>1,207,298.43</u>	<u>5,728,769.44</u>	<u>4,008.70</u>	<u>4,086.06</u>	<u>5,000.00</u>	<u>-</u>	<u>5,000.00</u>	<u>-</u>
A 类别分派 (美元)								
年初已发行份额数目	7,048,562.65	9,595,008.07	5,297,878.14	6,738,741.01	1,216,563.94	1,793,047.90	2,111,129.08	5,003,090.09
年内已发行份额	458,069.78	1,364,788.49	20,903.08	204,511.32	407,128.19	338,982.62	-	302,356.22
年内已赎回份额	(1,628,166.66)	(2,563,469.10)	(243,232.96)	(1,015,902.05)	(118,629.33)	(542,772.12)	(241,096.49)	(2,296,659.44)
年末已发行份额数目	<u>5,878,465.77</u>	<u>8,396,327.46</u>	<u>5,075,548.26</u>	<u>5,927,350.28</u>	<u>1,505,062.80</u>	<u>1,589,258.40</u>	<u>1,870,032.59</u>	<u>3,008,786.87</u>
A 类别分派 (港元)								
年初已发行份额数目	-	-	6,011,686.05	8,040,349.33	2,055,506.61	2,199,162.85	2,086,528.51	3,018,521.13
年内已发行份额	-	-	134,947.94	482,988.29	192,875.14	301,919.74	55.23	476,124.90
年内已赎回份额	-	-	(549,327.38)	(1,162,097.48)	(208,565.08)	(282,403.93)	(250,786.19)	(944,870.56)
年末已发行份额数目	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>5,597,306.61</u>	<u>7,361,240.14</u>	<u>2,039,816.67</u>	<u>2,218,678.66</u>	<u>1,835,797.55</u>	<u>2,549,775.47</u>
A 类别分派对冲 (澳元)								
年初已发行份额数目	920,834.94	1,130,949.32	4,070,624.44	6,093,295.42	521,630.91	667,563.62	1,258,542.14	2,826,210.53
年内已发行份额	4,835.09	408,094.24	13,709.16	380,490.92	-	123,320.95	-	517,336.55
年内已赎回份额	(280,724.25)	(338,685.55)	(336,819.92)	(1,491,433.34)	(8,505.07)	(256,143.49)	(266,346.90)	(913,212.13)
年末已发行份额数目	<u>644,945.78</u>	<u>1,200,358.01</u>	<u>3,747,513.68</u>	<u>4,982,353.00</u>	<u>513,125.84</u>	<u>534,741.08</u>	<u>992,195.24</u>	<u>2,430,334.95</u>

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

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金		东亚联丰中国高收益入息基金 ⁽¹⁾		东亚联丰亚洲策略债券基金 ⁽¹⁾	
	2022	2021	2022	2021	2022	2021	2022	2021
A 类别分派对冲(欧元)								
年初已发行份额数目	-	-	5,198.92	5,198.92	-	-	-	-
年内已发行份额	-	-	-	-	-	-	-	-
年内已赎回份额	-	-	-	-	-	-	-	-
年末已发行份额数目	-	-	5,198.92	5,198.92	-	-	-	-
A 类别分派对冲(新西兰元)								
年初已发行份额数目	-	-	1,479,320.82	1,613,700.68	-	-	-	-
年内已发行份额	-	-	104,782.67	117,318.00	-	-	-	-
年内已赎回份额	-	-	(278,969.10)	(252,332.57)	-	-	-	-
年末已发行份额数目	-	-	1,305,134.39	1,478,686.11	-	-	-	-
A 类别分派对冲(人民币)								
年初已发行份额数目	6,905,278.42	6,946,417.72	3,847,976.67	4,370,275.33	520,845.79	458,129.79	662,879.23	1,200,553.64
年内已发行份额	57,122.22	2,864,386.52	120,378.14	369,232.46	15,319.44	160,581.83	-	87,899.61
年内已赎回份额	(795,219.73)	(1,322,848.98)	(224,284.48)	(870,240.15)	(62,254.48)	(37,095.48)	(89,617.03)	(345,772.35)
年末已发行份额数目	6,167,180.91	8,487,955.26	3,744,070.33	3,869,267.64	473,910.75	581,616.14	573,262.20	942,680.90
H 类别分派(港元)								
年初已发行份额数目	66,957,107.37	74,602,737.85	-	-	-	-	-	-
年内已发行份额	1,482,126.67	15,315,457.27	-	-	-	-	-	-
年内已赎回份额	(7,263,596.81)	(12,460,765.80)	-	-	-	-	-	-
年末已发行份额数目	61,175,637.23	77,457,429.32	-	-	-	-	-	-
I 类别累积								
年初已发行份额数目	2,296,514.92	4,682,492.42	-	-	-	-	-	-
年内已发行份额	525,802.10	889,099.85	-	-	-	-	-	-
年内已赎回份额	(2,131,594.68)	(791,952.91)	-	-	-	-	-	-
年末已发行份额数目	690,722.34	4,779,639.36	-	-	-	-	-	-
I 类别分派(港元)								
年初已发行份额数目	7,582,643.56	21,450,028.23	-	-	-	-	-	-
年内已发行份额	-	-	-	-	-	-	-	-
年内已赎回份额	(500,000.00)	(5,099,356.33)	-	-	-	-	-	-
年末已发行份额数目	7,082,643.56	16,350,671.90	-	-	-	-	-	-

管理及行政

受托人兼基金登记机构

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

董事

李民斌
李繼昌
溫婉容
André Haagmann
Gunter Karl Haueisen

基金管理人

东亚联丰投资管理有限公司
香港德辅道中 10 号
东亚银行大厦 5 楼

审计师

毕马威会计师事务所
香港中环遮打道 10 号
太子大厦 8 楼

法律顾问

的近律师行
香港中环遮打道 18 号
历山大厦 5 楼