

年度报告 (经审计)

截至 2025 年 12 月 31 日止的年度

东亚联丰资本增长基金

东亚联丰环球股票基金

注意: 此年度报告 (经审计) 的摘要版本只适用于在此列示的子基金。

| 目录 | 页数 |
|------------------------------|-----------|
| 管理及行政 | 1 |
| 投资报告 | |
| - 受托人评注 | 2 - 7 |
| - 本基金和子基金的投资目标及政策 | 8 - 14 |
| - 投资收益和业绩表现 | 15 |
| - 除投资收益 / (亏损) 净额以外的投资所得收入明细 | 16 |
| - 基金业绩表现报表 | 17 - 22 |
| - 由金融衍生工具导致的风险敞口数据 | 23 - 24 |
| - 投资组合报表 | 25 - 79 |
| - 投资组合变动表 | 80 - 83 |
| 致基金份额持有人的受托人报告 | 84 |
| 就财务报表的独立审计师报告 | 85 - 88 |
| 独立审计师鉴证报告 | 89 - 91 |
| 资产负债表 | 92 - 94 |
| 全面收益表 | 95 |
| 基金份额持有人应占资产净值变动表 / 权益变动表 | 96 - 98 |
| 现金流量表 | 99 |
| 财务报表附注 | 100 - 159 |

管理及行政

受托人兼基金登记机构

东亚银行 (信托) 有限公司

香港九龙观塘道 418 号

创纪之城五期

东亚银行中心 32 楼

基金管理人

东亚联丰投资管理有限公司

香港中环德辅道中 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

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间

受托人评注

投资分析

美国股市

2025 年，美国股市再次交出亮眼成绩单，在半导体股表现强劲、人工智能热潮持续以及宽松的货币和财政政策支撑下，标准普尔 500 指数的总回报率约为 17.9%。尽管受关税、通胀担忧及政策不确定性影响，市场时有波动，但强劲的企业盈利以及对科技类成长股的持续需求，仍为投资者情绪提供了支撑。美国经济在全年表现出相对较强的韧性。尽管劳动力市场状况有所放缓，但消费者支出依然坚挺，生产率、企业投资和财富效应持续支撑经济增长。美联储于 2025 年重启宽松周期，累计降息三次，共下调 75 个基点，使联邦基金利率于年末降至 3.5% 至 3.75%。

此外，尽管贸易政策的不确定性仍是导致市场波动的重要因素，但特朗普政府可能推出的财政支持和放松监管的预期情况，继续影响着投资者的预期。

欧洲股市

2025 年，欧洲股市表现强劲，年末收盘价接近历史高位。STOXX 600 指数全年上涨 16.6%，创下自 2021 年以来的最佳年度表现；与此同时，在利率下降、德国财政扩张以及投资者抛售估值过高的美国科技股之推动下，德国 DAX 指数上涨约 23%。

欧洲的宏观经济形势依然喜忧参半。随着通胀压力在年内逐步缓解，欧元区通胀率从 1 月份的 2.5% 降至 12 月份的 2.0%，与欧洲央行的目标趋于一致。为应对通胀趋缓，欧洲央行年内多次降息，从而有助于缓解金融环境压力。然而，该地区仍面临工业增长势头疲弱、部分市场政治不确定性以及对全球贸易紧张局势持续敏感等挑战。

欧洲股市的估值水平仍较美国股市存在显著折价，这提振了投资者的相对兴趣。然而，欧洲的经济前景仍很大程度上取决于财政扩张——尤其是德国的财政扩张——能否转化为更强劲、更持续的国内经济增长复苏。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

受托人评注 (续)

投资分析 (续)

日本股市

2025 年，日本股市整体表现虽较为波动，但总体仍录得相对良好的表现，主要受益于出口企业的强劲表现、公司治理改革以及投资者情绪的改善。尽管贸易紧张局势、日元汇率波动以及货币政策正常化步伐的不确定性对市场走势产生了影响，但企业基本面的稳健仍持续为市场提供了支撑。

2025 年，日本央行继续推进政策正常化，累计上调政策利率 50 个基点，至 12 月将利率提升至 0.75%，创下约 30 年来的最高水平。核心通胀率全年均高于日本银行的目标水平，5 月一度升至 3.7%，随后 12 月回落至 2.4%，随着更为持续的工资 — 价格循环迹象显现，也为继续推进政策正常化提供了支持。

展望未来，日本股市的前景仍将与日本央行的政策立场、长期债券收益率的走势以及日元汇率的变动密切相关。尽管持续的工资增长和企业改革有望在长期内为市场提供支撑，但随着投资者权衡经济复苏与金融环境收紧之间的平衡，日本股市仍可能面临波动。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

受托人评注 (续)

投资分析 (续)

亚太地区 (日本除外) 股市

MSCI 亚太指数 (日本除外) 全年录得 29.6% 的强劲涨幅，尽管面临全球经济挑战，但仍彰显了该地区的韧性。全球货币政策宽松、人工智能相关技术需求的持续增长以及北亚市场的局部走强，共同提振了该地区的市场情绪，但投资回报仍易受贸易紧张局势、美元走势及各国宏观经济形势的影响。

与此同时，该地区仍延续了比往年更加分化的市场格局。中国和印度仍是该基准指数中的主导力量，但两国的经济和市场驱动因素不仅彼此之间存在显著差异，与亚洲其他地区相比也大相径庭。

在中国，随着政策支持、流动性措施以及对科技相关板块的乐观情绪推动市场复苏，年内股市情绪在不同时期有所好转。然而，更广泛的宏观环境仍呈现分化态势，国内需求疲弱以及房地产行业持续承压，限制了市场估值重估步伐的持续性。

2025 年，印度股市表现较为温和，但仍保持上涨态势。在相对稳定的经济增长、强劲的国内需求以及政策支持的推动下，印度指数 (Nifty50) 全年上涨约 10%，但创纪录的资金外流限制了涨幅，导致其表现较其他亚洲市场略显逊色。

在强劲的半导体需求以及对人工智能相关投资持续热潮的推动下，台湾和韩国成为该地区科技股领涨行情的主要受益者。2025 年，受半导体及科技类股整体强劲上涨的提振，台湾加权指数 (TAIEX) 上涨约 27%；而韩国 KOSPI 指数则飙升约 76%，这得益于强劲的芯片出口以及市场对存储器和人工智能相关技术领域的兴趣重燃。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

受托人评注 (续)

投资分析 (续)

大中华股市

2025 年，中国内地及香港股市整体呈现出分化走势，并在部分阶段有所改善。尽管内需依然疲软，房地产行业仍面临压力，但得益于出口的韧性以及贸易持续向东南亚、非洲和拉丁美洲多元化发展，2025 年中国经济实现了 5% 的增长。

受市场预期将出台更多政策支持，以及对科技、自动化和供应链本土化等特定领域的乐观情绪日益高涨的影响，投资者对中国市场的信心在多个方面有所改善。然而，消费持续疲软、房地产市场低迷以及对外贸易紧张局势再度升级，这些因素继续制约着整个市场的估值重估。

2025 年，香港恒生指数上涨 27.8%，创下自 2017 年以来最强劲的年度表现。此轮涨势得益于创纪录的南向资金流入以及市场对中概科技股和成长股兴趣的重新燃起，而市场表现仍与市场对内地的情绪、美联储政策预期以及区域流动性前景密切相关。

亚洲债券市场

亚洲债券市场在过去一年中，经历了美联储政策预期波动、关税相关波动以及全球风险偏好变化的多重考验。随着年内不同阶段美国降息预期的重燃及风险偏好改善，亚洲信用市场总体上仍获得有力支撑。投资级债券利差得益于稳健的基本面、可控的供应量以及该地区对相对价值机会的择优需求。

各细分领域表现分化明显。在市场走势较为积极的阶段，亚洲投资级债券的利差有所收窄；而高收益债券领域则受益于套利收益，以及市场对部分发行人和行业的信心改善。总体而言，市场表现受到美联储宽松政策的时间节点、中美贸易局势的发展，以及外部不确定性与区域信贷基本面仍具支撑性之间的平衡所影响。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

受托人评注 (续)

投资分析 (续)

货币市场

2025 年的外汇市场主要受美国利率预期变化、贸易紧张局势以及各国央行政策路径分化等因素驱动。在关税风险和通胀担忧加剧的某些时期，美元保持坚挺，但随后美国通胀放缓及美联储的宽松政策削弱了部分支撑。

日元汇率持续波动，投资者一方面权衡日本央行货币政策正常化的路径，另一方面关注外部市场冲击及风险偏好的变化。

受美元普遍走弱以及投资者对欧洲市场情绪好转的支撑，欧元兑美元汇率在年末显著走强。

在中国，人民币汇率在年内大部分时间维持在相对有限的区间内波动，期间虽受到美元普遍走弱的支撑，但同时受到出口因素以及市场对国内政策将继续保持宽松的预期所制约。

在香港，香港银行同业拆息 (HIBOR) 和港元利率在早前因流动性因素导致的扭曲后逐渐回归正常，而当港元汇率触及交易区间下限时，香港金融管理局 (HKMA) 进行了干预。总体而言，港元需求仍受到本地资产市场活动的支撑，港元兑美元汇率基本维持在区间内波动。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

本基金和子基金的投资目标及政策

东亚联丰资本增长基金 (“本基金”) 按照 2000 年 9 月 22 日订立的信托契约 (该信托契约于 2019 年 12 月 31 日经修订及重述) 设立。本基金设立 16 只子基金, 且投资政策各不相同。本基金的子基金为东亚联丰亚洲策略增长基金、东亚联丰环球债券基金、东亚联丰环球股票基金以及东亚联丰亚太区投资级别债券基金。

每项子基金的投资均采用单独且不同的投资政策。相应的投资目标及政策载列如下。

东亚联丰亚洲策略增长基金

投资目标

投资基金的投资目标是透过投资于主要由 (最少 70% 的资产净值) (a) 在亚太区 (包括但不限于中国香港、新加坡、马来西亚、韩国、中国台湾、泰国、印尼、菲律宾、印度及中国, 但日本除外) 上市的证券或 (b) 在亚太区成立的公司或其主营业务位于亚太区或其目前重大部分收入或利润源自亚太区的公司所发行的证券所组成的分散投资组合, 以提供以港元计算之长期资本增长予投资者。至于其余资产, 基金管理人可酌情投资于非该子基金首要的地域、市场类别、行业或资产类别。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

本基金和子基金的投资目标及政策 (续)

东亚联丰亚洲策略增长基金 (续)

投资政策

基金管理人打算采用“由上而下”的方法，先根据基金管理人对市场及经济趋势的分析而决定在每一国家内的资产分配，然后运用基础分析在每一国家内选择适当的投资。对公司收益增长及流动资金的分析亦将会是作出投资决定过程之一部分。

基金管理人预期该子基金于新加坡、马来西亚、韩国、中国台湾及中国中任何一个市场之最高投资额不会超过该子基金资产之 50%，而于泰国、印尼、菲律宾及印度中任何一个市场之最高投资额不会超过该子基金资产之 30%。

该子基金可将至少 60% 的资产 (现金或存款除外) 投资于股票证券，当中可报考首次公开发行的证券。该子基金可将其高达 10% 之资产投资于其他证券 (经《强制性公积金计划 (一般) 规例》之附表 1 批准的其他证券)。该子基金的投资组合亦可包括现金、存款、定息证券、浮息投资工具及短期票据，例如库券、存款证、银行承兑汇票及短期商业票据。如基金管理人认为情况需要及对份额持有人有利，投资组合之大部分可能会以现金或该等投资工具持有。

在《强制性公积金计划条例》之限制下，基金管理人可能会为对冲目的及其他目的而为该子基金订立金融期货及期权合约。倘若基金管理人为非对冲目的而取得该等工具，仅可为解决与相关投资证券市场的结算错配而进行。无论如何，该等合约的取得必须符合《强制性公积金计划规例》的规定。

基金管理人预期该子基金之回报，就长期而言反映亚洲区股票市场之变动。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

本基金和子基金的投资目标及政策 (续)

东亚联丰环球债券基金

投资目标

透过投资于以各种主要货币 (包括但不限于美元、欧元、英镑、日元及港元) 计算之范围多元化环球债券, 提供中期至长期的整体投资回报予投资者。

投资政策

一般而言, 子基金的资产于短至长期政府债券的投资将占 20%至 100%, 而于短至长期公司债券的投资将占 0%至 80%。投资基金将主要投资于美国、欧洲及亚洲, 但可包括其他市场。然而, 实际分配可因应市场及其他情况变动而更改。

子基金可投资少于资产净值 30%于具有吸收亏损特点的债务工具, 包括或有可换股债务证券 (少于其资产净值的 10%)、由金融机构发行的高级非优先债及次级债。

在《强制性公积金计划条例》之限制下, 基金管理人可能会为对冲目的及其他目的而为该子基金订立金融期货及期权合约。倘若基金管理人为非对冲目的而取得该等工具, 仅可为解决与相关投资证券市场的结算错配而进行。无论如何, 该等合约的取得必须符合《强制性公积金计划规例》的规定。

基金管理人预期该子基金之回报, 就长期而言可反映环球债券市场之变动。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

本基金和子基金的投资目标及政策 (续)

东亚联丰环球股票基金

投资目标

透过投资于一个分散环球投资组合，提供长期资本增值予投资者。

投资政策

该子基金的投资组合主要由环球股本证券组成，以《强制性公积金计划（一般）规例》附表 1 所准许为限，包括但不限于普通股、优先股、美国预托证券 (ADR)、环球预托证券 (GDR)、国际预托证券 (IDR)、核准交易所买卖基金 (ETF)、认股权证，或可转换为普通股或优先股，或 ADR、GDR 或 IDR 的债务证券。

基金管理人在管理投资组合的资产分配时，将不时参考一只或多只环球股票市场指数的地区分配。作为一项指示，投资基金的地区性分配预期为：

- | | |
|------|----------|
| - 美国 | 0% - 65% |
| - 欧洲 | 0% - 40% |
| - 其他 | 0% - 50% |

谨请注意，上述数字仅作指示性用途。该子基金的投资组合在各个国家与各个地区之间的实际分配可能不时改变，并且可能与上文因应基金管理人对目前及预期的环球市场情况的看法所显示的有所不同，亦会基于基金管理人对全球市场及经济增长、通货膨胀及利率走势的宏观经济分析而决定。

该子基金通常将其不少于 70% 的资产投资于股票。至于其余资产，基金管理人可酌情投资于非该子基金首要的市场类别、行业或资产类别。该子基金可将其高达 10% 之资产投资于其他证券（经《强制性公积金计划（一般）规例》之附表 1 批准的其他证券）。任何剩余资产均可以货币市场工具、现金或现金等价物持有。在市场极为波动时或在市况严重不利的期间，该子基金可将其大部分资产以货币市场工具、现金或现金等价物持有，以保障该子基金的投资组合。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

本基金和子基金的投资目标及政策 (续)

东亚联丰环球股票基金 (续)

投资政策 (续)

在《强制性公积金计划条例》之限制下，基金管理人可能会为对冲目的及其他目的而为该子基金订立金融期货及期权合约。倘若基金管理人为非对冲目的而取得该等工具，仅可为解决与相关投资证券市场的结算错配而进行。无论如何，该等合约的取得必须符合《强制性公积金计划规例》的规定。

此外，该子基金将以其至少 30% 的资产持有港元货币投资项目，该比例以有效货币敞口计算 (其按照《强制性公积金计划 (一般) 规例》附表 1 而确定)。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

本基金和子基金的投资目标及政策 (续)

东亚联丰亚太区投资级别债券基金

投资目标

通过投资于亚太区投资级别债券，以提供中至长期的投资总回报。

投资政策

子基金的投资组合主要 (最少 70% 的资产净值) 包括以各种亚洲或主要环球货币 (例如美元) 计算的债券，有关债券属投资级别，并由亚太区政府或企业实体发行。“投资级别”就此而言指符合强制性公积金计划管理局 (“管理局”) 不时规定条件的信贷评级。子基金的投资可包括 (但不限于)：固定及浮动利率债券、零息债券和贴现债券以及商业票据。

子基金可投资的亚太区国家或地区包括 (但不限于) 澳洲、中国香港、中国、韩国、马来西亚、新西兰、新加坡及泰国。子基金可通过投资于离岸人民币计价的债务证券或其他于中国内地境外发行或分发的证券 (例如香港发行的离岸人民币债券) 而大量投资于中国债券市场。基金并不投资于在中国内地境内发行或分发的债务证券或其他证券。

子基金通常将投资不超过 30% 的资产于以不同主要货币 (例如美元) 计算的其他债券，有关债券 (a) 属投资级别，但并非由亚太区政府或企业实体发行，包括但不限于欧洲联盟成员 (最低信贷级别为相等于标准普尔的 BBB- 级)、加拿大、美国、英国、墨西哥、巴西及卡塔尔，或 (b) 经《强制性公积金计划 (一般) 规例》之附表 1 批准。由非亚太区发行人发行的债券之投资可用以 (i) 管理下跌风险 (例如于亚洲债券市场波动时)；或 (ii) 通过将资产分配至该等基金管理人根据风险 / 回报基准认为具吸引力的债券而取得额外投资回报；或 (iii) 受惠于投资组合多元化。

子基金亦可将其不超过 30% 的资产投资于货币市场工具、现金或现金等价物。于市场极为波动或市况极为不利时，子基金可将其大部分资产投资于货币市场工具、现金或现金等价物，以保障子基金的投资组合。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

本基金和子基金的投资目标及政策 (续)

东亚联丰亚太区投资级别债券基金 (续)

投资政策 (续)

目标资产分配如下 (可因应市况变动在范围内更改) :

| | 最低 (资产净值%) | 最高 (资产净值%) |
|---------------------|------------|------------|
| <u>按资产类别</u> | | |
| - 债务证券 | 70% | 100% |
| - 货币市场工具 / 现金及现金等价物 | 0% | 30% |
| <u>按地区分配</u> | | |
| - 亚太区 | 70% | 100% |
| - 非亚太区 | 0% | 30% |

子基金可投资少于资产净值 30%于具有吸收亏损特点的债务工具, 包括或有可换股债务证券 (少于其资产净值的 10%)、由金融机构发行的高级非优先债及次级债。

在《强制性公积金计划条例》之限制下, 基金管理人可能会为对冲目的及其他目的而为该子基金订立金融期货及期权合约。倘若基金管理人为非对冲目的而取得该等工具, 仅可为解决与相关投资证券市场的结算错配而进行。无论如何, 该等合约的取得必须符合《强制性公积金计划规例》的规定。

此外, 该子基金将以其至少 30%的资产持有港元货币投资项目, 该比例以有效货币敞口计算 (其按照《强制性公积金计划 (一般) 规例》附表 1 而确定)。

子基金将不会投资于任何结构性存款或产品, 且将不会订立任何证券借贷、回购交易或其他类似交易。

投资报告

截至2025年12月31日止年度 / 期间 (续)

投资收益和业绩表现

| | 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | | 东亚联丰环球债券基金 | | |
|------------------------------|---------------|---------------|---------------|-----------------|---------------|---------------|
| | 2025年 港元 | 2024年 港元 | 2023年 港元 | 2025年 港元 | 2024年 港元 | 2023年 港元 |
| 不包括资本增值 / (贬值) 的收益 / (亏损) 净额 | 277,802 | 19,535,119 | 29,703,233 | (103,060,736) | 4,852,711 | (8,611,920) |
| 资本升值 / (贬值) - 已变现和未变现 | 611,213,134 | 326,052,547 | 86,073,470 | 520,723,669 | (189,324,130) | 348,991,956 |
| 于12月31日投资所得基金资产价值 | 2,061,094,773 | 1,761,061,656 | 2,038,923,962 | 7,191,625,887 | 7,370,909,906 | 6,937,984,382 |
| | | | | | | |
| | 东亚联丰环球股票基金 | | | 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | | |
| | 2025年 港元 | 2024年 港元 | 2023年 港元 | 2025年 港元 | 2024年 港元 | 2023年 港元 |
| 不包括资本增值 / (贬值) 的收益 / (亏损) 净额 | (7,714,251) | 37,787,537 | 25,819,376 | (8,120,709) | (2,317,777) | (4,322,901) |
| 资本升值 / (贬值) - 已变现和未变现 | 1,136,430,753 | 845,619,377 | 692,657,037 | 84,508,537 | 48,174,036 | 81,779,967 |
| 于12月31日投资所得基金资产价值 | 8,868,717,941 | 5,766,731,854 | 4,603,014,881 | 930,603,994 | 1,094,844,505 | 1,012,782,891 |

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

除投资收益 / (亏损) 净额以外的投资所得收入明细

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间

| | 存款凭证 | | 股息收入 | 银行现金 | 银行存款 | 其他收入 | 总额 |
|---------------------|-------------|----|------------|---------|------|--------|-------------|
| | 债券利息 | 利息 | | 利息 | 利息 | | |
| | 港元 | 港元 | 港元 | 港元 | 港元 | 港元 | 港元 |
| 东亚联丰亚洲策略 增长基金 | - | - | 38,051,040 | 4,297 | - | - | 38,055,337 |
| 东亚联丰环球债券 基金 | 250,803,261 | - | - | 569,500 | - | 786 | 251,373,547 |
| 东亚联丰环球股票 基金 | - | - | 98,730,387 | 34,459 | - | 18,663 | 98,783,509 |
| 东亚联丰亚太区投 资级别债券基金 | 45,673,416 | - | - | 122,127 | - | 668 | 45,796,211 |

截至 2024 年 12 月 31 日止年度

| | 存款凭证 | | 股息收入 | 银行现金 | 银行存款 | 其他收入 | 总额 |
|---------------------|-------------|----|------------|---------|------|---------|-------------|
| | 债券利息 | 利息 | | 利息 | 利息 | | |
| | 港元 | 港元 | 港元 | 港元 | 港元 | 港元 | 港元 |
| 东亚联丰亚洲策略 增长基金 | - | - | 48,324,254 | 18,567 | - | - | 48,342,821 |
| 东亚联丰环球债券 基金 | 221,124,627 | - | - | 511,400 | - | 8,104 | 221,644,131 |
| 东亚联丰环球股票 基金 | - | - | 83,839,208 | 6,461 | - | 100,286 | 83,945,955 |
| 东亚联丰亚太区投 资级别债券基金 | 47,253,698 | - | - | 178,708 | - | 4,122 | 47,436,528 |

投资报告

截至2025年12月31日止年度 / 期间 (续)

基金业绩表现报表

(a) 资产净值总额和份额净值

| 子基金 | 于2025年12月31日 | | 于2024年12月31日 | | 于2023年12月31日 | |
|----------------------------------|------------------|-----------|------------------|-----------|------------------|-----------|
| | 资产净值总额 | 份额净值 | 资产净值总额 | 份额净值 | 资产净值总额 | 份额净值 |
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | | | | | |
| - A类别 (港元) | 港元 2,042,311,477 | 港元 659.55 | 港元 1,756,730,993 | 港元 479.42 | 港元 2,061,358,094 | 港元 412.59 |
| - I(3)类别 (美元) | 港元 16,973,519 | 港元 128.77 | 港元 28,594,425 | 港元 94.38 | 港元 83,258 | 港元 81.88 |
| - R(2)类别 (美元) ⁽¹⁾ | 港元 60,444,895 | 港元 458.91 | 港元 52,245,748 | 港元 339.04 | 港元 50,222,176 | 港元 296.56 |
| 东亚联丰环球债券基金 | | | | | | |
| - A类别 (港元) | 港元 3,961,799,877 | 港元 121.53 | 港元 4,287,223,671 | 港元 115.06 | 港元 4,642,057,060 | 港元 118.09 |
| - I类别 (港元) | 港元 3,359,198,251 | 港元 104.76 | 港元 2,913,601,344 | 港元 99.16 | 港元 2,430,712,183 | 港元 101.74 |
| - I(2)类别 (港元) ⁽²⁾⁽⁵⁾ | 港元 - | 港元 - | 港元 212,037,597 | 港元 96.78 | 港元 - | 港元 - |
| - R(2)类别 (美元) ⁽¹⁾ | 港元 27,973,664 | 港元 99.08 | 港元 43,060,645 | 港元 94.69 | 港元 39,709,605 | 港元 98.10 |
| 东亚联丰环球股票基金 | | | | | | |
| - A类别 (港元) | 港元 1,686,007,617 | 港元 387.37 | 港元 3,149,035,828 | 港元 324.08 | 港元 2,589,416,526 | 港元 269.54 |
| - I类别 (港元) | 港元 3,235,585,096 | 港元 272.22 | 港元 2,553,621,667 | 港元 227.67 | 港元 2,086,751,132 | 港元 189.38 |
| - I(2)类别 (港元) ⁽³⁾ | 港元 1,888,103,526 | 港元 120.65 | 港元 118,073,332 | 港元 100.98 | 港元 - | 港元 - |
| - R类别 (港元) ⁽¹⁾ | 港元 61,050,377 | 港元 216.29 | 港元 39,307,437 | 港元 183.97 | 港元 31,376,991 | 港元 155.55 |
| - R(2)类别 (美元) ⁽¹⁾⁽⁴⁾ | 港元 95,789,188 | 港元 89.81 | 港元 - | 港元 - | 港元 - | 港元 - |
| - R(3)类别 (人民币) ⁽¹⁾⁽³⁾ | 港元 2,092,652,634 | 港元 125.13 | 港元 1,351,438 | 港元 106.33 | 港元 - | 港元 - |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | | | | | | |
| - A类别 (港元) | 港元 935,831,268 | 港元 159.27 | 港元 1,095,243,467 | 港元 147.24 | 港元 1,016,110,493 | 港元 140.97 |
| - R类别 (港元) ⁽⁵⁾ | 港元 3,490,011 | 港元 123.74 | 港元 3,188,620 | 港元 115.66 | 港元 1,569,403 | 港元 111.97 |

(1) 自2024年1月15日起，R类别基金份额已重组为R类别、R(2)类别和R(3)类别基金份额。R类别、R(2)类别和R(3)类别基金份额的计算货币分别为港元、美元及人民币。

(2) 东亚联丰环球债券基金 I(2)类别于2024年8月30日发行。

(3) 东亚联丰环球股票基金 I(2)类别和 R(3)类别分别于2024年8月30日和2024年11月19日发行。

(4) 东亚联丰环球股票基金 R(2)类别于2025年1月6日发行。

(5) 东亚联丰环球债券基金 I(2)类别于2025年4月8日全额赎回。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

基金业绩表现报表 (续)

(b) 基金支出比例 (“FER”)

| 子基金 | 2025 年 | |
|--------------------------------------|---|-----------------------------------|
| | 截至 12 月 31 日止 年度 / 期间的交易 成本 港元 | 截至 12 月 31 日止 年度 / 期间 FER % |
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | |
| - A 类别 (港元) | 8,261,835 | 0.07583 |
| - I(3)类别 (美元) | 86,765 | 0.89205 |
| - R(2)类别 (美元) | 242,864 | 1.70072 |
| 东亚联丰环球债券基金 | | |
| - A 类别 (港元) | 12,236 | 0.03220 |
| - I 类别 (港元) | 8,698 | 0.00298 |
| - I(2)类别 (港元) | - | 0.06507 |
| - R(2)类别 (美元) | 93 | 0.96680 |
| 东亚联丰环球股票基金 | | |
| - A 类别 (港元) | 1,971,879 | 0.04098 |
| - I 类别 (港元) | 3,131,517 | 0.01160 |
| - I(2)类别 (港元) | 642,920 | 0.09433 |
| - R 类别 (港元) | 53,602 | 1.69616 |
| - R(2)类别 (美元) ^{(1) (4)} | 67,933 | 1.60181 |
| - R(3)类别 (人民币) | 1,237,797 | 1.60278 |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | | |
| - A 类别 (港元) | - | 0.06009 |
| - I(2)类别 (港元) ^{(2) (3) (4)} | - | 0.09477 |
| - R 类别 (港元) | - | 1.16102 |

(1) 东亚联丰环球股票基金 R(2) 类别于 2025 年 1 月 6 日发行。

(2) 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 I(2) 类别于 2025 年 2 月 12 日发行。

(3) 东亚联丰环球债券基金和东亚联丰亚太区投资级别债券基金 I(2) 类别于 2025 年 4 月 8 日全额赎回。

(4) 基金支出比例是根据总支出和平均资产净值按年化方式计算。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

基金业绩表现报表 (续)

(c) 最高价和最低价

| 子基金 | 2025 年 | | | 2024 年 | | | 2023 年 | | | 2022 年 | | | | | | | | | | |
|----------------------------------|-------------|-------------|-------------------------|-------------|-------------|-------------------------|-------------|-------------|-------------------------|-------------|-------------|-------------------------|-----|--------|-------|-----|--------|-----|--------|---------|
| | 份额最高 发行价 | 份额最低 赎回价 | 年化投资 回报率 (注) % | 份额最高 发行价 | 份额最低 赎回价 | 年化投资 回报率 (注) % | 份额最高 发行价 | 份额最低 赎回价 | 年化投资 回报率 (注) % | 份额最高 发行价 | 份额最低 赎回价 | 年化投资 回报率 (注) % | | | | | | | | |
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| - A 类别 (港元) | 港元 | 659.55 | 港元 | 429.00 | 37.57 | 港元 | 522.05 | 港元 | 394.76 | 16.20 | 港元 | 432.93 | 港元 | 372.14 | 6.68 | 港元 | 526.79 | 港元 | 350.13 | (26.07) |
| - I(3)类别 (美元) ⁽⁴⁾ | 美元 | 16.58 | 美元 | 10.85 | 36.13 | 美元 | 13.21 | 美元 | 10.01 | 15.82 | 美元 | 11.06 | 美元 | 9.46 | 5.75 | 美元 | 10.34 | 美元 | 9.81 | (0.80) |
| - R(2)类别 (美元) ⁽⁵⁾ | 美元 | 59.15 | 美元 | 38.90 | 35.07 | 美元 | 47.65 | 美元 | 36.24 | 14.93 | 美元 | 40.35 | 美元 | 34.30 | 4.92 | 美元 | 50.17 | 美元 | 32.68 | (27.34) |
| 东亚联丰环球债券基金 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| - A 类别 (港元) | 港元 | 121.97 | 港元 | 113.52 | 5.62 | 港元 | 121.12 | 港元 | 112.76 | (2.57) | 港元 | 118.88 | 港元 | 108.45 | 4.66 | 港元 | 133.95 | 港元 | 109.27 | (16.04) |
| - I 类别 (港元) ⁽¹⁾ | 港元 | 105.14 | 港元 | 97.83 | 5.65 | 港元 | 104.37 | 港元 | 97.16 | (2.54) | 港元 | 102.42 | 港元 | 93.43 | 4.69 | 港元 | 115.34 | 港元 | 94.11 | (16.02) |
| - I(2)类别 (港元) ⁽⁶⁾⁽¹⁰⁾ | 港元 | 100.12 | 港元 | 95.48 | 不适用 | 港元 | 101.89 | 港元 | 96.58 | (3.22) | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - |
| - R(2)类别 (美元) ⁽⁵⁾ | 美元 | 12.82 | 美元 | 11.99 | 4.43 | 美元 | 12.83 | 美元 | 11.93 | (2.95) | 美元 | 12.64 | 美元 | 11.53 | 3.63 | 美元 | 14.55 | 美元 | 11.69 | (16.93) |
| 东亚联丰环球股票基金 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| - A 类别 (港元) | 港元 | 390.27 | 港元 | 286.04 | 19.53 | 港元 | 338.67 | 港元 | 264.84 | 20.23 | 港元 | 270.25 | 港元 | 219.89 | 22.61 | 港元 | 267.36 | 港元 | 200.23 | (17.18) |
| - I 类别 (港元) ⁽¹⁾ | 港元 | 274.25 | 港元 | 200.96 | 19.57 | 港元 | 237.90 | 港元 | 186.08 | 20.22 | 港元 | 189.88 | 港元 | 154.36 | 22.72 | 港元 | 187.59 | 港元 | 140.54 | (17.14) |
| - I(2)类别 (港元) ⁽⁷⁾ | 港元 | 121.56 | 港元 | 89.12 | 19.48 | 港元 | 105.53 | 港元 | 96.69 | 0.98 | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - |
| - R 类别 (港元) ⁽³⁾⁽⁵⁾ | 港元 | 217.98 | 港元 | 161.65 | 17.57 | 港元 | 192.46 | 港元 | 152.82 | 18.27 | 港元 | 155.98 | 港元 | 129.00 | 20.60 | 港元 | 159.44 | 港元 | 117.91 | (18.53) |
| - R(2)类别 (美元) ⁽⁵⁾⁽⁸⁾ | 美元 | 11.64 | 美元 | 8.63 | 15.40 | 美元 | - | 美元 | - | - | 美元 | - | 美元 | - | - | 美元 | - | 美元 | - | - |
| - R(3)类别 (人民币) ⁽⁵⁾⁽⁷⁾ | 人民币 | 114.75 | 人民币 | 88.29 | 11.66 | 人民币 | 104.07 | 人民币 | 100.05 | 0.49 | 人民币 | - | 人民币 | - | - | 人民币 | - | 人民币 | - | - |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| - A 类别 (港元) | 港元 | 159.59 | 港元 | 146.33 | 8.17 | 港元 | 150.98 | 港元 | 139.49 | 4.45 | 港元 | 141.18 | 港元 | 130.68 | 8.36 | 港元 | 144.77 | 港元 | 125.10 | (10.34) |
| - I(2)类别 (港元) ⁽⁹⁾⁽¹⁰⁾ | 港元 | 101.95 | 港元 | 100.06 | N/A | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - |
| - R 类别 (港元) ⁽²⁾⁽⁵⁾ | 港元 | 124.13 | 港元 | 114.91 | 6.99 | 港元 | 118.98 | 港元 | 110.77 | 3.30 | 港元 | 112.14 | 港元 | 104.22 | 7.17 | 港元 | 117.54 | 港元 | 100.63 | (11.31) |

(1) 东亚联丰环球债券基金及东亚联丰环球股票基金 I 类别于 2017 年 4 月 1 日发行。

(2) 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 R 类别于 2017 年 6 月 19 日发行。

(3) 东亚联丰环球股票基金 R 类别于 2018 年 12 月 13 日发行。

(4) 东亚联丰亚洲策略增长基金 I(3)类别于 2022 年 11 月 16 日发行。

(5) 自 2024 年 1 月 15 日起, R 类别基金份额已重组为 R 类别、R(2)类别和 R(3)类别基金份额。R 类别、R(2)类别和 R(3)类别基金份额的计算货币分别为港元、美元及人民币。

(6) 东亚联丰环球债券基金 I(2)类别于 2024 年 8 月 30 日发行。

(7) 东亚联丰环球股票基金 I(2)类别和 R(3)类别分别于 2024 年 8 月 30 日和 2024 年 11 月 19 日发行。

(8) 东亚联丰环球股票基金 R(2) 类别于 2025 年 1 月 6 日发行。

(9) 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 I(2) 类别于 2025 年 2 月 12 日发行。

(10) 东亚联丰环球债券基金和东亚联丰亚太区投资级别债券基金 I(2) 类别于 2025 年 4 月 8 日全额赎回。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

基金业绩表现报表 (续)

(c) 最高价和最低价 (续)

| 子基金 | 2021 年 | | | 2020 年 | | | 2019 年 | | | | | | | | |
|----------------------------------|-------------|-------------|--------------------------|-------------|-------------|--------------------------|-------------|-------------|--------------------------|-------|-----|--------|-----|--------|-------|
| | 份额最高 发行价 | 份额最低 赎回价 | 净年化投资 回报率 (注) % | 份额最高 发行价 | 份额最低 赎回价 | 净年化投资 回报率 (注) % | 份额最高 发行价 | 份额最低 赎回价 | 净年化投资 回报率 (注) % | | | | | | |
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | | | | | | | | | | | | | | |
| - A 类别 (港元) | 港元 | 618.01 | 港元 | 500.23 | (2.67) | 港元 | 537.50 | 港元 | 297.75 | 32.59 | 港元 | 406.03 | 港元 | 325.93 | 20.79 |
| - I(3)类别 (美元) ⁽⁴⁾ | 美元 | - | 美元 | - | - | 美元 | - | 美元 | - | - | 美元 | - | 美元 | - | - |
| - R(2)类别 (美元) ⁽⁵⁾ | 美元 | 60.03 | 美元 | 47.88 | (4.78) | 美元 | 52.32 | 美元 | 29.33 | 31.09 | 美元 | 40.00 | 美元 | 32.44 | 19.42 |
| 东亚联丰环球债券基金 | | | | | | | | | | | | | | | |
| - A 类别 (港元) | 港元 | 141.97 | 港元 | 133.71 | (5.18) | 港元 | 141.78 | 港元 | 127.67 | 8.24 | 港元 | 134.14 | 港元 | 122.93 | 6.67 |
| - I 类别 (港元) ⁽¹⁾ | 港元 | 122.21 | 港元 | 115.13 | (5.16) | 港元 | 122.05 | 港元 | 109.88 | 8.27 | 港元 | 115.43 | 港元 | 105.77 | 6.70 |
| - I(2)类别 (港元) ⁽⁶⁾⁽¹⁰⁾ | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - |
| - R(2)类别 (美元) ⁽⁵⁾ | 美元 | 15.64 | 美元 | 14.53 | (6.59) | 美元 | 15.62 | 美元 | 14.16 | 7.80 | 美元 | 14.79 | 美元 | 13.64 | 6.15 |
| 东亚联丰环球股票基金 | | | | | | | | | | | | | | | |
| - A 类别 (港元) | 港元 | 266.57 | 港元 | 221.04 | 19.42 | 港元 | 222.27 | 港元 | 132.82 | 17.36 | 港元 | 189.79 | 港元 | 150.22 | 23.67 |
| - I 类别 (港元) ⁽¹⁾ | 港元 | 187.02 | 港元 | 155.02 | 19.48 | 港元 | 155.88 | 港元 | 93.11 | 17.41 | 港元 | 133.03 | 港元 | 105.24 | 23.74 |
| - I(2)类别 (港元) ⁽⁷⁾ | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - |
| - R 类别 (港元) ⁽³⁾⁽⁵⁾ | 港元 | 159.38 | 港元 | 133.86 | 17.47 | 港元 | 134.78 | 港元 | 81.57 | 15.44 | 港元 | 117.02 | 港元 | 94.13 | 21.64 |
| - R(2)类别 (美元) ⁽⁵⁾⁽⁸⁾ | 美元 | - | 美元 | - | - | 美元 | - | 美元 | - | - | 美元 | - | 美元 | - | - |
| - R(3)类别 (人民币) ⁽⁵⁾⁽⁷⁾ | 人民币 | - | 人民币 | - | - | 人民币 | - | 人民币 | - | - | 人民币 | - | 人民币 | - | - |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | | | | | | | | | | | | | | | |
| - A 类别 (港元) | 港元 | 146.38 | 港元 | 141.79 | 0.62 | 港元 | 144.20 | 港元 | 129.38 | 7.16 | 港元 | 135.04 | 港元 | 120.31 | 12.13 |
| - I(2)类别 (港元) ⁽⁹⁾⁽¹⁰⁾ | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - |
| - R 类别 (港元) ⁽²⁾⁽⁵⁾ | 港元 | 119.24 | 港元 | 116.04 | (0.49) | 港元 | 118.47 | 港元 | 107.15 | 5.98 | 港元 | 112.42 | 港元 | 100.97 | 10.90 |

(1) 东亚联丰环球债券基金及东亚联丰环球股票基金 I 类别于 2017 年 4 月 1 日发行。

(2) 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 R 类别于 2017 年 6 月 19 日发行。

(3) 东亚联丰环球股票基金 R 类别于 2018 年 12 月 13 日发行。

(4) 东亚联丰亚洲策略增长基金 I(3)类别于 2022 年 11 月 16 日发行。

(5) 自 2024 年 1 月 15 日起, R 类别基金份额已重组为 R 类别、R(2)类别和 R(3)类别基金份额。R 类别、R(2)类别和 R(3)类别基金份额的计算货币分别为港元、美元及人民币。

(6) 东亚联丰环球债券基金 I(2)类别于 2024 年 8 月 30 日发行。

(7) 东亚联丰环球股票基金 I(2)类别和 R(3)类别分别于 2024 年 8 月 30 日和 2024 年 11 月 19 日发行。

(8) 东亚联丰环球股票基金 R(2) 类别于 2025 年 1 月 6 日发行。

(9) 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 I(2) 类别于 2025 年 2 月 12 日发行。

(10) 东亚联丰环球债券基金和东亚联丰亚太区投资级别债券基金 I(2) 类别于 2025 年 4 月 8 日全额赎回。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

基金业绩表现报表 (续)

(c) 最高价和最低价 (续)

| 子基金 | 2018 年 | | | 2017 年 | | | 2016 年 | | | | | | | | |
|----------------------------------|-------------|-------------|--------------------------|-------------|-------------|--------------------------|-------------|-------------|--------------------------|-------|-----|--------|-----|--------|------|
| | 份额最高 发行价 | 份额最低 赎回价 | 净年化投资 回报率 (注) % | 份额最高 发行价 | 份额最低 赎回价 | 净年化投资 回报率 (注) % | 份额最高 发行价 | 份额最低 赎回价 | 净年化投资 回报率 (注) % | | | | | | |
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | | | | | | | | | | | | | | |
| - A 类别 (港元) | 港元 | 447.27 | 港元 | 331.37 | (17.93) | 港元 | 416.20 | 港元 | 283.55 | 45.07 | 港元 | 310.98 | 港元 | 240.77 | 4.03 |
| - I(3)类别 (美元) ⁽⁴⁾ | 美元 | - | 美元 | - | - | 美元 | - | 美元 | - | - | 美元 | - | 美元 | - | - |
| - R(2)类别 (美元) ⁽⁵⁾ | 美元 | 45.28 | 美元 | 33.01 | (19.37) | 美元 | 42.29 | 美元 | 29.44 | 41.56 | 美元 | 32.41 | 美元 | 25.17 | 2.31 |
| 东亚联丰环球债券基金 | | | | | | | | | | | | | | | |
| - A 类别 (港元) | 港元 | 125.66 | 港元 | 119.84 | 0.16 | 港元 | 123.83 | 港元 | 113.86 | 6.96 | 港元 | 124.20 | 港元 | 112.43 | 2.12 |
| - I 类别 (港元) ⁽¹⁾ | 港元 | 108.09 | 港元 | 103.10 | 0.19 | 港元 | 106.50 | 港元 | 99.93 | 5.41 | 港元 | - | 港元 | - | - |
| - I(2)类别 (港元) ⁽⁶⁾⁽¹⁰⁾ | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - |
| - R(2)类别 (美元) ⁽⁵⁾ | 美元 | 14.04 | 美元 | 13.33 | (0.87) | 美元 | 13.97 | 美元 | 13.02 | 5.03 | 美元 | 14.25 | 美元 | 12.95 | 1.16 |
| 东亚联丰环球股票基金 | | | | | | | | | | | | | | | |
| - A 类别 (港元) | 港元 | 179.75 | 港元 | 147.00 | (7.79) | 港元 | 166.38 | 港元 | 133.82 | 24.71 | 港元 | 136.08 | 港元 | 114.29 | 4.92 |
| - I 类别 (港元) ⁽¹⁾ | 港元 | 125.86 | 港元 | 102.98 | (7.73) | 港元 | 116.49 | 港元 | 99.57 | 16.28 | 港元 | - | 港元 | - | - |
| - I(2)类别 (港元) ⁽⁷⁾ | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - |
| - R 类别 (港元) ⁽³⁾⁽⁵⁾ | 港元 | 98.35 | 港元 | 92.16 | (4.02) | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - |
| - R(2)类别 (美元) ⁽⁵⁾⁽⁶⁾ | 美元 | - | 美元 | - | - | 美元 | - | 美元 | - | - | 美元 | - | 美元 | - | - |
| - R(3)类别 (人民币) ⁽⁵⁾⁽⁷⁾ | 人民币 | - | 人民币 | - | - | 人民币 | - | 人民币 | - | - | 人民币 | - | 人民币 | - | - |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | | | | | | | | | | | | | | | |
| - A 类别 (港元) | 港元 | 120.00 | 港元 | 116.81 | 0.58 | 港元 | 119.36 | 港元 | 112.35 | 6.23 | 港元 | 115.72 | 港元 | 107.53 | 4.68 |
| - I(2)类别 (港元) ⁽⁹⁾⁽¹⁰⁾ | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - | 港元 | - | 港元 | - | - |
| - R 类别 (港元) ⁽²⁾⁽⁵⁾ | 港元 | 101.18 | 港元 | 98.64 | (0.51) | 港元 | 101.62 | 港元 | 99.43 | 1.25 | 港元 | - | 港元 | - | - |

(1) 东亚联丰环球债券基金及东亚联丰环球股票基金 I 类别于 2017 年 4 月 1 日发行。

(2) 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 R 类别于 2017 年 6 月 19 日发行。

(3) 东亚联丰环球股票基金 R 类别于 2018 年 12 月 13 日发行。

(4) 东亚联丰亚洲策略增长基金 I(3)类别于 2022 年 11 月 16 日发行。

(5) 自 2024 年 1 月 15 日起, R 类别基金份额已重组为 R 类别、R(2)类别和 R(3)类别基金份额。R 类别、R(2)类别和 R(3)类别基金份额的计算货币分别为港元、美元及人民币。

(6) 东亚联丰环球债券基金 I(2)类别于 2024 年 8 月 30 日发行。

(7) 东亚联丰环球股票基金 I(2)类别和 R(3)类别分别于 2024 年 8 月 30 日和 2024 年 11 月 19 日发行。

(8) 东亚联丰环球股票基金 R(2) 类别于 2025 年 1 月 6 日发行。

(9) 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 I(2) 类别于 2025 年 2 月 12 日发行。

(10) 东亚联丰环球债券基金和东亚联丰亚太区投资级别债券基金 I(2) 类别于 2025 年 4 月 8 日全额赎回。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

基金业绩表现报表 (续)

(c) 最高价和最低价 (续)

注：净年化投资回报率是指除第一个财务年度的净投资回报率 (按年终日的份额价格与初始发行价格之间的份额价格变动百分比计算) 以外，上述各年度 / 期间的份额价格变动百分比。

东亚联丰亚洲策略增长基金于 2003 年 4 月 15 日开始发行 A 类别份额，于 2003 年 9 月 8 日开始发行 C 类别和 R 类别份额 (前身为 B 类别份额)，以及于 2022 年 11 月 16 日开始发行 I(3)类别份额。自 2014 年 4 月 25 日起，将 C 类别份额合并至 R 类别份额。自 2024 年 1 月 15 日起，R 类别基金份额已重组为以美元计价的 R(2)类别基金份额。

东亚联丰环球债券基金于 2004 年 3 月 1 日开始发行 A 类别和 R 类别 (前身为 B 类别基金份额) 基金份额，于 2017 年 4 月 1 日开始发行 I 类别基金份额以及于 2024 年 8 月 30 日开始发行 I(2)类别基金份额。自 2024 年 1 月 15 日起，R 类别基金份额已重组为以美元计价的 R(2)类别基金份额。

东亚联丰环球股票基金于 2012 年 10 月 4 日开始发行 A 类别基金份额，于 2017 年 4 月 1 日开始发行 I 类别基金份额，于 2018 年 12 月 13 日开始发行 R 类别基金份额，于 2024 年 8 月 30 日开始发行 I(2)类别基金份额，于 2024 年 11 月 29 日开始发行 R(3)类别基金份额以及于 2025 年 1 月 6 日开始发行 R(2)类别基金份额。

东亚联丰亚太区投资级别债券基金于 2014 年 6 月 20 日开始发行 A 类别基金份额，于 2017 年 6 月 19 日开始发行 R 类别基金份额以及于 2025 年 2 月 12 日开始发行 I(2)类别基金份额。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

由金融衍生工具导致的风险敞口数据

东亚联丰亚洲策略增长基金

| | 总敞口 ⁽¹⁾ | | | 净敞口 ⁽²⁾ | | |
|--------|--------------------|------|--------|--------------------|----|--------|
| | 最高 | 最低 | 平均风险敞口 | 最高 | 最低 | 平均风险敞口 |
| 外币远期合约 | 20.93 | 5.17 | 8.23 | - | - | - |

东亚联丰环球债券基金

| | 总敞口 ⁽¹⁾ | | | 净敞口 ⁽²⁾ | | |
|--------|--------------------|-------|--------|--------------------|----|--------|
| | 最高 | 最低 | 平均风险敞口 | 最高 | 最低 | 平均风险敞口 |
| 外币远期合约 | 91.32 | 33.18 | 47.25 | - | - | - |

东亚联丰环球股票基金

| | 总敞口 ⁽¹⁾ | | | 净敞口 ⁽²⁾ | | |
|--------|--------------------|-------|--------|--------------------|----|--------|
| | 最高 | 最低 | 平均风险敞口 | 最高 | 最低 | 平均风险敞口 |
| 外币远期合约 | 117.41 | 27.73 | 39.94 | - | - | - |

东亚联丰亚太区投资级别债券基金

| | 总敞口 ⁽¹⁾ | | | 净敞口 ⁽²⁾ | | |
|--------|--------------------|-------|--------|--------------------|----|--------|
| | 最高 | 最低 | 平均风险敞口 | 最高 | 最低 | 平均风险敞口 |
| 外币远期合约 | 123.48 | 32.30 | 40.24 | - | - | - |

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

由金融衍生工具导致的风险敞口数据 (续)

- (1) 因将金融衍生工具用于任何目的而产生的总敞口，以金融衍生工具的相关资产的等价市场价值占金融衍生工具资产净值总额的比例为基准。
- (2) 考虑到相关资产的现行市场价值、交易对手风险，未来市场变动和时间，将计划为投资目的而购买的金融衍生工具的头寸转换为金融衍生工具的相关资产中的等值头寸。

计算并非详尽列示衍生工具风险敞口的换算方法

衍生工具种类

换算方法

外币远期合约

按相关现金流的名义价值

投资报告

于 2025 年 12 月 31 日

投资组合

东亚联丰亚洲策略增长基金

| | 持有股份 / 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|-----------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.23%) | | | |
| 股票 (97.22%) | | | |
| 澳洲 (1.64%) | | | |
| NexGen Energy Ltd | 327,948 | 23,830,645 | 1.13 |
| Ramelius Resources Ltd | 502,432 | 10,848,592 | 0.51 |
| 中国内地和中国香港 (36.27%) | | | |
| Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China - A | 38,987 | 11,856,612 | 0.56 |
| AIA Group Ltd | 536,000 | 42,826,400 | 2.02 |
| Alibaba Group Holding Ltd | 578,400 | 82,595,520 | 3.90 |
| Cambricon Technologies Corp Ltd - A | 9,014 | 13,625,640 | 0.64 |
| China Construction Bank Corp - H | 5,404,000 | 41,556,760 | 1.96 |
| China Hongqiao Group Ltd | 912,000 | 29,749,440 | 1.40 |
| CIG Shanghai Co Ltd - H | 186,750 | 17,461,125 | 0.82 |
| Contemporary Amperex Technology Co Ltd - H | 43,500 | 21,989,250 | 1.04 |
| CRRC Corp Ltd - H | 2,444,000 | 14,615,120 | 0.69 |
| Eoptolink Technology Inc Ltd - A | 42,000 | 20,180,385 | 0.95 |
| Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | 90,400 | 36,847,040 | 1.74 |
| Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd - A | 102,715 | 12,589,106 | 0.59 |
| Jiangxi Copper Co Ltd - H | 752,000 | 32,245,760 | 1.52 |
| JL Mag Rare-Earth Co Ltd - A | 348,900 | 13,271,087 | 0.63 |
| Kingdee International Software Group Co Ltd | 555,000 | 7,375,950 | 0.35 |
| Laopu Gold Co Ltd - H | 26,400 | 16,315,200 | 0.77 |
| Montage Technology Co Ltd - A | 105,744 | 13,890,723 | 0.66 |
| NAURA Technology Group Co Ltd - A | 30,479 | 15,603,172 | 0.74 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲策略增长基金(续)

| | 持有股份/ 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|-------------|-------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.23%) (续) | | | |
| 股票 (97.22%) (续) | | | |
| 中国内地和中国香港 (36.27%) (续) | | | |
| PetroChina Co Ltd - H | 1,748,000 | 14,648,240 | 0.69 |
| Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H | 435,500 | 28,372,825 | 1.34 |
| Semiconductor Manufacturing International Corp | 131,500 | 9,395,675 | 0.44 |
| Shandong Gold Mining Co Ltd - H | 521,750 | 18,052,550 | 0.85 |
| Shanghai Electric Group Co Ltd - H | 2,052,000 | 7,941,240 | 0.38 |
| Tencent Holdings Ltd | 214,800 | 128,665,200 | 6.07 |
| WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd - A | 185,800 | 15,139,399 | 0.71 |
| WuXi AppTec Co Ltd - A | 143,400 | 14,494,154 | 0.68 |
| Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd - A | 372,700 | 22,987,242 | 1.08 |
| Zijin Gold International Co Ltd | 82,016 | 11,974,336 | 0.57 |
| Zijin Mining Group Co Ltd - H | 1,474,000 | 52,562,840 | 2.48 |
| 印度 (7.15%) | | | |
| Apollo Hospitals Enterprise Ltd | 33,149 | 20,216,732 | 0.95 |
| Bharat Electronics Ltd | 808,614 | 27,982,106 | 1.32 |
| Bharti Airtel Ltd | 213,827 | 38,989,897 | 1.84 |
| CG Power & Industrial Solutions Ltd | 86,198 | 4,836,362 | 0.23 |
| Larsen & Toubro Ltd | 72,414 | 25,607,593 | 1.21 |
| Reliance Industries Ltd | 249,778 | 33,968,638 | 1.60 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲策略增长基金(续)

| | 持有股份/ 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|----------|-------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.23%) (续) | | | |
| 股票 (97.22%) (续) | | | |
| 韩国 (22.07%) | | | |
| Dongjin Semichem Co Ltd | 38,763 | 7,676,055 | 0.36 |
| Doosan Enerbility Co Ltd | 78,424 | 31,907,346 | 1.50 |
| Hanwha Aerospace Co Ltd | 8,672 | 44,091,574 | 2.08 |
| HD Hyundai Co Ltd | 13,415 | 13,663,084 | 0.64 |
| HD Hyundai Electric Co Ltd | 9,547 | 39,925,889 | 1.88 |
| KB Financial Group Inc | 34,472 | 23,226,279 | 1.10 |
| Samsung Electro-Mechanics Co Ltd | 6,910 | 9,520,614 | 0.45 |
| Samsung Electronics Co Ltd | 245,371 | 158,960,466 | 7.50 |
| Samsung Heavy Industries Co Ltd | 254,982 | 33,202,690 | 1.57 |
| SK Hynix Inc | 30,061 | 105,738,007 | 4.99 |
| 菲律宾 (1.64%) | | | |
| International Container Terminal Services Inc | 462,740 | 34,710,989 | 1.64 |
| 新加坡 (3.13%) | | | |
| DBS Group Holdings Ltd | 111,730 | 38,113,115 | 1.80 |
| Jardine Matheson Holdings Ltd | 19,700 | 10,486,570 | 0.50 |
| Singapore Technologies Engineering Ltd | 347,300 | 17,699,073 | 0.83 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚洲策略增长基金 (续)

| | 持有股份/ 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值的比例 |
|---|-------------|-------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.23%) (续) | | | |
| 股票 (97.22%) (续) | | | |
| <i>中国台湾 (22.18%)</i> | | | |
| Accton Technology Corp | 101,000 | 29,648,068 | 1.40 |
| Alchip Technologies Ltd | 22,000 | 19,128,745 | 0.90 |
| ASE Technology Holding Co Ltd | 419,000 | 26,000,304 | 1.23 |
| Asia Vital Components Co Ltd | 74,000 | 27,679,952 | 1.30 |
| ASPEED Technology Inc | 12,000 | 21,581,148 | 1.02 |
| Delta Electronics Inc | 160,000 | 38,168,311 | 1.80 |
| Elite Material Co Ltd | 88,000 | 35,859,584 | 1.69 |
| MediaTek Inc | 61,000 | 21,608,397 | 1.02 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 531,000 | 203,883,880 | 9.62 |
| Taiwan Union Technology Corp | 101,000 | 12,359,616 | 0.58 |
| Unimicron Technology Corp | 372,000 | 20,273,199 | 0.96 |
| Winbond Electronics Corp | 682,000 | 13,954,719 | 0.66 |
| <i>美国 (3.14%)</i> | | | |
| Cameco Corp | 28,368 | 20,201,190 | 0.95 |
| Futu Holdings Ltd - ADR | 21,123 | 26,997,889 | 1.27 |
| MakeMyTrip Ltd | 30,513 | 19,503,316 | 0.92 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲策略增长基金(续)

| | 持有股份/ 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|-------------------------------|-------------|----------------------|---------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.23%) (续) | | | |
| 权利 (0.01%) | | | |
| <i>中国台湾 (0.01%)</i> | | | |
| Unimicron Technology Corp | 8,390 | <u>216,148</u> | <u>0.01</u> |
| 上市 / 挂牌投资总额 | | <u>2,061,094,773</u> | <u>97.23</u> |
| 其他资产净值 | | <u>58,635,118</u> | <u>2.77</u> |
| 投资总额, 按成本计算 | | <u>1,426,678,624</u> | |
| 资产净值总额 | | <u>2,119,729,891</u> | <u>100.00</u> |

注： 投资按交易日期入账。

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合 (续)

东亚联丰环球债券基金

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|------------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.86%) | | | |
| 债券 (97.86%) | | | |
| <i>以澳元计价 (2.70%)</i> | | | |
| Airservices Australia 5.35% 15/11/2037 | 600,000 | 3,066,251 | 0.04 |
| Australia Government Bond 1.00% 21/12/2030 | 2,000,000 | 8,871,806 | 0.12 |
| Australia Government Bond 1.75% 21/06/2051 | 2,000,000 | 5,321,937 | 0.07 |
| Australia Government Bond 1.75% 21/11/2032 | 2,000,000 | 8,722,527 | 0.12 |
| Australia Government Bond 2.75% 21/11/2027 | 6,000,000 | 30,511,113 | 0.42 |
| Australia Government Bond 3.00% 21/11/2033 | 3,000,000 | 14,001,496 | 0.19 |
| Australia Government Bond 3.25% 21/04/2029 | 4,900,000 | 24,879,868 | 0.34 |
| Australia Government Bond 3.25% 21/06/2039 | 4,350,000 | 18,908,054 | 0.26 |
| Australia Government Bond 3.50% 21/12/2034 | 200,000 | 949,980 | 0.01 |
| Australia Government Bond 3.75% 21/05/2034 | 400,000 | 1,958,621 | 0.03 |
| Australia Government Bond 4.25% 21/04/2026 | 10,000,000 | 52,400,779 | 0.71 |
| Australia Government Bond 4.50% 21/04/2033 | 450,000 | 2,352,206 | 0.03 |
| Australia Government Bond 4.75% 21/04/2027 | 5,000,000 | 26,439,383 | 0.36 |
| <i>以英镑计价 (7.84%)</i> | | | |
| CK Hutchison Group Telecom Finance SA 2.00% 17/10/2027 | 1,000,000 | 10,059,576 | 0.14 |
| United Kingdom Gilt 0.125% 30/01/2026 | 800,000 | 8,361,921 | 0.11 |
| United Kingdom Gilt 0.625% 31/07/2035 | 8,700,000 | 64,310,729 | 0.87 |
| United Kingdom Gilt 0.625% 22/10/2050 | 3,900,000 | 15,135,175 | 0.21 |
| United Kingdom Gilt 1.25% 31/07/2051 | 2,200,000 | 10,349,088 | 0.14 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球债券基金(续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---------------------------------------|------------|-------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.86%) (续) | | | |
| 债券 (97.86%) (续) | | | |
| <i>以英镑计价 (7.84%) (续)</i> | | | |
| United Kingdom Gilt 1.50% 22/07/2047 | 7,690,000 | 43,078,579 | 0.59 |
| United Kingdom Gilt 1.75% 07/09/2037 | 950,000 | 7,407,656 | 0.10 |
| United Kingdom Gilt 3.25% 31/01/2033 | 500,000 | 4,988,310 | 0.07 |
| United Kingdom Gilt 3.25% 22/01/2044 | 450,000 | 3,760,830 | 0.05 |
| United Kingdom Gilt 3.75% 07/03/2027 | 500,000 | 5,299,381 | 0.07 |
| United Kingdom Gilt 3.75% 22/10/2053 | 2,000,000 | 16,598,785 | 0.23 |
| United Kingdom Gilt 4.00% 22/10/2063 | 2,500,000 | 21,294,911 | 0.29 |
| United Kingdom Gilt 4.25% 07/06/2032 | 4,000,000 | 42,393,053 | 0.58 |
| United Kingdom Gilt 4.25% 07/03/2036 | 11,100,000 | 114,751,771 | 1.56 |
| United Kingdom Gilt 4.25% 31/07/2034 | 4,000,000 | 42,132,846 | 0.57 |
| United Kingdom Gilt 4.25% 07/12/2049 | 400,000 | 3,679,790 | 0.05 |
| United Kingdom Gilt 4.50% 07/03/2035 | 6,600,000 | 70,212,551 | 0.96 |
| United Kingdom Gilt 4.50% 07/12/2042 | 1,700,000 | 16,820,722 | 0.23 |
| United Kingdom Gilt 4.75% 07/12/2038 | 3,740,000 | 39,229,254 | 0.53 |
| United Kingdom Gilt 5.375% 31/01/2056 | 3,300,000 | 36,331,474 | 0.49 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球债券基金(续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|--|------------|-------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.86%) (续) | | | |
| 债券 (97.86%) (续) | | | |
| <i>以加拿大元计价 (2.43%)</i> | | | |
| Canada Housing Trust No 1 3.65% 15/06/2033 | 3,700,000 | 21,397,141 | 0.29 |
| Canadian Government Bond 1.75% 01/12/2053 | 3,000,000 | 10,949,655 | 0.15 |
| Canadian Government Bond 2.00% 01/06/2028 | 5,000,000 | 28,012,738 | 0.38 |
| Canadian Government Bond 2.50% 01/12/2032 | 4,250,000 | 23,142,975 | 0.32 |
| Canadian Government Bond 2.75% 01/05/2027 | 6,400,000 | 36,628,211 | 0.50 |
| Canadian Government Bond 2.75% 01/12/2055 | 1,800,000 | 8,243,891 | 0.11 |
| Canadian Government Bond 3.25% 01/09/2028 | 1,000,000 | 5,818,945 | 0.08 |
| Canadian Government Bond 3.25% 01/12/2033 | 5,850,000 | 33,250,735 | 0.45 |
| Canadian Government Bond 5.00% 01/06/2037 | 1,700,000 | 11,042,710 | 0.15 |
| <i>以欧元计价 (19.95%)</i> | | | |
| AIA Group Ltd 0.88% 09/09/2033 | 4,400,000 | 38,266,988 | 0.52 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/02/2032 | 14,000,000 | 109,707,051 | 1.49 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.00% 15/05/2038 | 4,900,000 | 35,548,162 | 0.48 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.20% 15/02/2034 | 7,600,000 | 68,058,026 | 0.93 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.50% 15/02/2035 | 600,000 | 5,478,415 | 0.07 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.60% 15/08/2034 | 3,500,000 | 31,855,184 | 0.43 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球债券基金(续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|--|-----------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.86%) (续) | | | |
| 债券 (97.86%) (续) | | | |
| <i>以欧元计价 (19.95%) (续)</i> | | | |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.90% 15/08/2056 | 2,300,000 | 19,250,919 | 0.26 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4.75% 04/07/2040 | 1,500,000 | 16,533,295 | 0.22 |
| European Union 0.00% 04/07/2035 | 2,300,000 | 15,567,576 | 0.21 |
| European Union 0.30% 04/11/2050 | 5,500,000 | 21,931,290 | 0.30 |
| French Republic Government Bond OAT 0.00% 25/11/2030 | 4,400,000 | 35,127,333 | 0.48 |
| French Republic Government Bond OAT 0.50% 25/05/2040 | 1,000,000 | 5,734,878 | 0.08 |
| French Republic Government Bond OAT 0.75% 25/02/2028 | 5,000,000 | 44,519,617 | 0.61 |
| French Republic Government Bond OAT 1.25% 25/05/2034 | 3,100,000 | 24,199,284 | 0.33 |
| French Republic Government Bond OAT 1.25% 25/05/2038 | 6,400,000 | 44,233,394 | 0.60 |
| French Republic Government Bond OAT 1.50% 25/05/2031 | 3,000,000 | 25,792,857 | 0.35 |
| French Republic Government Bond OAT 2.00% 25/11/2032 | 6,000,000 | 51,134,601 | 0.70 |
| French Republic Government Bond OAT 2.00% 25/05/2048 | 3,400,000 | 21,347,632 | 0.29 |

投资报告

于 2025 年 12 月 31 日 (续)

投资组合 (续)

东亚联丰环球债券基金 (续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|-----------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.86%) (续) | | | |
| 债券 (97.86%) (续) | | | |
| <i>以欧元计价 (19.95%) (续)</i> | | | |
| French Republic Government Bond OAT 3.00% 25/05/2033 | 4,000,000 | 36,707,333 | 0.50 |
| French Republic Government Bond OAT 3.00% 25/05/2054 | 2,550,000 | 18,366,349 | 0.25 |
| French Republic Government Bond OAT 3.25% 25/05/2045 | 4,000,000 | 32,902,483 | 0.45 |
| French Republic Government Bond OAT 3.25% 25/05/2055 | 2,800,000 | 21,103,614 | 0.29 |
| French Republic Government Bond OAT 3.50% 25/11/2033 | 5,050,000 | 46,978,847 | 0.64 |
| French Republic Government Bond OAT 3.75% 25/05/2056 | 2,300,000 | 18,979,215 | 0.26 |
| German Treasury Bill 0.00% 16/09/2026 | 1,500,000 | 13,523,996 | 0.18 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.00% 01/02/2028 | 5,000,000 | 45,873,235 | 0.62 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.25% 01/09/2036 | 5,800,000 | 47,361,576 | 0.65 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.45% 01/09/2050 | 2,600,000 | 17,525,565 | 0.24 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.95% 01/09/2038 | 2,600,000 | 22,162,952 | 0.30 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.00% 01/08/2029 | 650,000 | 6,111,340 | 0.08 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.10% 01/03/2040 | 3,100,000 | 26,365,988 | 0.36 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.85% 01/09/2049 | 5,000,000 | 44,020,285 | 0.60 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.00% 01/02/2037 | 400,000 | 3,863,528 | 0.05 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.30% 01/10/2054 | 5,500,000 | 50,410,931 | 0.69 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球债券基金(续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值的比例 |
|---|------------|-------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.86%) (续) | | | |
| 债券 (97.86%) (续) | | | |
| <i>以欧元计价 (19.95%) (续)</i> | | | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.50% 01/03/2026 | 1,000,000 | 9,318,628 | 0.13 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 01/08/2034 | 2,800,000 | 29,326,234 | 0.40 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.75% 01/02/2033 | 2,250,000 | 24,456,075 | 0.33 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6.00% 01/05/2031 | 1,400,000 | 14,928,960 | 0.20 |
| Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 0.337% 08/06/2027 | 2,000,000 | 18,156,704 | 0.25 |
| NTT Finance Corp 2.906% 16/03/2029 | 1,900,000 | 17,617,151 | 0.24 |
| Spain Government Bond 1.40% 30/07/2028 | 3,000,000 | 26,999,869 | 0.37 |
| Spain Government Bond 1.50% 30/04/2027 | 2,000,000 | 18,325,424 | 0.25 |
| Spain Government Bond 2.35% 30/07/2033 | 2,750,000 | 24,277,380 | 0.33 |
| Spain Government Bond 2.70% 31/10/2048 | 2,550,000 | 19,131,907 | 0.26 |
| Spain Government Bond 4.20% 31/01/2037 | 10,120,000 | 102,775,876 | 1.40 |
| Spain Government Bond 4.90% 30/07/2040 | 300,000 | 3,178,324 | 0.04 |
| Spain Government Bond 5.15% 31/10/2044 | 1,400,000 | 15,170,423 | 0.21 |
| Spain Government Bond 5.75% 30/07/2032 | 5,000,000 | 54,670,051 | 0.74 |
| Spain Government Bond 6.00% 31/01/2029 | 2,000,000 | 21,265,071 | 0.29 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球债券基金(续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|-------------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.86%) (续) | | | |
| 债券 (97.86%) (续) | | | |
| <i>以日元计价 (4.90%)</i> | | | |
| HSBC Holdings PLC 0.459% 24/03/2028 | 500,000,000 | 24,407,485 | 0.33 |
| Japan Government Forty Year Bond 0.50% 20/03/2059 | 700,000,000 | 15,339,654 | 0.21 |
| Japan Government Forty Year Bond 2.20% 20/03/2051 | 800,000,000 | 32,442,731 | 0.44 |
| Japan Government Ten Year Bond 0.10% 20/06/2027 | 280,000,000 | 13,719,234 | 0.19 |
| Japan Government Thirty Year Bond 0.40% 20/06/2049 | 930,000,000 | 25,129,975 | 0.34 |
| Japan Government Thirty Year Bond 0.40% 20/12/2049 | 800,000,000 | 21,186,954 | 0.29 |
| Japan Government Thirty Year Bond 0.50% 20/03/2049 | 520,000,000 | 14,638,890 | 0.20 |
| Japan Government Thirty Year Bond 1.50% 20/12/2044 | 350,000,000 | 13,891,194 | 0.19 |
| Japan Government Twenty Year Bond 0.20% 20/06/2036 | 605,000,000 | 24,699,036 | 0.33 |
| Japan Government Twenty Year Bond 0.30% 20/09/2039 | 400,000,000 | 14,889,443 | 0.20 |
| Japan Government Twenty Year Bond 0.30% 20/12/2039 | 400,000,000 | 14,752,097 | 0.20 |
| Japan Government Twenty Year Bond 0.50% 20/12/2038 | 970,000,000 | 38,056,291 | 0.52 |
| Japan Government Twenty Year Bond 1.30% 20/06/2035 | 762,000,000 | 35,573,980 | 0.48 |

投资报告

于 2025 年 12 月 31 日 (续)

投资组合 (续)

东亚联丰环球债券基金 (续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|-------------|-------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.86%) (续) | | | |
| 债券 (97.86%) (续) | | | |
| <i>以日元计价 (4.90%) (续)</i> | | | |
| Japan Government Twenty Year Bond 2.30% 20/09/2026 | 468,000,000 | 23,628,310 | 0.32 |
| Japan Government Two Year Bond 0.70% 01/05/2027 | 70,000,000 | 3,466,816 | 0.05 |
| KT Corp 1.217% 05/03/2027 | 300,000,000 | 14,930,672 | 0.20 |
| MetLife Inc 0.495% 22/05/2026 | 500,000,000 | 24,768,720 | 0.34 |
| Procter & Gamble Co 0.11% 06/11/2026 | 100,000,000 | 4,931,497 | 0.07 |
| <i>以马来西亚林吉特计价 (0.54%)</i> | | | |
| Malaysia Government Bond 4.709% 15/09/2026 | 20,000,000 | 39,391,606 | 0.54 |
| <i>以墨西哥比索计价 (2.23%)</i> | | | |
| Mexican Bonos 5.75% 05/03/2026 | 2,620,000 | 115,291,320 | 1.57 |
| Mexican Bonos 7.75% 23/11/2034 | 1,200,000 | 48,570,847 | 0.66 |
| <i>以新西兰元计价 (0.22%)</i> | | | |
| New Zealand Government Bond 2.75% 15/04/2037 | 2,010,000 | 7,582,503 | 0.10 |
| New Zealand Government Bond 3.50% 14/04/2033 | 2,000,000 | 8,647,133 | 0.12 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球债券基金(续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|------------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.86%) (续) | | | |
| 债券 (97.86%) (续) | | | |
| <i>以挪威克朗计价 (0.06%)</i> | | | |
| Norway Government Bond 1.50% 19/02/2026 | 6,000,000 | 4,675,891 | 0.06 |
| <i>以人民币计价 (9.57%)</i> | | | |
| Alibaba Group Holding Ltd 2.65% 28/05/2028 | 40,000,000 | 45,158,508 | 0.61 |
| China Cinda 2020 I Management Ltd 2.43% 04/08/2030 | 70,000,000 | 78,009,331 | 1.06 |
| China Development Bank 2.82% 22/05/2033 | 25,000,000 | 30,035,249 | 0.41 |
| China Government Bond 1.61% 15/02/2035 | 25,000,000 | 27,486,210 | 0.37 |
| China Government Bond 1.67% 15/06/2026 | 49,000,000 | 55,223,123 | 0.75 |
| China Government Bond 1.91% 15/07/2029 | 14,200,000 | 16,208,895 | 0.22 |
| China Government Bond 2.05% 15/04/2029 | 33,000,000 | 38,028,566 | 0.52 |
| China Government Bond 2.11% 25/08/2034 | 34,000,000 | 39,007,207 | 0.53 |
| China Government Bond 2.19% 25/09/2054 | 6,000,000 | 6,519,529 | 0.09 |
| China Government Bond 2.49% 25/05/2044 | 8,800,000 | 10,065,352 | 0.14 |
| China Government Bond 2.55% 15/10/2028 | 49,000,000 | 56,730,598 | 0.77 |
| China Government Bond 2.67% 25/05/2033 | 24,800,000 | 29,455,990 | 0.40 |
| China Government Bond 2.88% 25/02/2033 | 68,800,000 | 83,561,492 | 1.14 |
| China Government Bond 3.00% 15/10/2053 | 64,000,000 | 81,635,661 | 1.11 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球债券基金(续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|--|------------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.86%) (续) | | | |
| 债券 (97.86%) (续) | | | |
| <i>以人民币计价 (9.57%) (续)</i> | | | |
| China Government Bond 3.19% 15/04/2053 | 31,300,000 | 40,995,678 | 0.56 |
| China Government Bond 3.39% 16/03/2050 | 3,800,000 | 5,090,398 | 0.07 |
| China Government Bond 4.50% 23/06/2041 | 11,100,000 | 16,531,242 | 0.23 |
| HSBC Holdings PLC 3.40% 29/06/2027 | 3,000,000 | 3,425,776 | 0.05 |
| Huafa 2024 I Co Ltd 3.05% 17/10/2028 | 36,000,000 | 39,911,312 | 0.54 |
| <i>以新加坡元计价 (1.45%)</i> | | | |
| Singapore Government Bond 1.25% 01/11/2026 | 6,000,000 | 36,317,677 | 0.50 |
| Singapore Government Bond 2.125% 01/06/2026 | 2,700,000 | 16,415,077 | 0.22 |
| Singapore Government Bond 2.50% 01/04/2030 | 6,000,000 | 37,565,905 | 0.51 |
| Singapore Government Bond 2.75% 01/04/2042 | 2,500,000 | 16,243,665 | 0.22 |
| <i>以美元计价 (45.97%)</i> | | | |
| Adani International Container Terminal Pvt Ltd 3.00% 16/02/2031 | 5,355,000 | 38,812,291 | 0.53 |
| AIA Group Ltd 2.70% Perpetual Callable - 07/04/2026 | 3,756,000 | 29,243,283 | 0.40 |
| Chang Development International Ltd 6.25% 26/03/2028 | 1,450,000 | 11,777,609 | 0.16 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球债券基金(续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|------------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.86%) (续) | | | |
| 债券 (97.86%) (续) | | | |
| <i>以美元计价 (45.97%) (续)</i> | | | |
| Far East Horizon Ltd 5.875% 05/03/2028 | 2,100,000 | 16,911,713 | 0.23 |
| Hongkong International Qingdao Co Ltd 5.40% 09/04/2028 | 1,500,000 | 12,015,108 | 0.16 |
| HPHT Finance 21 II Ltd 1.50% 17/09/2026 | 3,150,000 | 24,160,862 | 0.33 |
| HPHT Finance 25 Ltd 5.00% 21/02/2030 | 5,500,000 | 44,276,529 | 0.60 |
| Hyundai Motor Turkiye Otomotiv AS 1.625% 12/07/2026 | 4,000,000 | 30,929,380 | 0.42 |
| Incheon International Airport Corp 1.25% 04/05/2026 | 1,650,000 | 12,751,186 | 0.17 |
| Korea National Oil Corp FRN 31/03/2028 | 3,000,000 | 23,426,019 | 0.32 |
| Mirae Asset Securities Co Ltd 5.25% 06/03/2028 | 3,900,000 | 31,428,421 | 0.43 |
| Mitsubishi HC Capital UK PLC 5.302% 23/01/2028 | 2,400,000 | 19,500,640 | 0.27 |
| Mitsui & Co Ltd 4.40% 12/09/2029 | 1,400,000 | 11,115,181 | 0.15 |
| Momentive Performance Materials Inc 4.125% 22/10/2028 | 3,400,000 | 26,640,825 | 0.36 |
| MTR Corp CI Ltd 4.875% Perpetual Callable - 24/09/2030 | 4,800,000 | 38,028,332 | 0.52 |
| POSCO 4.875% 23/01/2027 | 1,450,000 | 11,604,625 | 0.16 |
| Shinhan Bank Co Ltd 3.75% 20/09/2027 | 1,400,000 | 10,931,444 | 0.15 |
| SK Battery America Inc 4.875% 23/01/2027 | 2,000,000 | 15,993,304 | 0.22 |
| SK Hynix Inc 5.50% 16/01/2027 | 1,500,000 | 12,131,023 | 0.17 |
| United States Treasury Bill 0.00% 10/02/2026 | 10,000,000 | 77,536,446 | 1.06 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球债券基金(续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|------------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.86%) (续) | | | |
| 债券 (97.86%) (续) | | | |
| <i>以美元计价 (45.97%) (续)</i> | | | |
| United States Treasury Note/Bond 0.875% 15/11/2030 | 800,000 | 5,451,871 | 0.07 |
| United States Treasury Note/Bond 1.125% 15/02/2031 | 8,000,000 | 55,096,882 | 0.75 |
| United States Treasury Note/Bond 1.125% 15/05/2040 | 18,000,000 | 89,312,272 | 1.22 |
| United States Treasury Note/Bond 1.125% 31/08/2028 | 300,000 | 2,202,685 | 0.03 |
| United States Treasury Note/Bond 1.25% 15/08/2031 | 4,800,000 | 32,737,187 | 0.45 |
| United States Treasury Note/Bond 1.875% 15/11/2051 | 4,000,000 | 17,330,826 | 0.24 |
| United States Treasury Note/Bond 2.00% 15/02/2050 | 8,500,000 | 39,378,956 | 0.54 |
| United States Treasury Note/Bond 2.00% 15/08/2051 | 3,000,000 | 13,586,507 | 0.18 |
| United States Treasury Note/Bond 2.25% 15/05/2041 | 14,000,000 | 80,631,827 | 1.10 |
| United States Treasury Note/Bond 2.25% 15/08/2049 | 1,000,000 | 4,960,021 | 0.07 |
| United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/05/2051 | 9,000,000 | 44,463,349 | 0.60 |
| United States Treasury Note/Bond 2.625% 31/07/2029 | 2,400,000 | 18,276,290 | 0.25 |
| United States Treasury Note/Bond 2.75% 15/08/2032 | 4,600,000 | 33,764,798 | 0.46 |
| United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/05/2032 | 5,400,000 | 39,803,821 | 0.54 |
| United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/05/2052 | 4,350,000 | 23,837,705 | 0.32 |
| United States Treasury Note/Bond 3.00% 15/05/2045 | 1,000,000 | 6,030,905 | 0.08 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球债券基金(续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|------------|-------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.86%) (续) | | | |
| 债券 (97.86%) (续) | | | |
| <i>以美元计价 (45.97%) (续)</i> | | | |
| United States Treasury Note/Bond 3.375% 15/05/2033 | 6,620,000 | 49,792,087 | 0.68 |
| United States Treasury Note/Bond 3.50% 30/09/2027 | 4,900,000 | 38,492,092 | 0.52 |
| United States Treasury Note/Bond 3.50% 31/01/2030 | 2,100,000 | 16,493,440 | 0.22 |
| United States Treasury Note/Bond 3.50% 30/11/2030 | 12,000,000 | 92,773,545 | 1.26 |
| United States Treasury Note/Bond 3.625% 31/08/2029 | 9,500,000 | 74,859,731 | 1.02 |
| United States Treasury Note/Bond 3.625% 15/02/2053 | 4,100,000 | 26,325,827 | 0.36 |
| United States Treasury Note/Bond 3.625% 15/05/2053 | 3,350,000 | 21,259,529 | 0.29 |
| United States Treasury Note/Bond 3.75% 31/12/2030 | 1,000,000 | 7,790,686 | 0.11 |
| United States Treasury Note/Bond 3.875% 30/09/2029 | 2,300,000 | 18,233,819 | 0.25 |
| United States Treasury Note/Bond 3.875% 30/11/2029 | 6,400,000 | 50,406,315 | 0.69 |
| United States Treasury Note/Bond 3.875% 30/04/2030 | 33,100,000 | 261,396,528 | 3.56 |
| United States Treasury Note/Bond 3.875% 15/02/2043 | 8,000,000 | 57,030,382 | 0.78 |
| United States Treasury Note/Bond 3.875% 15/05/2043 | 1,300,000 | 9,142,576 | 0.12 |
| United States Treasury Note/Bond 4.00% 31/01/2029 | 950,000 | 7,613,412 | 0.10 |
| United States Treasury Note/Bond 4.00% 31/05/2030 | 11,500,000 | 90,978,789 | 1.24 |
| United States Treasury Note/Bond 4.00% 31/01/2031 | 7,000,000 | 56,045,614 | 0.76 |

投资报告

于 2025 年 12 月 31 日 (续)

投资组合 (续)

东亚联丰环球债券基金 (续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|------------|-------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.86%) (续) | | | |
| 债券 (97.86%) (续) | | | |
| <i>以美元计价 (45.97%) (续)</i> | | | |
| United States Treasury Note/Bond 4.00% 30/04/2032 | 7,700,000 | 60,762,559 | 0.83 |
| United States Treasury Note/Bond 4.00% 15/02/2034 | 2,650,000 | 20,889,553 | 0.28 |
| United States Treasury Note/Bond 4.00% 15/11/2035 | 10,400,000 | 80,268,344 | 1.09 |
| United States Treasury Note/Bond 4.00% 15/11/2042 | 8,950,000 | 64,315,015 | 0.88 |
| United States Treasury Note/Bond 4.125% 31/03/2029 | 4,100,000 | 32,788,423 | 0.45 |
| United States Treasury Note/Bond 4.125% 31/07/2031 | 7,800,000 | 62,762,426 | 0.85 |
| United States Treasury Note/Bond 4.125% 30/11/2031 | 2,000,000 | 15,864,242 | 0.22 |
| United States Treasury Note/Bond 4.125% 29/02/2032 | 6,900,000 | 55,239,266 | 0.75 |
| United States Treasury Note/Bond 4.125% 31/05/2032 | 9,400,000 | 74,427,612 | 1.01 |
| United States Treasury Note/Bond 4.125% 15/08/2053 | 3,600,000 | 25,291,714 | 0.34 |
| United States Treasury Note/Bond 4.25% 30/06/2029 | 7,900,000 | 62,810,684 | 0.85 |
| United States Treasury Note/Bond 4.25% 15/02/2054 | 3,000,000 | 21,530,748 | 0.29 |
| United States Treasury Note/Bond 4.25% 15/11/2034 | 6,500,000 | 51,441,049 | 0.70 |
| United States Treasury Note/Bond 4.25% 15/05/2035 | 13,800,000 | 108,978,341 | 1.48 |
| United States Treasury Note/Bond 4.25% 15/08/2035 | 13,800,000 | 109,992,450 | 1.50 |
| United States Treasury Note/Bond 4.375% 31/12/2029 | 2,200,000 | 17,585,956 | 0.24 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球债券基金(续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|------------|-------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.86%) (续) | | | |
| 债券 (97.86%) (续) | | | |
| <i>以美元计价 (45.97%) (续)</i> | | | |
| United States Treasury Note/Bond 4.375% 15/05/2034 | 4,350,000 | 34,822,914 | 0.47 |
| United States Treasury Note/Bond 4.375% 15/08/2043 | 700,000 | 5,303,093 | 0.07 |
| United States Treasury Note/Bond 4.50% 31/05/2029 | 900,000 | 7,235,350 | 0.10 |
| United States Treasury Note/Bond 4.50% 31/12/2031 | 4,000,000 | 32,237,266 | 0.44 |
| United States Treasury Note/Bond 4.50% 15/05/2038 | 5,800,000 | 46,349,706 | 0.63 |
| United States Treasury Note/Bond 4.625% 30/09/2028 | 1,000,000 | 8,096,508 | 0.11 |
| United States Treasury Note/Bond 4.625% 30/04/2029 | 8,540,000 | 69,160,482 | 0.94 |
| United States Treasury Note/Bond 4.625% 15/02/2035 | 7,300,000 | 60,013,869 | 0.82 |
| United States Treasury Note/Bond 4.625% 15/05/2044 | 4,700,000 | 36,193,341 | 0.49 |
| United States Treasury Note/Bond 4.625% 15/11/2044 | 5,000,000 | 38,427,543 | 0.52 |
| United States Treasury Note/Bond 4.625% 15/02/2055 | 1,300,000 | 9,945,111 | 0.14 |
| United States Treasury Note/Bond 4.625% 15/11/2055 | 13,300,000 | 100,567,407 | 1.37 |
| United States Treasury Note/Bond 4.75% 15/11/2043 | 9,100,000 | 71,377,286 | 0.97 |
| United States Treasury Note/Bond 4.75% 15/02/2045 | 1,400,000 | 11,052,388 | 0.15 |
| United States Treasury Note/Bond 4.75% 15/05/2055 | 900,000 | 6,942,175 | 0.09 |
| United States Treasury Note/Bond 4.875% 31/10/2030 | 1,400,000 | 11,541,233 | 0.16 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球债券基金(续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|--|-----------|----------------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.86%) (续) | | | |
| 债券 (97.86%) (续) | | | |
| <i>以美元计价 (45.97%) (续)</i> | | | |
| Wistron Corp 0.00% 23/10/2030 | 2,900,000 | 22,178,927 | 0.30 |
| Woori Bank 5.125% 06/08/2028 | 400,000 | 3,248,931 | 0.04 |
| Woori Bank 6.375% Perpetual Callable - 24/07/2029 | 4,600,000 | 38,272,481 | 0.52 |
| Woori Card Co Ltd 1.75% 23/03/2026 | 2,000,000 | <u>15,553,039</u> | <u>0.21</u> |
| 上市 / 挂牌投资总额 | | <u>7,191,625,887</u> | <u>97.86</u> |

投资报告

于 2025 年 12 月 31 日 (续)

投资组合 (续)

东亚联丰环球债券基金 (续)

| 相关投资 | 对手方 | 未行使合约的 名义金额 | 公允价值 港元 | 占资产净值 百分比 |
|------------------------|------------------------|----------------|------------|--------------|
| 衍生金融工具 (-0.05%) | | | | |
| 买入欧元 / 卖出港元 | Citibank, Hong Kong | 欧元 6,600,000 | (16,672) | (0.00) |
| 买入港元 / 卖出澳元 | Citibank, Hong Kong | 港元 75,157,880 | (550,128) | (0.01) |
| 买入港元 / 卖出英镑 | Citibank, Hong Kong | 港元 145,813,388 | (583,016) | (0.01) |
| 买入港元 / 卖出英镑 | Citibank, Hong Kong | 港元 41,661,636 | (165,908) | (0.00) |
| 买入港元 / 卖出英镑 | Citibank, Hong Kong | 港元 60,225,582 | (424,357) | (0.01) |
| 买入港元 / 卖出加拿大元 | Citibank, Hong Kong | 港元 67,839,888 | (317,436) | (0.01) |
| 买入港元 / 卖出欧元 | Citibank, Hong Kong | 港元 91,366,250 | (77,350) | (0.00) |
| 买入港元 / 卖出欧元 | Citibank, Hong Kong | 港元 153,544,658 | (80,590) | (0.00) |
| 买入港元 / 卖出美元 | Citibank, Hong Kong | 港元 380,000,000 | (300,152) | (0.00) |
| 买入港元 / 卖出美元 | Citibank, Hong Kong | 港元 310,000,000 | (227,153) | (0.00) |
| 买入港元 / 卖出美元 | Citibank, Hong Kong | 港元 350,000,000 | (232,970) | (0.00) |
| 买入港元 / 卖出美元 | Citibank, Hong Kong | 港元 400,000,000 | (219,780) | (0.00) |
| 买入港元 / 卖出美元 | Citibank, Hong Kong | 港元 420,000,000 | (305,297) | (0.01) |
| 买入港元 / 卖出美元 | Citibank, Hong Kong | 港元 400,000,000 | (257,657) | (0.00) |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球债券基金(续)

| 相关投资 | 对手方 | 未行使合约的 名义金额 | 公允价值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|----------------------------|------------------------|----------------|----------------------|---------------|
| 衍生金融工具 (-0.05%) (续) | | | | |
| 买入美元 / 卖出港元 | Citibank, Hong Kong | 美元 25,688,404 | <u>(160,222)</u> | <u>(0.00)</u> |
| 衍生金融工具总额 | | | <u>(3,918,688)</u> | <u>(0.05)</u> |
| 其他资产净值 | | | <u>161,264,593</u> | <u>2.19</u> |
| 投资总额, 按成本计算 | | | <u>7,353,234,922</u> | |
| 资产净值总额 | | | <u>7,348,971,792</u> | <u>100.00</u> |

注: 投资按交易日期入账。

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球股票基金

| | 持有股份/份额 | 市值 港元 | 占资产净值 百分比 |
|--------------------------------|---------|------------|--------------|
| 上市/挂牌投资(97.90%) | | | |
| 股票(97.88%) | | | |
| <i>澳洲(1.19%)</i> | | | |
| Aristocrat Leisure Ltd | 6,352 | 1,918,169 | 0.02 |
| BHP Group Ltd | 54,401 | 12,844,748 | 0.14 |
| Brambles Ltd | 47,766 | 5,692,375 | 0.06 |
| Commonwealth Bank of Australia | 12,565 | 10,472,001 | 0.12 |
| CSL Ltd | 4,512 | 4,043,323 | 0.05 |
| Evolution Mining Ltd | 99,406 | 6,542,363 | 0.07 |
| Fortescue Ltd | 1,329 | 151,827 | 0.00 |
| Lottery Corp Ltd | 243,520 | 6,522,095 | 0.07 |
| National Australia Bank Ltd | 96,728 | 21,242,127 | 0.24 |
| Northern Star Resources Ltd | 31,742 | 4,403,885 | 0.05 |
| Pro Medicus Ltd | 4,658 | 5,339,972 | 0.06 |
| Qantas Airways Ltd | 1,293 | 69,662 | 0.00 |
| QBE Insurance Group Ltd | 11,958 | 1,234,514 | 0.01 |
| Rio Tinto Ltd | 2,603 | 1,983,637 | 0.02 |
| Telstra Group Ltd | 158,329 | 4,002,139 | 0.04 |
| Wesfarmers Ltd | 40,586 | 17,082,299 | 0.19 |
| Westpac Banking Corp | 5,845 | 1,171,048 | 0.01 |
| Woodside Energy Group Ltd | 28,711 | 3,515,435 | 0.04 |
| <i>奥地利(0.13%)</i> | | | |
| Erste Group Bank AG | 12,900 | 12,134,286 | 0.13 |
| <i>比利时(0.03%)</i> | | | |
| Anheuser-Busch InBev SA/NV | 5,833 | 2,927,342 | 0.03 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球股票基金(续)

| | 持有股份/份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|--|-----------|------------|--------------|
| 上市/挂牌投资(97.90%)(续) | | | |
| 股票(97.88%)(续) | | | |
| 巴西(0.03%) | | | |
| Ambev SA | 46,000 | 905,597 | 0.01 |
| Banco Bradesco SA | 90,605 | 2,007,661 | 0.02 |
| 加拿大(2.28%) | | | |
| Agnico Eagle Mines Ltd | 8,500 | 11,234,244 | 0.12 |
| Bank of Montreal | 12,700 | 12,854,342 | 0.14 |
| Brookfield Asset Management Ltd - CL A | 1,926 | 786,324 | 0.01 |
| Canadian Natural Resources Ltd | 30,600 | 8,077,883 | 0.09 |
| Canadian Pacific Kansas City Ltd | 80,500 | 46,190,087 | 0.51 |
| Dollarama Inc | 52,600 | 61,270,676 | 0.68 |
| Intact Financial Corp | 7,000 | 11,357,179 | 0.13 |
| Nutrien Ltd | 5,100 | 2,453,425 | 0.03 |
| Royal Bank of Canada | 15,000 | 19,929,901 | 0.22 |
| Shopify Inc - CL A | 12,500 | 15,686,240 | 0.17 |
| Toronto-Dominion Bank | 22,600 | 16,600,647 | 0.18 |
| 中国内地和中国香港(2.85%) | | | |
| 3SBio Inc | 19,500 | 471,510 | 0.01 |
| Agricultural Bank of China Ltd - H | 2,974,000 | 17,189,720 | 0.19 |
| Alibaba Group Holding Ltd | 147,000 | 20,991,600 | 0.23 |
| Bank of China Ltd - H | 2,701,000 | 12,046,460 | 0.13 |
| BeOne Medicines Ltd | 23,000 | 4,123,900 | 0.05 |
| BYD Electronic International Co Ltd | 16,000 | 538,240 | 0.01 |
| China Galaxy Securities Co Ltd - H | 92,500 | 927,775 | 0.01 |

投资报告

于 2025 年 12 月 31 日 (续)

投资组合 (续)

东亚联丰环球股票基金 (续)

| | 持有股份 / 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|--|-----------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.90%) (续) | | | |
| 股票 (97.88%) (续) | | | |
| 中国内地和中国香港 (2.85%) (续) | | | |
| China Gold International Resources Corp Ltd | 3,300 | 517,770 | 0.01 |
| China Hongqiao Group Ltd | 67,000 | 2,185,540 | 0.02 |
| China Life Insurance Co Ltd - H | 197,000 | 5,393,860 | 0.06 |
| China Merchants Bank Co Ltd - H | 153,500 | 8,104,800 | 0.09 |
| China Nonferrous Mining Corp Ltd | 140,000 | 2,065,000 | 0.02 |
| CITIC Securities Co Ltd - H | 28,000 | 767,200 | 0.01 |
| CK Hutchison Holdings Ltd | 74,500 | 3,944,775 | 0.04 |
| CMOC Group Ltd - H | 300,000 | 5,772,000 | 0.06 |
| Contemporary Amperex Technology Co Ltd - H | 8,100 | 4,094,550 | 0.04 |
| Fuyao Glass Industry Group Co Ltd - H | 11,600 | 779,520 | 0.01 |
| Geely Automobile Holdings Ltd | 354,000 | 6,336,600 | 0.07 |
| GF Securities Co Ltd - H | 29,800 | 524,778 | 0.01 |
| Haier Smart Home Co Ltd - H | 226,000 | 5,487,280 | 0.06 |
| Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | 43,200 | 17,608,320 | 0.19 |
| JD Health International Inc | 44,100 | 2,447,550 | 0.03 |
| JD.com Inc - CL A | 2,564 | 286,142 | 0.00 |
| Kuaishou Technology | 56,200 | 3,593,990 | 0.04 |
| Midea Group Co Ltd - H | 49,500 | 4,205,025 | 0.05 |
| NetEase Inc | 58,500 | 12,554,100 | 0.14 |
| New China Life Insurance Co Ltd - H | 83,600 | 4,543,660 | 0.05 |
| Nongfu Spring Co Ltd - H | 88,800 | 4,159,392 | 0.05 |
| People's Insurance Co Group of China Ltd - H | 780,000 | 5,265,000 | 0.06 |
| PetroChina Co Ltd - H | 584,000 | 4,893,920 | 0.05 |
| Pop Mart International Group Ltd | 7,400 | 1,388,980 | 0.02 |
| Shenzhou International Group Holdings Ltd | 6,300 | 385,560 | 0.00 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球股票基金(续)

| | 持有股份/ 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|--|-------------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.90%) (续) | | | |
| 股票 (97.88%) (续) | | | |
| 中国内地和中国香港 (2.85%) (续) | | | |
| Sino Biopharmaceutical Ltd | 71,000 | 438,780 | 0.00 |
| Sinopharm Group Co Ltd - H | 170,000 | 3,304,800 | 0.04 |
| SITC International Holdings Co Ltd | 54,000 | 1,504,440 | 0.02 |
| Techtronic Industries Co Ltd | 2,000 | 179,800 | 0.00 |
| Tencent Holdings Ltd | 96,600 | 57,863,400 | 0.64 |
| Tingyi Cayman Islands Holding Corp | 582,000 | 6,861,780 | 0.08 |
| Trip.com Group Ltd | 11,400 | 6,315,600 | 0.07 |
| WH Group Ltd | 218,000 | 1,890,060 | 0.02 |
| WuXi AppTec Co Ltd - H | 29,500 | 2,911,650 | 0.03 |
| Wuxi Biologics Cayman Inc | 55,500 | 1,744,920 | 0.02 |
| WuXi XDC Cayman Inc | 7,500 | 455,625 | 0.01 |
| Xiaomi Corp - CL B | 185,400 | 7,286,220 | 0.08 |
| Yum China Holdings Inc | 4,950 | 1,824,570 | 0.02 |
| Zhejiang Leapmotor Technology Co Ltd - H | 23,000 | 1,118,260 | 0.01 |
| 丹麦 (0.42%) | | | |
| Danske Bank A/S | 30,030 | 11,709,734 | 0.13 |
| DSV A/S | 6,560 | 12,966,486 | 0.14 |
| Vestas Wind Systems A/S | 61,700 | 13,094,237 | 0.15 |
| 芬兰 (0.05%) | | | |
| UPM-Kymmene Oyj | 20,467 | 4,638,097 | 0.05 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球股票基金(续)

| | 持有股份/ 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|-------------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.90%) (续) | | | |
| 股票 (97.88%) (续) | | | |
| 法国 (3.36%) | | | |
| Air Liquide SA | 35,180 | 51,538,303 | 0.57 |
| Airbus SE | 31,653 | 57,407,111 | 0.63 |
| AXA SA | 4,000 | 1,497,715 | 0.02 |
| BNP Paribas SA | 35,250 | 26,033,099 | 0.29 |
| Danone SA | 82,311 | 57,771,698 | 0.64 |
| Dassault Systemes SE | 252,399 | 55,005,109 | 0.61 |
| Engie SA | 10,000 | 2,048,571 | 0.02 |
| EssilorLuxottica SA | 19,796 | 48,841,554 | 0.54 |
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 18 | 106,131 | 0.00 |
| TotalEnergies SE | 8,011 | 4,070,920 | 0.04 |
| 德国 (1.92%) | | | |
| Adidas AG | 1,240 | 1,916,223 | 0.02 |
| Allianz SE - REG | 18,218 | 65,032,565 | 0.72 |
| BASF SE | 6,039 | 2,452,734 | 0.03 |
| Commerzbank AG | 26,700 | 8,811,049 | 0.10 |
| Daimler Truck Holding AG | 2,408 | 821,499 | 0.01 |
| Deutsche Telekom AG - REG | 37,700 | 9,532,409 | 0.11 |
| DHL Group | 7,615 | 3,252,931 | 0.03 |
| E.ON SE | 12,500 | 1,842,548 | 0.02 |
| Heidelberg Materials AG | 4,900 | 9,988,726 | 0.11 |
| Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen - REG | 1,856 | 9,538,453 | 0.10 |
| Rheinmetall AG | 1,564 | 22,317,667 | 0.25 |
| SAP SE | 10,867 | 20,697,234 | 0.23 |
| Siemens AG - REG | 7,058 | 15,429,832 | 0.17 |
| Siemens Energy AG | 1,784 | 1,963,498 | 0.02 |

投资报告

于 2025 年 12 月 31 日 (续)

投资组合 (续)

东亚联丰环球股票基金 (续)

| | 持有股份 / 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|-----------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.90%) (续) | | | |
| 股票 (97.88%) (续) | | | |
| <i>印度 (1.51%)</i> | | | |
| APL Apollo Tubes Ltd | 17,720 | 2,937,104 | 0.03 |
| Bajaj Finance Ltd | 26,505 | 2,265,013 | 0.03 |
| Bharat Petroleum Corp Ltd | 6,292 | 209,235 | 0.00 |
| Bharti Airtel Ltd | 9,909 | 1,806,839 | 0.02 |
| Canara Bank | 529,235 | 7,099,728 | 0.08 |
| Cholamandalam Investment and Finance Co Ltd | 11,705 | 1,725,423 | 0.02 |
| Coromandel International Ltd | 1,049 | 205,885 | 0.00 |
| Cummins India Ltd | 25,790 | 9,903,755 | 0.11 |
| Eicher Motors Ltd | 3,134 | 1,984,625 | 0.02 |
| HCL Technologies Ltd | 57,809 | 8,126,582 | 0.09 |
| HDFC Asset Management Co Ltd | 24,896 | 5,761,190 | 0.06 |
| Hero MotoCorp Ltd | 1,374 | 686,675 | 0.01 |
| Hitachi Energy India Ltd | 126 | 199,789 | 0.00 |
| Infosys Ltd | 153,211 | 21,433,036 | 0.24 |
| ITC Ltd | 17,127 | 597,723 | 0.01 |
| Jindal Stainless Ltd | 24,734 | 1,797,626 | 0.02 |
| LTIMindtree Ltd | 1,004 | 527,194 | 0.01 |
| Marico Ltd | 12,728 | 827,337 | 0.01 |
| Muthoot Finance Ltd | 10,590 | 3,495,653 | 0.04 |
| Page Industries Ltd | 807 | 2,519,024 | 0.03 |
| Persistent Systems Ltd | 1,605 | 871,756 | 0.01 |
| Petronet LNG Ltd | 191,704 | 4,716,459 | 0.05 |
| Polycab India Ltd | 10,870 | 7,172,015 | 0.08 |
| Power Finance Corp Ltd | 61,728 | 1,899,824 | 0.02 |
| Punjab National Bank | 174,982 | 1,872,644 | 0.02 |
| Reliance Industries Ltd | 51,754 | 7,038,302 | 0.08 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球股票基金(续)

| | 持有股份/ 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|-------------------------------|-------------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.90%) (续) | | | |
| 股票 (97.88%) (续) | | | |
| <i>印度 (1.51%) (续)</i> | | | |
| Tata Consultancy Services Ltd | 59,460 | 16,509,320 | 0.18 |
| Tata Steel Ltd | 161,006 | 2,510,853 | 0.03 |
| Tech Mahindra Ltd | 14,470 | 1,993,541 | 0.02 |
| Titan Co Ltd | 13,813 | 4,846,381 | 0.05 |
| TVS Motor Co Ltd | 3,759 | 1,210,892 | 0.01 |
| TVS Motor Co Ltd - PREF SHS | 31,324 | 0.00 | 0.00 |
| UPL Ltd | 57,561 | 3,963,611 | 0.04 |
| Vedanta Ltd | 88,267 | 4,619,942 | 0.05 |
| Vodafone Idea Ltd | 1,589,703 | 1,481,296 | 0.02 |
| Wipro Ltd | 81,342 | 1,854,583 | 0.02 |
| <i>意大利 (0.49%)</i> | | | |
| Enel SpA | 137,000 | 11,117,213 | 0.12 |
| Eni SpA | 10,396 | 1,533,836 | 0.02 |
| Intesa Sanpaolo SpA | 254,136 | 13,755,310 | 0.15 |
| UniCredit SpA | 27,339 | 17,723,949 | 0.20 |
| <i>日本 (4.27%)</i> | | | |
| Advantest Corp | 9,400 | 9,165,154 | 0.10 |
| Aeon Co Ltd | 30,300 | 3,726,916 | 0.04 |
| AGC Inc | 4,900 | 1,263,559 | 0.01 |
| Aisin Corp | 33,100 | 4,809,316 | 0.05 |
| Ajinomoto Co Inc | 8,700 | 1,432,998 | 0.02 |
| Asahi Group Holdings Ltd | 21,800 | 1,774,798 | 0.02 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合 (续)

东亚联丰环球股票基金 (续)

| | 持有股份 / 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|-------------------------------|-----------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.90%) (续) | | | |
| 股票 (97.88%) (续) | | | |
| 日本 (4.27%) (续) | | | |
| Asahi Intecc Co Ltd | 7,900 | 1,152,354 | 0.01 |
| Asahi Kasei Corp | 59,500 | 4,103,932 | 0.05 |
| Asics Corp | 9,000 | 1,678,160 | 0.02 |
| Astellas Pharma Inc | 63,000 | 6,547,730 | 0.07 |
| Bandai Namco Holdings Inc | 8,600 | 1,781,656 | 0.02 |
| Bridgestone Corp | 34,000 | 5,932,827 | 0.07 |
| Central Japan Railway Co | 13,600 | 2,928,932 | 0.03 |
| Chiba Bank Ltd | 23,600 | 2,048,493 | 0.02 |
| Chugai Pharmaceutical Co Ltd | 6,300 | 2,578,736 | 0.03 |
| Daifuku Co Ltd | 6,300 | 1,541,673 | 0.02 |
| Dai-ichi Life Holdings Inc | 88,000 | 5,696,062 | 0.06 |
| Daiichi Sankyo Co Ltd | 14,500 | 2,410,652 | 0.03 |
| Daikin Industries Ltd | 1,500 | 1,495,671 | 0.02 |
| Daiwa Securities Group Inc | 29,600 | 2,014,428 | 0.02 |
| Disco Corp | 600 | 1,435,188 | 0.02 |
| Ebara Corp | 11,700 | 2,140,358 | 0.02 |
| ENEOS Holdings Inc | 30,700 | 1,687,590 | 0.02 |
| FANUC Corp | 15,700 | 4,743,183 | 0.05 |
| Fast Retailing Co Ltd | 2,000 | 5,654,946 | 0.06 |
| Fuji Electric Co Ltd | 2,900 | 1,706,465 | 0.02 |
| Fujikura Ltd | 1,900 | 1,645,436 | 0.02 |
| Fujitsu Ltd | 27,500 | 5,911,549 | 0.07 |
| GMO Payment Gateway Inc | 2,300 | 1,113,902 | 0.01 |
| Haseko Corp | 11,100 | 1,713,109 | 0.02 |
| Hitachi Ltd | 64,100 | 15,603,152 | 0.17 |
| Hoya Corp | 8,000 | 9,409,020 | 0.10 |
| Inpex Corp | 23,000 | 3,571,385 | 0.04 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球股票基金(续)

| | 持有股份/份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|------------------------------------|---------|------------|--------------|
| 上市/挂牌投资(97.90%)(续) | | | |
| 股票(97.88%)(续) | | | |
| 日本(4.27%)(续) | | | |
| Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd | 6,200 | 700,413 | 0.01 |
| ITOCHU Corp | 79,000 | 7,747,743 | 0.09 |
| Japan Airlines Co Ltd | 3,900 | 562,590 | 0.01 |
| Japan Exchange Group Inc | 44,000 | 3,661,910 | 0.04 |
| Japan Tobacco Inc | 11,100 | 3,108,731 | 0.03 |
| JTEKT Corp | 32,400 | 2,791,422 | 0.03 |
| Kao Corp | 5,100 | 1,585,605 | 0.02 |
| KDDI Corp | 65,800 | 8,849,846 | 0.10 |
| Keyence Corp | 1,700 | 4,784,756 | 0.05 |
| Kioxia Holdings Corp | 3,600 | 1,865,417 | 0.02 |
| Konami Group Corp | 1,500 | 1,588,778 | 0.02 |
| Kurita Water Industries Ltd | 6,200 | 1,954,383 | 0.02 |
| Kyocera Corp | 36,400 | 3,970,211 | 0.04 |
| Kyushu Electric Power Co Inc | 14,100 | 1,175,576 | 0.01 |
| M3 Inc | 11,800 | 1,238,705 | 0.01 |
| Marubeni Corp | 20,500 | 4,431,222 | 0.05 |
| Mitsubishi Corp | 31,600 | 5,627,019 | 0.06 |
| Mitsubishi Electric Corp | 43,400 | 9,881,209 | 0.11 |
| Mitsubishi Estate Co Ltd | 13,900 | 2,637,381 | 0.03 |
| Mitsubishi Heavy Industries Ltd | 32,700 | 6,235,338 | 0.07 |
| Mitsubishi UFJ Financial Group Inc | 119,700 | 14,818,267 | 0.16 |
| Mitsui & Co Ltd | 35,700 | 8,230,911 | 0.09 |
| Mitsui Fudosan Co Ltd | 41,800 | 3,695,722 | 0.04 |
| Mizuho Financial Group Inc | 33,100 | 9,368,797 | 0.10 |
| MS&AD Insurance Group Holdings Inc | 14,900 | 2,725,016 | 0.03 |
| Murata Manufacturing Co Ltd | 14,200 | 2,288,853 | 0.03 |
| NEC Corp | 27,400 | 7,224,804 | 0.08 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球股票基金(续)

| | 持有股份/份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|-------------------------------------|---------|------------|--------------|
| 上市/挂牌投资(97.90%)(续) | | | |
| 股票(97.88%)(续) | | | |
| 日本(4.27%)(续) | | | |
| Nexon Co Ltd | 9,100 | 1,729,342 | 0.02 |
| NH Foods Ltd | 6,500 | 2,116,409 | 0.02 |
| Nintendo Co Ltd | 12,300 | 6,471,233 | 0.07 |
| Nissan Chemical Corp | 10,500 | 2,796,263 | 0.03 |
| Nitto Denko Corp | 16,400 | 3,025,406 | 0.03 |
| Nomura Holdings Inc | 33,500 | 2,164,228 | 0.02 |
| Nomura Research Institute Ltd | 12,300 | 3,677,517 | 0.04 |
| Obayashi Corp | 14,600 | 2,370,002 | 0.03 |
| Open House Group Co Ltd | 4,300 | 1,964,860 | 0.02 |
| ORIX Corp | 22,200 | 5,020,269 | 0.06 |
| Otsuka Holdings Co Ltd | 1,200 | 528,729 | 0.01 |
| Recruit Holdings Co Ltd | 18,500 | 8,127,346 | 0.09 |
| Rinnai Corp | 9,700 | 1,907,427 | 0.02 |
| Sanrio Co Ltd | 2,900 | 708,075 | 0.01 |
| SBI Holdings Inc | 17,600 | 2,949,629 | 0.03 |
| Seven & i Holdings Co Ltd | 28,600 | 3,196,142 | 0.04 |
| Shin-Etsu Chemical Co Ltd | 8,600 | 2,081,018 | 0.02 |
| Shionogi & Co Ltd | 24,400 | 3,442,247 | 0.04 |
| SoftBank Group Corp | 28,000 | 6,117,750 | 0.07 |
| Sony Group Corp | 84,200 | 16,824,845 | 0.19 |
| Subaru Corp | 6,600 | 1,112,666 | 0.01 |
| Sumitomo Bakelite Co Ltd | 3,000 | 769,138 | 0.01 |
| Sumitomo Electric Industries Ltd | 8,700 | 2,732,504 | 0.03 |
| Sumitomo Mitsui Financial Group Inc | 45,300 | 11,339,552 | 0.12 |
| Suzuki Motor Corp | 13,900 | 1,611,349 | 0.02 |
| Taisei Corp | 3,800 | 2,799,317 | 0.03 |
| TDK Corp | 37,600 | 4,128,170 | 0.05 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球股票基金(续)

| | 持有股份/份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|--|---------|------------|--------------|
| 上市/挂牌投资(97.90%)(续) | | | |
| 股票(97.88%)(续) | | | |
| 日本(4.27%)(续) | | | |
| TIS Inc | 12,200 | 3,184,775 | 0.03 |
| Tokio Marine Holdings Inc | 11,300 | 3,264,063 | 0.04 |
| Tokyo Electron Ltd | 4,800 | 8,180,305 | 0.09 |
| Tokyo Gas Co Ltd | 3,600 | 1,109,239 | 0.01 |
| Tokyu Fudosan Holdings Corp | 26,600 | 1,887,534 | 0.02 |
| Toyo Tire Corp | 7,300 | 1,571,422 | 0.02 |
| Toyota Motor Corp | 93,800 | 15,631,685 | 0.17 |
| Toyota Tsusho Corp | 7,500 | 1,964,185 | 0.02 |
| Tsuruha Holdings Inc | 11,300 | 1,614,917 | 0.02 |
| Yokogawa Electric Corp | 15,400 | 3,835,829 | 0.04 |
| 韩国(1.37%) | | | |
| Alteogen Inc | 189 | 459,027 | 0.01 |
| DB Insurance Co Ltd | 9,635 | 6,824,976 | 0.07 |
| Hana Financial Group Inc | 4,274 | 2,173,056 | 0.02 |
| Hanwha Aerospace Co Ltd | 281 | 1,428,705 | 0.02 |
| Hanwha Ocean Co Ltd | 1,260 | 773,385 | 0.01 |
| HD Hyundai Co Ltd | 2,446 | 2,491,234 | 0.03 |
| HD Hyundai Electric Co Ltd | 391 | 1,635,176 | 0.02 |
| HD Hyundai Heavy Industries Co Ltd | 335 | 921,317 | 0.01 |
| HD Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd | 1,121 | 2,465,169 | 0.03 |
| Hyosung Heavy Industries Corp | 96 | 923,808 | 0.01 |
| Hyundai Glovis Co Ltd | 797 | 777,719 | 0.01 |
| Hyundai Mobis Co Ltd | 431 | 868,626 | 0.01 |
| Hyundai Rotem Co Ltd | 966 | 980,733 | 0.01 |
| KB Financial Group Inc | 5,601 | 3,773,799 | 0.04 |
| Kia Corp | 3,805 | 2,504,083 | 0.03 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合 (续)

东亚联丰环球股票基金 (续)

| | 持有股份 / 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|--|-----------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.90%) (续) | | | |
| 股票 (97.88%) (续) | | | |
| 韩国 (1.37%) (续) | | | |
| Korea Investment Holdings Co Ltd | 748 | 653,519 | 0.01 |
| LG Display Co Ltd | 4,358 | 278,089 | 0.00 |
| LG Uplus Corp | 88,608 | 7,047,376 | 0.08 |
| NAVER Corp | 849 | 1,112,413 | 0.01 |
| NH Investment & Securities Co Ltd | 12,810 | 1,460,422 | 0.02 |
| Samsung Electro-Mechanics Co Ltd | 1,305 | 1,798,032 | 0.02 |
| Samsung Electronics Co Ltd | 57,850 | 37,477,383 | 0.41 |
| Samsung Electronics Co Ltd - Preference SHS | 8,254 | 3,978,103 | 0.04 |
| Samsung Heavy Industries Co Ltd | 7,016 | 913,594 | 0.01 |
| Shinhan Financial Group Co Ltd | 5,644 | 2,345,093 | 0.03 |
| SK Hynix Inc | 7,075 | 24,885,945 | 0.27 |
| SK Square Co Ltd | 1,299 | 2,582,877 | 0.03 |
| Woori Financial Group Inc | 66,075 | 9,996,361 | 0.11 |
| 马来西亚 (0.39%) | | | |
| AMMB Holdings Bhd | 165,100 | 2,058,369 | 0.02 |
| Hong Leong Bank Bhd | 12,000 | 509,591 | 0.01 |
| MR DIY Group M Bhd | 2,715,200 | 7,968,125 | 0.09 |
| Nestle Malaysia Bhd | 5,300 | 1,158,894 | 0.01 |
| Petronas Dagangan Bhd | 32,400 | 1,240,419 | 0.01 |
| Press Metal Aluminium Holdings Bhd | 180,400 | 2,463,652 | 0.03 |
| RHB Bank Bhd | 1,339,600 | 19,810,362 | 0.22 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球股票基金(续)

| | 持有股份/ 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|-------------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.90%) (续) | | | |
| 股票 (97.88%) (续) | | | |
| <i>墨西哥 (0.05%)</i> | | | |
| America Movil SAB de CV | 605,400 | 4,882,622 | 0.05 |
| <i>荷兰 (1.73%)</i> | | | |
| ASM International NV | 448 | 2,119,734 | 0.02 |
| ASML Holding NV | 10,094 | 85,019,912 | 0.94 |
| ING Groep NV | 61,100 | 13,410,424 | 0.15 |
| Koninklijke Philips NV | 7,560 | 1,606,080 | 0.02 |
| Prosus NV | 19,050 | 9,203,417 | 0.10 |
| Shell PLC | 157,100 | 45,201,315 | 0.50 |
| <i>新西兰 (0.03%)</i> | | | |
| Auckland International Airport Ltd | 18,011 | 671,526 | 0.01 |
| Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd | 6,611 | 1,117,029 | 0.01 |
| Meridian Energy Ltd | 29,749 | 745,660 | 0.01 |
| <i>挪威 (0.15%)</i> | | | |
| DNB Bank ASA | 62,000 | 13,467,570 | 0.15 |
| <i>菲律宾 (0.04%)</i> | | | |
| International Container Terminal Services Inc | 51,760 | 3,882,614 | 0.04 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球股票基金(续)

| | 持有股份/ 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|-------------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.90%) (续) | | | |
| 股票 (97.88%) (续) | | | |
| <i>新加坡 (0.15%)</i> | | | |
| DBS Group Holdings Ltd | 31,700 | 10,813,441 | 0.12 |
| Singapore Exchange Ltd | 10,400 | 1,067,561 | 0.01 |
| Singapore Technologies Engineering Ltd | 41,600 | 2,120,016 | 0.02 |
| <i>南非 (0.11%)</i> | | | |
| FirstRand Ltd | 41,710 | 1,778,028 | 0.02 |
| Naspers Ltd - N SHS | 11,315 | 5,870,514 | 0.07 |
| Standard Bank Group Ltd | 15,705 | 2,142,330 | 0.02 |
| <i>西班牙 (1.35%)</i> | | | |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA | 105,287 | 19,297,377 | 0.21 |
| Banco Santander SA | 247,676 | 22,799,354 | 0.25 |
| Iberdrola SA | 365,138 | 61,633,310 | 0.68 |
| Industria de Diseno Textil SA | 35,500 | 18,283,290 | 0.20 |
| Telefonica SA | 21,292 | 679,867 | 0.01 |
| <i>瑞典 (1.55%)</i> | | | |
| Atlas Copco AB – A SHS | 263,430 | 36,932,132 | 0.41 |
| Atlas Copco AB – B SHS | 149,542 | 18,812,639 | 0.21 |
| Boliden AB | 67,173 | 29,219,371 | 0.32 |
| Hexagon AB – B SHS | 560,104 | 51,782,506 | 0.57 |
| Telefonaktiebolaget LM Ericsson – B SHS | 24,012 | 1,836,779 | 0.02 |
| Volvo AB – B SHS | 8,467 | 2,115,314 | 0.02 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球股票基金(续)

| | 持有股份/份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|--|-----------|------------|--------------|
| 上市/挂牌投资(97.90%)(续) | | | |
| 股票(97.88%)(续) | | | |
| <i>瑞士(2.02%)</i> | | | |
| ABB Ltd - REG | 15,520 | 9,029,684 | 0.10 |
| Cie Financiere Richemont SA - CL A REG | 5,890 | 9,955,943 | 0.11 |
| Helvetia Baloise Holding AG | 6,600 | 13,564,945 | 0.15 |
| Holcim AG | 14,400 | 11,000,975 | 0.12 |
| Nestle SA - REG | 23,432 | 18,126,635 | 0.20 |
| Novartis AG - REG | 20,380 | 21,944,574 | 0.24 |
| Partners Group Holding AG | 1,400 | 13,512,285 | 0.15 |
| Roche Holding AG - Genusschein | 7,989 | 25,759,855 | 0.29 |
| Sandoz Group AG | 21,940 | 12,467,441 | 0.14 |
| Swiss Life Holding AG - REG | 1,351 | 12,168,649 | 0.13 |
| Swiss Re AG | 7,000 | 9,136,335 | 0.10 |
| UBS Group AG - REG | 41,878 | 15,206,537 | 0.17 |
| Zurich Insurance Group AG | 1,811 | 10,707,376 | 0.12 |
| <i>中国台湾(2.32%)</i> | | | |
| Accton Technology Corp | 16,090 | 4,723,143 | 0.05 |
| Alchip Technologies Ltd | 1,680 | 1,460,741 | 0.02 |
| Asia Vital Components Co Ltd | 6,020 | 2,251,802 | 0.02 |
| Chang Hwa Commercial Bank Ltd | 993,000 | 5,030,362 | 0.06 |
| Delta Electronics Inc | 36,000 | 8,587,870 | 0.09 |
| E.Sun Financial Holding Co Ltd | 1,355,000 | 11,328,430 | 0.13 |
| Elite Material Co Ltd | 3,350 | 1,365,109 | 0.02 |
| Far EasTone Telecommunications Co Ltd | 825,000 | 18,045,600 | 0.20 |
| Fubon Financial Holding Co Ltd | 162,000 | 3,856,515 | 0.04 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球股票基金(续)

| | 持有股份/ 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|-------------|-------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.90%) (续) | | | |
| 股票 (97.88%) (续) | | | |
| 中国台湾 (2.32%) (续) | | | |
| Gigabyte Technology Co Ltd | 61,700 | 3,813,400 | 0.04 |
| Hon Hai Precision Industry Co Ltd | 152,800 | 8,724,709 | 0.10 |
| International Games System Co Ltd | 7,450 | 1,330,602 | 0.01 |
| King Slide Works Co Ltd | 3,550 | 3,297,739 | 0.04 |
| Lite-On Technology Corp | 37,000 | 1,498,567 | 0.02 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 341,000 | 130,931,079 | 1.45 |
| TS Financial Holding Co Ltd | 424,000 | 2,142,657 | 0.02 |
| Wiwynn Corp | 1,010 | 1,122,123 | 0.01 |
| Zhen Ding Technology Holding Ltd | 6,000 | 211,055 | 0.00 |
| 泰国 (0.37%) | | | |
| Advanced Info Service PCL - NVDR | 287,500 | 22,231,942 | 0.24 |
| Delta Electronics Thailand PCL - NVDR | 18,900 | 807,799 | 0.01 |
| Krung Thai Bank PCL - NVDR | 254,700 | 1,777,635 | 0.02 |
| SCB X PCL - NVDR | 254,500 | 8,739,726 | 0.10 |
| Siam Cement PCL - NVDR | 8,100 | 367,212 | 0.00 |
| 英国 (3.08%) | | | |
| Anglo American PLC | 108,112 | 34,917,417 | 0.39 |
| AstraZeneca PLC | 49,320 | 71,203,342 | 0.79 |
| BAE Systems PLC | 50,304 | 9,026,645 | 0.10 |
| BP PLC | 141,867 | 6,428,086 | 0.07 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球股票基金(续)

| | 持有股份/份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---------------------------------|---------|-------------|--------------|
| 上市/挂牌投资(97.90%)(续) | | | |
| 股票(97.88%)(续) | | | |
| 英国(3.08%)(续) | | | |
| GSK PLC | 17,979 | 3,434,175 | 0.04 |
| Haleon PLC | 22,275 | 874,038 | 0.01 |
| HSBC Holdings PLC | 226,314 | 27,811,126 | 0.31 |
| Lloyds Banking Group PLC | 431,150 | 4,434,348 | 0.05 |
| London Stock Exchange Group PLC | 7,232 | 6,777,843 | 0.07 |
| Magnum Ice Cream Co NV | 2,400 | 295,859 | 0.00 |
| National Grid PLC | 39,588 | 4,730,995 | 0.05 |
| Prudential PLC | 22,500 | 2,695,947 | 0.03 |
| RELX PLC | 12,930 | 4,088,072 | 0.05 |
| Rentokil Initial PLC | 78,268 | 3,666,826 | 0.04 |
| Rio Tinto PLC | 20,749 | 13,020,479 | 0.14 |
| Rolls-Royce Holdings PLC | 519,362 | 62,528,938 | 0.69 |
| Shell PLC | 57,400 | 16,465,522 | 0.18 |
| Unilever PLC | 10,762 | 5,475,170 | 0.06 |
| Vodafone Group PLC | 121,041 | 1,253,008 | 0.01 |
| 美国(64.64%) | | | |
| 3M Co | 39,100 | 48,723,974 | 0.54 |
| AbbVie Inc | 43,100 | 76,651,222 | 0.85 |
| Accenture PLC - CL A | 5,000 | 10,441,558 | 0.12 |
| Adobe Inc | 2,000 | 5,448,290 | 0.06 |
| Advanced Micro Devices Inc | 16,700 | 27,837,450 | 0.31 |
| Agilent Technologies Inc | 40,700 | 43,105,373 | 0.48 |
| Alnylam Pharmaceuticals Inc | 3,500 | 10,832,873 | 0.12 |
| Alphabet Inc - CL A | 81,000 | 197,334,932 | 2.18 |
| Alphabet Inc - CL C | 74,800 | 182,696,047 | 2.02 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球股票基金(续)

| | 持有股份/ 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|-------------------------------|----------|-------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.90%) (续) | | | |
| 股票 (97.88%) (续) | | | |
| 美国 (64.64%) (续) | | | |
| Amazon.com Inc | 130,300 | 234,095,177 | 2.58 |
| American Express Co | 22,760 | 65,537,505 | 0.72 |
| Amrize Ltd | 85,700 | 36,073,819 | 0.40 |
| Apple Inc | 192,800 | 407,968,804 | 4.50 |
| AppLovin Corp - CL A | 2,500 | 13,111,685 | 0.14 |
| Ares Management Corp | 21,700 | 27,299,602 | 0.30 |
| ARM Holdings PLC - ADR | 45,100 | 38,371,701 | 0.42 |
| Atmos Energy Corp | 43,800 | 57,147,925 | 0.63 |
| AutoZone Inc | 1,820 | 48,043,852 | 0.53 |
| Axon Enterprise Inc | 2,000 | 8,840,960 | 0.10 |
| Baker Hughes Co | 105,200 | 37,289,227 | 0.41 |
| Bank of America Corp | 108,600 | 46,490,812 | 0.51 |
| Berkshire Hathaway Inc - CL B | 16,700 | 65,336,636 | 0.72 |
| Blackrock Inc | 5,410 | 45,070,631 | 0.50 |
| Block Inc | 2,000 | 1,013,255 | 0.01 |
| Boeing Co | 9,400 | 15,885,551 | 0.18 |
| Boston Scientific Corp | 77,100 | 57,220,242 | 0.63 |
| Bristol-Myers Squibb Co | 21,000 | 8,816,675 | 0.10 |
| Broadcom Inc | 44,500 | 119,877,099 | 1.32 |
| Cameco Corp | 32,100 | 22,858,792 | 0.25 |
| Cardinal Health Inc | 8,100 | 12,956,015 | 0.14 |
| Carrier Global Corp | 3,600 | 1,480,607 | 0.02 |
| Carvana Co | 4,720 | 15,504,210 | 0.17 |
| Casey's General Stores Inc | 8,880 | 38,201,895 | 0.42 |
| Caterpillar Inc | 5,100 | 22,740,545 | 0.25 |
| CBRE Group Inc | 9,000 | 11,263,572 | 0.12 |
| Charles Schwab Corp | 18,000 | 13,997,681 | 0.15 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球股票基金(续)

| | 持有股份/ 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|--------------------------------------|-------------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.90%) (续) | | | |
| 股票 (97.88%) (续) | | | |
| 美国 (64.64%) (续) | | | |
| Chevron Corp | 8,000 | 9,490,259 | 0.10 |
| Cisco Systems Inc | 49,100 | 29,438,522 | 0.33 |
| Citigroup Inc | 79,700 | 72,387,999 | 0.80 |
| Cloudflare Inc - CL A | 38,200 | 58,618,508 | 0.65 |
| Coca-Cola Co | 57,100 | 31,070,627 | 0.34 |
| Constellation Energy Corp | 5,100 | 14,023,343 | 0.15 |
| CoStar Group Inc | 18,700 | 9,786,872 | 0.11 |
| Costco Wholesale Corp | 8,200 | 55,038,552 | 0.61 |
| Credicorp Ltd | 1,000 | 2,233,863 | 0.02 |
| CRH PLC | 65,799 | 63,915,839 | 0.71 |
| Datadog Inc - CL A | 2,800 | 2,963,737 | 0.03 |
| Dominion Energy Inc | 2,900 | 1,322,501 | 0.01 |
| DR Horton Inc | 48,600 | 54,483,355 | 0.60 |
| Duke Energy Corp | 10,000 | 9,123,034 | 0.10 |
| Ecolab Inc | 24,800 | 50,674,409 | 0.56 |
| Eli Lilly & Co | 9,699 | 81,129,862 | 0.90 |
| Exxon Mobil Corp | 52,500 | 49,174,950 | 0.54 |
| Fastenal Co | 12,000 | 3,748,220 | 0.04 |
| FTAI Aviation Ltd | 21,500 | 32,941,888 | 0.36 |
| Futu Holdings Ltd - ADR | 2,700 | 3,450,945 | 0.04 |
| General Electric Co | 21,300 | 51,067,810 | 0.56 |
| Goldman Sachs Group Inc | 10,998 | 75,244,923 | 0.83 |
| Grab Holdings Ltd - CL A | 10,500 | 407,816 | 0.00 |
| Home Depot Inc | 9,000 | 24,104,704 | 0.27 |
| Howmet Aerospace Inc | 33,200 | 52,979,631 | 0.58 |
| IDEXX Laboratories Inc | 800 | 4,212,614 | 0.05 |
| International Business Machines Corp | 9,400 | 21,672,159 | 0.24 |

投资报告

于 2025 年 12 月 31 日 (续)

投资组合 (续)

东亚联丰环球股票基金 (续)

| | 持有股份 / 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|------------------------------------|-----------|-------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.90%) (续) | | | |
| 股票 (97.88%) (续) | | | |
| 美国 (64.64%) (续) | | | |
| Intuit Inc | 1,500 | 7,733,913 | 0.09 |
| Johnson & Johnson | 28,000 | 45,102,236 | 0.50 |
| Johnson Controls International plc | 54,600 | 50,891,210 | 0.56 |
| JPMorgan Chase & Co | 54,240 | 136,033,787 | 1.50 |
| Kinder Morgan Inc | 11,300 | 2,417,841 | 0.03 |
| KKR & Co Inc | 28,600 | 28,378,060 | 0.31 |
| Lam Research Corp | 35,500 | 47,299,439 | 0.52 |
| Lennar Corp - CL A | 2,100 | 1,680,301 | 0.02 |
| Linde PLC | 14,632 | 48,560,742 | 0.54 |
| Mastercard Inc - CL A | 11,520 | 51,188,443 | 0.57 |
| Match Group Inc | 3,700 | 929,917 | 0.01 |
| McKesson Corp | 8,400 | 53,631,669 | 0.59 |
| Medline Inc - CL A | 140,000 | 45,766,947 | 0.51 |
| Merck & Co Inc | 27,000 | 22,120,847 | 0.24 |
| Meta Platforms Inc - CL A | 26,640 | 136,871,172 | 1.51 |
| Micron Technology Inc | 38,300 | 85,082,956 | 0.94 |
| Microsoft Corp | 96,100 | 361,744,764 | 3.99 |
| MongoDB Inc | 18,700 | 61,086,443 | 0.67 |
| Monolithic Power Systems Inc | 800 | 5,643,718 | 0.06 |
| Morgan Stanley | 13,000 | 17,963,449 | 0.20 |
| Newmont Corp | 28,000 | 21,761,093 | 0.24 |
| NextEra Energy Inc | 40,000 | 24,994,357 | 0.28 |
| Norfolk Southern Corp | 22,880 | 51,417,091 | 0.57 |
| NVIDIA Corp | 339,500 | 492,825,564 | 5.44 |
| Occidental Petroleum Corp | 4,068 | 1,301,993 | 0.01 |
| Otis Worldwide Corp | 1,850 | 1,257,793 | 0.01 |
| Palantir Technologies Inc | 11,600 | 16,048,787 | 0.18 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合 (续)

东亚联丰环球股票基金 (续)

| | 持有股份 / 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---------------------------------|-----------|-------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.90%) (续) | | | |
| 股票 (97.88%) (续) | | | |
| 美国 (64.64%) (续) | | | |
| Parker-Hannifin Corp | 8,600 | 58,835,869 | 0.65 |
| PDD Holdings Inc - ADR | 14,700 | 12,973,785 | 0.14 |
| Philip Morris International Inc | 18,200 | 22,722,199 | 0.25 |
| Procter & Gamble Co | 31,400 | 35,025,211 | 0.39 |
| Qnity Electronics Inc | 950 | 603,746 | 0.01 |
| Quanta Services Inc | 14,700 | 48,290,994 | 0.53 |
| Ralph Lauren Corp - CL A | 14,960 | 41,174,729 | 0.45 |
| Salesforce Inc | 11,200 | 23,093,565 | 0.26 |
| Sea Ltd - ADR | 4,388 | 4,357,022 | 0.05 |
| Seagate Technology Holdings PLC | 24,600 | 52,730,014 | 0.58 |
| Sherwin-Williams Co | 18,400 | 46,406,376 | 0.51 |
| Southern Co | 13,000 | 8,823,369 | 0.10 |
| Spotify Technology SA | 1,500 | 6,779,929 | 0.07 |
| Tapestry Inc | 27,700 | 27,547,569 | 0.30 |
| Tesla Inc | 35,200 | 123,213,836 | 1.36 |
| Texas Pacific Land Corp | 2,280 | 5,097,112 | 0.06 |
| Thermo Fisher Scientific Inc | 13,400 | 60,435,954 | 0.67 |
| TJX Cos Inc | 58,800 | 70,302,607 | 0.78 |
| TopBuild Corp | 16,280 | 52,864,351 | 0.58 |
| Trane Technologies PLC | 10,200 | 30,899,227 | 0.34 |
| Uber Technologies Inc | 25,000 | 15,899,733 | 0.18 |
| United Rentals Inc | 1,800 | 11,338,808 | 0.13 |
| UnitedHealth Group Inc | 9,500 | 24,409,388 | 0.27 |
| Valero Energy Corp | 1,700 | 2,154,028 | 0.02 |
| Veralto Corp | 1,700 | 1,320,283 | 0.01 |
| Vertiv Holdings Co | 23,100 | 29,129,190 | 0.32 |
| Vipshop Holdings Ltd - ADR | 3,500 | 481,915 | 0.01 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰环球股票基金(续)

| | 持有股份/ 份额 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|-------------------------------|-------------|----------------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (97.90%) (续) | | | |
| 股票 (97.88%) (续) | | | |
| 美国 (64.64%) (续) | | | |
| Visa Inc - CL A | 22,560 | 61,583,144 | 0.68 |
| Vistra Corp | 22,100 | 27,751,216 | 0.31 |
| Walmart Inc | 105,460 | 91,450,599 | 1.01 |
| Walt Disney Co | 31,600 | 27,982,690 | 0.31 |
| Warner Bros Discovery Inc | 76,934 | 17,257,858 | 0.19 |
| Waste Connections Inc | 26,300 | 35,897,227 | 0.40 |
| Wells Fargo & Co | 16,000 | 11,606,747 | 0.13 |
| Western Digital Corp | 4,000 | 5,363,450 | 0.06 |
| Yum China Holdings Inc | 1,300 | 483,059 | 0.01 |
| 投资基金 (0.02%) | | | |
| 中国内地和中国香港 (0.02%) | | | |
| HKT Trust & HKT Ltd | 141,000 | <u>1,622,910</u> | <u>0.02</u> |
| 上市 / 挂牌投资总额 | | <u>8,868,717,941</u> | <u>97.90</u> |

投资报告

于 2025 年 12 月 31 日 (续)

投资组合 (续)

东亚联丰环球股票基金 (续)

| 相关投资 | 对手方 | 未行使合约的 名义金额 | 公允价值 港元 | 占资产净值 百分比 |
|------------------------|------------------------|------------------|----------------------|---------------|
| 衍生金融工具 (-0.03%) | | | | |
| 买入港元 / 卖出美元 | Citibank, Hong Kong | 港元 2,959,455,600 | <u>(2,689,584)</u> | <u>(0.03)</u> |
| 衍生金融工具总额 | | | <u>(2,689,584)</u> | <u>(0.03)</u> |
| 其他资产净值 | | | <u>193,160,081</u> | <u>2.13</u> |
| 投资总额, 按成本计算 | | | <u>7,302,362,639</u> | |
| 资产净值总额 | | | <u>9,059,188,438</u> | <u>100.00</u> |

注： 投资按交易日期入账。

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区投资级别债券基金

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|-----------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (99.07%) | | | |
| 债券 (99.07%) | | | |
| <i>以澳元计价 (0.44%)</i> | | | |
| Airservices Australia 5.35% 15/11/2037 | 200,000 | 1,022,084 | 0.11 |
| Electricite de France SA 6.627% 28/08/2045 | 600,000 | 3,139,418 | 0.33 |
| <i>以欧元计价 (3.57%)</i> | | | |
| AIA Group Ltd 0.88% 09/09/2033 | 650,000 | 5,653,078 | 0.60 |
| CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd 1.00% 02/11/2033 | 500,000 | 3,789,005 | 0.40 |
| Foxconn Singapore Pte Ltd 3.125% 04/11/2031 | 850,000 | 7,644,761 | 0.81 |
| Indonesia Government International Bond 1.40% 30/10/2031 | 1,350,000 | 11,050,639 | 1.18 |
| State Grid Overseas Investment BVI Ltd 2.125% 02/05/2030 | 600,000 | 5,405,076 | 0.58 |
| <i>以人民币计价 (1.28%)</i> | | | |
| Airport Authority 3.40% 14/01/2055 | 1,400,000 | 1,755,509 | 0.19 |
| Huafa 2024 I Co Ltd 3.05% 17/10/2028 | 4,200,000 | 4,656,320 | 0.50 |
| Swire Properties MTN Financing Ltd 3.45% 22/07/2035 | 1,000,000 | 1,147,806 | 0.12 |
| Temasek Financial I Ltd 2.55% 30/07/2055 | 2,000,000 | 2,145,432 | 0.23 |
| Tencent Holdings Ltd 3.10% 23/09/2055 | 2,000,000 | 2,274,618 | 0.24 |
| <i>以美元计价 (93.78%)</i> | | | |
| AAC Technologies Holdings Inc 3.75% 02/06/2031 | 800,000 | 5,949,584 | 0.63 |
| Adani Electricity Mumbai Ltd 3.867% 22/07/2031 | 350,000 | 2,503,504 | 0.27 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区投资级别债券基金(续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|--|-----------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (99.07%) (续) | | | |
| 债券 (99.07%) (续) | | | |
| <i>以美元计价 (93.78%) (续)</i> | | | |
| Adani International Container Terminal Pvt Ltd 3.00% 16/02/2031 | 765,000 | 5,544,613 | 0.59 |
| Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 3.10% 02/02/2031 | 600,000 | 4,204,210 | 0.45 |
| Adani Transmission Step-One Ltd 4.25% 21/05/2036 | 665,000 | 4,683,795 | 0.50 |
| AIA Group Ltd 5.40% 30/09/2054 | 1,600,000 | 12,233,661 | 1.30 |
| Alibaba Group Holding Ltd 2.70% 09/02/2041 | 2,200,000 | 12,779,408 | 1.36 |
| Alibaba Group Holding Ltd 4.40% 06/12/2057 | 550,000 | 3,581,315 | 0.38 |
| Alibaba Group Holding Ltd 4.50% 28/11/2034 | 1,300,000 | 10,044,323 | 1.07 |
| Alibaba Group Holding Ltd 5.625% 26/11/2054 | 200,000 | 1,588,609 | 0.17 |
| Bangkok Bank PCL/Hong Kong 5.65% 05/07/2034 | 1,000,000 | 8,377,781 | 0.89 |
| Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 5.28% 05/04/2029 | 700,000 | 5,663,296 | 0.60 |
| Bright Galaxy International Ltd 3.25% 15/07/2026 | 750,000 | 5,851,492 | 0.62 |
| CCBL Cayman 1 Corp Ltd 3.875% 16/05/2029 | 50,000 | 386,397 | 0.04 |
| CFAMC II Co Ltd 4.625% 03/06/2026 | 900,000 | 7,032,025 | 0.75 |
| Chang Development International Ltd 6.25% 26/03/2028 | 450,000 | 3,655,120 | 0.39 |
| China Cinda 2020 I Management Ltd 3.25% 28/01/2027 | 600,000 | 4,687,855 | 0.50 |
| China Cinda 2020 I Management Ltd 4.375% 13/11/2028 | 400,000 | 3,146,037 | 0.34 |
| China Cinda 2020 I Management Ltd 5.375% 23/07/2027 | 700,000 | 5,655,870 | 0.60 |
| China Cinda 2020 I Management Ltd 5.75% 28/05/2029 | 1,300,000 | 10,566,398 | 1.12 |

投资报告

于 2025 年 12 月 31 日 (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚太区投资级别债券基金 (续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|-----------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (99.07%) (续) | | | |
| 债券 (99.07%) (续) | | | |
| <i>以美元计价 (93.78%) (续)</i> | | | |
| China Great Wall International Holdings VI Ltd 5.25% 23/04/2028 | 750,000 | 6,004,557 | 0.64 |
| China Ping An Insurance Overseas Holdings Ltd 6.125% 16/05/2034 | 1,650,000 | 13,974,679 | 1.49 |
| Chongqing Nan'an Urban Construction & Development Group Co Ltd 4.50% 17/08/2026 | 500,000 | 3,947,788 | 0.42 |
| CITIC Ltd 2.85% 25/02/2030 | 600,000 | 4,501,203 | 0.48 |
| CITIC Ltd 3.50% 17/02/2032 | 700,000 | 5,254,306 | 0.56 |
| CK Hutchison International 21 Ltd 3.125% 15/04/2041 | 900,000 | 5,440,596 | 0.58 |
| CK Hutchison International 24 Ltd 5.50% 26/04/2034 | 550,000 | 4,523,224 | 0.48 |
| CMB International Leasing Management Ltd 2.875% 04/02/2031 | 450,000 | 3,332,136 | 0.35 |
| CNAC HK Finbridge Co Ltd 3.00% 22/09/2030 | 350,000 | 2,590,464 | 0.28 |
| CNAC HK Finbridge Co Ltd 3.70% 22/09/2050 | 1,000,000 | 5,985,624 | 0.64 |
| CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.125% 19/07/2027 | 1,950,000 | 15,473,971 | 1.65 |
| CNOOC Finance 2013 Ltd 3.30% 30/09/2049 | 1,950,000 | 11,806,695 | 1.26 |
| Development Bank of the Philippines 2.375% 11/03/2031 | 1,500,000 | 10,687,714 | 1.14 |
| Export-Import Bank of India 2.25% 13/01/2031 | 1,050,000 | 7,466,224 | 0.79 |
| Far East Horizon Ltd 5.875% 05/03/2028 | 750,000 | 6,039,898 | 0.64 |
| Far East Horizon Ltd 6.00% 01/10/2028 | 550,000 | 4,442,184 | 0.47 |
| First Abu Dhabi Bank PJSC 5.875% Perpetual Callable - 28/05/2031 | 750,000 | 5,907,587 | 0.63 |
| Freeport Indonesia PT 4.763% 14/04/2027 | 600,000 | 4,730,189 | 0.50 |

投资报告

于 2025 年 12 月 31 日 (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚太区投资级别债券基金 (续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|--|-----------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (99.07%) (续) | | | |
| 债券 (99.07%) (续) | | | |
| <i>以美元计价 (93.78%) (续)</i> | | | |
| Freeport Indonesia PT 5.315% 14/04/2032 | 1,850,000 | 14,811,407 | 1.58 |
| Fubon Life Singapore Pte Ltd 5.45% 10/12/2035 | 600,000 | 4,840,621 | 0.52 |
| FWD Group Holdings Ltd 5.252% 22/09/2030 | 250,000 | 1,983,085 | 0.21 |
| FWD Group Holdings Ltd 5.836% 22/09/2035 | 800,000 | 6,383,082 | 0.68 |
| FWD Group Holdings Ltd 7.635% 02/07/2031 | 900,000 | 8,029,668 | 0.85 |
| Gaci First Investment Co 5.375% 29/01/2054 | 650,000 | 4,770,561 | 0.51 |
| GC Treasury Center Co Ltd 2.98% 18/03/2031 | 1,950,000 | 13,981,440 | 1.49 |
| Great Eastern Life Assurance Co Ltd 5.398% Perpetual Callable - 22/01/2032 | 1,250,000 | 10,088,977 | 1.07 |
| Hongkong International Qingdao Co Ltd 5.40% 09/04/2028 | 600,000 | 4,806,043 | 0.51 |
| Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd 5.25% 14/07/2033 | 800,000 | 6,586,357 | 0.70 |
| HPHT Finance 25 Ltd 5.00% 21/02/2030 | 1,200,000 | 9,660,334 | 1.03 |
| India Vehicle Finance 5.85% 25/03/2029 | 484,000 | 3,832,554 | 0.41 |
| Indonesia Asahan Aluminium PT / Mineral Industri Indonesia Persero PT 5.45% 15/05/2030 | 1,750,000 | 14,147,079 | 1.51 |
| Indonesia Government International Bond 5.45% 20/09/2052 | 600,000 | 4,725,112 | 0.50 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区投资级别债券基金(续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|---|-----------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (99.07%) (续) | | | |
| 债券 (99.07%) (续) | | | |
| <i>以美元计价 (93.78%) (续)</i> | | | |
| Indonesia Government International Bond 6.625% 17/02/2037 | 500,000 | 4,542,018 | 0.48 |
| ITOCHU Corp 1.564% 30/03/2026 | 600,000 | 4,660,959 | 0.50 |
| JSW Infrastructure Ltd 4.95% 21/01/2029 | 600,000 | 4,779,984 | 0.51 |
| Korea Investment & Securities Co Ltd 6.875% 06/11/2026 | 2,450,000 | 19,656,779 | 2.09 |
| Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp 4.125% 20/04/2027 | 450,000 | 3,530,752 | 0.38 |
| Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp 5.125% 08/05/2029 | 350,000 | 2,819,721 | 0.30 |
| Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp 5.375% 11/05/2028 | 300,000 | 2,420,103 | 0.26 |
| Korea Water Resources Corp 4.375% 21/05/2027 | 150,000 | 1,181,115 | 0.13 |
| KT Corp 4.375% 03/01/2029 | 325,000 | 2,601,356 | 0.28 |
| KT&G Corp 5.00% 02/05/2028 | 200,000 | 1,600,729 | 0.17 |
| Mega Advance Investments Ltd 6.375% 12/05/2041 | 1,500,000 | 12,948,509 | 1.38 |
| Meituan 4.50% 02/04/2028 | 2,100,000 | 16,588,475 | 1.77 |
| Metropolitan Bank & Trust Co 5.50% 06/03/2034 | 300,000 | 2,475,734 | 0.26 |
| Minejesa Capital BV 5.625% 10/08/2037 | 1,900,000 | 14,999,544 | 1.60 |
| Mirae Asset Securities Co Ltd 4.375% 14/10/2028 | 700,000 | 5,500,847 | 0.59 |
| Mirae Asset Securities Co Ltd 5.25% 06/03/2028 | 650,000 | 5,238,070 | 0.56 |
| Mirae Asset Securities Co Ltd 5.50% 31/07/2027 | 1,100,000 | 8,911,676 | 0.95 |
| Momentive Performance Materials Inc 4.125% 22/10/2028 | 700,000 | 5,484,876 | 0.58 |

投资报告

于 2025 年 12 月 31 日 (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚太区投资级别债券基金 (续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|--|-----------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (99.07%) (续) | | | |
| 债券 (99.07%) (续) | | | |
| <i>以美元计价 (93.78%) (续)</i> | | | |
| MTR Corp CI Ltd 4.875% Perpetual Callable - 24/09/2030 | 1,300,000 | 10,299,340 | 1.10 |
| MTR Corp CI Ltd 5.625% Perpetual Callable - 24/09/2035 | 1,950,000 | 15,967,269 | 1.70 |
| Nanshan Life Pte Ltd 5.875% 17/03/2041 | 650,000 | 5,182,526 | 0.55 |
| NH Investment & Securities Co Ltd 4.75% 10/07/2030 | 350,000 | 2,819,659 | 0.30 |
| Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 5.52% 21/05/2034 | 500,000 | 4,053,696 | 0.43 |
| Pertamina Hulu Energi PT 5.25% 21/05/2030 | 900,000 | 7,191,855 | 0.77 |
| Pertamina Persero PT 3.10% 27/08/2030 | 500,000 | 3,688,326 | 0.39 |
| Pertamina Persero PT 6.45% 30/05/2044 | 200,000 | 1,672,493 | 0.18 |
| Pertamina Persero PT 6.50% 07/11/2048 | 3,954,000 | 33,287,253 | 3.54 |
| Petronas Capital Ltd 5.848% 03/04/2055 | 975,000 | 8,102,487 | 0.86 |
| Philippine Government International Bond 5.50% 17/01/2048 | 1,400,000 | 11,216,885 | 1.19 |
| PLDT Inc 3.45% 23/06/2050 | 1,650,000 | 9,287,974 | 0.99 |
| POSCO Holdings Inc 5.125% 07/05/2030 | 400,000 | 3,212,956 | 0.34 |
| QIC Cayman Ltd 6.15% Perpetual Callable - 10/04/2031 | 1,100,000 | 8,953,398 | 0.95 |
| REC Ltd 2.25% 01/09/2026 | 600,000 | 4,643,430 | 0.49 |
| Reliance Industries Ltd 2.875% 12/01/2032 | 850,000 | 6,144,824 | 0.65 |
| Reliance Industries Ltd 4.875% 10/02/2045 | 850,000 | 6,349,371 | 0.68 |
| RLGH Finance Bermuda Ltd 6.875% Perpetual Callable - 19/05/2032 | 500,000 | 3,969,819 | 0.42 |
| Sands China Ltd 3.25% 08/08/2031 | 850,000 | 6,187,320 | 0.66 |
| Sands China Ltd 5.40% 08/08/2028 | 1,300,000 | 10,532,593 | 1.12 |
| Saudi Arabian Oil Co 6.375% 02/06/2055 | 550,000 | 4,505,009 | 0.48 |
| SF Holding Investment 2021 Ltd 3.125% 17/11/2031 | 650,000 | 4,786,827 | 0.51 |
| Shinhan Bank Co Ltd 5.75% 15/04/2034 | 1,200,000 | 9,935,620 | 1.06 |

投资报告

于 2025 年 12 月 31 日 (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚太区投资级别债券基金 (续)

| | 名义价值 | 市值 HK\$ | 占资产净 值百分比 |
|--|-----------|------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (99.07%) (续) | | | |
| 债券 (99.07%) (续) | | | |
| <i>以美元计价 (93.78%) (续)</i> | | | |
| Sinochem Offshore Capital Co Ltd 2.375% 23/09/2031 | 800,000 | 5,622,891 | 0.60 |
| Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 3.44% 12/11/2049 | 700,000 | 4,313,983 | 0.46 |
| SK Battery America Inc 4.875% 23/01/2027 | 350,000 | 2,798,828 | 0.30 |
| SK hynix Inc 4.25% 11/09/2028 | 300,000 | 2,375,109 | 0.25 |
| SK hynix Inc 4.375% 11/09/2030 | 700,000 | 5,525,694 | 0.59 |
| SK Hynix Inc 5.50% 16/01/2027 | 400,000 | 3,234,940 | 0.34 |
| SK Hynix Inc 5.50% 16/01/2029 | 400,000 | 3,300,944 | 0.35 |
| SNB Funding Ltd 6.00% 24/06/2035 | 450,000 | 3,611,105 | 0.38 |
| State Bank of India/London 4.50% 09/09/2030 | 600,000 | 4,750,983 | 0.51 |
| Sumitomo Life Insurance Co 5.875% 10/09/2055 | 1,200,000 | 9,619,414 | 1.02 |
| Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 6.45% Perpetual Callable - 05/06/2035 | 200,000 | 1,587,706 | 0.17 |
| Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 6.60% Perpetual Callable - 05/06/2034 | 1,600,000 | 12,910,098 | 1.37 |
| Sumitomo Mitsui Financial Group Inc FRN 08/07/2031 | 1,000,000 | 7,933,599 | 0.84 |
| Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd 2.875% 21/01/2030 | 850,000 | 6,366,864 | 0.68 |
| Tata Capital Ltd 5.389% 21/07/2028 | 550,000 | 4,472,926 | 0.48 |
| Tencent Holdings Ltd 3.68% 22/04/2041 | 600,000 | 3,973,614 | 0.42 |
| Tencent Holdings Ltd 3.84% 22/04/2051 | 800,000 | 5,004,226 | 0.53 |

投资报告

于 2025 年 12 月 31 日 (续)

投资组合 (续)

东亚联丰亚太区投资级别债券基金 (续)

| | 名义价值 | 市值 港元 | 占资产净 值百分比 |
|--|-----------|--------------------|--------------|
| 上市 / 挂牌投资 (99.07%) (续) | | | |
| 债券 (99.07%) (续) | | | |
| <i>以美元计价 (93.78%) (续)</i> | | | |
| Tencent Holdings Ltd 3.925% 19/01/2038 | 650,000 | 4,805,056 | 0.51 |
| Tencent Music Entertainment Group 2.00% 03/09/2030 | 2,050,000 | 14,521,952 | 1.55 |
| Thaioil Treasury Center Co Ltd 3.50% 17/10/2049 | 700,000 | 3,905,797 | 0.42 |
| Thaioil Treasury Center Co Ltd 3.75% 18/06/2050 | 1,724,000 | 9,921,607 | 1.06 |
| TML Holdings Pte Ltd 4.35% 09/06/2026 | 1,400,000 | 10,900,143 | 1.16 |
| United Overseas Bank Ltd 1.75% 16/03/2031 | 1,000,000 | 7,783,215 | 0.83 |
| United States Treasury Bill 0.00% 13/01/2026 | 3,500,000 | 27,213,231 | 2.90 |
| United States Treasury Note/Bond 3.75% 31/10/2032 | 3,000,000 | 23,256,005 | 2.48 |
| United States Treasury Note/Bond 4.375% 31/12/2029 | 400,000 | 3,197,447 | 0.34 |
| Weibo Corp 3.375% 08/07/2030 | 900,000 | 6,760,446 | 0.72 |
| Wistron Corp 0.00% 23/10/2030 | 300,000 | 2,294,372 | 0.24 |
| Woori Bank 6.375% Perpetual Callable - 24/07/2029 | 2,000,000 | 16,640,209 | 1.77 |
| Xiaomi Best Time International Ltd 4.10% 14/07/2051 | 1,800,000 | 11,495,015 | 1.22 |
| 上市 / 挂牌投资总额 | | 930,603,994 | 99.07 |

投资报告

于2025年12月31日(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区投资级别债券基金(续)

| 相关投资 | 对手方 | 未行使合约的 名义金额 | 公允价值 港元 | 占资产净值 百分比 |
|------------------------|------------------------|----------------|--------------------|---------------|
| 衍生金融工具 (-0.03%) | | | | |
| 买入港元 / 卖出澳元 | Citibank, Hong Kong | 港元 3,399,594 | (22,823) | (0.00) |
| 买入港元 / 卖出欧元 | Citibank, Hong Kong | 港元 31,994,550 | (10,710) | (0.00) |
| 买入港元 / 卖出人民币 | Citibank, Hong Kong | 港元 11,337,091 | (101,807) | (0.01) |
| 买入港元 / 卖出美元 | Citibank, Hong Kong | 港元 294,000,000 | (176,978) | (0.02) |
| 衍生金融工具总额 | | | <u>(312,318)</u> | <u>(0.03)</u> |
| 其他资产净值 | | | <u>9,029,603</u> | <u>0.96</u> |
| 投资总额, 按成本计算 | | | <u>907,606,133</u> | |
| 资产净值总额 | | | <u>939,321,279</u> | <u>100.00</u> |

注: 投资按交易日期入账。

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

投资组合变动表

东亚联丰亚洲策略增长基金

| | 占资产净值百分比 | |
|----------------|--------------|--------------|
| | 2025 年 | 2024 年 |
| 股票： | | |
| 澳洲 | 1.64 | 2.56 |
| 中国内地和中国香港 | 36.27 | 31.04 |
| 印度 | 7.15 | 23.73 |
| 印尼 | - | 1.01 |
| 韩国 | 22.07 | 5.08 |
| 菲律宾 | 1.64 | 2.31 |
| 新加坡 | 3.13 | 5.51 |
| 中国台湾 | 22.18 | 18.22 |
| 美国 | 3.14 | 6.38 |
| 权利： | | |
| 中国台湾 | 0.01 | - |
| 衍生金融工具： | | |
| 外币远期合约 | - | 0.04 |
| | <u>97.23</u> | <u>95.88</u> |

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

投资组合变动表 (续)

东亚联丰环球债券基金

| | 占资产净值百分比 | |
|----------------|--------------|--------------|
| | 2025 年 | 2024 年 |
| 债券： | | |
| 澳元 | 2.70 | 2.14 |
| 英镑 | 7.84 | 4.66 |
| 加拿大元 | 2.43 | 1.93 |
| 欧元 | 19.95 | 18.84 |
| 日元 | 4.90 | 6.90 |
| 马来西亚林吉特 | 0.54 | - |
| 墨西哥比索 | 2.23 | 0.51 |
| 新西兰元 | 0.22 | 0.21 |
| 挪威克朗 | 0.06 | 0.06 |
| 人民币 | 9.57 | 8.84 |
| 新加坡元 | 1.45 | 0.19 |
| 美元 | 45.97 | 54.58 |
| 衍生金融工具： | | |
| 外币远期合约 | (0.05) | 0.18 |
| | <u>97.81</u> | <u>99.04</u> |

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

投资组合变动表 (续)

东亚联丰环球股票基金

| | 占资产净值百分比 | |
|----------------|--------------|--------------|
| | 2025 年 | 2024 年 |
| 股票： | | |
| 澳洲 | 1.19 | 1.28 |
| 奥地利 | 0.13 | - |
| 比利时 | 0.03 | 0.04 |
| 巴西 | 0.03 | 0.10 |
| 加拿大 | 2.28 | 2.72 |
| 中国内地和中国香港 | 2.85 | 2.59 |
| 丹麦 | 0.42 | 0.62 |
| 芬兰 | 0.05 | 0.08 |
| 法国 | 3.36 | 3.72 |
| 德国 | 1.92 | 2.33 |
| 印度 | 1.51 | 1.55 |
| 印尼 | - | 0.02 |
| 意大利 | 0.49 | 0.26 |
| 日本 | 4.27 | 4.50 |
| 韩国 | 1.37 | 0.83 |
| 马来西亚 | 0.39 | 0.13 |
| 墨西哥 | 0.05 | 0.06 |
| 荷兰 | 1.73 | 1.65 |
| 新西兰 | 0.03 | 0.05 |
| 挪威 | 0.15 | - |
| 菲律宾 | 0.04 | 0.04 |
| 新加坡 | 0.15 | 0.20 |
| 南非 | 0.11 | 0.11 |
| 西班牙 | 1.35 | 0.74 |
| 瑞典 | 1.55 | 0.94 |
| 瑞士 | 2.02 | 1.85 |
| 中国台湾 | 2.32 | 1.68 |
| 泰国 | 0.37 | 0.20 |
| 英国 | 3.08 | 3.35 |
| 美国 | 64.64 | 66.70 |
| 投资基金： | | |
| 中国内地和中国香港 | 0.02 | 0.05 |
| 衍生金融工具： | | |
| 外币远期合约 | (0.03) | (0.01) |
| | <u>97.87</u> | <u>98.38</u> |

投资报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

投资组合变动表 (续)

东亚联丰亚太区投资级别债券基金

| | 占资产净值百分比 | |
|----------------|--------------|--------------|
| | 2025 年 | 2024 年 |
| 债券： | | |
| 澳元 | 0.44 | - |
| 欧元 | 3.57 | - |
| 人民币 | 1.28 | - |
| 美元 | 93.78 | 99.67 |
| 衍生金融工具： | | |
| 外币远期合约 | (0.03) | 0.02 |
| | <u>99.04</u> | <u>99.69</u> |

受托人报告

致东亚联丰资本增长基金 (“本基金”) 份额持有人

我们谨此确认：

- (1) 我们认为，本基金及其子基金 (“子基金”) 基金管理人于截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间在所有重大方面均按照于 2000 年 9 月 22 日订立的信托契约以及于 2019 年 12 月 31 日经修订和重述的信托契约之规定管理本基金及子基金。
- (2) 我们并未发现保管人、基金管理人或其受委派代表于截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间存在任何未能履行其就本基金所须承担的责任之情况，除非此类未履行责任的情况已于早前向香港强制性公积金计划管理局 (“积金局”) 报告；
- (3) 我们并未发现于截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间内发生的与本基金和子基金相关且尚未向积金局报告的任何重大事件；
- (4) 截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间，本基金在所有重大方面均已遵守法律文件、《香港强制公积金计划条例》、《香港强制公积金计划 (一般) 规例》、香港证券及期货事务监察委员会颁布的《香港强积金投资基金披露守则》、《单位信托及互惠基金守则》及积金局颁布的其他相关指引之规定，但先前已向积金局报告的任何不合规情况除外；
- (5) 截至 2025 年 12 月 31 日年度期间，本基金和子基金并无未向积金局报告的任何重大变动；及
- (6) 截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间，我们已对所有为本基金和子基金而任命或聘用的人员进行监督及执行适当控制措施。

授权代表

东亚银行 (信托) 有限公司

2026 年 4 月 23 日

独立审计师报告

致东亚联丰资本增长基金 (“贵基金”) 份额持有人

财务报表审计报告

意见

本审计师 (以下简称“我们”) 已审计载列于第 92 至 159 页的贵基金子基金 (以下简称“贵子基金”) 的财务报表, 此财务报表包括于 2025 年 12 月 31 日的资产负债表与截至该日止年度 / 期间的全面收益表、基金份额持有人应占资产净值变动表和现金流量表, 以及财务报表附注, 包括重要会计政策及其他解释性资料。

我们认为, 该等财务报表已根据香港会计师公会 (“香港会计师公会”) 颁布的香港财务报告会计准则真实而中肯地反映贵子基金于 2025 年 12 月 31 日的财务状况及截至该日止年度 / 期间的财务交易及现金流量。

意见的基础

我们已根据香港会计师公会颁布的《香港审计准则》并参照《实务说明》860.1 (修订本) - “退休计划审计”进行审计。我们在该等准则下承担的责任已在本报告“审计师就审计财务报表承担的责任”部分中作进一步阐述。根据香港会计师公会颁布的《专业会计师道德守则》(以下简称“守则”), 我们独立于贵基金, 并已履行守则中的其他专业道德责任。我们相信, 我们所获得的审计凭证能充足及适当地为我们的审计意见提供基础。

财务报表及其审计师报告以外的信息

基金管理人及贵基金受托人需对其他信息负责。其他信息包括刊载于年报内的全部信息, 但不包括财务报表及我们的审计师报告。

我们对财务报表的意见并不涵盖其他信息, 我们亦不对该等其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计, 我们的责任是阅读其他信息, 在此过程中, 考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中所了解的情况存在重大抵触或者似乎存在重大错误陈述的情况。

基于我们已执行的工作, 如果我们认为其他信息存在重大错误陈述, 我们需要报告该事实。在这方面, 我们没有任何报告。

独立审计师报告

致东亚联丰资本增长基金 (“贵基金”) 份额持有人 (续)

财务报表审计报告 (续)

基金管理人及受托人就财务报表须承担的责任

基金管理人及贵基金受托人须负责根据香港会计师公会颁布的香港财务报告会计准则拟备真实而中肯的财务报表，并对其认为为使财务报表的拟备不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述所需的内部控制负责。

在拟备财务报表时，基金管理人及贵基金受托人负责评估贵子基金持续经营的能力，并在适用情况下披露与持续经营有关的事项，以及使用持续经营为会计基础，除非基金管理人及贵基金受托人有意将贵子基金清盘或停止经营，或别无其他实际的替代方案。东亚联丰货币市场基金于 2025 年 12 月 11 日停止运营，且已作全额赎回。贵基金受托人认为，东亚联丰货币市场基金已不再持续经营，并已根据附注 2(b) 所载列的基准编制本财务报表。

此外，基金管理人及贵基金受托人须确保财务报表根据于 2000 年 9 月 22 日订立的《信托契约》和于 2019 年 12 月 31 日订立的经修订及重述《信托契约》、《强制性公积金计划条例》(“《强积金计划条例》”)、《强制性公积金计划 (一般) 规例》(“《一般规例》”)、《强积金投资基金披露守则》(“《强积金守则》”) 和强制性公积金计划管理局 (“积金局”) 颁布的《强积金管理局指引》第 II.5 号以及香港证券及期货事务监察委员会 (“香港证监会”) 颁布的《单位信托及互惠基金守则》(“《证监会守则》”) 附录 E 所列的相关披露要求妥为编制。

基金管理人及受托人负责监督贵基金的财务报告过程。

审计师就审计财务报表承担的责任

我们的目标，是对财务报表整体是否不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述取得合理保证，并出具包括我们意见的审计师报告。本报告乃根据积金局颁布的《强积金守则》第 C2.2 条以及《一般规例》第 102 条，仅向贵基金报告。除此以外，我们的报告不可用作其他用途。我们概不就本报告的内容，对任何其他人士负责或承担法律责任。

独立审计师报告

致东亚联丰资本增长基金 (“贵基金”) 份额持有人 (续)

财务报表审计报告 (续)

审计师就审计财务报表承担的责任 (续)

合理保证是高水平的保证，但不能保证按照《香港审计准则》进行的审计，在某一重大错误陈述存在时总能发现。错误陈述可以由欺诈或错误引起，如果合理预期它们单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依赖财务报表所作出的经济决定，则有关的错误陈述可被视作重大。此外，我们亦须评估贵基金的财务报表是否在所有重大方面均已根据贵基金《信托契约》、《强积金计划条例》、《一般规例》、积金局颁布的《强积金守则》和《强积金管理局指引》第 II.5 号以及香港证监会颁布的《证监会守则》之相关披露规定妥为编制。

在根据《香港审计准则》进行审计的过程中，我们运用了专业判断，保持了专业怀疑态度。我们亦：

- 识别和评估由于欺诈或错误而导致财务报表存在重大错误陈述的风险，设计及执行审计程序以应对这些风险，以及获取充足和适当的审计凭证，作为我们意见的基础。由于欺诈可能涉及串谋、伪造、蓄意遗漏、虚假陈述，或凌驾于内部控制之上，因此未能发现因欺诈而导致的重大错误陈述的风险高于未能发现因错误而导致的重大错误陈述的风险。
- 了解与审计相关的内部控制，以设计适当的审计程序，但目的并非对贵基金内部控制的有效性发表意见。
- 评价基金管理人及贵基金受托人所采用会计政策的恰当性及作出会计估计和相关披露的合理性。
- 对基金管理人及贵基金受托人采用持续经营会计基础的恰当性作出结论。根据所获取的审计凭证，确定是否存在与事项或情况有关的重大不确定性，从而可能导致对贵子基金的持续经营能力产生重大疑虑。如果我们认为存在重大不确定性，则有必要在审计师报告中提请使用者注意财务报表中的相关披露。假若有关的披露不足，则我们应当发表非无保留意见。我们的结论是基于审计师报告日止所取得的审计凭证。然而，未来事项或情况可能导致贵子基金不能持续经营。

独立审计师报告

致东亚联丰资本增长基金 (“贵基金”) 份额持有人 (续)

财务报表审计报告 (续)

审计师就审计财务报表承担的责任 (续)

- 评价财务报表的整体列报方式、结构和内容，包括披露，以及财务报表是否中肯反映交易和事项。

除其他事项外，我们与基金管理人及贵基金受托人沟通了计划的审计范围、时间安排、重大审计发现等，包括我们在审计中识别出内部控制的任何重大缺陷。

根据《信托契约》、《强积金计划条例》、《一般规例》、积金局颁布的《强积金守则》和《强积金管理局指引》第 II.5 号以及香港证监会颁布的《证监会守则》之相关披露规定的报告

- (a) 我们认为，该等财务报表在所有重大方面均已根据《信托契约》、《强积金计划条例》、《一般规例》、积金局颁布的《强积金守则》和《强积金管理局指引》第 II.5 号以及香港证监会颁布的《证监会守则》附录 E 之相关规定妥为编制；及
- (b) 就我们所知及所信，我们已获得进行审计工作所需的一切资料及解释。

出具本独立审计师报告的审计项目合伙人是李楠燊 (执业证书编号：P08066)。

执业会计师

香港中环
遮打道 10 号
太子大厦 8 楼

2026 年 4 月 23 日

独立审计师鉴证报告

致东亚联丰资本增长基金 (“贵基金”) 份额持有人

我们已按照香港会计师公会 (“香港会计师公会”) 所颁布的《香港审计准则》并参照《实务说明》860.1 (修订本) - “退休计划审计”对截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间贵基金子基金 (以下简称“贵子基金”) 的财务报表进行审计工作, 并于 2026 年 4 月 21 日对此发表无保留意见的审计师报告。

根据强制性公积金计划管理局 (“积金局”) 颁布的《强积金管理局指引》第 II.5 号和《强积金投资基金披露守则》 (“《强积金守则》”), 我们须报告贵子基金是否符合《强制性公积金计划条例》 (“《强积金计划条例》”) 和《强制性公积金计划 (一般) 规例》 (“《一般规例》”) (通过《强积金守则》适用于贵子基金) 之若干规定。

受托人的责任

《一般规例》规定受托人须确保:

- (a) 就贵子基金的资产及所有与贵子基金相关的财务交易事项, 均有妥善保存的会计纪录和其他纪录;
- (b) 贵子基金均符合积金局根据《强积金计划条例》第 28 条 就受禁制投资活动所指明的指引, 以及《一般规例》第 37(2) 条、51 条、52 条和附表 1 所订明的规定 (通过《强积金投资基金披露守则》适用于贵子基金); 及
- (c) 除《一般规例》第 65 条所允许的情况以外, 贵子基金的资产并无任何产权负担。

本所的独立性和质量管理

本所遵守香港会计师公会颁布的《职业会计师道德守则》的独立性和其他道德要求, 有关要求是基于诚信、客观、专业胜任能力和应有的审慎、保密及专业行为的基本原则而制定的。

本所采用《香港质量管理准则》第 1 号, 该准则要求本所设计、实施和运行质量管理体系, 其中包括符合道德要求、专业标准和适用法律法规要求的政策或程序。

审计师的责任

我们的责任是按照积金局颁布的《强积金守则》第 C2.2 条以及《一般规例》第 102 条的规定, 根据我们已执行程序的结果, 仅向贵基金报告贵子基金是否遵守上述规定。除此以外, 我们的报告不可用作其他用途。我们概不就本报告的内容, 对任何其他人士负责或承担法律责任。

独立审计师鉴证报告

致东亚联丰资本增长基金 (“贵基金”) 份额持有人 (续)

审计师的责任 (续)

我们是按照香港会计师公会颁布的《香港鉴证业务准则》第 3000 (修订本) “审计或审阅历史财务信息外的鉴证业务”，并参照《实务说明》第 860.1 (修订本) “退休计划审计”开展我们的工作。我们已计划和执行鉴证工作，以就贵子基金是否遵守上述规定获得合理保证。

我们已参照《实务说明》第 860.1 (修订本) 计划并执行我们认为必要的程序，其中包括以测试的方式审查由受托人提供的有关贵子基金遵守上述规定的凭证。

我们相信，我们所获得的凭证能充足及适当地为我们的意见提供基础。

意见

根据以上所述：

1 我们认为：

- (a) 截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间，已就贵子基金的资产及所有与贵子基金相关的财务交易事项，均有妥善保存的会计纪录和其他纪录；及
- (b) 于 2025 年 3 月 31 日、2025 年 9 月 30 日和 2025 年 12 月 31 日，贵子基金在所有重大方面均已符合积金局根据《强积金计划条例》第 28 条就受禁制投资活动所指定的指引，以及《一般规例》第 37(2) 条、51 条、52 条和附表 1 所订明的规定 (通过《强积金守则》适用于贵子基金)。

2 于 2025 年 12 月 31 日，除《一般规例》第 65 条所允许的情况以外 (通过《强积金守则》适用于贵子基金)，贵子基金的资产并无任何产权负担。

独立审计师鉴证报告

致东亚联丰资本增长基金（“贵基金”）份额持有人（续）

目标用户和用途

本报告仅供受托人提交予积金局使用。除此以外，我们的报告不可用作其他用途。

执业会计师

香港中环
遮打道 10 号
太子大厦 8 楼

2026 年 4 月 23 日

资产负债表 于2025年12月31日

| | 附注 | 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | 东亚联丰环球债券基金 | | 东亚联丰环球股票基金 | | 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | |
|---------------------------------|------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|--------------------|----------------------|
| | | 2025年 港元 | 2024年 港元 | 2025年 港元 | 2024年 港元 | 2025年 港元 | 2024年 港元 | 2025年 港元 | 2024年 港元 |
| 资产 | | | | | | | | | |
| 投资 | 6(a), 7, 10(g) | 2,061,094,773 | 1,761,061,656 | 7,191,625,887 | 7,370,909,906 | 8,868,717,941 | 5,766,731,854 | 930,603,994 | 1,094,844,505 |
| 衍生金融工具 | 8 | - | 700,596 | - | 13,593,626 | - | - | - | 177,558 |
| 应收经纪款项 | | - | 9,168,157 | 1,347,217 | 6,149,760 | - | 230,693 | 1,678,245 | 1,610,992 |
| 认购应收款项 | | - | - | 3,718,038 | 1,719,145 | 72,828,233 | 2,116,738 | 117,428 | - |
| 股息和其他应收款 | | 1,902,542 | 975,813 | 50,978 | 49,021 | 3,531,037 | 2,791,401 | 18 | 24 |
| 银行现金 | 10(d) | 62,944,460 | 66,208,063 | 159,779,623 | 64,337,796 | 156,040,579 | 91,893,104 | 7,378,359 | 1,941,925 |
| 资产总额 | | 2,125,941,775 | 1,838,114,285 | 7,356,521,743 | 7,456,759,254 | 9,101,117,790 | 5,863,763,790 | 939,778,044 | 1,098,575,004 |
| 负债 | | | | | | | | | |
| 衍生金融工具 | 8 | - | - | 3,918,688 | - | 2,689,584 | 813,961 | 312,318 | - |
| 应付经纪款项 | | 5,412,405 | - | - | - | - | 231,054 | - | - |
| 赎回应付款项 | | 108,311 | - | 3,343,774 | 558,603 | 35,371,437 | 407,328 | 807 | - |
| 应计费用和其他应付款 | 10(a), 10(b), 10(c) | 691,168 | 543,119 | 287,489 | 277,394 | 3,868,331 | 921,745 | 143,640 | 142,917 |
| 负债总额 (不包括基金份额持有人应占的资产净值) | | 6,211,884 | 543,119 | 7,549,951 | 835,997 | 41,929,352 | 2,374,088 | 456,765 | 142,917 |
| 基金份额持有人应占的资产净值 | | | | | | | | | |
| 金融负债 | | 2,119,729,891 | 1,837,571,166 | 7,348,971,792 | 7,455,923,257 | 9,059,188,438 | 5,861,389,702 | 939,321,279 | 1,098,432,087 |
| 权益 | | - | - | - | - | - | - | - | - |

资产负债表 于2025年12月31日(续)

| | 附注 | 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | 东亚联丰环球债券基金 | | 东亚联丰环球股票基金 | | 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | |
|----------------------------------|----|---------------|---------------|----------------|---------------|----------------|----------------|-----------------|---------------|
| | | 2025年 港元 | 2024年 港元 | 2025年 港元 | 2025年 港元 | 2025年 港元 | 2024年 港元 | 2025年 港元 | 2024年 港元 |
| 代表: | | | | | | | | | |
| 基金份额持有人应占的资产净值 | 4 | 2,119,729,891 | 1,837,571,166 | 7,348,971,792 | 939,321,279 | 9,059,188,438 | 5,861,389,702 | 939,321,279 | 1,098,432,087 |
| 份额发行数量 | 4 | | | | | | | | |
| - A类别 | | 3,096,536.378 | 3,664,311.782 | 32,599,023.111 | 5,875,915.572 | 4,352,463.288 | 9,716,809.974 | 5,875,915.572 | 7,438,662.231 |
| - D类别 | | - | - | - | - | - | - | - | - |
| - I类别 | | - | - | 32,064,279.285 | - | 11,886,075.184 | 11,216,496.354 | - | - |
| - I(2)类别 ⁽²⁾⁽³⁾⁽⁵⁾⁽⁶⁾ | | - | - | - | - | 15,649,243.305 | 1,169,283.060 | - | - |
| - I(3)类别 | | 131,816.771 | 302,962.371 | - | - | - | - | - | - |
| - R类别 ⁽¹⁾ | | - | - | - | 28,203.372 | 282,258.237 | 213,666.955 | 28,203.372 | 27,568.073 |
| - R(2)类别 ⁽¹⁾⁽⁴⁾ | | 131,712.929 | 154,097.281 | 282,324.895 | - | 1,066,535.490 | - | - | - |
| - R(3)类别 ⁽¹⁾⁽³⁾ | | - | - | - | - | 16,723,539.230 | 12,710.240 | - | - |
| 每份额资产净值 | 4 | | | | | | | | |
| - A类别 | | 659.55 | 479.42 | 121.53 | 159.27 | 387.37 | 324.08 | 159.27 | 147.24 |
| - D类别 | | - | - | - | - | - | - | - | - |
| - I类别 | | - | - | 104.76 | - | 272.22 | 227.67 | - | - |
| - I(2)类别 ⁽²⁾⁽³⁾⁽⁵⁾⁽⁶⁾ | | - | - | - | - | 120.65 | 100.98 | - | - |
| - I(3)类别 | | 128.77 | 94.38 | - | - | - | - | - | - |
| - R类别 ⁽¹⁾ | | - | - | - | 123.74 | 216.29 | 183.97 | 123.74 | 115.66 |
| - R(2)类别 ⁽¹⁾⁽⁴⁾ | | 458.91 | 339.04 | 99.08 | - | 89.81 | - | - | - |
| - R(3)类别 ⁽¹⁾⁽³⁾ | | - | - | - | - | 125.13 | 106.33 | - | - |

资产负债表

于 2025 年 12 月 31 日 (续)

- (1) 自 2024 年 1 月 15 日起, R 类别基金份额已重组为 R 类别、R(2)类别和 R(3)类别基金份额。R 类别、R(2)类别和 R(3)类别基金份额的计算货币分别为港元、美元及人民币。
- (2) 东亚联丰环球债券基金 I(2)类别于 2024 年 8 月 30 日发行。
- (3) 东亚联丰环球股票基金 I(2)类别和 R(3)类别分别于 2024 年 8 月 30 日和 2024 年 11 月 19 日发行。
- (4) 东亚联丰环球股票基金 R(2) 类别于 2025 年 1 月 6 日发行。
- (5) 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 I(2) 类别于 2025 年 2 月 12 日发行。
- (6) 东亚联丰环球债券基金和东亚联丰亚太区投资级别债券基金 I(2) 类别于 2025 年 4 月 8 日全额赎回。

受托人及基金管理人于 2026 年 4 月 23 日核准并许可发出。

)
) 代表
) 东亚银行 (信托) 有限公司
)
)
)
) 代表
) 东亚联丰投资管理有限公司
)
)

第 100 至第 159 页的附注属本财务报表的一部分。

全面收益表

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间

| 附注 | 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | 东亚联丰环球债券基金 | | 东亚联丰环球股票基金 | | 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | |
|------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|----------------------|----------------------|--------------------|-------------------|-------------------|
| | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 |
| 收入 | | | | | | | | |
| 股息收入 | 38,051,040 | 48,324,254 | - | - | 98,730,387 | 83,839,208 | - | - |
| 银行现金利息 | 10(e) 4,297 | 18,567 | 569,500 | 511,400 | 34,459 | 6,461 | 122,127 | 178,708 |
| 其他收入 | - | - | 786 | 8,104 | 18,663 | 100,286 | 668 | 4,122 |
| 投资收益 / (亏损) 净额 | 9 611,213,134 | 326,052,547 | 520,723,669 | (189,324,130) | 1,136,430,753 | 845,619,377 | 84,508,537 | 48,174,036 |
| 汇兑 (亏损) / 收益 | (10,228,893) | (847,255) | (101,706,428) | 6,415,982 | (56,029,957) | (20,466,693) | (7,613,261) | (1,894,240) |
| 投资收入 / (亏损) 总额 | 639,039,578 | 373,548,113 | 419,587,527 | (182,388,644) | 1,179,184,305 | 909,098,639 | 77,018,071 | 46,462,626 |
| 支出 | | | | | | | | |
| 投资管理费 | 10(a) 943,020 | 975,585 | 298,416 | 329,571 | 18,451,238 | 553,219 | 25,096 | 22,958 |
| 受托人费用 | 10(b) 80,015 | 82,902 | 49,699 | 64,513 | 767,236 | 70,206 | 2,786 | 2,296 |
| 保管费及银行费用 | 10(f) 722,532 | 870,228 | 528,308 | 615,388 | 1,007,796 | 753,292 | 138,501 | 120,112 |
| 审计费用 | 63,333 | 62,166 | 81,333 | 62,166 | 70,833 | 62,166 | 81,333 | 62,166 |
| 基金登记机构费用 | 10(c) 497,670 | 541,364 | 897,265 | 917,328 | 774,474 | 626,219 | 364,863 | 374,432 |
| 营运前支出 | 19 - | - | - | - | - | - | - | - |
| 印刷及出版费用 | 2,242 | 4,744 | 9,226 | 14,922 | 7,408 | 10,495 | 1,137 | 2,211 |
| 法律及专业服务费用 | 132,609 | 152,362 | 33,271 | 61,296 | 328,113 | 434,055 | 4,546 | 9,324 |
| 交易成本 | 20 8,591,464 | 6,823,086 | 21,027 | 10,572 | 7,105,648 | 3,145,025 | - | 497 |
| 其他营运费用 | 12,202 | 12,620 | 6,049 | 6,274 | 5,807 | 5,657 | 11,981 | 12,371 |
| 营运费用总额 | 11,045,087 | 9,525,057 | 1,924,594 | 2,082,030 | 28,518,553 | 5,660,334 | 630,243 | 606,367 |
| 税前利润 / (亏损) | 627,994,491 | 364,023,056 | 417,662,933 | (184,470,674) | 1,150,665,752 | 903,438,305 | 76,387,828 | 45,856,259 |
| 海外税项 (包括预扣税) | 13 (16,503,555) | (18,435,390) | - | (745) | (21,949,250) | (20,031,391) | - | - |
| 营运产生的基金份额持有人应占的资产净值变动 | 611,490,936 | 345,587,666 | 417,662,933 | (184,471,419) | 1,128,716,502 | 883,406,914 | 76,387,828 | 45,856,259 |

第 100 至第 159 页的附注属本财务报表的一部分。

基金份额持有人应占资产净值变动表 / 权益变动表

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间

| | 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | 东亚联丰环球债券基金 | | 东亚联丰环球股票基金 | | 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | |
|------------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|--------------------|----------------------|
| | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 |
| 年初 / 期初基金份额持有人应占的资产净值 | 1,837,571,166 | 2,111,663,528 | 7,455,923,257 | 7,112,478,848 | 5,861,389,702 | 4,707,544,649 | 1,098,432,087 | 1,017,679,896 |
| 认购基金份额所得款项 | 149,573,159 | 105,758,003 | 1,988,399,474 | 2,335,152,006 | 7,547,464,005 | 1,570,694,699 | 61,590,530 | 36,860,521 |
| 赎回基金份额付款 | (478,905,370) | (725,438,031) | (2,513,013,872) | (1,807,236,178) | (5,478,381,771) | (1,300,256,560) | (297,089,166) | (1,964,589) |
| 营运产生的基金份额持有人应占的资产净值变动 | 1,508,238,955 | 1,491,983,500 | 6,931,308,859 | 7,640,394,676 | 7,930,471,936 | 4,977,982,788 | 862,933,451 | 1,052,575,828 |
| | 611,490,936 | 345,587,666 | 417,662,933 | (184,471,419) | 1,128,716,502 | 883,406,914 | 76,387,828 | 45,856,259 |
| 年末 / 期末基金份额持有人应占的资产净值 | <u>2,119,729,891</u> | <u>1,837,571,166</u> | <u>7,348,971,792</u> | <u>7,455,923,257</u> | <u>9,059,188,438</u> | <u>5,861,389,702</u> | <u>939,321,279</u> | <u>1,098,432,087</u> |

第 100 至第 159 页的附注属本财务报表的一部分。

基金份额持有人应占资产净值变动表 / 权益变动表

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

(以份额列示)

| | 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | 东亚联丰环球债券基金 | | 东亚联丰环球股票基金 | | 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | |
|----------------|---------------|-----------------|------------------|------------------|------------------|-----------------|-----------------|---------------|
| | 2025 年 份额 | 2024 年 份额 | 2025 年 份额 | 2024 年 份额 | 2025 年 份额 | 2024 年 份额 | 2025 年 份额 | 2024 年 份额 |
| A 类别 | | | | | | | | |
| 年初 / 期初结余 | 3,664,311.782 | 4,996,155.506 | 37,259,676.868 | 39,308,959.850 | 9,716,809.974 | 9,606,744.512 | 7,438,662.231 | 7,207,863.337 |
| 已发行基金份额 | 267,564.832 | 148,087.691 | 11,890,362.448 | 11,339,549.982 | 5,712,108.356 | 3,114,064.603 | 356,992.155 | 231,556.544 |
| 已赎回基金份额 | (835,340.236) | (1,479,931.415) | (16,551,016.205) | (13,388,832.964) | (11,076,455.042) | (3,003,999.141) | (1,919,738.814) | (757.650) |
| 年末 / 期末结余 | 3,096,536.378 | 3,664,311.782 | 32,599,023.111 | 37,259,676.868 | 4,352,463.288 | 9,716,809.974 | 5,875,915.572 | 7,438,662.231 |
| D 类别 | | | | | | | | |
| 年初 / 期初结余 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 已发行基金份额 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 已赎回基金份额 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 年末 / 期末结余 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| I 类别 | | | | | | | | |
| 年初 / 期初结余 | - | - | 29,382,923.321 | 23,891,261.405 | 11,216,496.354 | 11,018,845.409 | - | - |
| 已发行基金份额 | - | - | 5,563,438.102 | 7,364,176.149 | 1,963,033.746 | 2,092,302.432 | - | - |
| 已赎回基金份额 | - | - | (2,882,082.138) | (1,872,514.233) | (1,293,454.916) | (1,894,651.487) | - | - |
| 年末 / 期末结余 | - | - | 32,064,279.285 | 29,382,923.321 | 11,886,075.184 | 11,216,496.354 | - | - |
| I(2) 类别 | | | | | | | | |
| 年初 / 期初结余 | - | - | 2,190,900.726 | - | 1,169,283.060 | - | - | - |
| 已发行基金份额 | - | - | 102,818.234 | 2,570,008.740 | 15,182,147.166 | 1,262,855.557 | 49,861.324 | - |
| 已赎回基金份额 | - | - | (2,293,718.960) | (379,108.014) | (702,186.921) | (93,572.497) | (49,861.324) | - |
| 年末 / 期末结余 | - | - | - | 2,190,900.726 | 15,649,243.305 | 1,169,283.060 | - | - |
| I(3) 类别 | | | | | | | | |
| 年初 / 期初结余 | 302,962.371 | 1,016.781 | - | - | - | - | - | - |
| 已发行基金份额 | - | 381,545.590 | - | - | - | - | - | - |
| 已赎回基金份额 | (171,145.600) | (79,600.000) | - | - | - | - | - | - |
| 年末 / 期末结余 | 131,816.771 | 302,962.371 | - | - | - | - | - | - |

基金份额持有人应占资产净值变动表 / 权益变动表

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间 (续)

(以份额列示)

| | 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | 东亚联丰环球债券基金 | | 东亚联丰环球股票基金 | | 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | |
|----------------|--------------|--------------|---------------|---------------|------------------|--------------|-----------------|--------------|
| | 2025 年 份额 | 2024 年 份额 | 2025 年 份额 | 2024 年 份额 | 2025 年 份额 | 2024 年 份额 | 2025 年 份额 | 2024 年 份额 |
| R 类别 | | | | | | | | |
| 年初 / 期初结余 | - | - | - | - | 213,666.955 | 201,713.569 | 27,568.073 | 14,016.593 |
| 已发行基金份额 | - | - | - | - | 91,785.875 | 24,647.668 | 15,590.109 | 29,515.820 |
| 已赎回基金份额 | - | - | - | - | (23,194.593) | (12,694.282) | (14,954.810) | (15,964.340) |
| 年末 / 期末结余 | - | - | - | - | 282,258.237 | 213,666.955 | 28,203.372 | 27,568.073 |
| R(2)类别 | | | | | | | | |
| 年初 / 期初结余 | 154,097.281 | 169,347.095 | 454,738.473 | 404,789.774 | - | - | - | - |
| 已发行基金份额 | 4,118.775 | 856.844 | 37,694.283 | 221,352.749 | 1,682,881.030 | - | - | - |
| 已赎回基金份额 | (26,503.127) | (16,106.658) | (210,107.861) | (171,404.050) | (616,345.540) | - | - | - |
| 年末 / 期末结余 | 131,712.929 | 154,097.281 | 282,324.895 | 454,738.473 | 1,066,535.490 | - | - | - |
| R(3) 类别 | | | | | | | | |
| 年初 / 期初结余 | - | - | - | - | 12,710.240 | - | - | - |
| 已发行基金份额 | - | - | - | - | 27,154,731.760 | 12,710.240 | - | - |
| 已赎回基金份额 | - | - | - | - | (10,443,902.770) | - | - | - |
| 年末 / 期末结余 | - | - | - | - | 16,723,539.230 | 12,710.240 | - | - |

现金流量表

截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间

| | 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | 东亚联丰环球债券基金 | | 东亚联丰环球股票基金 | | 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | |
|-----------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|------------------------|----------------------|----------------------|---------------------|
| | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 |
| 经营活动 | | | | | | | | |
| 税前利润 / (亏损) | 627,994,491 | 364,023,056 | 417,662,933 | (184,470,674) | 1,150,665,752 | 903,438,305 | 76,387,828 | 45,856,259 |
| 调整项目： | | | | | | | | |
| 银行现金利息 | (4,297) | (18,567) | (569,500) | (511,400) | (34,459) | (6,461) | (122,127) | (178,708) |
| 银行存款利息 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 股息收入 | (38,051,040) | (48,324,254) | - | - | (98,730,387) | (83,839,208) | - | - |
| 其他收入 | - | - | (786) | (8,104) | (18,663) | (100,286) | (668) | (4,122) |
| 营运资金变动前的经营利润 / (亏损) | 589,939,154 | 315,680,235 | 417,092,647 | (184,990,178) | 1,051,882,243 | 819,492,350 | 76,265,033 | 45,673,429 |
| 投资 (增加) / 减少净额 | (300,033,117) | 277,862,306 | 179,284,019 | (432,925,524) | (3,101,986,087) | (1,163,716,973) | 164,240,511 | (82,061,614) |
| 应收经纪款项减少 / (增加) 净额 | 9,168,157 | (9,057,160) | 4,802,543 | (6,074,649) | 230,693 | 321,778 | (67,253) | (1,610,992) |
| 其他应收款 (增加) / 减少净额 | - | - | (2,133) | (16,187) | 6,236 | (22,105) | - | - |
| 衍生金融工具变动净额 | 700,596 | (840,754) | 17,512,314 | (21,134,831) | 1,875,623 | 1,536,949 | 489,876 | (21,399) |
| 应付经纪款项增加 / (减少) 净额 | 5,412,405 | (111,043) | - | - | (231,054) | (321,687) | - | - |
| 应计费用和其他应付款增加 / (减少) 净额 | 22,215 | 8,352 | 10,095 | 2,409 | 2,858,494 | 16,052 | 723 | 8,431 |
| 经营活动产生 / (所用) 的现金 | 305,209,410 | 583,541,936 | 618,699,485 | (645,138,960) | (2,045,363,852) | (342,693,636) | 240,928,890 | (38,012,145) |
| 已收股息 (已扣除预扣税) | 32,625,104 | 42,342,346 | - | - | 77,907,567 | 68,866,439 | - | - |
| 已收利息 (已扣除预扣税) | 4,349 | 18,708 | 569,676 | 547,262 | 34,497 | 6,470 | 122,133 | 179,361 |
| 已付海外税项 | (11,878,566) | (11,717,489) | - | - | (1,784,248) | (3,603,068) | - | - |
| 已收其他收入 | - | - | 786 | 8,104 | 18,663 | 100,286 | 668 | 4,122 |
| 经营活动产生 / (所用) 的现金净额 | 325,960,297 | 614,185,501 | 619,269,947 | (644,583,594) | (1,969,187,373) | (277,323,509) | 241,051,691 | (37,828,662) |
| 融资活动 | | | | | | | | |
| 认购基金份额所得款项 | 149,573,159 | 105,758,003 | 1,986,400,581 | 2,334,814,648 | 7,476,752,510 | 1,569,675,621 | 61,473,102 | 36,860,521 |
| 赎回基金份额付款 | (478,797,059) | (725,438,031) | (2,510,228,701) | (1,806,706,734) | (5,443,417,662) | (1,299,894,840) | (297,088,359) | (1,974,993) |
| 融资活动 (所用) / 产生的现金净额 | (329,223,900) | (619,680,028) | (523,828,120) | 528,107,914 | 2,033,334,848 | 269,780,781 | (235,615,257) | 34,885,528 |
| 现金和现金等价物 (减少) / 增加净额 | (3,263,603) | (5,494,527) | 95,441,827 | (116,475,680) | 64,147,475 | (7,542,728) | 5,436,434 | (2,943,134) |
| 年初 / 期初现金和现金等价物 | 66,208,063 | 71,702,590 | 64,337,796 | 180,813,476 | 91,893,104 | 99,435,832 | 1,941,925 | 4,885,059 |
| 年末 / 期末现金和现金等价物 | 62,944,460 | 66,208,063 | 159,779,623 | 64,337,796 | 156,040,579 | 91,893,104 | 7,378,359 | 1,941,925 |
| 现金流量表补充资料： | | | | | | | | |
| 出售投资所得款项 | 2,408,313,861 | 1,988,173,673 | 11,170,514,894 | 8,120,671,054 | 7,399,130,170 | 2,973,833,346 | 1,965,140,960 | 1,303,213,544 |
| 购买投资付款 | (2,082,553,282) | (1,393,427,023) | (10,724,214,192) | (8,955,393,204) | (9,364,685,865) | (3,291,930,851) | (1,764,810,410) | (1,383,373,575) |

第 100 至第 159 页的附注属本财务报表的一部分。

财务报表附注

(除非另有注明, 否则均以港元列示)

1 本基金

东亚联丰资本增长基金 (“本基金”) 按照 2000 年 9 月 22 日订立的信托契约 (该信托契约于 2019 年 12 月 31 日经修订及重述) 设立。

本基金是一项伞型基金, 其中设立 16 只投资基金 (以下统称为“本子基金”), 该等子基金具有不同的投资目标及政策。于 2025 年 12 月 31 日, 该等投资基金设立了九种不同的可赎回份额, 分别为 A 类别、D 类别、I 类别、I(2)类别、I(3)类别、I(4)类别、R 类别、R(2) 类别和 R(3) 类别。D 类别、I 类别、I(2) 类别、I(3) 类别、I(4) 类别、R 类别、R(2) 类别和 R(3) 类别的初始投资和后续持有均有最低金额限制。本基金的子基金为:

- 东亚联丰亚洲策略增长基金 - 于 2003 年 4 月 15 日发行
- 东亚联丰环球债券基金 - 于 2004 年 3 月 1 日发行
- 东亚联丰环球股票基金 - 于 2012 年 10 月 4 日发行
- 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 - 于 2014 年 6 月 20 日发行

本基金及子基金已获香港证券及期货事务监察委员会 (“证监会”) 根据香港《证券及期货条例》第 104 条认可, 并获强制性公积金计划管理局 (“积金局”) 根据《强制性公积金计划 (一般) 规例》 (“《一般规例》”) 第 6 条核准作为核准汇集投资基金 (“APIF”)。

《信托契约》(经修订及重述) 当中并无涵盖任何规定, 要求本基金本身必须编制合并财务报表。该等财务报表仅为本子基金而编制。

2 重要会计政策

编制本财务报表所采纳的重要会计政策列载如下。除非另有说明, 否则有关政策已贯彻应用, 并与以往年度所采用的政策一致。

(a) 合规声明

本财务报表已按照香港会计师公会颁布的香港财务报告会计准则 (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)、《信托契约》(经修订及重述) 的相关条文、《香港强制性公积金计划条例》 (“强积金条例”)、《一般规例》和由证监会颁布的《单位信托及互惠基金守则》以及积金局颁布的其他相关指引编制。以下是本子基金采用的重要会计政策。

香港会计师公会颁布了若干新订或经修订的香港财务报告会计准则。这些准则在本子基金当前的会计年度首次生效或可供提早采用。在与本子基金有关的范围内初始应用这些新订和经修订的准则所引致当前会计期间的任何会计政策变动, 已于本财务报表内反映, 有关资料载列于附注 3。

2 重要会计政策 (续)

(b) 财务报表的编制基准

就东亚联丰货币市场基金而言，该子基金于 2025 年 12 月 11 日停止运营，且已作全额赎回。由于该子基金不再被视为持续经营，因此其财务报表乃按非持续经营基准编制。受托人认为，鉴于该子基金终止后的费用将由基金管理人承担，因此无须根据非持续经营基准计提额外准备。本财务报表未作任何调整。

除划归为以公允价值计量且其变动计入损益的金融工具是按公允价值入账 (见下文所载的会计政策) 外，编制本财务报表时是以历史成本作为计量基准。

管理层需在编制符合香港财务报告会计准则的财务报表时作出会对会计政策的应用，以及资产、负债、收入和支出的报告数额构成影响的判断、估计和假设。这些估计和相关假设是根据以往经验和管理层因应当时情况认为合理的多项其他因素作出的，其结果构成了管理层在无法依循其他途径即时得知资产与负债的账面值时所作出判断的基础。实际结果可能有别于估计数额。

管理层会不断审阅各项估计和相关假设。如果会计估计的修订只是影响某一期间，其影响便会在该期间内确认；如果修订对当前和未来期间均有影响，则在作出修订的期间和未来期间确认。

(c) 投资

(i) 金融资产的分类

初始确认时，本子基金将金融资产分类为按摊销成本计量或以公允价值计量且其变动计入损益 (“FVTPL”) 计量。

当金融资产同时符合以下条件，且未被指定为以公允价值计量且其变动计入损益，则该金融资产按摊销成本计量：

- 该金融资产由一个旨在通过持有金融资产收取合约现金流量的业务模式所持有；及
- 该金融资产的合约条款于特定日期所产生的现金流量属于仅为本金及利息的支付 (“SPPI”)。

本子基金所有其他金融资产是按 FVTPL 计量。

2 重要会计政策 (续)

(c) 投资 (续)

(i) 金融资产的分类 (续)

业务模式评估

就持有金融资产的业务模式目的作出评估时，本子基金考虑所有有关管理业务方式的资料，包括：

- 投资策略文件及策略的实际执行。其包括投资策略是否着重于获得合约利息收入、维持特定利率曲线、将金融资产的期限与任何相关负债或预期现金流出或通过出售资产变现现金流量之期限相配；
- 如何评估投资组合之表现并向本子基金之管理层报告；；
- 影响业务模式 (及该业务模式下持有的金融资产) 表现的风险以及如何管理该等风险；
- 投资管理人如何获取薪酬：例如，薪酬是否根据所管理资产之公允价值或所收取合约现金流量决定；及
- 前期金融资产销售的频率、数量和时间，销售原因以及对未来销售活动的预期。

对于不符合终止确认条件的交易，将金融资产转移至第三方不会被视为销售，这与本子基金对资产的持续确认一致。

本子基金已确定为有两个业务模式。

- 持有以收取的业务模式：当中包括应收经纪款项、认购应收款项、股息和其他应收款以及银行现金。该等金融资产用作收取合约现金流量。
- 其他业务模式：该业务模式包括银行存款、债务证券、权益工具、衍生工具和投资基金。该等金融资产受到管理，并以公允价值为基础评估其表现，而且发生频繁的销售。

2 重要会计政策 (续)

(c) 投资 (续)

(i) 金融资产的分类 (续)

评估合约现金流量是否仅为本金及利息的支付

就此评估而言，“本金”定义为初始确认时金融资产之公允价值。“利息”的定义为货币时间价值、于特定时期内与未偿还本金金额有关信贷风险及其他基本贷款风险及成本（如流通资金风险及行政成本）以及利润率的对价。

在评估合约现金流量是否仅为本金及利息的支付时，本子基金会考虑该工具的合约条款。其包括评估金融资产是否包含可能改变合约现金流量之时点或金额的条款，致使其不符合该项条件。进行该评估时，本子基金会考虑：

- 可能改变现金流量金额或时点的或有事件；
- 杠杆特征；
- 预付及延期特征；
- 限制本子基金对特定资产现金流量索赔的条款（如无追索权特征）；及
- 修改货币时间价值对价的特征（如利率定期重置）。

本子基金根据业务模式及合约现金流量评估对其投资进行分类。因此，本子基金将其所有权益工具、债务证券、衍生金融工具和银行存款分类为按 FVTPL 计量的金融资产。按摊销成本计量的金融资产包括应收经纪款项、认购应收款项、股息和其他应收款以及银行现金。

重新分类

金融资产于其初始确认后并不会重新分类，除非本子基金将变更其管理金融资产的商业模式，于此情况下，所有受影响金融资产将于商业模式变更后第一个报告期的首日重新分类。

2 重要会计政策 (续)

(c) 投资 (续)

(ii) 金融负债的分类

金融负债分类为按摊销成本计量或按公允价值计量且其变动计入损益。

倘金融负债为衍生工具，则分类为按公允价值计量且其变动计入损益。按公允价值计量且其变动计入损益的金融负债按公允价值计量，收益及亏损净额于损益中确认。

其他金融负债其后以实际利率法按摊销成本计量。利息开支以及汇兑损益则于损益中确认。

任何终止确认的收益或亏损亦于损益确认。

因此，本子基金将其所有衍生金融工具分类为按公允价值计量且其变动计入损益的金融负债。按摊销成本计量的金融负债包括应付经纪款项、赎回应付款项以及应计费用和其他应付款。

(iii) 确认

本子基金在成为相关金融工具的合约条款的一方时确认金融资产及金融负债。

按常规买卖按公允价值计量且其变动计入损益的金融资产或金融负债按交易日期确认。自该日起，按公允价值计量且其变动计入损益的金融资产或金融负债公允价值变动产生的任何收益或亏损已记账。

金融负债将不进行确认，除非其中一方履行合约义务或合约为不获《香港财务报告准则》第 9 号豁免的衍生工具合约。

(iv) 计量

金融工具初始以公允价值 (即交易价格) 计量。以公允价值计量且其变动计入损益的金融资产和金融负债会即时列支。

于初始确认后，以公允价值计量且其变动计入损益的所有工具以公允价值计量，公允价值的变动在损益中确认。

分类为贷款及应收款的金融资产采用实际利率法按摊销成本扣除减值亏损 (如有) 后列账。

除了以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，其他金融负债采用实际利率法按摊销成本计量。

2 重要会计政策 (续)

(c) 投资 (续)

(v) 公允价值计量原则

公允价值是指市场参与者于计量日在可接触的主要市场 (如没有主要市场, 则为最有利的市场) 进行有秩序的交易时, 因出售资产所收取的价格或因转移负债所支付的价格。负债的公允价值反映了其不履约风险。

本子基金使用金融工具在活跃市场的报价计量该工具的公允价值 (如适用)。如果该资产或负债的交易频率和数额足以持续提供定价信息, 即可视为有“活跃”的市场。

当金融工具在活跃市场中没有报价时, 本子基金会采用估值技术, 并尽量使用相关的可观察输入值和避免使用不可观察的输入值。所选用的估值技术包含了市场参与者在确定交易价格时会考虑的所有因素。

于 2025 年及 2024 年 12 月 31 日, 于某一交易所上市或买卖的投资按所报之最后交易价得出。

本子基金会于报告期末确认期内在各公允价值层级之间出现的任何转移。

投资收益或亏损净额计入损益。投资的已变现及未变现收益及亏损产生自公允价值变动, 详情载列于附注 9。按公允价值计量且其变动计入损益的金融工具已变现收益或亏损净额运用平均成本法计算。

(vi) 摊销成本计量

金融资产或金融负债的“摊销成本”是指有关金融资产或金融负债于初始确认时计量的金额, 并扣除本金偿还额, 再加上或减去利用实际利率法就已确认的初始金额和到期金额之间的差额 (若是金融资产, 则以任何亏损拨备调整) 计算的累计摊销。

(vii) 减值

本子基金就按摊销成本计量的金融资产确认预期信贷亏损的亏损拨备。

本子基金以相当于存续期预期亏损减值的金额计量亏损拨备, 但以下情况除外 (该等准备金以十二个月预期信贷亏损计量):

- 在报告日确定具有低信贷风险的金融资产; 及
- 自初始确认以来信贷风险 (即在资产预期存续期内发生违约的风险) 未显著增加的其他金融资产。

2 重要会计政策 (续)

(c) 投资 (续)

(vii) 减值 (续)

在确定自初始确认以及估计预期信贷亏损后金融资产的信贷风险是否显著增加时，本子基金会考虑相关且可获取之合理且可靠之信息，而无需过多的成本或努力。这包括基于本子基金的以往经验和已知信贷评估以及包括前瞻性信息之定量与定性信息和分析。

本子基金假设金融资产的信贷风险在逾期 30 天后显著增加。

本子基金认为金融资产在下列情况发生违约：

- 债务人不大会全额支付其对本子基金的欠款，该评估不考虑本子基金采取例如变现抵押品 (如果持有) 等追索行动；或
- 金融资产逾期超过 90 天。

倘交易对方的信贷评级等同于全球范围所理解的“投资级别”定义，本子基金则认为该金融资产信贷风险为低。本子基金认为此须为穆迪给予的投资评级 Baa3 或更高，或标准普尔给予的投资评级 BBB-或更高。

存续期预期信贷亏损为对金融工具预期存续期内所有可能发生的违约事件而产生的预期信贷亏损。

十二个月预期信贷亏损为于报告日期后十二个月内 (或倘该工具的预期存续期少于十二个月，则为较短时间) 可能发生的违约事件产生的预期信贷亏损的一部分。

估计预期信贷亏损时所考虑的最长期限为本子基金面临信贷风险之最长合约期。

计量预期信贷亏损

预期信贷亏损为信贷亏损的概率加权估计。信贷亏损以所有现金所缺金额的现值 (即根据合约应付予实体的现金流量与本子基金预计所收现金流量之间的差额) 计量。

预期信贷亏损以金融资产的实际利率折现。

2 重要会计政策 (续)

(c) 投资 (续)

(vii) 减值 (续)

已发生信贷减值的金融资产

在每个报告日，本子基金评估按摊销成本列账的金融资产是否已发生信贷减值。倘发生一项或多项事件损害金融资产的预计未来现金流量时，该金融资产则被视为“已发生信贷减值”。

金融资产出现信贷减值的证据包括下列可观察数据：

- 借款人或发行人陷入严重财政困难；
- 违约，如欠缴或拖欠超过 90 天；或
- 借款人很有可能将宣告破产或进行其他财务重组。

预期信贷亏损拨备于资产负债表内呈列

按摊销成本计量的金融资产减值拨备从资产的账面总额中扣除。

撤销

本子基金于无合理预期可收回其全部或部分金融资产时，金融资产的账面总额会被撤销。

(viii) 终止确认

若收取某项金融资产的现金流量的合约权利终止，或有关金融资产绝大部分的所有权风险和回报已被转让，则该金融资产被终止确认。

持作买卖的资产被终止确认，而相关应收经纪款项则于本子基金承诺出售该资产当日确认。

若合约所指定的责任被解除、取消或终止时，金融负债即终止确认。

当终止确认一项金融资产，该资产的账面价值与最终收取的对价之差额将于损益中确认。

2 重要会计政策 (续)

(c) 投资 (续)

(ix) 抵销

当本子基金有法定可执行权力可抵销已确认金额，并有意图按净额基准结算或同时变现资产和结算负债时 (如通过市场清算机制)，金融资产与负债可互相抵销，并在资产负债表中按其净额呈报。

(d) 外币远期合约

尚未行使的外币远期合约于年末 / 期末日经参考适用于尚未行使的合约条款外币远期汇率而估值。尚未行使合约的未变现收益和亏损以及已完成合约的已变现收益和亏损计入损益中的“汇兑 (亏损) / 收益”项内。

(e) 收入和支出

利息收入和支出于其产生时按实际利率法予以确认，而实际利率为在金融资产预期期限内将未来现金流入或付款贴现现为金融资产或金融负债账面总值的利率。股息收入会于相关证券获报价除息时确认。股息是指任何不可收回的预扣税总额，并于损益中分开披露。债务证券和银行存款的利息收入则计入投资收益。所有其他收入及支出均按应计基准入账。

(f) 已发行份额

本子基金根据资本工具的合约条款内容将工具分类为金融负债或权益工具。

可认沽金融工具如果具有以下的所有特性，将分类为权益工具：

- 赋予持有人权利，可于本子基金清盘时按比例分占本子基金的资产净值。
- 工具所属的类别后偿于所有其他工具类别。
- 在后偿于所有其他工具类别的工具类别内的所有金融工具均具有相同的特性。
- 除了持有人可按比例分占本子基金的资产净值之权利外，工具并不包括交付现金或其他金融资产的任何合约义务。
- 工具在其有效年期内应占的预期现金流量总额主要是根据损益、在工具的有效年期内本子基金之已确认资产净值的变动或已确认及未确认资产净值的公允价值变动而确定。

2 重要会计政策 (续)

(f) 已发行份额 (续)

除了具备上述所有特性的工具外，本子基金不得持有符合以下条件的其他金融工具或合约：

- 其现金流量总额基本上取决于本子基金的损益、已确认资产净值的变动或已确认及未确认资产净值的公允价值变动；及
- 实质上限制或确定了可认沽工具持有人的剩余回报。

东亚联丰亚洲策略增长基金设有八类可赎回份额：A 类别、D 类别、I(2)类别、I(3)类别、I(4)类别、R 类别、R(2)类别和 R(3)类别。A 类别、I(3)类别和 R(2) 类别份额已获发行。

东亚联丰环球债券基金设有九类可赎回份额：A 类别、D 类别、I 类别、I(2) 类别、I(3) 类别、I(4) 类别、R 类别、R(2) 类别和 R(3) 类别。A 类别、I 类别和 R(2) 类别份额已获发行。

东亚联丰亚太区投资级别债券基金设有八类可赎回份额：A 类别、D 类别、I(2)类别、I(3)类别、I(4)类别、R 类别、R(2)类别和 R(3)类别。A 类别和 R 类别份额已获发行。

东亚联丰环球股票基金设有九类可赎回份额：A 类别、D 类别、I 类别、I(2) 类别、I(3) 类别、I(4) 类别、R 类别、R(2) 类别和 R(3) 类别。A 类别、I 类别、I(2) 类别、R 类别、R(2) 类别和 R(3) 类别份额已获发行。

2 重要会计政策 (续)

(f) 已发行份额 (续)

由本子基金发行的所有可赎回份额均赋予投资者权利，可要求在每个赎回日及当相关子基金清算时，按照投资者在相关子基金资产净值所占的份额价值赎回现金。

因此，东亚联丰环球债券基金、东亚联丰环球股票基金、东亚联丰亚太区投资级别债券基金和东亚联丰亚洲策略增长基金都发行了多个类别的可赎回份额，这些基金份额在所有重要方面享有同等权益，但条款和条件不尽相同，详见《基金说明书》，其中包括最低投资额、管理费、认购费 / 申购费、变现费用、转换费用、持有人服务费和收益分配政策。这些可赎回份额是本子基金当中最次级的金融工具类别。然而，由于不同类别的可赎回份额拥有不同的特质，它们未能符合权益分类的准则，因此被分类为金融负债，并按赎回金额的现值计量。

受托人会持续评估可赎回份额的分类。如果这些可赎回份额不再具备《香港会计准则》第 32 号第 16A 和第 16B 段之下的所有特点或符合所有条件，受托人会将它们重新分类为金融负债，并于重新分类当日按照公允价值计量，而因先前的账面价值所产生的任何差额会于权益中确认。如果这些可赎回份额其后具备《香港会计准则》第 32 号第 16A 和第 16B 段之下的所有特点或符合所有条件，受托人会将它们重新分类为权益工具，并于重新分类当日按照负债的账面价值计量。

2 重要会计政策 (续)

(g) 外币换算

(i) 功能货币和列报货币

本子基金财务报表中的项目均使用其经营所在的主要经济环境之货币 (“功能货币”) 计量。

本子基金的财务报表以港元、日元、欧元及美元列报，因此港元、日元、欧元及美元是本子基金的功能货币和列报货币。

(ii) 交易和结余

外币交易按交易当日的汇率换算为功能货币。该等交易结算及以外币结算之货币性资产或负债按年末 / 期末日之汇率换算所产生之汇兑损益，于损益内确认。

(h) 现金和现金等价物

现金和现金等价物包括银行存款和现金、存放于银行和其他金融机构的活期存款。这些投资可以随时换算为已知的现金额、价值变动方面的风险不大，并在购入后三个月内到期。

(i) 非以公允价值计量的金融资产及负债

按摊销成本计量的金融资产包括应收经纪款项、认购应收款项、股息和其他应收款以及银行现金，这些款项初始按公允价值确认，其后采用实际利率法按摊销成本减去减值亏损 (如有) 列报。

非以公允价值计量且其变动计入损益的金融负债包括应付经纪款项、赎回应付款项、应计费用和其他应付款，这些款项初始按公允价值确认，其后采用实际利率法按摊销成本列报。

(j) 抵销

当且仅当本子基金拥有抵销相关金额的法律权利，并且意图以净额为基础进行结算，或同时变现资产和清偿负债时，金融资产和金融负债互相抵销并在资产负债表内以其净额列报。

收入和支出按净额列报，包括以公允价值计量且其变动计入损益的金融工具损益以及汇兑损益。

2 重要会计政策 (续)

(k) 关联方

(a) 如属以下人士，即该人士或该人士的近亲是本子基金的关联方：

- (i) 控制或共同控制本子基金；
- (ii) 对本子基金有重大影响；或
- (iii) 是本子基金或本子基金母公司的关键管理人员。

(b) 如符合下列任何条件，即企业实体是本子基金的关联方：

- (i) 该实体与本子基金隶属同一集团 (即各母公司、附属公司和同系附属公司彼此间有关联)。
- (ii) 一家实体是另一实体的联营公司或合营企业 (或另一实体所属集团旗下成员公司的联营公司或合营企业)。
- (iii) 两家实体是同一第三方的合营企业。
- (iv) 一家实体是第三方实体的合营企业，而另一实体是第三方实体的联营公司。
- (v) 该实体作为本子基金关联方的任何实体的雇员福利而设的离职后福利计划。
- (vi) 该实体受到上述第 (a) 项内所认定人士控制或共同控制。
- (vii) 上述第 (a)(i) 项内所认定人士对该实体有重大影响或是该实体 (或该实体母公司) 的关键管理人员。
- (viii) 该实体或其所属集团的任何成员公司向本子基金或本子基金母公司提供关键管理人员服务。

一名个人的近亲是指与有关实体交易并可能影响该个人或受该个人影响的家庭成员。

(l) 分部报告

经营分部的报告方式与首席经营决策者所采用的内部报告方式贯彻一致。作为首席经营决策者，东亚联丰投资管理有限公司 (“基金管理人”) 负责经营分部的资源分配和绩效评估。

3 会计政策的修订

香港会计师公会颁布了若干新订或经修订的香港财务报告会计准则。这些准则在本基金当前的会计期间首次生效。该等准则修订均不会对本基金当前或以往期间的业绩和财务状况编制或列报方式产生重大影响。

本基金并无采用任何在当前会计期间尚未生效的新准则或释义 (参阅附注 23)。

4 资本管理及已发行份额

本基金的资本以基金份额持有人应占资产净值呈列。本基金对份额认购及赎回并无限制。年内 / 期内认购及赎回份额在基金份额持有人应占资产净值变动表内呈列。为实现投资目标, 本基金竭尽所能根据投资报告所呈列的投资政策将收取的认购款项进行投资。本基金于必要时会通过出售投资来满足赎回。

4 资本管理及已发行份额 (续)

各类别于 12 月 31 日的已发行份额

| | 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | 东亚联丰环球债券基金 | | 东亚联丰环球股票基金 | | 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | |
|---------|---------------|---------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|---------------|
| | 2025 年 份额 | 2024 年 份额 | 2025 年 份额 | 2024 年 份额 | 2025 年 份额 | 2024 年 份额 | 2025 年 份额 | 2024 年 份额 |
| A 类别 | 3,096,536.378 | 3,664,311.782 | 32,599,023.111 | 37,259,676.868 | 4,352,463.288 | 9,716,809.974 | 5,875,915.572 | 7,438,662.231 |
| D 类别 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| I 类别 | - | - | 32,064,279.285 | 29,382,923.321 | 11,886,075.184 | 11,216,496.354 | - | - |
| I(2) 类别 | - | - | - | 2,190,900.726 | 15,649,243.305 | 1,169,283.060 | - | - |
| I(3) 类别 | 131,816.771 | 302,962.371 | - | - | - | - | - | - |
| R 类别 | - | - | - | - | 282,258.237 | 213,666.955 | 28,203.372 | 27,568.073 |
| R(2) 类别 | 131,712.929 | 154,097.281 | 282,324.895 | 454,738.473 | 1,066,535.490 | - | - | - |
| R(3) 类别 | - | - | - | - | 16,723,539.230 | 12,710.240 | - | - |

4 资本管理及已发行份额 (续)

于12月31日基金份额持有人应占的资产净值

| | 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | 东亚联丰环球债券基金 | | 东亚联丰环球股票基金 | | 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | |
|--------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|-----------------|---------------|
| | 2025年 港元 | 2024年 港元 | 2025年 港元 | 2024年 港元 | 2025年 港元 | 2024年 港元 | 2025年 港元 | 2024年 港元 |
| 基金份额持有人应占的资产净值 | | | | | | | | |
| A类别份额 | 2,042,311,477 | 1,756,730,993 | 3,961,799,877 | 4,287,223,671 | 1,686,007,617 | 3,149,035,828 | 935,831,268 | 1,095,243,467 |
| D类别份额 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| I类别份额 | - | - | 3,359,198,251 | 2,913,601,344 | 3,235,585,096 | 2,553,621,667 | - | - |
| I(2)类别份额 | - | - | - | 212,037,597 | 1,888,103,526 | 118,073,332 | - | - |
| I(3)类别份额 | 16,973,519 | 28,594,425 | - | - | - | - | - | - |
| R类别份额 | - | - | - | - | 61,050,377 | 39,307,437 | 3,490,011 | 3,188,620 |
| R(2)类别份额 | 60,444,895 | 52,245,748 | 27,973,664 | 43,060,645 | 95,789,188 | - | - | - |
| R(3)类别份额 | - | - | - | - | 2,092,652,634 | 1,351,438 | - | - |
| 各份额基金份额持有人应占的资产净值 | | | | | | | | |
| A类别份额 | 659.55 | 479.42 | 121.53 | 115.06 | 387.37 | 324.08 | 159.27 | 147.24 |
| D类别份额 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| I类别份额 | - | - | 104.76 | 99.16 | 272.22 | 227.67 | - | - |
| I(2)类别份额 | - | - | - | 96.78 | 120.65 | 100.98 | - | - |
| I(3)类别份额 | 128.77 | 94.38 | - | - | - | - | - | - |
| R类别份额 | - | - | - | - | 216.29 | 183.97 | 123.74 | 115.66 |
| R(2)类别份额 | 458.91 | 339.04 | 99.08 | 94.69 | 89.81 | - | - | - |
| R(3)类别份额 | - | - | - | - | 125.13 | 106.33 | - | - |

4 资本管理及已发行份额 (续)

于 12 月 31 日基金份额持有人应占的资产净值 (续)

由于本子基金具有发行和赎回基金份额的能力，因此本子基金的资本可根据对本子基金的认购和赎回需求而变动。本子基金毋须遵守外部施加的资本要求及对发行和赎回份额的限制。

本子基金的资本管理目标如下：

- 保障资本的同时，根据基金说明书所示本子基金的投资目标、概况、风险额度和预期回报进行投资，以达致回报。
- 保持充足的流动资金，以应付本子基金的开支及赎回要求。
- 保持充足的基金规模，使本子基金的营运达致成本效益。

基金管理人会根据本子基金的投资目标和政策来管理本子基金的资本。为了保障基金份额持有人的利益，基金管理人可酌情及在受托人的核准下，将于任何交易日赎回的任何子基金份额数目，限制至已发行子基金的份额总数 10%。

5 关键会计估计和假设

东亚银行 (信托) 有限公司 (“受托人”) 会对未来情况作出估计和假设。如其定义, 会计估计结果很少会与相关实际结果相同。受托人会基于历史经验和其他因素持续评估其估计, 其中包括根据相关情况认为合理的未来事件预期。下一财政年度内对资产和负债账面金额进行重大调整的重大风险估计和假设载列如下。

投资的公允价值

部分基金持有若干非上市债务证券, 其估值参考经纪商的报价。在确定此类投资的公允价值时, 受托人会对经纪商的来源以及所使用的报价之数量和质量作出判断和估计。为公允评估投资价值而采用的此类报价可能仅供参考, 不具有可执行性或法律约束力。因此, 经纪商报价并不一定表明证券在 2025 年 12 月 31 日和 2024 年 12 月 31 日的实际交易价格。实际交易价格可能有别于经纪商提供的报价。受托人认为, 在没有任何其他可靠市场来源的情况下, 其所能获得的经纪商报价反映了对公允价值的最佳估计。

6 金融风险管理

使用金融工具的策略

东亚联丰亚洲策略增长基金的投资目标是透过投资于主要由在亚太区 (不包括日本) 或从亚太区 (不包括日本) 或预计将从亚太区 (不包括日本) 获取重大部分收入的公司之上市证券所组成的分散投资组合, 以提供以港元计算之长期资本增长予投资者。

东亚联丰环球债券基金的投资目标是透过投资于以各种主要货币计算之范围多元化环球债券, 提供中期至长期的整体投资回报予投资者。

6 金融风险管理 (续)

使用金融工具的策略 (续)

东亚联丰环球股票基金的投资目标是透过投资于一个分散环球投资组合，提供长期资本增值予投资者。

东亚联丰亚太区投资级别债券基金的投资目标是透过投资于亚太区投资级别债券，以提供中至长期的投资总回报。

本子基金的经营活​​动会面临各种金融风险：市场风险 (包括货币风险、公允价值和现金流量利率风险以及价格风险)、信贷风险和流动资金风险。基金管理人管理这些风险所采用的金融风险管理政策和惯常做法载列于下文。

(a) 市场风险

市场风险包含了潜在损益，当中涵盖货币风险、利率风险和价格风险。本子基金对市场风险的管理策略受到它们的投资目标所带动。

本子基金的市场风险会由基金管理人定期根据既定政策和程序管理。受托人会每年监察该等子基金的整体市场状况。本子基金于结算日的投资组合性质详载于投资报告中。

(i) 货币风险

本子基金持有以功能货币以外的货币计价的资产和负债，因此本子基金承担货币风险，即其货币相对于其他外币的汇率可能发生变化，从而对本子基金以功能货币以外的货币计价的资产和负债的公允价值产生不利影响。

资产或负债的计价货币与功能货币两者的汇率如有波动，可能会导致资产或负债的公允价值上升或下跌。基金管理人会定期监察本子基金的所有外币持仓。东亚联丰货币市场基金和东亚联丰美国基金不持有任何以港元和 / 或美元以外的货币计值的资产。鉴于港元与美元相挂钩，本子基金预期美元兑港元的汇率不会发生大幅波动。

6 金融风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(i) 货币风险 (续)

敏感度分析

各子基金于报告日直接承受美元或港元以外的各种货币的净风险敞口额度，以及如果美元贬值 / 升值 5%，对基金份额持有人应占资产净值和年度全面收益总额的估计变动说明如下。以上分析是按 2024 年的同一基准进行。

| | 于 2025 年 12 月 31 日 | | 于 2024 年 12 月 31 日 | |
|---------------------|--------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------|
| | 直接净风险敞口 港元 | 估计升幅 (如果港 元贬值 5%) 港元 | 直接净风险敞口 港元 | 估计升幅 (如果港 元贬值 5%) 港元 |
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | | | |
| 澳元 | 34,690,218 | 1,734,511 | 9,313,289 | 465,664 |
| 印度卢比 | 155,859,911 | 7,792,996 | 436,109,466 | 21,805,473 |
| 印尼盾 | - | - | 18,608,407 | 930,420 |
| 日元 | 1,811 | 91 | 4,247,585 | 212,379 |
| 韩元 | 462,597,618 | 23,129,881 | 93,254,509 | 4,662,725 |
| 新台币 | 470,895,832 | 23,544,792 | 344,484,759 | 17,224,238 |
| 菲律宾比索 | 34,710,989 | 1,735,549 | 42,444,171 | 2,122,209 |
| 人民币 | 154,451,249 | 7,722,563 | 90,795,296 | 4,539,765 |
| 新加坡元 | 55,812,188 | 2,790,609 | 62,921,157 | 3,146,058 |

6 金融风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(i) 货币风险 (续)

敏感度分析 (续)

| | 于 2025 年 12 月 31 日 | | 于 2024 年 12 月 31 日 | |
|-------------------|--------------------|---------------------------|--------------------|---------------------------|
| | 直接净风险敞口 港元 | 估计升幅(如果 港元贬值 5%) 港元 | 直接净风险敞口 港元 | 估计升幅(如果 港元贬值 5%) 港元 |
| 东亚联丰环球债券基金 | | | | |
| 澳元 | 124,097,319 | 6,204,866 | 66,049,890 | 3,302,495 |
| 英镑 | 328,547,903 | 16,427,395 | 280,400,281 | 14,020,014 |
| 加拿大元 | 111,059,616 | 5,552,981 | 100,589,034 | 5,029,452 |
| 丹麦克朗 | 897 | 45 | 791 | 40 |
| 欧元 | 1,298,315,402 | 64,915,770 | 1,248,709,968 | 62,435,498 |
| 印尼盾 | 159,245 | 7,962 | 164,652 | 8,233 |
| 日元 | 423,679,393 | 21,183,970 | 326,138,124 | 16,306,906 |
| 韩元 | 2,543,726 | 127,186 | 1,022,291 | 51,115 |
| 马来西亚林吉特 | 224,298,350 | 11,214,918 | 3,239,056 | 161,953 |
| 墨西哥比索 | 40,294,822 | 2,014,741 | - | - |
| 新西兰元 | 16,370,034 | 818,502 | 15,884,623 | 794,231 |
| 挪威克朗 | 5,130,929 | 256,546 | 4,436,535 | 221,827 |
| 人民币 | 705,269,783 | 35,263,489 | 536,454,591 | 26,822,730 |
| 新加坡元 | 107,391,799 | 5,369,590 | 15,442,978 | 772,149 |
| 瑞士法郎 | 1,637 | 82 | - | - |

6 金融风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(i) 货币风险 (续)

敏感度分析 (续)

| | 于 2025 年 12 月 31 日 | | 于 2024 年 12 月 31 日 | |
|-------------------|--------------------|---------------------------|--------------------|---------------------------|
| | 直接净风险敞口 港元 | 估计升幅(如果 港元贬值 5%) 港元 | 直接净风险敞口 港元 | 估计升幅(如果 港元贬值 5%) 港元 |
| 东亚联丰环球股票基金 | | | | |
| 澳元 | 108,271,396 | 5,413,570 | 75,299,422 | 3,764,971 |
| 巴西雷亚尔 | 3,098,680 | 154,934 | 6,881,288 | 344,064 |
| 英镑 | 279,230,951 | 13,961,548 | 196,500,927 | 9,825,046 |
| 加拿大元 | 206,661,867 | 10,333,093 | 159,848,479 | 7,992,424 |
| 丹麦克朗 | 37,770,457 | 1,888,523 | 36,462,334 | 1,823,117 |
| 欧元 | 821,135,596 | 41,056,780 | 516,358,428 | 25,817,921 |
| 印度卢比 | 136,816,862 | 6,840,843 | 91,140,252 | 4,557,013 |
| 印尼盾 | - | - | 1,262,132 | 63,107 |
| 日元 | 387,504,206 | 19,375,210 | 264,082,323 | 13,204,116 |
| 韩元 | 123,530,056 | 6,176,503 | 48,893,602 | 2,444,680 |
| 马来西亚林吉特 | 35,209,414 | 1,760,471 | 7,912,862 | 395,643 |
| 墨西哥比索 | 4,882,708 | 244,135 | 3,506,948 | 175,347 |
| 新台币 | 210,004,287 | 10,500,214 | 98,504,102 | 4,925,205 |
| 新西兰元 | 2,534,246 | 126,712 | 2,840,319 | 142,016 |
| 挪威克朗 | 13,467,570 | 673,379 | - | - |
| 菲律宾比索 | 3,882,614 | 194,131 | 2,108,259 | 105,413 |
| 人民币 | 62,409,783 | 3,120,489 | 926,537 | 46,327 |
| 新加坡元 | 14,001,018 | 700,051 | 11,507,638 | 575,382 |
| 南非兰特 | 9,790,872 | 489,544 | 6,625,600 | 331,280 |
| 瑞典克朗 | 140,698,740 | 7,034,937 | 55,239,075 | 2,761,954 |
| 瑞士法郎 | 182,581,430 | 9,129,072 | 108,350,791 | 5,417,540 |
| 泰铢 | 33,924,313 | 1,696,216 | 11,611,225 | 580,561 |

6 金融风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(i) 货币风险 (续)

敏感度分析 (续)

| | 于 2025 年 12 月 31 日 | | 于 2024 年 12 月 31 日 | |
|------------------------|--------------------|---------------------------|--------------------|---------------------------|
| | 直接净风险敞口 港元 | 估计升幅(如果 港元贬值 5%) 港元 | 直接净风险敞口 港元 | 估计升幅(如果 港元贬值 5%) 港元 |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | | | | |
| 澳元 | 766,284 | 38,314 | 51,150 | 2,558 |
| 欧元 | 1,715,156 | 85,758 | 10,561 | 528 |
| 人民币 | 559,295 | 27,965 | 133,812 | 6,691 |
| 新加坡元 | 9,820 | 491 | 73,142 | 3,657 |

在所有其他变量保持不变的情况下，本子基金的功能货币对上述货币升值 5%，则会对本财务报表产生相等但相反的影响。

6 金融风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(ii) 利率风险

利率风险源于利率变动，利率变化可能会对债务工具的价值产生反向影响，从而可能导致本子基金录得收益或亏损。

截至年末，除了东亚联丰环球债券基金及东亚联丰亚太区投资级别债券基金外，所有子基金均无任何带息负债，且带息资产仅限于银行存款，因此认为其不存在重大的直接利率风险。

基金管理人会定期监察该等子基金承受的直接利率风险。

下表载列了东亚联丰环球债券基金及东亚联丰亚太区投资级别债券基金的利率风险敞口。其中包括其利率敏感度差额，以及截至年末计息资产和计息负债利率重新定价的年度（合约重新定价或到期日中的较早者）。

东亚联丰环球债券基金

于 2025 年 12 月 31 日

| | 1 年以内 港元 | 1 至 5 年 港元 | 5 年以上 港元 | 不计息 港元 | 总额 港元 |
|-------------------------------|--------------------|----------------------|----------------------|------------------|----------------------|
| 资产 | | | | | |
| 投资 | 565,179,458 | 1,941,657,315 | 4,684,789,114 | - | 7,191,625,887 |
| 银行现金 | 159,779,623 | - | - | - | 159,779,623 |
| 其他资产 | - | - | - | 5,116,233 | 5,116,233 |
| 资产总值 | <u>724,959,081</u> | <u>1,941,657,315</u> | <u>4,684,789,114</u> | <u>5,116,233</u> | <u>7,356,521,743</u> |
| 负债 (不包括基金份额持有人应占的资产净值) | | | | | |
| 其他负债 | - | - | - | 7,549,951 | 7,549,951 |
| 利率敏感度总差额 | <u>724,959,081</u> | <u>1,941,657,315</u> | <u>4,684,789,114</u> | | |

6 金融风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(ii) 利率风险 (续)

东亚联丰环球债券基金 (续)

于 2024 年 12 月 31 日

| | 1 年以内 港元 | 1 至 5 年 港元 | 5 年以上 港元 | 不计息 港元 | 总额 港元 |
|-------------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| 资产 | | | | | |
| 投资 | 961,832,777 | 2,564,513,299 | 3,844,563,830 | - | 7,370,909,906 |
| 银行现金 | 64,337,796 | - | - | - | 64,337,796 |
| 其他资产 | - | - | - | 21,511,552 | 21,511,552 |
| 资产总值 | <u>1,026,170,573</u> | <u>2,564,513,299</u> | <u>3,844,563,830</u> | <u>21,511,552</u> | <u>7,456,759,254</u> |
| 负债 (不包括基金份额持有人应占的资产净值) | | | | | |
| 其他负债 | - | - | - | 835,997 | 835,997 |
| 利率敏感度总差额 | <u>1,026,170,573</u> | <u>2,564,513,299</u> | <u>3,844,563,830</u> | | |

年末，下表载列了在其他变量不变的情况下，若相关市场利率上升一定比例，对本年度份额持有人应占资产净值以及营运产生的基金份额持有人应占的资产净值变动之预计影响。

| | 潜在的合理变动 | | |
|------------|---------|---------------|---------------|
| | 百分比 | 估计增加 / (减少) | |
| | | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 |
| 东亚联丰环球债券基金 | 0.25% | (132,138,875) | (127,258,577) |

6 金融风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(ii) 利率风险 (续)

东亚联丰亚太区投资级别债券基金

于 2025 年 12 月 31 日

| | 1 年以内 港元 | 1 至 5 年 港元 | 5 年以上 港元 | 不计息 港元 | 总额 港元 |
|-------------------------------|-------------------|--------------------|--------------------|------------------|--------------------|
| 资产 | | | | | |
| 投资 | 83,905,847 | 269,737,528 | 576,960,619 | - | 930,603,994 |
| 银行现金 | 7,378,359 | - | - | - | 7,378,359 |
| 其他资产 | - | - | - | 1,795,691 | 1,795,691 |
| 资产总值 | <u>91,284,206</u> | <u>269,737,528</u> | <u>576,960,619</u> | <u>1,795,691</u> | <u>939,778,044</u> |
| 负债 (不包括基金份额持有人应占的资产净值) | | | | | |
| 其他负债 | - | - | - | 456,765 | 456,765 |
| 利率敏感度总差额 | <u>91,284,206</u> | <u>269,737,528</u> | <u>576,960,619</u> | | |

6 金融风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(ii) 利率风险 (续)

东亚联丰亚太区投资级别债券基金 (续)

于 2024 年 12 月 31 日

| | 1 年以内 港元 | 1 至 5 年 港元 | 5 年以上 港元 | 不计息 港元 | 总额 港元 |
|-------------------------------|-------------------|--------------------|--------------------|------------------|----------------------|
| 资产 | | | | | |
| 投资 | 66,545,975 | 344,142,327 | 684,156,203 | - | 1,094,844,505 |
| 银行现金 | 1,941,925 | - | - | - | 1,941,925 |
| 其他资产 | - | - | - | 1,788,574 | 1,788,574 |
| 资产总值 | <u>68,487,900</u> | <u>344,142,327</u> | <u>684,156,203</u> | <u>1,788,574</u> | <u>1,098,575,004</u> |
| 负债 (不包括基金份额持有人应占的资产净值) | | | | | |
| 其他负债 | <u>-</u> | <u>-</u> | <u>-</u> | <u>142,917</u> | <u>142,917</u> |
| 利率敏感度总差额 | <u>68,487,900</u> | <u>344,142,327</u> | <u>684,156,203</u> | | |

年末，下表载列了在其他变量不变的情况下，若相关市场利率上升一定比例，对本年度份额持有人应占资产净值以及营运产生的基金份额持有人应占的资产净值变动之预计影响。

| | 潜在的合理变动 | | |
|-----------------|---------|--------------|--------------|
| | 百分比 | 估计增加 / (减少) | 估计增加 / (减少) |
| | | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | 0.25% | (13,470,227) | (14,647,445) |

6 金融风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(iii) 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值因市场价格变化而波动的风险 (利率风险或货币风险引起的变动除外), 该等变动由个别投资的具体因素或其发行人或由影响市场上所有工具的因素造成。除了东亚联丰环球债券基金、东亚联丰港元债券基金、东亚联丰亚太区投资级别债券基金、东亚联丰货币市场基金和东亚联丰短期债券基金之外, 其他子基金均面临因权益工具、单位信托和集体投资计划的市场价格变化而产生的价格风险。

有关该等子基金持有的投资明细载于投资报告中。

各子基金的市场风险是通过以下方式管理: (i) 审慎的证券挑选; 以及 (ii) 分散投资组合。基金管理人负责定期监察该等子基金的市场持仓。

敏感度分析

于 2025 年 12 月 31 日, 投资价值增长 10% 的影响 (所有其他变量维持不变) 如下所示。相反方向的等额变化将使本年度 / 期间基金份额持有人应占资产净值以同等但反向的数额下跌。

| | 东亚联丰亚洲策略增长基金 港元 | 东亚联丰环球股票基金 港元 |
|---------------------------|--------------------|--------------------|
| 于 2025 年 12 月 31 日 | | |
| - 股票 | 206,087,863 | 886,709,503 |
| - 集体投资计划 | - | 162,291 |
| - 权利 | 21,615 | - |
| | <u>206,109,478</u> | <u>886,871,794</u> |

6 金融风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(iii) 其他价格风险 (续)

敏感度分析 (续)

于 2024 年，为了就市场价格对基金的影响进行更为直接的评估，基金管理人决定基于投资价值的直接变动 (其他变量保持不变) 进行敏感度分析。

于 2024 年 12 月 31 日，投资价值增长 10% 的影响 (所有其他变量维持不变) 如下所示。相反方向的等额变化将使本年度 / 期间基金份额持有人应占资产净值以同等但反向的数额下跌。

| | 东亚联丰亚洲策略增长基金 港元 | 东亚联丰环球股票基金 港元 |
|---------------------------|--------------------|------------------|
| 于 2024 年 12 月 31 日 | | |
| - 股票 | 176,106,166 | 576,375,585 |
| - 集体投资计划 | - | 297,600 |
| | 176,106,166 | 576,673,185 |

6 金融风险管理 (续)

(b) 信贷风险

信贷风险是指交易对手未能在到期时全数付款的风险。就上市证券进行的交易全部通过经核准的经纪商以货到付款的方式结算。由于只会在本子基金的保管人收到款项后才交收已出售的证券，所以拖欠付款的风险被视为甚低。

就购入而言，当本子基金的保管人收妥证券后，会随即付款。如果任何一方未有履行其义务，交易将告失效。

基金管理人会定期监察本子基金的信贷状况。信贷风险上限是指各金融资产于资产负债表的账面金额。

预期信贷亏损引致的金额

应收经纪款项、认购应收款项、股息和其他应收款以及银行现金的减值已按十二个月的预期损失基准计量，反映了该敞口的短期期限。本子基金根据交易对手的外部信用评级，认为这些敞口具有较低的信贷风险。

子基金通过跟踪交易对手公布的外部信用评级来监控这些敞口的信贷风险变化。为了确定公布的评级是否保持最新状态，并评估报告日期信贷风险是否存在显著增加而未反映在公布的评级中，子基金通过审查债券收益率的变化，以及 (如可得) 信用违约掉期 (“CDS”) 价格以及有关交易对手的可用新闻报导和监管信息，对此进行补充。

基金管理人认为违约的可能性接近于零，因为交易对手具有在短期内履行合约义务的强大能力。应收经纪款项、认购应收款项、股息和其他应收款以及银行现金均无确认减值准备。亏损拨备在 2025 年和 2024 年期间没有变化。

6 金融风险管理 (续)

(b) 信贷风险 (续)

于报告日，东亚联丰环球债券基金、东亚联丰港元债券基金、东亚联丰亚太区投资级别债券基金和东亚联丰短期债券基金持有债务证券。东亚联丰货币市场基金持有债务证券和短期存款。于 2025 年 12 月 31 日及 2024 年 12 月 31 日，该等子基金投资的债务证券和短期存款之信用评级与标准普尔信用评级服务提供的信用评级相当，并以债务投资的百分比列示：

| | 2025 年 12 月 31 日 % | 2024 年 12 月 31 日 % |
|-------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 东亚联丰环球债券基金 | | |
| 按债务证券评级类别划分的投资组合 | | |
| <i>评级</i> | | |
| AAA | 11.70 | 53.67 |
| AA+ | 40.01 | 1.62 |
| AA | 0.50 | 2.42 |
| AA- | 10.54 | 9.83 |
| A+ | 16.91 | 15.88 |
| A | 4.04 | 1.32 |
| A- | 5.96 | 5.92 |
| BBB+ | 4.61 | 4.06 |
| BBB | 4.11 | 3.49 |
| BBB- | 1.31 | 1.79 |
| NR | 0.31 | - |
| | 100.00 | 100.00 |

6 金融风险管理 (续)

(b) 信贷风险 (续)

| | 2025 年 12 月 31 日 % | 2024 年 12 月 31 日 % |
|-------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | | |
| 按债务证券评级类别划分的投资组合 | | |
| <i>评级</i> | | |
| AAA | 0.34 | 7.25 |
| AA+ | 5.96 | - |
| AA | 0.13 | 1.55 |
| AA- | 1.89 | 5.90 |
| A+ | 10.13 | 10.15 |
| A | 14.64 | 13.24 |
| A- | 13.00 | 18.54 |
| BBB+ | 8.61 | 18.44 |
| BBB | 29.66 | 19.63 |
| BBB- | 15.39 | 5.30 |
| NR | 0.25 | - |
| | 100.00 | 100.00 |

6 金融风险管理 (续)

(c) 流动资金风险

如本子基金不能及时地将其投资转换为现金以应付流动资金需求，则会产生流动资金风险。由于本子基金可能会被要求提前偿还其负债或其可赎回基金份额，因此本子基金承受流动资金风险。本子基金就其可赎回份额承受日常现金赎回风险。赎回时，持有人基于本子基金的份额净值选择赎回份额。

本子基金的政策是定期监察当前及预期的流动资金需求，以确保能够维持充分的现金储备及可随时变现的有价证券，从而满足短期以至长期的流动资金需求。

本子基金的大部分资产均投资于活跃市场并可随时变现。基金管理人会定期监察本子基金的流动资金状况。

于 2025 年和 2024 年 12 月 31 日，本子基金的所有金融负债均为于要求时偿还或于 3 个月内到期。

(d) 公允价值估计

于 2025 年和 2024 年 12 月 31 日，资产和负债的账面价值与其公允价值是合理近似。

7 以公允价值计量且其变动计入损益的金融工具

(a) 投资明细表

本子基金按投资类型划分的投资明细载列如下。

| | 于 2025 年 12 月 31 日 | | 于 2024 年 12 月 31 日 | |
|------------------------|----------------------|--------------|----------------------|--------------|
| | 港元 | 占资产净值 百分比 | 港元 | 占资产净值 百分比 |
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | | | |
| 上市 / 挂牌投资 | | | | |
| - 股票 | 2,060,878,625 | 97.22 | 1,761,061,656 | 95.84 |
| - 权利 | 216,148 | 0.01 | - | - |
| | <u>2,061,094,773</u> | <u>97.23</u> | <u>1,761,061,656</u> | <u>95.84</u> |
| 东亚联丰环球债券基金 | | | | |
| 上市 / 挂牌投资 | | | | |
| - 债券 | 7,191,625,887 | 97.86 | 7,370,909,906 | 98.86 |
| | <u>7,191,625,887</u> | <u>97.86</u> | <u>7,370,909,906</u> | <u>98.86</u> |
| 东亚联丰环球股票基金 | | | | |
| 上市 / 挂牌投资 | | | | |
| - 股票 | 8,867,095,031 | 97.88 | 5,763,755,854 | 98.34 |
| - 投资基金 | 1,622,910 | 0.02 | 2,976,000 | 0.05 |
| | <u>8,868,717,941</u> | <u>97.90</u> | <u>5,766,731,854</u> | <u>98.39</u> |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | | | | |
| 上市 / 挂牌投资 | | | | |
| - 债券 | 930,603,994 | 99.07 | 1,094,844,505 | 99.67 |
| | <u>930,603,994</u> | <u>99.07</u> | <u>1,094,844,505</u> | <u>99.67</u> |

7 以公允价值计量且其变动计入损益的金融工具 (续)

(b) 公允价值层级

下表呈列本子基金的投资及衍生金融工具于报告期末按经常基准所计量的公允价值。该等投资已归入《香港财务报告准则》第 13 号“公允价值计量”所界定的三个公允价值层级。

于 2025 年 12 月 31 日

| 金融资产 / (金融 负债) | 东亚联丰 | | | |
|-------------------|----------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|
| | 亚洲策略增长基金 港元 | 环球债券基金 港元 | 环球股票基金 港元 | 亚太区投资级别 债券基金 港元 |
| 第 1 层级 | 2,060,878,625 | - | 8,868,717,941 | - |
| 第 2 层级 | 216,148 | 7,187,707,199 | (2,689,584) | 930,291,676 |
| 第 3 层级 | - | - | - | - |
| | <u>2,061,094,773</u> | <u>7,187,707,199</u> | <u>8,866,028,357</u> | <u>930,291,676</u> |

于 2024 年 12 月 31 日

| 金融资产 / (金融 负债) | 东亚联丰 | | | |
|-------------------|----------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|
| | 亚洲策略增长基金 港元 | 环球债券基金 港元 | 环球股票基金 港元 | 亚太区投资级别 债券基金 港元 |
| 第 1 层级 | 1,761,061,656 | - | 5,766,731,854 | - |
| 第 2 层级 | 700,596 | 7,384,503,532 | (813,961) | 1,095,022,063 |
| 第 3 层级 | - | - | - | - |
| | <u>1,761,762,252</u> | <u>7,384,503,532</u> | <u>5,765,917,893</u> | <u>1,095,022,063</u> |

于截至 2025 年及 2024 年 12 月 31 日止年度 / 期间，在第 1 与第 2 层级之间并无出现任何公允价值转移，亦无任何公允价值转入第 3 层级。

7 以公允价值计量且其变动计入损益的金融工具 (续)

(b) 公允价值层级 (续)

本子基金以下列公允价值层级计量公允价值，以反映在计量时所用输入值的重要性：

第 1 层级：所用输入值为相同金融工具在活跃市场的报价 (未经调整)。

第 2 层级：所用输入值为第 1 层级的市场报价以外的数据，包括可直接 (即价格) 或间接 (即源自价格) 观察的数据。此类包括采用以下方法进行估值的工具：活跃市场中类似金融工具的市场报价；相同或类似工具在非活跃市场的报价；或所有重要输入值均可直接或间接从市场数据观察而获得之其他估值技术。

第 3 层级：所用输入值为不可观察的数据。此类别包括所有工具，其所用估值技术并非基于可观察的输入值，而不可观察的输入值对工具的估值有重大影响。此类别亦包括工具是基于类似工具的报价进行估值，但需要重大不可观察的输入值作出调整或假设，以反映工具之间的差异。

如果上市及挂牌投资于报告日的公允价值是以活跃市场的开列市价或具约束力的交易商报价作为基准，在没有就交易成本作出任何扣减的情况下，工具计入公允价值层级的第 1 层级。当定息工具于报告日的公允价值代表了在交投较为淡静的市场上的报价，有关定息工具会计入公允价值层级的第 2 层级。

对于并无上市的投资基金而言，交易不一定是定期进行，而本子基金会根据相关投资基金的行政管理人发布的份额净值进行估值。有关资产净值会在必要时调整，以反映自计算日以来的时间推移、流动资金风险、赎回限制和其他因素的影响。本子基金将相关投资基金的公允价值分类为第 1 层级或第 2 层级，取决于相关投资基金的资产及负债的公允价值水平及需否调整而定。

场外衍生合约包括与外币相关的远期合约。基于交易的产品和条款，并考虑到交易对手的信誉和使用多项技术 (包括仿真模型)，场外衍生产品的公允价值可制定模型。许多定价模型并不需要涉及重大的主观性，因为所采用的方法并不需要作出重大判断，而且定价输入变量可从活跃报价的市场中观察出来。本子基金使用定价模型估值的外币远期合约属于这个类别，并划归为公允价值层级的第 2 层级。

8 衍生金融工具

衍生金融工具是指截至年末 / 期末日期尚未到期的外币远期合约，具体如下：

东亚联丰亚洲策略增长基金

于2024年12月31日

| 到期日 | 相关投资 | <u>未行使合约的名义金额</u> | | 公允价值 港元 |
|------------|---------------|-------------------|------------|----------------|
| 2025年1月24日 | 买入港元 / 卖出澳元 | 港元 | 38,139,512 | 410,959 |
| 2025年1月24日 | 买入港元 / 卖出新加坡元 | 港元 | 38,646,729 | 273,897 |
| 2025年1月24日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 | 51,078,395 | <u>15,740</u> |
| | | | | <u>700,596</u> |

于2025年12月31日，本子基金并无尚未行使的远期合约。

8 衍生金融工具 (续)

东亚联丰环球债券基金

于2025年12月31日

| 到期日 | 相关投资 | 未行使合约的名义金额 | | 公允价值 港元 |
|------------|---------------|------------|-------------|--------------------|
| 2026年1月14日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 | 380,000,000 | (300,152) |
| 2026年1月14日 | 买入美元 / 卖出港元 | 美元 | 25,688,404 | (160,222) |
| 2026年1月16日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 | 310,000,000 | (227,153) |
| 2026年1月23日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 | 350,000,000 | (232,970) |
| 2026年1月28日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 | 400,000,000 | (219,780) |
| 2026年1月30日 | 买入欧元 / 卖出港元 | 欧元 | 6,600,000 | (16,672) |
| 2026年1月30日 | 买入港元 / 卖出澳元 | 港元 | 75,157,880 | (550,128) |
| 2026年1月30日 | 买入港元 / 卖出英镑 | 港元 | 145,813,388 | (583,016) |
| 2026年1月30日 | 买入港元 / 卖出英镑 | 港元 | 41,661,636 | (165,908) |
| 2026年1月30日 | 买入港元 / 卖出英镑 | 港元 | 60,225,582 | (424,357) |
| 2026年1月30日 | 买入港元 / 卖出加拿大元 | 港元 | 67,839,888 | (317,436) |
| 2026年1月30日 | 买入港元 / 卖出欧元 | 港元 | 91,366,250 | (77,350) |
| 2026年1月30日 | 买入港元 / 卖出欧元 | 港元 | 153,544,658 | (80,590) |
| 2026年1月30日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 | 420,000,000 | (305,297) |
| 2026年2月6日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 | 400,000,000 | (257,657) |
| | | | | <u>(3,918,688)</u> |

8 衍生金融工具 (续)

东亚联丰环球债券基金 (续)

于2024年12月31日

| 到期日 | 相关投资 | 未行使合约的名义金额 | | 公允价值 港元 |
|------------|---------------|------------|-------------|-------------------|
| 2025年1月8日 | 买入港元 / 卖出澳元 | 港元 | 9,907,836 | 289,382 |
| 2025年1月8日 | 买入港元 / 卖出澳元 | 港元 | 87,028,164 | 462,078 |
| 2025年1月8日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 | 250,000,000 | 334,664 |
| 2025年1月9日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 | 470,000,000 | 622,131 |
| 2025年1月10日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 | 240,000,000 | 386,492 |
| 2025年1月15日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 | 200,000,000 | 233,653 |
| 2025年1月17日 | 买入港元 / 卖出英镑 | 港元 | 68,732,937 | 653,779 |
| 2025年1月17日 | 买入港元 / 卖出加拿大元 | 港元 | 49,251,717 | 617,139 |
| 2025年1月17日 | 买入港元 / 卖出欧元 | 港元 | 170,213,430 | 2,814,261 |
| 2025年1月17日 | 买入港元 / 卖出日元 | 港元 | 194,608,720 | 4,442,898 |
| 2025年1月17日 | 买入港元 / 卖出墨西哥元 | 港元 | 36,502,521 | 1,128,951 |
| 2025年1月17日 | 买入港元 / 卖出人民币 | 港元 | 130,237,523 | 1,150,177 |
| 2025年1月17日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 | 420,000,000 | 247,634 |
| 2025年1月22日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 | 130,000,000 | 94,253 |
| 2025年1月24日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 | 270,000,000 | 116,134 |
| | | | | <u>13,593,626</u> |

8 衍生金融工具 (续)

东亚联丰环球股票基金

于2025年12月31日

| 到期日 | 相关投资 | 未行使合约的名义金额 | Fair value 港元 |
|------------|-------------|------------------|--------------------|
| 2026年1月30日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 2,959,455,600 | <u>(2,689,584)</u> |

于2024年12月31日

| 到期日 | 相关投资 | 未行使合约的名义金额 | 公允价值 港元 |
|------------|-------------|------------------|------------------|
| 2025年1月28日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 1,971,725,800 | <u>(813,961)</u> |

东亚联丰亚太区投资级别债券基金

于2025年12月31日

| 到期日 | 相关投资 | 未行使合约的名义金额 | 公允价值 港元 |
|------------|--------------|----------------|------------------|
| 2026年1月30日 | 买入港元 / 卖出澳元 | 港元 3,399,594 | (22,823) |
| 2026年1月30日 | 买入港元 / 卖出欧元 | 港元 31,994,550 | (10,710) |
| 2026年1月30日 | 买入港元 / 卖出人民币 | 港元 11,337,091 | (101,807) |
| 2026年1月30日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 294,000,000 | <u>(176,978)</u> |
| | | | <u>(312,318)</u> |

于2024年12月31日

| 到期日 | 相关投资 | 未行使合约的名义金额 | 公允价值 港元 |
|------------|-------------|----------------|----------------|
| 2025年3月13日 | 买入港元 / 卖出美元 | 港元 370,000,000 | <u>177,558</u> |

9 投资收益 / (亏损) 净额

| | 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | 东亚联丰环球债券基金 | |
|----------------------|--------------------|--------------------|--------------------|----------------------|
| | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 |
| 未变现投资收益 / (亏损) 的变动净额 | 268,908,234 | 144,037,722 | 428,172,802 | (269,920,539) |
| 已变现投资收益 / (亏损) | 342,304,900 | 182,014,825 | 92,550,867 | 80,596,409 |
| | <u>611,213,134</u> | <u>326,052,547</u> | <u>520,723,669</u> | <u>(189,324,130)</u> |

| | 东亚联丰环球股票基金 | | 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | |
|----------------------|----------------------|--------------------|-------------------|-------------------|
| | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 | 2025 年 港元 | 2024 年 港元 |
| 未变现投资收益 / (亏损) 的变动净额 | 260,350,907 | 478,574,241 | 30,212,706 | 4,213,390 |
| 已变现投资收益 / (亏损) | 876,079,846 | 367,045,136 | 54,295,831 | 43,960,646 |
| | <u>1,136,430,753</u> | <u>845,619,377</u> | <u>84,508,537</u> | <u>48,174,036</u> |

10 与基金管理人、受托人及关连人士进行的交易

以下概述了重大关联方交易或本子基金在年内 / 期内与基金管理人、受托人及其关联人士进行的交易。关联人士是指香港证监会颁布的《单位及互惠基金守则》所界定的人士。本子基金在年内与基金管理人、受托人及其关联人士进行的所有交易均于日常业务过程中按正常商业条款进行。东亚联丰核心累积基金和东亚联丰 65 岁后基金的 I 类别份额并不收取投资管理方、受托人费用及基金登记机构费用。据基金管理人及受托人所知，本子基金除了下列交易外，没有与关联人士进行其他交易。

10 与基金管理人、受托人及关连人士进行的交易 (续)

(a) 投资管理费

自 2024 年 1 月 15 日起，基金管理人有权收取各类别份额的管理费，管理费按有关子基金与有关类别份额相关的部分资产净值的百分比计算，详情如下：

| | A 类别 %每年 | D 类别 %每年 | I 类别 %每年 | I(2) 类别 %每年 | I(3) 类别 %每年 | I(4) 类别 %每年 | R 类别 / R(2)类别 / R(3)类别 ⁽¹⁾ %每年 |
|-----------------------------------|-------------|-------------|-------------|----------------|----------------|----------------|--|
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | 零 | 1.75 | 不适用 | 高达 0.40 | 0.75 | 0.75 | 1.50 |
| 东亚联丰环球债券基金 ⁽²⁾⁽⁶⁾ | 零 | 1.10 | 零 | 高达 0.30 | 0.43 | 0.43 | 0.85 |
| 东亚联丰环球股票基金 ⁽³⁾⁽⁴⁾ | 零 | 1.75 | 零 | 高达 0.40 | 0.75 | 0.75 | 1.50 |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 ⁽⁵⁾⁽⁶⁾ | 零 | 1.25 | 不适用 | 高达 0.30 | 0.50 | 0.50 | 1.00 |

费用于每个交易日计算和累计，并按月支付。

⁽¹⁾ 自 2024 年 1 月 15 日起，R 类别基金份额已重组为 R 类别、R(2) 类别和 R(3) 类别基金份额。R 类别、R(2) 类别和 R(3) 类别基金份额的计算货币分别为港元、美元及人民币。

⁽²⁾ 东亚联丰环球债券基金 I(2) 类别于 2024 年 8 月 30 日发行。I(2) 类别年内并无收取任何管理费。

⁽³⁾ 东亚联丰环球股票基金 I(2) 类别和 R(3) 类别分别于 2024 年 8 月 30 日和 2024 年 11 月 19 日发行。I(2) 类别年内并无收取任何管理费。

⁽⁴⁾ 东亚联丰环球股票基金 R(2) 类别于 2025 年 1 月 6 日发行。

⁽⁵⁾ 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 I(2) 类别于 2025 年 2 月 12 日发行。

⁽⁶⁾ 东亚联丰环球债券基金和东亚联丰亚太区投资级别债券基金 I(2) 类别于 2025 年 4 月 8 日全额赎回。

10 与基金管理人、受托人及关连人士进行的交易 (续)

(a) 投资管理费 (续)

自 2022 年 8 月 8 日至 2024 年 1 月 14 日期间，基金管理人有权收取各类别份额的管理费，管理费按有关子基金与有关类别份额相关的部分资产净值的百分比计算，详情如下：

| | A 类别 %每年 | D 类别 %每年 | I 类别 %每年 | I(2) 类别 %每年 | I(3) 类别 %每年 | R 类别 %每年 |
|-----------------|-------------|-------------|-------------|----------------|----------------|-------------|
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | 零 | 1.75 | 不适用 | 高达 0.40 | 0.75 | 1.50 |
| 东亚联丰环球债券基金 | 零 | 1.10 | 零 | 高达 0.30 | 0.43 | 0.85 |
| 东亚联丰环球股票基金 | 零 | 1.75 | 零 | 高达 0.40 | 0.75 | 1.50 |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | 零 | 1.25 | 不适用 | 高达 0.30 | 0.50 | 1.00 |

费用于每个交易日计算和累计，并按月支付。

10 与基金管理人、受托人及关连人士进行的交易 (续)

(a) 投资管理费 (续)

年内 / 期内就各子基金收取的投资管理费会于全面收益表中披露。于 12 月 31 日, 就各子基金应付的投资管理费如下:

| | 2025 年 | | 2024 年 | |
|-----------------|--------|-----------|--------|--------|
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | 港元 | 91,580 | 港元 | 88,699 |
| 东亚联丰环球债券基金 | 港元 | 22,400 | 港元 | 31,324 |
| 东亚联丰环球股票基金 | 港元 | 2,608,258 | 港元 | 52,127 |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | 港元 | 3,001 | 港元 | 2,798 |

10 与基金管理人、受托人及关连人士进行的交易 (续)

(b) 受托人费用

自 2025 年 4 月 30 日起，基金管理人有权收取各类别份额的受托人费用，受托人费用按有关子基金与有关类别份额相关的部分资产净值的百分比计算，详情如下：

| | A 类别 | D 类别 | I 类别 | I(2)类别 / I(3)类别 | I(4)类别 / R(3)类别 ⁽³⁾ | R 类别 ⁽¹⁾ | R(2) 类别 ⁽¹⁾ |
|-----------------------------------|------|-------------|------|--------------------|-----------------------------------|---------------------|------------------------|
| | %每年 | %每年 | %每年 | %每年 | %每年 | %每年 | %每年 |
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | 零 | 高达 0.125 | 不适用 | 高达 0.070 | 高达 0.070 | 高达 0.070 | 高达 0.125 |
| 东亚联丰环球债券基金 ⁽²⁾⁽⁶⁾ | 零 | 高达 0.085 | 零 | 高达 0.070 | 高达 0.070 | 高达 0.070 | 高达 0.085 |
| 东亚联丰环球股票基金 ⁽³⁾⁽⁴⁾ | 零 | 高达 0.150 | 零 | 高达 0.070 | 高达 0.070 | 高达 0.150 | 高达 0.070 |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 ⁽⁵⁾⁽⁶⁾ | 零 | 高达 0.100 | 不适用 | 高达 0.070 | 高达 0.070 | 高达 0.100 | 高达 0.070 |

费用于每个交易日计算和累计，并按月支付。

(1) 自 2024 年 1 月 15 日起，R 类别基金份额已重组为 R 类别、R(2) 类别和 R(3) 类别基金份额。R 类别、R(2) 类别和 R(3) 类别基金份额的计算货币分别为港元、美元及人民币。

(2) 东亚联丰环球债券基金 I(2)类别于 2024 年 8 月 30 日发行。

(3) 东亚联丰环球股票基金 I(2) 类别和 R(3) 类别分别于 2024 年 8 月 30 日和 2024 年 11 月 19 日发行。

(4) 东亚联丰环球股票基金 R(2) 类别于 2025 年 1 月 6 日发行。

(5) 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 I(2) 类别于 2025 年 2 月 12 日发行。

(6) 东亚联丰环球债券基金和东亚联丰亚太区投资级别债券基金 I(2) 类别于 2025 年 4 月 8 日全额赎回。

10 与基金管理人、受托人及关连人士进行的交易 (续)

(b) 受托人费用 (续)

自 2024 年 1 月 15 日至 2025 年 4 月 29 日期间，受托人有权收取各类别份额的受托人费用，受托人费用按有关子基金与有关类别份额相关的部分资产净值的百分比计算，详情如下：

| | A 类别 | D 类别 | I 类别 | I(2)类别 / I(3)类别 | I(4)类别 / R(3)类别 | R 类别 | R(2) 类别 |
|---------------------|------|-------|------|--------------------|--------------------|-------|---------|
| | %每年 | %每年 | %每年 | %每年 | %每年 | %每年 | %每年 |
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | 零 | 0.125 | 不适用 | 0.070 | 0.070 | 0.070 | 0.125 |
| 东亚联丰环球债券基金 | 零 | 0.085 | 零 | 0.070 | 0.070 | 0.070 | 0.085 |
| 东亚联丰环球股票基金 | 零 | 0.150 | 零 | 0.070 | 0.070 | 0.150 | 0.070 |
| 东亚联丰亚太区投资级 别债券基金 | 零 | 0.100 | 不适用 | 0.070 | 0.070 | 0.100 | 0.070 |

10 与基金管理人、受托人及关连人士进行的交易 (续)

(b) 受托人费用 (续)

自 2022 年 8 月 8 日至 2024 年 1 月 14 日期间，受托人有权收取各类别份额的受托人费用，受托人费用按有关子基金与有关类别份额相关的部分资产净值的百分比计算，详情如下：

| | A 类别 %每年 | D 类别 %每年 | I 类别 %每年 | I(2) 类别 %每年 | I(3) 类别 %每年 | R 类别 %每年 |
|-----------------|-------------|-------------|-------------|----------------|----------------|-------------|
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | 零 | 0.125 | 不适用 | 0.070 | 0.070 | 0.125 |
| 东亚联丰环球债券基金 | 零 | 0.085 | 零 | 0.070 | 0.070 | 0.085 |
| 东亚联丰环球股票基金 | 零 | 0.150 | 零 | 0.070 | 0.070 | 0.150 |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | 零 | 0.100 | 不适用 | 0.070 | 0.070 | 0.100 |

费用于每个交易日计算和累计，并按月支付。

10 与基金管理人、受托人及关连人士进行的交易 (续)

(b) 受托人费用 (续)

年内 / 期内就各子基金收取的受托人费用会于全面收益表中披露。于 12 月 31 日，就各子基金应付的受托人费用如下：

| | 2025 年 | 2024 年 |
|-----------------|------------|-----------|
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | 港元 7,750 | 港元 7,604 |
| 东亚联丰环球债券基金 | 港元 2,240 | 港元 10,456 |
| 东亚联丰环球股票基金 | 港元 143,814 | 港元 9,247 |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | 港元 300 | 港元 280 |

10 与基金管理人、受托人及关连人士进行的交易 (续)

(c) 基金登记机构费用

于 2025 年和 2024 年期间，受托人将基金登记机构的职能指派予基金管理人，并同意基金管理人直接从子基金收取所有基金登记机构费用。基金登记机构费用按子基金资产净值百分比计算，相关费率载列如下（但东亚联丰环球债券基金和东亚联丰环球股票基金的 I 类别份额除外）。东亚联丰环球债券基金和东亚联丰环球股票基金 I 类别份额无须缴纳基金登记机构费用。

资产净值

| | |
|----------------|--------|
| 首笔 3.9 亿港元 | 0.050% |
| 接下来的 7,800 万港元 | 0.045% |
| 接下来的 7,800 万港元 | 0.040% |
| 接下来的 7,800 万港元 | 0.035% |
| 接下来的 7,800 万港元 | 0.030% |
| 接下来的 7,800 万港元 | 0.025% |
| 余额 | 0.015% |

2025 年和 2024 年所采用的费率相同。费用于每个交易日计算和累计，并按月支付。

年内 / 期内就各子基金收取的基金登记机构费用会于全面收益表中披露。于 12 月 31 日，就各子基金应付的基金登记机构费用如下：

| | 2025 年 | | 2024 年 | |
|-----------------|--------|--------|--------|--------|
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | 港元 | 46,918 | 港元 | 42,390 |
| 东亚联丰环球债券基金 | 港元 | 75,505 | 港元 | 77,118 |
| 东亚联丰环球股票基金 | 港元 | 92,517 | 港元 | 61,056 |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | 港元 | 32,114 | 港元 | 32,217 |

10 与基金管理人、受托人及关连人士进行的交易 (续)

(d) 银行结余

本子基金的银行账户存置于东亚银行有限公司，即基金管理人和受托人的最终控股公司。该等账户的结余载列如下：

| | 2025 年 | | 2024 年 | |
|--------------------|--------|--------|--------|--------|
| 于 12 月 31 日 | | | | |
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | 港元 | 21,441 | 港元 | 20,210 |
| 东亚联丰环球债券基金 | 港元 | 89,104 | 港元 | 88,600 |
| 东亚联丰环球股票基金 | 港元 | 15,982 | 港元 | 14,914 |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | 港元 | 20,983 | 港元 | 20,794 |

10 与基金管理人、受托人及关连人士进行的交易 (续)

(e) 银行现金利息

本子基金的银行账户存置于东亚银行有限公司，即基金管理人和受托人的最终控股公司。年内/期内获取的银行现金利息结余载列如下：

| | 2025 年 | 2024 年 |
|-----------------|----------|-----------|
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | 港元 1,411 | 港元 299 |
| 东亚联丰环球债券基金 | 港元 338 | 港元 36,034 |
| 东亚联丰环球股票基金 | 港元 67 | 港元 119 |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | 港元 64 | 港元 39 |

10 与基金管理人、受托人及关连人士进行的交易 (续)

(f) 银行手续费

本子基金的银行账户存置于东亚银行有限公司，即基金管理人和受托人的最终控股公司。年内 / 期内的银行手续费结余载列如下：

| | 2025 年 | 2024 年 |
|-----------------|--------|--------|
| 东亚联丰亚洲策略增长基金 | 港元 180 | 港元 - |
| 东亚联丰环球债券基金 | 港元 - | 港元 - |
| 东亚联丰环球股票基金 | 港元 - | 港元 - |
| 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | 港元 - | 港元 - |

10 与基金管理人、受托人及关连人士进行的交易 (续)

(g) 投资

东亚联丰投资管理公司、子基金的基金管理人、东亚银行受托代管有限公司以及东亚银行(中国)有限公司(上述两间公司均为基金管理人的子公司)于报告年末/期末持有以下子基金份额。

| | 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | 东亚联丰环球债券基金 | |
|---------------------------------------|--------------|-------------|-----------------|-------------|
| | 2025年 份额 | 2024年 份额 | 2025年 份额 | 2024年 份额 |
| 东亚联丰投资管理有限公司 | | | | |
| - I类别 | - | - | - | - |
| - R(3)类别 ⁽²⁾ | - | - | - | - |
| 东亚银行受托代管有限公司 | | | | |
| - R类别 ⁽²⁾ | - | - | - | - |
| - R(2)类别 ⁽²⁾ | 110,028 | 134,293 | 27 | - |
| 东亚银行(中国)有限公司 | | | | |
| - R类别 | - | - | - | - |
| - R(2)类别 ⁽²⁾ | 12,151 | 13,994 | 44,312 | 171,559 |
| | | | | |
| | 东亚联丰环球股票基金 | | 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | |
| | 2025年 份额 | 2024年 份额 | 2025年 份额 | 2024年 份额 |
| 东亚联丰投资管理有限公司 | | | | |
| - I类别 | - | - | - | - |
| - R(3)类别 ⁽²⁾ | - | 3,988 | - | - |
| 东亚银行受托代管有限公司 | | | | |
| - R类别 ⁽²⁾ | 230,027 | 201,646 | - | - |
| - R(2)类别 ⁽²⁾ | - | - | - | - |
| The Bank of East Asia (China) Limited | | | | |
| - R类别 ⁽²⁾ | 36,068 | 11,124 | 12,319 | - |
| - R(2)类别 ⁽²⁾ | - | - | - | - |

⁽²⁾ 自2024年1月15日起, R类别基金份额已重组为R类别、R(2)类别和R(3)类别基金份额。R类别、R(2)类别和R(3)类别基金份额的计算货币分别为港元、美元及人民币。

10 与基金管理人、受托人及关连人士进行的交易 (续)

(g) 投资 (续)

于截至 2025 年 12 月 31 日及 2024 年 12 月 31 日止年度，东亚联丰核心累积基金投资和东亚联丰 65 岁后基金均投资于东亚联丰环球股票基金及东亚联丰环球债券基金。此等投资基金由基金管理人管理及由受托人保管。相关交易详情载列如下：

2025 年

| 相关基金份额持有人名称 | 东亚联丰 核心累积基金 | 东亚联丰 核心累积基金 | 东亚联丰 65 岁后基金 | 东亚联丰 65 岁后基金 |
|-------------|---------------------|---------------------|---------------------|-------------------|
| 被投资基金名称 | 东亚联丰环球债券 基金 | 东亚联丰环球股票 基金 | 东亚联丰环球债券 基金 | 东亚联丰环球股票 基金 |
| 年终持有的份额数目 | 16,350,467 | 10,173,665 | 15,713,810 | 1,660,733 |
| 年终持有的份额市值 | 港元 1,712,875,009 | 港元 2,769,475,524 | 港元 1,646,178,889 | 港元 452,084,815 |
| 年内销售总额 | 港元 148,055,115 | 港元 239,109,690 | 港元 146,804,514 | 港元 72,130,929 |
| 年内购入总额 | 港元 340,318,135 | 港元 390,515,703 | 港元 232,400,855 | 港元 74,975,275 |

2024 年

| 相关基金份额持有人名称 | 东亚联丰 核心累积基金 | 东亚联丰 核心累积基金 | 东亚联丰 65 岁后基金 | 东亚联丰 65 岁后基金 |
|-------------|---------------------|---------------------|---------------------|-------------------|
| 被投资基金名称 | 东亚联丰 环球债券基金 | 东亚联丰 环球股票基金 | 东亚联丰 环球债券基金 | 东亚联丰 环球股票基金 |
| 年终持有的份额数目 | 14,493,850 | 9,512,906 | 14,889,072 | 1,636,983 |
| 年终持有的份额市值 | 港元 1,437,210,216 | 港元 2,165,803,533 | 港元 1,476,400,461 | 港元 372,691,921 |
| 年内销售总额 | 港元 84,220,653 | 港元 290,426,462 | 港元 104,641,484 | 港元 111,679,136 |
| 年内购入总额 | 港元 449,097,725 | 港元 376,359,217 | 港元 287,838,647 | 港元 69,863,390 |

11 与联营公司进行的交易

与香港《强制性公积金计划条例》及积金局颁布的《核准汇集投资基金周年报表指引》附件 A 第 I(E)(2) 条所界定的联营公司的所有交易，已纳入与基金管理人、受托人及关连人士的交易中，详见附注 10。

12 银行贷款、透支及其他借款

于 2025 年及 2024 年 12 月 31 日，本子基金并无银行贷款、透支或其他借款。

13 税项

由于本子基金的股息收入、银行存款利息、已变现收益以及出售投资所得款项根据香港《税务条例》第 14、26 或 26A 条获豁免纳税，因此，并无在财务报表中就香港利得税计提准备金。

本子基金年内 / 期内收取的若干股息及利息收入需要缴付不可收回的海外预扣税。

本子基金年内 / 期内收取的若干投资资本增值需要缴付不可退回的资本利得税。

14 非金钱佣金安排

于截至 2025 年及 2024 年 12 月 31 日止年度 / 期间，基金管理人及其受委派代表并无与经纪就本子基金资产交易订立非金钱佣金安排。

15 担保贷款安排

于截至 2025 年及 2024 年 12 月 31 日止年度 / 期间，本子基金并未订立任何担保贷款安排。

16 资产流通性

于 2025 年 12 月 31 日，不存在限制本子基金资产流通性的法定或合约要求 (2024 年：零港元)。

17 承担

于 2025 年 12 月 31 日，本子基金并无承担 (2024 年：零港元)。

18 或有负债和资本承担

于 2025 年 12 月 31 日，本子基金并无或有负债或未履行的资本承担 (2024 年：零港元)。

19 交易成本

于年末 / 期末，各子基金的交易成本涉及以下费用：

| | 东亚联丰亚洲策略增长基金 | | 东亚联丰环球债券基金 | | 东亚联丰环球股票基金 | | 东亚联丰亚太区投资级别债券基金 | |
|----------|--------------|-----------|------------|--------|------------|-----------|-----------------|--------|
| | 2025 年 | 2024 年 | 2025 年 | 2024 年 | 2025 年 | 2024 年 | 2025 年 | 2024 年 |
| | 港元 | 港元 | 港元 | 港元 | 港元 | 港元 | 港元 | 港元 |
| 经纪佣金 | 4,578,095 | 3,383,311 | - | 10,572 | 2,760,273 | 1,149,265 | - | 497 |
| 印花税及交易征费 | 4,013,369 | 3,439,775 | 21,027 | - | 4,345,375 | 1,995,760 | - | - |
| 交易成本总额 | 8,591,464 | 6,823,086 | 21,027 | 10,572 | 7,105,648 | 3,145,025 | - | 497 |

20 参与未合并结构化实体业务

该等子基金认为其已作投资但并未合并的上市房地产投资信托基金及上市和非上市开放式投资基金均符合结构化实体的定义，理由是：

- 就控制权的决定而言，两者在这些投资基金中所占的投票权并不占主导权，因投票权仅与行政事务相关；
- 这些投资基金的活动受各自章程限制；及
- 投资基金设定了有限而明确的投资目标，以为投资者提供投资机会。

下表列出了该等子基金未合并但在其中占有权益的结构化实体的类型。

| <i>结构化主体类型</i> | <i>性质和用途</i> | <i>子基金持有的权益</i> |
|----------------|--|-----------------|
| 投资基金 | 代表第三方投资者投资及凭借投资管理取得管理费。 这些工具通过向投资者发行份额获取资金。 | 对投资基金发行的份额进行投资 |

20 参与未合并结构化实体业务 (续)

下表列出了该等子基金持有的未合并结构化实体的权益。最大亏损额度为持有的金融资产的账面价值。

于 2025 年 12 月 31 日

| | 被投资基金数量 | 结构化实体的资产 净值总额 港元 (百万) | 计入“投资”的账 面金额 港元 (百万) |
|-------------------|---------|--------------------------------|-------------------------------|
| 东亚联丰环球股票基金 | | | |
| 投资于上市开放式投资基金 | | | |
| - 长仓 | 1 | 87,273 | 2 |

于 2024 年 12 月 31 日

| | | | |
|-------------------|---|--------|---|
| 东亚联丰环球股票基金 | | | |
| 投资于上市开放式投资基金 | | | |
| - 长仓 | 1 | 72,779 | 3 |

于截至 2025 年及 2024 年 12 月 31 日止年度 / 期间，本子基金并未向未合并结构化实体提供财务支持，且亦无意提供财务或其他支持。

21 分部信息

基金管理人代表本子基金进行策略性的资源分配，并根据用以作出策略性决定的内部检讨报告来确定经营分部。基金管理人以单一及综合的投资策略作出资产配置的决定，并在整体层面评估本子基金的业绩表现。因此，基金管理人视本子基金只有一个经营分部，而这个分部根据基金说明书所定的投资目标，投资于一个金融工具组合，以产生投资回报。各子基金的投资目标和投资组合均载列于投资报告。

年内 / 期内并无经营分部的变动。

向基金管理人作出的内部报告与全面收益表及资产负债表所披露者相等。

22 已颁布但尚未在截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间生效的修订、新准则和释义可能带来的影响

截至本财务报表发布日，香港会计师公会已颁布数项在截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间尚未生效，亦没有在本财务报表中采用的新准则或准则修订。这些准则变化具体推进包括下列可能与本子基金有关的项目。

在以下日期或之后开始
的会计期间生效

| | |
|---|----------------|
| 《香港财务报告准则》第 9 号之修订， <i>金融工具</i> 及《香港财务报告准则》第 7 号之修订， <i>金融工具：披露 - 对金融工具分类和计量的修订</i> | 2026 年 1 月 1 日 |
| 《香港财务报告会计准则》年度改进 – 第 11 卷 | 2026 年 1 月 1 日 |
| 《香港财务报告准则》第 18 号， <i>财务报表的呈列及披露</i> | 2027 年 1 月 1 日 |

基金管理人和受托人正在评估这些准则变化对初始采用期间的预期影响。目前结论是除以下事项外，采用这些修订不大可能对财务报表有重大影响：

《香港财务报告准则》第 18 号将替代《香港会计准则》第 1 号，财务报表列报，旨在提高实体财务报表信息的透明度及可比性。《香港财务报告准则》第 18 号将于自 2027 年 1 月 1 日或之后开始的年度报告期生效，并将追溯应用。

除其他变动以外，根据《香港财务报告准则》第 18 号，实体须在损益表中将所有收入和费用划分为五类，即经营、投资、融资、终止经营和所得税类别。本基金亦须在财务报表的一个单独附注中，就管理层定义的业绩指标作出具体披露。

22 已颁布但尚未在截至 2025 年 12 月 31 日止年度 / 期间生效的修订、新准则和释义可能带来的影响 (续)

基金管理人和受托人未计划提前采用《香港财务报告准则》第 18 号，且目前仍正在评估采用该项准则的影响。

23 后续事项

自本年末起未发生任何需要在财务报表中披露的重大事项。