

中期报告 ( 未经审计 )  
截至2020年6月30日止期间

---

## 东亚联丰投资系列

东亚联丰亚洲债券及货币基金  
东亚联丰亚太区多元收益基金

**注意:** 此中期报告 ( 未经审计 ) 的摘要版本只适用于在此列示的子基金。

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

附注：

本基金的财务报表已按照香港会计师公会颁布的所有适用的《香港财务报告准则》(此统称包含所有适用的个别《香港财务报告准则》、《香港会计准则》及诠释)、香港公认会计原则、《信托契约》(经修订)的相关条文，以及由香港证监会颁布的该守则当中的相关条文编制。

采纳的主要会计政策与年度财务报表的财务报表附注所采用的政策一致。

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合

#### 东亚联丰亚洲债券及货币基金

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
<b>上市 / 挂牌投资 (95.37%)</b>			
<b>债务证券 (95.37%)</b>			
<b>以美元计价 (95.37%)</b>			
21Vianet Group Inc 7.875% 15/10/2021	400,000	411,644	0.06
ABJA Investment Co Pte Ltd 5.45% 24/01/2028	8,200,000	7,824,260	1.15
ABJA Investment Co Pte Ltd 5.95% 31/07/2024	7,800,000	7,935,462	1.16
Adani Green Energy UP Ltd 6.25% 10/12/2024	6,200,000	6,506,130	0.95
Adaro Indonesia PT 4.25% 31/10/2024	4,000,000	3,808,006	0.56
Agile Group Holdings Ltd 5.75% 02/01/2025	1,300,000	1,274,351	0.19
Agile Group Holdings Ltd 7.75% Perpetual Callable - 25/05/2025	4,400,000	4,296,600	0.63
Agile Group Holdings Ltd 7.875% Perpetual Callable - 31/07/2024	2,800,000	2,854,995	0.42
Agile Group Holdings Ltd 8.50% 18/07/2021	300,000	322,901	0.05
Alam Synergy Pte Ltd 6.625% 24/04/2022	8,700,000	4,192,703	0.62
Anton Oilfield Services Group/Hong Kong 7.50% 02/12/2022	5,300,000	3,451,952	0.51
APL Realty Holdings Pte Ltd 5.95% 02/06/2024	4,000,000	2,286,852	0.34
Azure Power Energy Ltd 5.50% 03/11/2022	6,000,000	6,114,247	0.90
Azure Power Solar Energy Pvt Ltd 5.65% 24/12/2024	4,700,000	4,756,252	0.70
Bank Mandiri Persero Tbk PT 4.75% 13/05/2025	974,000	1,040,362	0.15
Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT 4.20% 23/01/2025	2,000,000	1,956,087	0.29

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合(续)

#### 东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (95.37%) (续)			
债务证券 (95.37%) (续)			
以美元计价 (95.37%) (续)			
Barmenco Finance Pty Ltd 6.625% 15/05/2022	5,500,000	5,528,574	0.81
Central China Real Estate Ltd 6.50% 05/03/2021	750,000	766,796	0.11
Central China Real Estate Ltd 6.875% 10/02/2021	600,000	616,665	0.09
Central China Real Estate Ltd 8.75% 23/01/2021	300,000	316,778	0.05
Central Plaza Development Ltd 5.75% Perpetual Callable - 14/11/2024	4,000,000	3,929,268	0.58
CFLD Cayman Investment Ltd 6.90% 13/01/2023	2,400,000	2,451,528	0.36
CFLD Cayman Investment Ltd 6.92% 16/06/2022	1,900,000	1,901,868	0.28
CFLD Cayman Investment Ltd 8.625% 28/02/2021	700,000	732,255	0.11
CFLD Cayman Investment Ltd 9.00% 31/07/2021	4,000,000	4,254,760	0.62
Champion Sincerity Holdings Ltd 8.125% Perpetual Callable - 08/02/2022	2,300,000	2,411,491	0.35
China Aoyuan Group Ltd 6.35% 08/02/2024	1,700,000	1,688,389	0.25
China Aoyuan Group Ltd 7.50% 10/05/2021	200,000	205,203	0.03
China Aoyuan Group Ltd 7.95% 07/09/2021	3,300,000	3,457,517	0.51
China Aoyuan Group Ltd 7.95% 19/02/2023	3,000,000	3,209,430	0.47
China Aoyuan Group Ltd 8.50% 23/01/2022	200,000	214,301	0.03

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合(续)

#### 东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (95.37%) (续)			
债务证券 (95.37%) (续)			
以美元计价 (95.37%) (续)			
China Construction Bank Corp 2.45% 24/06/2030	1,500,000	1,497,595	0.22
China Evergrande Group 8.25% 23/03/2022	5,500,000	5,197,986	0.76
China Evergrande Group 9.50% 11/04/2022	500,000	480,406	0.07
China Evergrande Group 10.00% 11/04/2023	6,200,000	5,750,576	0.84
China Evergrande Group 11.50% 22/01/2023	5,200,000	5,177,233	0.76
China Evergrande Group 12.00% 22/01/2024	1,500,000	1,454,730	0.21
China Oil & Gas Group Ltd 5.50% 25/01/2023	2,000,000	2,039,027	0.30
China SCE Group Holdings Ltd 5.875% 10/03/2022	2,700,000	2,711,082	0.40
China SCE Group Holdings Ltd 7.25% 19/04/2023	5,000,000	5,074,200	0.74
China SCE Group Holdings Ltd 7.45% 17/04/2021	1,800,000	1,844,341	0.27
China SCE Group Holdings Ltd 8.75% 15/01/2021	2,000,000	2,106,281	0.31
China South City Holdings Ltd 10.875% 26/06/2022	1,600,000	1,464,737	0.21
China South City Holdings Ltd 11.50% 12/02/2022	2,400,000	2,396,518	0.35
Chong Hing Bank Ltd 5.70% Perpetual Callable - 15/07/2024	2,000,000	2,022,623	0.30
CIFI Holdings Group Co Ltd 6.45% 07/11/2024	1,000,000	1,028,355	0.15

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (95.37%) (续)			
债务证券 (95.37%) (续)			
以美元计价 (95.37%) (续)			
CIFI Holdings Group Co Ltd 6.55% 28/03/2024	1,425,000	1,491,862	0.22
CIFI Holdings Group Co Ltd 7.625% 02/03/2021	500,000	521,872	0.08
Country Garden Holdings Co Ltd 5.40% 27/05/2025	1,500,000	1,568,580	0.23
Country Garden Holdings Co Ltd 7.25% 08/04/2026	2,000,000	2,214,671	0.32
Delhi International Airport Ltd 6.125% 03/02/2022	1,500,000	1,544,476	0.23
Delhi International Airport Ltd 6.125% 31/10/2026	3,600,000	3,549,090	0.52
Delhi International Airport Ltd 6.45% 04/06/2029	6,500,000	6,339,499	0.93
Easy Tactic Ltd 8.75% 10/01/2021	627,000	652,364	0.10
Easy Tactic Ltd 9.125% 28/07/2022	2,000,000	1,995,702	0.29
Fantasia Holdings Group Co Ltd 7.95% 05/07/2022	750,000	752,682	0.11
Fantasia Holdings Group Co Ltd 10.875% 09/01/2023	1,500,000	1,603,182	0.24
Fantasia Holdings Group Co Ltd 11.75% 17/04/2022	400,000	423,829	0.06
Fantasia Holdings Group Co Ltd 12.25% 18/10/2022	1,100,000	1,177,363	0.17
Fantasia Holdings Group Co Ltd 15.00% 18/12/2021	2,000,000	2,163,873	0.32
Fortune Star BVI Ltd 5.25% 23/03/2022	5,000,000	5,022,158	0.74
Fortune Star BVI Ltd 6.75% 02/07/2023	3,700,000	3,868,544	0.57
Fortune Star BVI Ltd 6.85% 02/07/2024	3,100,000	3,142,284	0.46

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合(续)

#### 东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (95.37%) (续)			
债务证券 (95.37%) (续)			
以美元计价 (95.37%) (续)			
FWD Ltd 5.50% Perpetual Callable - 01/02/2023	2,000,000	1,845,768	0.27
Global Prime Capital Pte Ltd 5.95% 23/01/2025	1,500,000	1,466,526	0.22
Global Prime Capital Pte Ltd 7.25% 26/04/2021	5,000,000	5,086,751	0.75
GMR Hyderabad International Airport Ltd 4.25% 27/10/2027	1,400,000	1,256,858	0.18
GMR Hyderabad International Airport Ltd 5.375% 10/04/2024	3,300,000	3,249,489	0.48
Golden Eagle Retail Group Ltd 4.625% 21/05/2023	7,400,000	7,234,528	1.06
Greenko Dutch BV 4.875% 24/07/2022	4,200,000	4,252,647	0.62
Greenko Dutch BV 5.25% 24/07/2024	1,200,000	1,218,067	0.18
Greenko Solar Mauritius Ltd 5.55% 29/01/2025	6,100,000	6,149,857	0.90
Greenko Solar Mauritius Ltd 5.95% 29/07/2026	4,800,000	4,858,811	0.71
Greenland Global Investment Ltd 5.60% 13/11/2022	2,200,000	2,183,603	0.32
Greenland Global Investment Ltd 6.25% 16/12/2022	600,000	604,976	0.09
Greenland Global Investment Ltd 6.75% 25/06/2022	1,100,000	1,113,799	0.16
Greenland Global Investment Ltd 6.75% 26/09/2023	1,800,000	1,831,270	0.27
Greenland Global Investment Ltd 7.25% 12/03/2022	1,000,000	1,041,833	0.15
Greenland Global Investment Ltd FRN 26/09/2021	300,000	296,005	0.04

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合(续)

#### 东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (95.37%) (续)			
债务证券 (95.37%) (续)			
以美元计价 (95.37%) (续)			
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd 5.625% 24/10/2024	950,000	982,004	0.14
Hejun Shunze Investment Co Ltd 9.00% 04/03/2021	9,000,000	9,243,720	1.36
Hejun Shunze Investment Co Ltd 12.00% 25/04/2021	2,000,000	2,086,720	0.31
Hong Seng Ltd 9.875% 27/08/2022	700,000	689,972	0.10
Honghua Group Ltd 6.375% 01/08/2022	3,000,000	3,027,074	0.44
Hopson Capital International Group Co Ltd 6.00% 17/02/2021	3,270,000	3,323,792	0.49
HPCL-Mittal Energy Ltd 5.25% 28/04/2027	1,000,000	948,058	0.14
HT Global IT Solutions Holdings Ltd 7.00% 14/07/2021	4,000,000	4,088,649	0.60
Huarong Finance 2019 Co Ltd 3.375% 24/02/2030	1,250,000	1,242,720	0.18
Hutama Karya Persero PT 3.75% 11/05/2030	2,000,000	2,123,757	0.31
Hyundai Capital America 6.375% 08/04/2030	2,000,000	2,438,370	0.36
IIFL Finance Ltd 5.875% 20/04/2023	2,000,000	1,624,134	0.24
Indika Energy Capital II Pte Ltd 6.875% 10/04/2022	9,350,000	9,233,861	1.35
Indo Energy Finance II BV 6.375% 24/01/2023	4,617,000	4,446,411	0.65
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.45% 15/05/2030	2,000,000	2,244,928	0.33
International Container Terminal Services Inc 4.75% 17/06/2030	2,000,000	2,038,794	0.30



## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合(续)

#### 东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市/挂牌投资(95.37%)(续)			
债务证券(95.37%)(续)			
以美元计价(95.37%)(续)			
Jinke Properties Group Co Ltd 8.375% 20/06/2021	2,000,000	2,032,898	0.30
JSW Steel Ltd 5.25% 13/04/2022	5,000,000	4,936,375	0.72
JSW Steel Ltd 5.375% 04/04/2025	3,000,000	2,842,079	0.42
JSW Steel Ltd 5.95% 18/04/2024	2,000,000	1,952,571	0.29
Kaisa Group Holdings Ltd 6.75% 18/02/2021	900,000	921,827	0.14
Kaisa Group Holdings Ltd 7.875% 30/06/2021	1,900,000	1,906,591	0.28
Kaisa Group Holdings Ltd 8.50% 30/06/2022	4,000,000	3,969,424	0.58
Kaisa Group Holdings Ltd 9.375% 30/06/2024	2,800,000	2,575,861	0.38
Kaisa Group Holdings Ltd 10.50% 15/01/2025	1,500,000	1,500,655	0.22
Kaisa Group Holdings Ltd 10.875% 23/07/2023	2,950,000	3,093,397	0.45
Kaisa Group Holdings Ltd 11.25% 09/04/2022	1,100,000	1,171,671	0.17
Kaisa Group Holdings Ltd 11.50% 30/01/2023	2,500,000	2,686,840	0.39
Kaisa Group Holdings Ltd 11.95% 22/10/2022	3,600,000	3,835,779	0.56
Kaisa Group Holdings Ltd 11.95% 12/11/2023	200,000	209,025	0.03
King Talent Management Ltd 5.60% Perpetual Callable - 04/12/2022	1,600,000	1,375,712	0.20
KWG Group Holdings Ltd 5.20% 21/09/2022	200,000	199,705	0.03

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合(续)

#### 东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (95.37%) (续)			
债务证券 (95.37%) (续)			
以美元计价 (95.37%) (续)			
KWG Group Holdings Ltd 7.40% 05/03/2024	1,000,000	1,045,134	0.15
KWG Group Holdings Ltd 7.875% 01/09/2023	2,900,000	3,087,282	0.45
Lai Fung Bonds 2018 Ltd 5.65% 18/01/2023	2,500,000	2,401,330	0.35
LMIRT Capital Pte Ltd 7.25% 19/06/2024	7,100,000	6,374,640	0.93
Logan Group Co Ltd 6.50% 16/07/2023	3,800,000	4,016,796	0.59
Marble II Pte Ltd 5.30% 20/06/2022	2,700,000	2,691,737	0.39
Medco Bell Pte Ltd 6.375% 30/01/2027	5,765,000	5,046,794	0.74
Medco Oak Tree Pte Ltd 7.375% 14/05/2026	3,600,000	3,377,407	0.50
Medco Platinum Road Pte Ltd 6.75% 30/01/2025	10,300,000	9,899,562	1.45
Melco Resorts Finance Ltd 5.375% 04/12/2029	2,000,000	2,004,963	0.29
Melco Resorts Finance Ltd 5.625% 17/07/2027	3,900,000	4,047,518	0.59
MGM China Holdings Ltd 5.25% 18/06/2025	500,000	508,978	0.07
MGM China Holdings Ltd 5.875% 15/05/2026	8,710,000	9,073,790	1.33
Modern Land China Co Ltd 15.50% 02/07/2020	2,015,000	2,175,171	0.32
Muthoot Finance Ltd 4.40% 02/09/2023	1,000,000	974,314	0.14
Muthoot Finance Ltd 6.125% 31/10/2022	2,000,000	2,049,237	0.30

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合(续)

#### 东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (95.37%) (续)			
债务证券 (95.37%) (续)			
以美元计价 (95.37%) (续)			
Nanyang Commercial Bank Ltd 5.00% Perpetual Callable - 02/06/2022	8,400,000	8,261,381	1.21
Neerg Energy Ltd 6.00% 13/02/2022	2,200,000	2,232,252	0.33
New Metro Global Ltd 5.00% 08/08/2022	1,000,000	996,031	0.15
New Metro Global Ltd 6.50% 23/04/2021	400,000	406,719	0.06
New Metro Global Ltd 6.80% 05/08/2023	3,000,000	3,115,073	0.46
New Metro Global Ltd 7.50% 16/12/2021	7,700,000	7,866,667	1.15
New Metro Global Ltd 7.50% 20/03/2022	300,000	312,907	0.05
NWD Finance BVI Ltd 5.75% Perpetual Callable - 05/10/2021	1,500,000	1,501,539	0.22
PB International BV 7.625% 26/01/2022	3,900,000	3,593,537	0.53
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 6.15% 21/05/2048	2,000,000	2,514,947	0.37
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 6.95% 17/04/2021	2,000,000	2,049,752	0.30
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 6.95% 23/07/2023	4,600,000	4,761,473	0.70
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 7.125% 08/11/2022	1,800,000	1,843,775	0.27
Radiance Capital Investments Ltd 11.75% 31/10/2021	2,000,000	2,110,219	0.31
Redsun Properties Group Ltd 9.70% 16/04/2023	2,700,000	2,748,191	0.40
Redsun Properties Group Ltd 13.50% 03/12/2020	1,600,000	1,656,064	0.24

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合(续)

#### 东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市/挂牌投资(95.37%)(续)			
债务证券(95.37%)(续)			
以美元计价(95.37%)(续)			
ReNew Power Pvt Ltd 5.875% 05/03/2027	4,000,000	3,965,702	0.58
ReNew Power Pvt Ltd 6.45% 27/09/2022	6,600,000	6,708,235	0.98
ReNew Power Synthetic 6.67% 12/03/2024	6,000,000	6,189,692	0.91
RKPF Overseas 2019 A Ltd 6.70% 30/09/2024	2,800,000	2,892,977	0.42
RongXingDa Development BVI Ltd 8.00% 24/04/2022	2,900,000	2,804,993	0.41
RongXingDa Development BVI Ltd 8.75% 28/01/2021	9,400,000	9,752,137	1.43
Ronshine China Holdings Ltd 7.35% 15/12/2023	2,500,000	2,526,902	0.37
Ronshine China Holdings Ltd 8.75% 25/10/2022	1,950,000	2,066,496	0.30
Ronshine China Holdings Ltd 8.95% 22/01/2023	700,000	761,207	0.11
Ronshine China Holdings Ltd 10.50% 01/03/2022	12,400,000	13,606,768	2.00
Ronshine China Holdings Ltd 11.25% 22/08/2021	400,000	438,145	0.06
Scenery Journey Ltd 11.50% 24/10/2022	5,500,000	5,478,180	0.80
Scenery Journey Ltd 12.00% 24/10/2023	300,000	297,178	0.04
SD International Sukuk Ltd 6.30% 09/05/2022	9,250,000	7,422,015	1.09
Seazen Group Ltd 7.50% 22/01/2021	1,200,000	1,253,190	0.18
Shimao Group Holdings Ltd 5.60% 15/07/2026	3,800,000	4,107,808	0.60

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (95.37%) (续)			
债务证券 (95.37%) (续)			
以美元计价 (95.37%) (续)			
Shriram Transport Finance Co Ltd 5.10% 16/07/2023	6,000,000	5,426,730	0.80
Shriram Transport Finance Co Ltd 5.70% 27/02/2022	2,000,000	1,902,303	0.28
Shriram Transport Finance Co Ltd 5.95% 24/10/2022	4,500,000	4,192,171	0.61
Shui On Development Holding Ltd 5.50% 03/03/2025	4,800,000	4,656,949	0.68
Sinic Holdings Group Co Ltd 11.75% 10/03/2021	4,300,000	4,483,966	0.66
SMC Global Power Holdings Corp 6.50% Perpetual Callable - 25/04/2024	3,000,000	3,003,800	0.44
Sri Lanka Government International Bond 5.75% 18/04/2023	2,000,000	1,440,999	0.21
Sri Lanka Government International Bond 6.85% 14/03/2024	2,000,000	1,448,739	0.21
Studio City Finance Ltd 7.25% 11/02/2024	4,555,000	4,826,088	0.71
Sunac China Holdings Ltd 7.25% 14/06/2022	4,400,000	4,489,688	0.66
Sunac China Holdings Ltd 7.50% 01/02/2024	500,000	526,215	0.08
Sunac China Holdings Ltd 7.875% 15/02/2022	7,600,000	8,029,096	1.18
Sunac China Holdings Ltd 7.95% 08/08/2022	1,300,000	1,374,957	0.20
Sunac China Holdings Ltd 8.35% 19/04/2023	5,700,000	5,980,041	0.88
TBLA International Pte Ltd 7.00% 24/01/2023	8,650,000	7,842,417	1.15
Theta Capital Pte Ltd 6.75% 31/10/2026	6,600,000	5,327,438	0.78

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (95.37%) (续)			
债务证券 (95.37%) (续)			
以美元计价 (95.37%) (续)			
Theta Capital Pte Ltd 8.125% 22/01/2025	11,100,000	10,358,691	1.52
Times China Holdings Ltd 6.00% 05/05/2021	5,400,000	5,475,616	0.80
Times China Holdings Ltd 6.60% 02/03/2023	5,850,000	5,977,784	0.88
Times China Holdings Ltd 7.625% 21/02/2022	2,350,000	2,479,473	0.36
TMB Bank PCL/Cayman Islands 4.90% Perpetual Callable - 02/12/2024	1,850,000	1,735,498	0.25
Tsinghua Unic Ltd 4.75% 31/01/2021	1,000,000	875,234	0.13
Vedanta Resources Finance II PLC 8.00% 23/04/2023	5,500,000	4,143,871	0.61
Vedanta Resources Ltd 6.125% 09/08/2024	4,000,000	2,884,239	0.42
Vedanta Resources Ltd 6.375% 30/07/2022	14,200,000	11,238,016	1.65
Vedanta Resources Ltd 7.125% 31/05/2023	4,800,000	3,542,840	0.52
Vedanta Resources Ltd 8.25% 07/06/2021	4,400,000	3,880,272	0.57
Wanda Properties Overseas Ltd 6.875% 23/07/2023	4,200,000	4,135,587	0.61
Wanda Properties Overseas Ltd 6.95% 05/12/2022	700,000	689,479	0.10
Woori Bank 4.25% Perpetual Callable - 04/10/2024	4,500,000	4,541,224	0.67
Yango Justice International Ltd 8.25% 25/11/2023	1,600,000	1,581,736	0.23
Yango Justice International Ltd 9.25% 15/04/2023	6,200,000	6,448,947	0.95

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市 / 挂牌投资 (95.37%) (续)			
债务证券 (95.37%) (续)			
以美元计价 (95.37%) (续)			
Yango Justice International Ltd 10.25% 18/03/2022	4,060,000	4,315,441	0.63
Yanlord Land HK Co Ltd 6.75% 23/04/2023	1,500,000	1,532,925	0.22
Yanlord Land HK Co Ltd 6.80% 27/02/2024	2,860,000	2,899,446	0.43
Yuzhou Properties Co Ltd 5.375% Perpetual Callable - 29/09/2022	1,800,000	1,657,901	0.24
Yuzhou Properties Co Ltd 6.00% 25/10/2023	1,500,000	1,467,855	0.22
Yuzhou Properties Co Ltd 7.70% 20/02/2025	3,600,000	3,629,374	0.53
Yuzhou Properties Co Ltd 8.375% 30/10/2024	4,000,000	4,109,724	0.60
Yuzhou Properties Co Ltd 8.50% 26/02/2024	4,300,000	4,537,334	0.67
Yuzhou Properties Co Ltd 8.625% 23/01/2022	500,000	537,947	0.08
Zhenro Properties Group Ltd 7.875% 14/04/2024	1,700,000	1,682,577	0.25
Zhenro Properties Group Ltd 8.35% 10/03/2024	2,000,000	1,991,776	0.29
Zhenro Properties Group Ltd 8.65% 21/01/2023	530,000	554,123	0.08
Zhenro Properties Group Ltd 8.70% 03/08/2022	4,500,000	4,697,715	0.69
Zhenro Properties Group Ltd 9.15% 08/03/2022	2,500,000	2,632,027	0.39

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合(续)

#### 东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

	面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市/挂牌投资(95.37%)(续)			
债务证券(95.37%)(续)			
以美元计价(95.37%)(续)			
Zhenro Properties Group Ltd 9.15% 06/05/2023	3,550,000	3,653,160	0.54
Zhenro Properties Group Ltd 10.25% Perpetual Callable - 25/01/2022	200,000	207,733	0.03
Zhongliang Holdings Group Co Ltd 8.75% 16/02/2021	2,550,000	2,629,602	0.39
债务证券总额		<u>650,373,079</u>	<u>95.37</u>
投资总额		<u>650,373,079</u>	<u>95.37</u>
投资总额,按成本计算		<u>645,199,075</u>	

基础投资	对手方	未清偿合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
衍生金融工具(-0.06%)				
外汇远期合约(-0.06%)				
买入澳元/卖出美元	花旗银行,香港	58,935	(53)	(0.00)
买入澳元/卖出美元	花旗银行,香港	9,815,970	(38,371)	(0.01)
买入澳元/卖出美元	花旗银行,香港	19,000	(142)	(0.00)
买入澳元/卖出美元	花旗银行,香港	3,980	16	0.00



## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合(续)

#### 东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

基础投资	对手方	未清偿合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
<b>衍生金融工具 (-0.06%)(续)</b>				
<b>外汇远期合约 (-0.06%)(续)</b>				
买入加拿大元/ 卖出美元	花旗银行, 香港	8,000,000	44,115	0.01
买入加拿大元/ 卖出美元	花旗银行, 香港	8,000,000	(65,284)	(0.01)
买入欧元/ 卖出美元	花旗银行, 香港	5,000,000	(74,580)	(0.01)
买入欧元/ 卖出美元	花旗银行, 香港	5,000,000	(60,060)	(0.01)
买入欧元/ 卖出美元	花旗银行, 香港	5,000,000	(70,060)	(0.01)
买入欧元/ 卖出美元	花旗银行, 香港	14,636,226	(85,256)	(0.01)
买入挪威克朗/ 卖出美元	花旗银行, 香港	56,000,000	6,658	0.00
买入挪威克朗/ 卖出美元	花旗银行, 香港	56,000,000	(207,197)	(0.03)
买入人民币 / 卖出美元	花旗银行, 香港	3,462,304	(467)	(0.00)
买入人民币 / 卖出美元	花旗银行, 香港	783,250,187	(114,918)	(0.02)
买入人民币 / 卖出美元	花旗银行, 香港	225,010	(30)	(0.00)
买入人民币 / 卖出美元	花旗银行, 香港	634,833,846	(93,143)	(0.01)
买入人民币 / 卖出美元	花旗银行, 香港	110,452	(35)	(0.00)
买入人民币 / 卖出美元	花旗银行, 香港	156,615	(50)	(0.00)
买入人民币 / 卖出美元	花旗银行, 香港	6,174	-	0.00
买入人民币 / 卖出美元	花旗银行, 香港	146,015	(3)	(0.00)

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合(续)

#### 东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

基础投资	对手方	未清偿合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
<b>衍生金融工具 (-0.06%) (续)</b>				
<b>外汇远期合约 (-0.06%) (续)</b>				
买入人民币 / 卖出美元	花旗银行, 香港	1,970,229	284	0.00
买入新加坡元 / 卖出美元	花旗银行, 香港	8,000,000	1,122	0.00
买入 南韩圆 / 卖出美元	花旗银行, 香港	7,000,000,000	(2,030)	(0.00)
买入新台币 / 卖出美元	花旗银行, 香港	175,000,000	11,463	0.00
买入新台币 / 卖出美元	花旗银行, 香港	175,000,000	(22,256)	(0.00)
买入泰珠 / 卖出美元	花旗银行, 香港	190,000,000	192	0.00
买入美元 / 卖出澳元	花旗银行, 香港	135,816	(631)	(0.00)
买入美元 / 卖出加拿大元	花旗银行, 香港	5,910,602	36,858	0.01
买入美元 / 卖出加拿大元	花旗银行, 香港	5,964,808	90,968	0.01
买入美元 / 卖出欧罗	花旗银行, 香港	5,651,500	34,580	0.01
买入美元 / 卖出欧罗	花旗银行, 香港	5,638,500	21,060	0.00
买入美元 / 卖出欧罗	花旗银行, 香港	5,642,000	24,560	0.00
买入美元 / 卖出 挪威克朗	花旗银行, 香港	5,896,909	91,949	0.01
买入美元 / 卖出 挪威克朗	花旗银行, 香港	5,966,969	161,841	0.02
买入美元 / 卖出人民币	花旗银行, 香港	12,010	8	0.00
买入美元 / 卖出人民币	花旗银行, 香港	6,340,707	(15,903)	(0.00)

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合(续)

#### 东亚联丰亚洲债券及货币基金(续)

基础投资	对手方	未清偿合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
<b>衍生金融工具 (-0.06%)(续)</b>				
<b>外汇远期合约 (-0.06%)(续)</b>				
买入美元/ 卖出人民币	花旗银行, 香港	59,104	(76)	(0.00)
买入美元/ 卖出新加坡	花旗银行, 香港	5,751,258	16,602	0.00
买入美元/ 卖出 南韩圜	花旗银行, 香港	5,787,516	(32,145)	(0.00)
买入美元/ 卖出新台币	花旗银行, 香港	5,895,233	(36,392)	(0.00)
买入美元/ 卖出泰珠	花旗银行, 香港	6,095,605	(51,465)	(0.01)
<b>外汇远期合约总额</b>			<u>(428,271)</u>	<u>(0.06)</u>
<b>衍生金融工具总额</b>			<u>(428,271)</u>	<u>(0.06)</u>

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合

#### 东亚联丰亚太区多元收益基金

	持有股份/ 份额/面值	市值 美元	占资产净值 百分比
<b>上市 / 挂牌投资 (89.93%)</b>			
<b>股票 (10.16%)</b>			
<b>澳大利亚 (3.53%)</b>			
Alumina Ltd	1,940,931	2,171,538	0.73
Ampol Ltd	153,571	3,100,110	1.04
Australia & New Zealand Banking Group Ltd	110,370	1,416,449	0.48
Coronado Global Resources Inc	2,072,218	1,319,718	0.44
Viva Energy Group Ltd	2,007,289	2,515,274	0.84
<b>中国 (0.51%)</b>			
Daqin Railway Co Ltd - A	1,526,883	1,520,891	0.51
<b>香港 (2.65%)</b>			
AIA Group Ltd	164,400	1,533,607	0.52
BOC Aviation Ltd	327,000	2,088,463	0.70
China Construction Bank Corp - H	3,440,000	2,782,914	0.93
Power Assets Holdings Ltd	271,000	1,473,807	0.50
<b>新加坡 (1.03%)</b>			
Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	476,700	3,075,373	1.03
<b>台湾 (2.44%)</b>			
Chenbro Micom Co Ltd	966,000	3,031,783	1.02
CTBC Financial Holding Co Ltd	2,246,000	1,549,117	0.52
Novatek Microelectronics Corp	193,000	1,491,428	0.50
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	111,000	1,177,544	0.40
<b>股票总额</b>		<b>30,248,016</b>	<b>10.16</b>

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份/ 份额/面值	市值 美元	占资产净值 百分比
<b>上市 / 挂牌投资 (89.93%) (续)</b>			
<b>债务证券 (44.50%)</b>			
<b>以港元计价 (0.57%)</b>			
National Australia Bank Ltd 3.73% 17/05/2026	13,000,000	1,689,182	0.57
<b>以人民币计价 (0.55%)</b>			
China Development Bank 3.30% 01/02/2024	5,000,000	726,863	0.24
China Development Bank 3.76% 14/08/2023	1,000,000	150,192	0.05
China Government Bond 3.60% 06/09/2025	5,000,000	763,629	0.26
<b>以美元计价 (43.38%)</b>			
21Vianet Group Inc 7.875% 15/10/2021	1,300,000	1,337,843	0.45
ABJA Investment Co Pte Ltd 5.45% 24/01/2028	2,000,000	1,908,356	0.64
ABJA Investment Co Pte Ltd 5.95% 31/07/2024	2,800,000	2,848,627	0.96
Adani Green Energy UP Ltd 6.25% 10/12/2024	600,000	629,625	0.21
Agile Group Holdings Ltd 5.75% 02/01/2025	400,000	392,108	0.13
Agile Group Holdings Ltd 7.75% Perpetual Callable - 25/05/2025	1,400,000	1,367,100	0.46
Agile Group Holdings Ltd 7.875% Perpetual Callable - 31/07/2024	1,200,000	1,223,569	0.41
Alam Synergy Pte Ltd 11.50% 22/04/2021	460,000	349,334	0.12
Anton Oilfield Services Group/Hong Kong 7.50% 02/12/2022	1,500,000	976,967	0.33

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合(续)

#### 东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份/ 份额面值	市值 美元	占资产净值 百分比
<b>上市 / 挂牌投资 (89.93%) (续)</b>			
<b>债务证券 (44.50%) (续)</b>			
<b>以美元计价 (43.38%) (续)</b>			
Azure Power Energy Ltd 5.50% 03/11/2022	1,200,000	1,222,849	0.41
Barmingo Finance Pty Ltd 6.625% 15/05/2022	1,000,000	1,005,195	0.34
BOC Aviation Ltd 3.25% 29/04/2025	250,000	257,527	0.09
CCCI Treasure Ltd 3.65% Perpetual Callable - 21/11/2026	700,000	705,705	0.24
Central China Real Estate Ltd 6.875% 10/02/2021	2,400,000	2,466,660	0.83
Central Plaza Development Ltd 5.75% Perpetual Callable - 14/11/2024	1,100,000	1,080,549	0.36
CFLD Cayman Investment Ltd 6.90% 13/01/2023	600,000	612,882	0.21
CFLD Cayman Investment Ltd 9.00% 31/07/2021	1,900,000	2,021,011	0.68
Champion Sincerity Holdings Ltd 8.125% Perpetual Callable - 08/02/2022	1,400,000	1,467,864	0.49
China Aoyuan Group Ltd 8.50% 23/01/2022	2,000,000	2,143,011	0.72
China Construction Bank Corp 2.45% 24/06/2030	650,000	648,958	0.22
China Evergrande Group 11.50% 22/01/2023	1,200,000	1,194,746	0.40
China Oil & Gas Group Ltd 5.50% 25/01/2023	1,000,000	1,019,513	0.34
China SCE Group Holdings Ltd 7.25% 19/04/2023	1,000,000	1,014,840	0.34
China SCE Group Holdings Ltd 7.375% 09/04/2024	400,000	401,159	0.13
China South City Holdings Ltd 10.875% 26/06/2022	500,000	457,730	0.15

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份/ 份额/面值	市值 美元	占资产净值 百分比
<b>上市 / 挂牌投资 (89.93%) (续)</b>			
<b>债务证券 (44.50%) (续)</b>			
<b>以美元计价 (43.38%) (续)</b>			
China South City Holdings Ltd 11.50% 12/02/2022	600,000	599,129	0.20
Chinalco Capital Holdings Ltd 4.10% Perpetual Callable - 11/09/2024	1,000,000	1,018,718	0.34
Chong Hing Bank Ltd 5.70% Perpetual Callable - 15/07/2024	1,000,000	1,011,153	0.34
CIFI Holdings Group Co Ltd 5.50% 23/01/2022	1,100,000	1,135,067	0.38
CIFI Holdings Group Co Ltd 6.45% 07/11/2024	1,050,000	1,079,773	0.36
CNAC HK Finbridge Co Ltd 3.375% 19/06/2024	500,000	519,742	0.17
COSL Singapore Capital Ltd 2.50% 24/06/2030	1,000,000	989,756	0.33
Country Garden Holdings Co Ltd 5.40% 27/05/2025	300,000	313,716	0.11
Country Garden Holdings Co Ltd 6.15% 17/09/2025	700,000	756,705	0.25
Country Garden Holdings Co Ltd 7.25% 08/04/2026	1,000,000	1,107,335	0.37
Country Garden Holdings Co Ltd 8.00% 27/01/2024	1,000,000	1,103,859	0.37
Easy Tactic Ltd 8.75% 10/01/2021	2,500,000	2,601,131	0.87
Fantasia Holdings Group Co Ltd 8.375% 08/03/2021	500,000	515,424	0.17
Fantasia Holdings Group Co Ltd 10.875% 09/01/2023	200,000	213,758	0.07
Fortune Star BVI Ltd 6.75% 02/07/2023	1,100,000	1,150,108	0.39
Fortune Star BVI Ltd 6.85% 02/07/2024	800,000	810,912	0.27

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份/ 份额面值	市值 美元	占资产净值 百分比
<b>上市 / 挂牌投资 (89.93%) (续)</b>			
<b>债务证券 (44.50%) (续)</b>			
<b>以美元计价 (43.38%) (续)</b>			
Gemdale Ever Prosperity Investment Ltd 5.60% 14/06/2022	2,000,000	2,028,449	0.68
Global Prime Capital Pte Ltd 5.95% 23/01/2025	1,000,000	977,684	0.33
Global Prime Capital Pte Ltd 7.25% 26/04/2021	2,600,000	2,645,111	0.89
GMR Hyderabad International Airport Ltd 5.375% 10/04/2024	2,200,000	2,166,326	0.73
Greenko Solar Mauritius Ltd 5.55% 29/01/2025	1,000,000	1,008,173	0.34
Greenland Global Investment Ltd 5.60% 13/11/2022	1,200,000	1,191,056	0.40
Greenland Global Investment Ltd 5.75% 26/09/2022	500,000	501,572	0.17
Greenland Global Investment Ltd 6.25% 16/12/2022	200,000	201,659	0.07
Greenland Global Investment Ltd 6.75% 26/09/2023	1,200,000	1,220,847	0.41
Greentown China Holdings Ltd 4.55% 10/11/2020	1,400,000	1,409,552	0.47
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd 5.625% 24/10/2024	250,000	258,422	0.09
Hejun Shunze Investment Co Ltd 9.00% 04/03/2021	1,000,000	1,027,080	0.35
Hong Seng Ltd 9.875% 27/08/2022	400,000	394,270	0.13
Honghua Group Ltd 6.375% 01/08/2022	1,200,000	1,210,830	0.41
Hongkong Electric Finance Ltd 2.25% 09/06/2030	1,000,000	995,365	0.33
Hopson Capital International Group Co Ltd 6.00% 17/02/2021	1,200,000	1,219,740	0.41



## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份/ 份额面值	市值 美元	占资产净值 百分比
<b>上市 / 挂牌投资 (89.93%) (续)</b>			
<b>债务证券 (44.50%) (续)</b>			
<b>以美元计价 (43.38%) (续)</b>			
Hopson Development Holdings Ltd 7.50% 27/06/2022	1,000,000	1,004,733	0.34
HT Global IT Solutions Holdings Ltd 7.00% 14/07/2021	2,500,000	2,555,406	0.86
Hutama Karya Persero PT 3.75% 11/05/2030	300,000	318,563	0.11
Indika Energy Capital II Pte Ltd 6.875% 10/04/2022	2,000,000	1,975,157	0.66
JSW Steel Ltd 5.95% 18/04/2024	1,600,000	1,562,056	0.53
Kaisa Group Holdings Ltd 6.75% 18/02/2021	600,000	614,551	0.21
Kaisa Group Holdings Ltd 10.50% 15/01/2025	600,000	600,262	0.20
Kaisa Group Holdings Ltd 10.875% 23/07/2023	200,000	209,722	0.07
Kaisa Group Holdings Ltd 11.75% 26/02/2021	2,000,000	2,141,297	0.72
Kaisa Group Holdings Ltd 11.95% 22/10/2022	400,000	426,198	0.14
KWG Group Holdings Ltd 7.875% 01/09/2023	900,000	958,122	0.32
LMIRT Capital Pte Ltd 7.25% 19/06/2024	2,000,000	1,795,673	0.60
Logan Group Co Ltd 5.75% 14/01/2025	500,000	512,312	0.17
Logan Group Co Ltd 6.50% 16/07/2023	1,000,000	1,057,052	0.36
Logan Group Co Ltd 6.90% 09/06/2024	700,000	743,573	0.25
Logan Group Co Ltd 7.50% 25/08/2022	1,000,000	1,065,940	0.36

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份/ 份额面值	市值 美元	占资产净值 百分比
<b>上市 / 挂牌投资 (89.93%) (续)</b>			
<b>债务证券 (44.50%) (续)</b>			
<b>以美元计价 (43.38%) (续)</b>			
Marble II Pte Ltd 5.30% 20/06/2022	3,000,000	2,990,818	1.00
Medco Bell Pte Ltd 6.375% 30/01/2027	1,300,000	1,138,045	0.38
Melco Resorts Finance Ltd 5.375% 04/12/2029	700,000	701,737	0.24
MGM China Holdings Ltd 5.875% 15/05/2026	400,000	416,707	0.14
Minejesa Capital BV 5.625% 10/08/2037	1,400,000	1,475,098	0.50
New Metro Global Ltd 6.80% 05/08/2023	700,000	726,850	0.24
New Metro Global Ltd 7.50% 16/12/2021	600,000	612,987	0.21
Pertamina Persero PT 4.70% 30/07/2049	500,000	550,352	0.19
Petronas Capital Ltd 3.50% 21/04/2030	300,000	335,261	0.11
Powerlong Real Estate Holdings Ltd 7.125% 08/11/2022	700,000	717,024	0.24
ReNew Power Pvt Ltd 6.45% 27/09/2022	1,200,000	1,219,679	0.41
ReNew Power Synthetic 6.67% 12/03/2024	2,200,000	2,269,554	0.76
RKPF Overseas 2019 A Ltd 6.70% 30/09/2024	800,000	826,565	0.28
RongXingDa Development BVI Ltd 8.75% 28/01/2021	1,900,000	1,971,177	0.66
Ronshine China Holdings Ltd 8.75% 25/10/2022	850,000	900,780	0.30
Ronshine China Holdings Ltd 10.50% 01/03/2022	1,600,000	1,755,712	0.59

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份/ 份额/面值	市值 美元	占资产净值 百分比
<b>上市 / 挂牌投资 (89.93%) (续)</b>			
<b>债务证券 (44.50%) (续)</b>			
<b>以美元计价 (43.38%) (续)</b>			
Ronshine China Holdings Ltd 11.25% 22/08/2021	200,000	219,073	0.07
SD International Sukuk Ltd 6.30% 09/05/2022	2,500,000	2,005,950	0.67
Shimao Group Holdings Ltd 5.60% 15/07/2026	2,000,000	2,162,004	0.73
Shui On Development Holding Ltd 5.50% 03/03/2025	800,000	776,158	0.26
Shui On Development Holding Ltd 5.75% 12/11/2023	500,000	494,548	0.17
SMC Global Power Holdings Corp 6.50% Perpetual Callable - 25/04/2024	1,000,000	1,001,267	0.34
Studio City Finance Ltd 7.25% 11/02/2024	1,700,000	1,801,175	0.60
Sunac China Holdings Ltd 6.50% 10/01/2025	700,000	699,177	0.24
Sunac China Holdings Ltd 7.50% 01/02/2024	600,000	631,458	0.21
Sunac China Holdings Ltd 7.875% 15/02/2022	1,000,000	1,056,460	0.36
TBLA International Pte Ltd 7.00% 24/01/2023	2,600,000	2,357,258	0.79
Tencent Holdings Ltd 2.39% 03/06/2030	1,400,000	1,409,476	0.47
Theta Capital Pte Ltd 8.125% 22/01/2025	1,600,000	1,493,145	0.50
Times China Holdings Ltd 6.60% 02/03/2023	500,000	510,922	0.17
Times China Holdings Ltd 6.75% 16/07/2023	400,000	419,735	0.14

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份/ 份额面值	市值 美元	占资产净值 百分比
上市/挂牌投资(89.93%)(续)			
债务证券(44.50%)(续)			
以美元计价(43.38%)(续)			
TMB Bank PCL/Cayman Islands 4.90% Perpetual Callable - 02/12/2024	700,000	656,675	0.22
Vedanta Resources Ltd 6.375% 30/07/2022	5,000,000	3,957,048	1.33
Wanda Properties Overseas Ltd 6.875% 23/07/2023	500,000	492,332	0.17
Wisdom Glory Group Ltd 5.25% Perpetual Callable - 19/07/2020	1,300,000	1,342,123	0.45
Yango Justice International Ltd 8.25% 25/11/2023	400,000	395,434	0.13
Yuzhou Properties Co Ltd 7.375% 13/01/2026	400,000	390,783	0.13
Yuzhou Properties Co Ltd 8.30% 27/05/2025	300,000	299,481	0.10
Yuzhou Properties Co Ltd 8.375% 30/10/2024	800,000	821,945	0.28
Yuzhou Properties Co Ltd 8.50% 04/02/2023	400,000	430,763	0.14
Yuzhou Properties Co Ltd 8.625% 23/01/2022	1,200,000	1,291,073	0.43
Zhenro Properties Group Ltd 7.875% 14/04/2024	600,000	593,851	0.20
Zhenro Properties Group Ltd 8.35% 10/03/2024	200,000	199,178	0.07
Zhenro Properties Group Ltd 9.15% 08/03/2022	550,000	579,046	0.19
Zhenro Properties Group Ltd 9.15% 06/05/2023	700,000	720,341	0.24
Zhenro Properties Group Ltd 9.80% 20/08/2021	1,000,000	1,065,541	0.36

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合(续)

#### 东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份/ 份额/面值	市值 美元	占资产净值 百分比
<b>上市 / 挂牌投资 (89.93%) (续)</b>			
<b>债务证券 (44.50%) (续)</b>			
<b>以美元计价 (43.38%) (续)</b>			
Zhongliang Holdings Group Co Ltd 8.75% 16/02/2021	600,000	618,730	0.21
<b>债务证券总额</b>		<b>132,507,129</b>	<b>44.50</b>
<b>投资基金 (22.79%)</b>			
<b>澳大利亚 (3.36%)</b>			
APA Group	252,254	1,933,024	0.65
Atlas Arteria Ltd	535,703	2,441,665	0.82
Transurban Group	579,843	5,641,006	1.89
<b>香港 (19.43%)</b>			
东亚联丰亚太区股息基金- ADU 类别	2,006,104	19,679,876	6.61
东亚联丰亚太区投资级别债券基金- BAH 类别	393,654	5,804,421	1.95
东亚联丰亚洲债券及货币基金 - ADU 类别	55,388	681,832	0.23
东亚联丰亚洲债券及货币基金 - IDU 类别	840,454	8,505,398	2.86
东亚联丰亚太区债券基金	2,310,000	23,169,300	7.78
<b>投资基金总额</b>		<b>67,856,522</b>	<b>22.79</b>

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

	持有股份/ 份额面值	市值 美元	占资产净值 百分比
<b>上市 / 挂牌投资 (89.93%) (续)</b>			
<b>房地产投资信托基金 (12.48%)</b>			
<b>澳大利亚 (1.05%)</b>			
Charter Hall Group	468,100	3,122,960	1.05
<b>香港 (1.31%)</b>			
Fortune Real Estate Investment Trust	1,647,000	1,481,154	0.50
Link REIT	295,500	2,415,338	0.81
<b>新加坡 (7.95%)</b>			
Ascendas Real Estate Investment Trust	2,463,744	5,598,413	1.88
CapitaLand Commercial Trust	3,315,200	4,016,119	1.34
Manulife US Real Estate Investment Trust	5,841,600	4,410,408	1.48
Mapletree Industrial Trust	3,054,100	6,283,119	2.11
Mapletree Logistics Trust	2,442,200	3,396,199	1.14
<b>美国 (2.17%)</b>			
Prologis Inc	69,141	6,452,930	2.17
房地产投资信托基金总额		<u>37,176,640</u>	<u>12.48</u>
投资总额		<u>267,788,307</u>	<u>89.93</u>
投资总额, 按成本计算		<u>267,919,800</u>	

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

投资组合(续)

东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

基础投资	对手方	未清偿合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
<b>衍生金融工具 (-0.13%)</b>				
<b>证券期指 (-0.01%)</b>				
<b>美国 (-0.01%)</b>				
US 10Yr Note Future 21/09/2020	花旗银行,香港	(20)	(28,750)	(0.01)
<b>证券期指总额</b>			<b>(28,750)</b>	<b>(0.01)</b>
<b>外汇远期合约 (-0.12%)</b>				
买入澳元/ 卖出美元	花旗银行,香港	60,003,823	(234,555)	(0.08)
买入欧罗/ 卖出美元	花旗银行,香港	44,632	(260)	(0.00)
买入欧罗/ 卖出美元	花旗银行,香港	45,355	(264)	(0.00)
买入新西兰元/ 卖出美元	花旗银行,香港	14,145,195	(66,256)	(0.02)
买入人民币 / 卖出美元	花旗银行,香港	12,973,670	(1,904)	(0.00)
买入人民币 / 卖出美元	花旗银行,香港	100	-	0.00
买入人民币 / 卖出美元	花旗银行,香港	397,775,894	(58,362)	(0.02)
买入人民币 / 卖出美元	花旗银行,香港	20,000,000	(98)	(0.00)
买入人民币 / 卖出美元	花旗银行,香港	198,020	70	0.00

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合(续)

#### 东亚联丰亚太区多元收益基金(续)

基础投资	对手方	未清偿合约 的名义金额	公允价值 美元	占资产净值 百分比
<b>衍生金融工具 (-0.13%)(续)</b>				
<b>外汇远期合约 (-0.12%)(续)</b>				
买入新加坡元/ 卖出美元	花旗银行, 香港	4,000,000	561	0.00
买入美元/ 卖出澳元	花旗银行, 香港	58,730	76	0.00
买入美元/ 卖出澳元	花旗银行, 香港	10,744	(63)	(0.00)
买入美元/ 卖出人民币	花旗银行, 香港	2,818,092	(7,068)	(0.00)
买入美元/ 卖出人民币	花旗银行, 香港	51,902	(66)	(0.00)
买入美元/ 卖出人民币	花旗银行, 香港	12	-	0.00
<b>外汇远期合约总额</b>			<u>(368,189)</u>	<u>(0.12)</u>
<b>衍生金融工具总额</b>			<u>(396,939)</u>	<u>(0.13)</u>



## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合变动表

#### 东亚联丰亚洲债券及货币基金

	占资产净值百分比	
	于2020年 6月30日	于2019年 12月31日
<b>债务证券</b>		
印度尼西亚盾	-	1.90
美元	95.37	96.58
<b>衍生金融工具</b>		
外汇远期合约	(0.06)	0.34
	<u>95.31</u>	<u>98.82</u>

## 投资报告

于2020年6月30日(未经审计)(续)

### 投资组合变动表(续)

#### 东亚联丰亚太区多元收益基金

	占资产净值百分比	
	于2020年 6月30日	于2019年 12月31日
<b>股票</b>		
澳大利亚	3.53	2.22
中国	0.51	0.52
香港	2.65	6.72
新加坡	1.03	4.12
台湾	2.44	2.50
泰国	-	0.43
<b>债务证券</b>		
港元	0.57	0.48
印度尼西亚盾	-	0.59
人民币	0.55	0.46
美元	43.38	51.34
<b>投资基金</b>		
澳大利亚	3.36	3.69
香港	19.43	10.70
<b>房地产投资信托基金</b>		
澳大利亚	1.05	-
香港	1.31	1.45
新加坡	7.95	9.05
美国	2.17	1.48
<b>衍生金融工具</b>		
<b>证券期指</b>		
美国	(0.01)	(0.02)
<b>外汇远期合约</b>		
	(0.12)	0.43
	<u>89.80</u>	<u>96.16</u>

## 全面收益表

截至2020年6月30日止期间(未经审计)

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金	
	2020 美元	2019 美元	2020 美元	2019 美元
<b>收入</b>				
股息收入	-	-	1,254,640	3,892,952
银行存款利息	20,307	3,254	10,219	28,627
其他收入	7,892,714	16,000	248,907	635,158
	<u>7,913,021</u>	<u>19,254</u>	<u>1,513,766</u>	<u>4,556,737</u>
<b>支出</b>				
投资管理费	4,094,343	3,297,487	2,087,990	3,170,567
受托人费用	466,910	358,406	223,713	339,704
保管费及银行费用	39,942	20,202	17,208	21,447
审计师酬金	5,234	5,113	5,234	5,113
基金登记机构费用	69,702	56,646	36,046	47,607
基金终止费用	-	-	-	-
印刷及出版费用	8,504	1,285	4,276	636
监管费	1,167	4,890	1,166	1,953
营运前开支	-	-	-	-
法律及专业服务费用	8,185	15,336	18,692	14,185
交易成本	28,363	6,714	236,119	347,298
利息费用	1,763	400	692	478
其他营运费用	74,395	836	29,947	833
	<u>4,798,508</u>	<u>3,767,315</u>	<u>2,661,083</u>	<u>3,949,821</u>
<b>计算投资及外汇(收益)/亏损净额前的年内(亏损)/收益净额</b>	<u>3,114,513</u>	<u>(3,748,061)</u>	<u>(1,147,317)</u>	<u>606,916</u>
<b>投资及外汇(收益)/亏损净额</b>				
投资的已变现收益/(亏损)净额	(81,475,243)	18,548,266	(9,016,234)	10,526,043
投资的未变现收益/(亏损)变动净额	(28,836,333)	19,394,743	(14,511,396)	30,350,674
汇兑(亏损)/收益	(188,698)	94,392	(2,591,954)	437,239
	<u>(110,500,274)</u>	<u>38,037,401</u>	<u>(26,119,584)</u>	<u>41,313,956</u>
<b>计算融资成本前的利润/(亏损)</b>	<u>(107,385,761)</u>	<u>34,289,340</u>	<u>(27,266,901)</u>	<u>41,920,872</u>
<b>向基金份额持有人作出收益分配</b>	<u>(13,191,336)</u>	<u>(7,942,782)</u>	<u>(9,478,161)</u>	<u>(13,534,821)</u>
<b>税前(亏损)/利润</b>	<u>(120,577,097)</u>	<u>26,346,558</u>	<u>(36,745,062)</u>	<u>28,386,051</u>
<b>税项</b>	<u>(254,783)</u>	<u>(76,498)</u>	<u>(180,646)</u>	<u>(177,103)</u>
<b>年内(损失)/利润及全面收益总额</b>	<u>(120,831,880)</u>	<u>26,270,060</u>	<u>(36,925,708)</u>	<u>28,208,948</u>

资产负债表 于2020年6月30日(未经审计)

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金	
	2020年6月30日 美元	2019年12月31日 美元	2020年6月30日 美元	2019年12月31日 美元
<b>资产</b>				
投资	650,373,079	921,989,588	267,759,557	334,014,114
应收外汇远期合同款项	-	3,191,814	-	1,508,569
应收股息	-	-	295,533	274,557
出售投资应收款项	22,855,327	735,820	780,535	1,155,553
认购基金份额的应收款项	30,693,246	2,377,979	57,821	641,999
其他应收款项	-	-	41,985	39,768
从经纪的应收款项	2,193,016	2,342,987	758,288	213,790
银行结余	24,790,207	10,188,896	32,023,861	13,946,350
<b>资产总值</b>	<b>730,904,875</b>	<b>940,827,084</b>	<b>301,717,580</b>	<b>351,794,700</b>
<b>负债</b>				
赎回基金份额的应付款项	1,913,459	2,835,189	584,892	1,583,256
应付外汇远期合同款项	428,271	-	368,189	-
应付购入投资款项	45,883,435	733,565	2,507,234	817,066
应计费用及其他应付款项	760,779	1,062,369	483,998	495,992
银行透支	-	-	-	-
<b>负债总值 (不包括基金份额持有人应占的资产净值)</b>	<b>48,985,944</b>	<b>4,631,123</b>	<b>3,944,313</b>	<b>2,896,314</b>
<b>基金份额持有人应占的资产净值</b>				
金融负债	681,918,931	936,195,961	297,773,267	348,898,386
权益	-	-	-	-

资产负债表 于2020年6月30日(未经审计)(续)

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金	
	2020年6月30日	2019年12月31日	2020年6月30日	2019年12月31日
<b>A 类别累积</b>				
份额发行数量	3,904,798.76	5,397,059.34	200,712.87	247,975.61
财务报告中每份资产净值 <sup>(3)</sup>	23.07	24.95	13.26	14.28
<b>A 类别累积对冲(欧元)</b>				
份额发行数量	1,571,634.37	4,104,636.82	5,000.00	5,000.00
财务报告中每份资产净值 <sup>(3)</sup>	10.73	11.72	10.57	11.51
<b>A 类别累积对冲(人民币)</b>				
份额发行数量	7,926,508.21	14,757,492.04	122,769.37	122,419.06
财务报告中每份资产净值 <sup>(3)</sup>	14.20	15.55	14.75	16.10
<b>A 类别分派</b>				
份额发行数量	8,787,656.98	8,829,416.17	7,185,176.34	8,127,409.68
财务报告中每份资产净值 <sup>(3)</sup>	12.31	13.76	9.16	10.19
<b>A 类别分派(港元)</b>				
份额发行数量	-	-	10,059,647.48	10,126,098.28
财务报告中每份资产净值 <sup>(3)</sup>	-	-	11.81	13.13
<b>A 类别分派对冲(澳元)</b>				
份额发行数量	1,115,754.93	1,307,036.60	8,363,015.66	9,565,708.94
财务报告中每份资产净值 <sup>(3)</sup>	6.05	6.96	5.02	5.77
<b>A 类别分派对冲(欧元)</b>				
份额发行数量	-	-	5,198.92	12,418.39
财务报告中每份资产净值 <sup>(3)</sup>	-	-	9.90	10.99
<b>A 类别分派对冲(新西兰元)</b>				
份额发行数量	-	-	1,952,508.09	2,207,344.32
财务报告中每份资产净值 <sup>(3)</sup>	-	-	4.75	5.59
<b>A 类别分派对冲(人民币)</b>				
份额发行数量	6,716,778.62	7,506,051.11	5,019,808.99	4,629,872.66
财务报告中每份资产净值 <sup>(3)</sup>	13.35	15.16	11.39	12.89
<b>H 类别分派(港元)</b>				
份额发行数量	75,025,175.99	85,813,348.84	-	-
财务报告中每份资产净值 <sup>(3)</sup>	1.26	1.41	-	-
<b>I 类别累积</b>				
份额发行数量	2,552,572.48	7,563,520.08	-	-
财务报告中每份资产净值 <sup>(3)</sup>	10.12	10.86	-	-
<b>I 类别分派(港元)</b>				
份额发行数量	11,821,195.65	5,868,816.66	-	-
财务报告中每份资产净值 <sup>(3)</sup>	11.55	12.87	-	-

<sup>(3)</sup> 根据基金说明书，每份资产净值四舍五入至两个小数位。

## 权益变动表 / 基金份额持有人应占资产净额变动表

截至2020年6月30日止期间(未经审计)

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金	
	2020 美元	2019 美元	2020 美元	2019 美元
于1月1日 / 成立日期的结余	936,195,961	387,585,829	348,898,386	460,539,531
与所有者的交易并直接计入权益/ 与基金份额持有人的交易				
年内 / 期内认购/申购基金份额	375,324,615	517,103,796	51,103,195	65,605,546
年内 / 期内赎回基金份额	(508,769,765)	(63,865,748)	(65,302,606)	(132,589,337)
与所有者 / 基金份额持有人的交易总额	(133,445,150)	453,238,048	(14,199,411)	(66,983,791)
年内(损失) / 利润及全面收益总额	(120,831,880)	26,270,060	(36,925,708)	28,208,948
于6月30日的结余	681,918,931	867,093,937	297,773,267	421,764,688

## 权益变动表 / 基金份额持有人应占资产净额变动表

截至2020年6月30日止期间 (未经审计) (续)

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金	
	2020	2019	2020	2019
<b>A 类别 累积 (美元)</b>				
年初已发行份额数目	5,397,059.34	5,574,256.02	247,975.61	563,639.60
年内已发行份额	765,234.73	1,204,645.50	103,624.34	51,951.16
年内已赎回份额	(2,257,495.31)	(906,889.33)	(150,887.08)	(270,507.77)
年末已发行份额数目	<u>3,904,798.76</u>	<u>5,872,012.19</u>	<u>200,712.87</u>	<u>345,082.99</u>
<b>A 类别 累积 对冲 (欧元)</b>				
年初已发行份额数目	4,104,636.82	5,000.00	5,000.00	5,000.00
年内已发行份额	3,521,327.71	4,260,152.92	-	-
年内已赎回份额	(6,054,330.16)	(68,226.12)	-	-
年末已发行份额数目	<u>1,571,634.37</u>	<u>4,196,926.80</u>	<u>5,000.00</u>	<u>5,000.00</u>
<b>A 类别 累积 对冲(人民币)</b>				
年初已发行份额数目	14,757,492.04	1,240,261.82	122,419.06	29,469.54
年内已发行份额	6,621,222.19	14,575,903.72	1,636.39	6,599.79
年内已赎回份额	(13,452,206.02)	(150,127.69)	(1,286.08)	(1,037.95)
年末已发行份额数目	<u>7,926,508.21</u>	<u>15,666,037.85</u>	<u>122,769.37</u>	<u>35,031.38</u>
<b>A 类别 分派 (美元)</b>				
年初已发行份额数目	8,829,416.17	5,712,660.99	8,127,409.68	9,375,900.55
年内已发行份额	1,968,201.05	2,262,508.52	548,295.39	2,666,994.50
年内已赎回份额	(2,009,960.24)	(815,508.57)	(1,490,528.73)	(2,942,452.67)
年末已发行份额数目	<u>8,787,656.98</u>	<u>7,159,660.94</u>	<u>7,185,176.34</u>	<u>9,100,442.38</u>
<b>A 类别 分派 (港币)</b>				
年初已发行份额数目	-	-	10,126,098.28	15,431,470.62
年内已发行份额	-	-	2,317,548.22	1,543,121.17
年内已赎回份额	-	-	(2,383,999.02)	(3,955,294.27)
年末已发行份额数目	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>10,059,647.48</u>	<u>13,019,297.52</u>
<b>A 类别 分派 对冲 (澳元)</b>				
年初已发行份额数目	1,307,036.60	847,417.47	9,565,708.94	12,970,852.73
年内已发行份额	585,064.55	378,478.08	558,862.80	1,552,344.69
年内已赎回份额	(776,346.22)	(277,153.70)	(1,761,556.08)	(3,756,396.01)
年末已发行份额数目	<u>1,115,754.93</u>	<u>948,741.85</u>	<u>8,363,015.66</u>	<u>10,766,801.41</u>

## 权益变动表 / 基金份额持有人应占资产净额变动表

截至2020年6月30日止期间(未经审计)(续)

	东亚联丰亚洲债券及货币基金		东亚联丰亚太区多元收益基金	
	2020	2019	2020	2019
<b>A 类别分派 对冲 (欧罗)</b>				
年初已发行份额数目	-	-	12,418.39	5,198.92
年内已发行份额	-	-	-	7,219.47
年内已赎回份额	-	-	(7,219.47)	-
年末已发行份额数目	-	-	5,198.92	12,418.39
<b>A 类别 分派 对冲 (新西兰元)</b>				
年初已发行份额数目	-	-	2,207,344.32	2,814,178.04
年内已发行份额	-	-	105,622.65	348,416.12
年内已赎回份额	-	-	(360,458.88)	(781,584.05)
年末已发行份额数目	-	-	1,952,508.09	2,381,010.11
<b>A 类别 分派 对冲 (人民币)</b>				
年初已发行份额数目	7,506,051.11	2,939,926.93	4,629,872.66	6,592,134.89
年内已发行份额	1,410,757.08	3,745,919.55	1,181,868.45	772,453.43
年内已赎回份额	(2,200,029.57)	(533,452.63)	(791,932.12)	(1,869,990.11)
年末已发行份额数目	6,716,778.62	6,152,393.85	5,019,808.99	5,494,598.21
<b>H 类别 分派 (港币)</b>				
年初已发行份额数目	85,813,348.84	57,249,421.24	-	-
年内已发行份额	12,969,611.36	25,087,281.63	-	-
年内已赎回份额	(23,757,784.21)	(9,504,610.69)	-	-
年末已发行份额数目	75,025,175.99	72,832,092.18	-	-
<b>I 类别累积</b>				
年初已发行份额数目	7,563,520.08	3,949,647.58	-	-
年内已发行份额	6,100,360.46	1,193,374.61	-	-
年内已赎回份额	(11,111,308.06)	(420,954.62)	-	-
年末已发行份额数目	2,552,572.48	4,722,067.57	-	-
<b>I 类别分派 (港币)</b>				
年初已发行份额数目	5,868,816.66	-	-	-
年内已发行份额	7,548,707.43	5,868,816.66	-	-
年内已赎回份额	(1,596,328.44)	-	-	-
年末已发行份额数目	11,821,195.65	5,868,816.66	-	-



## 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