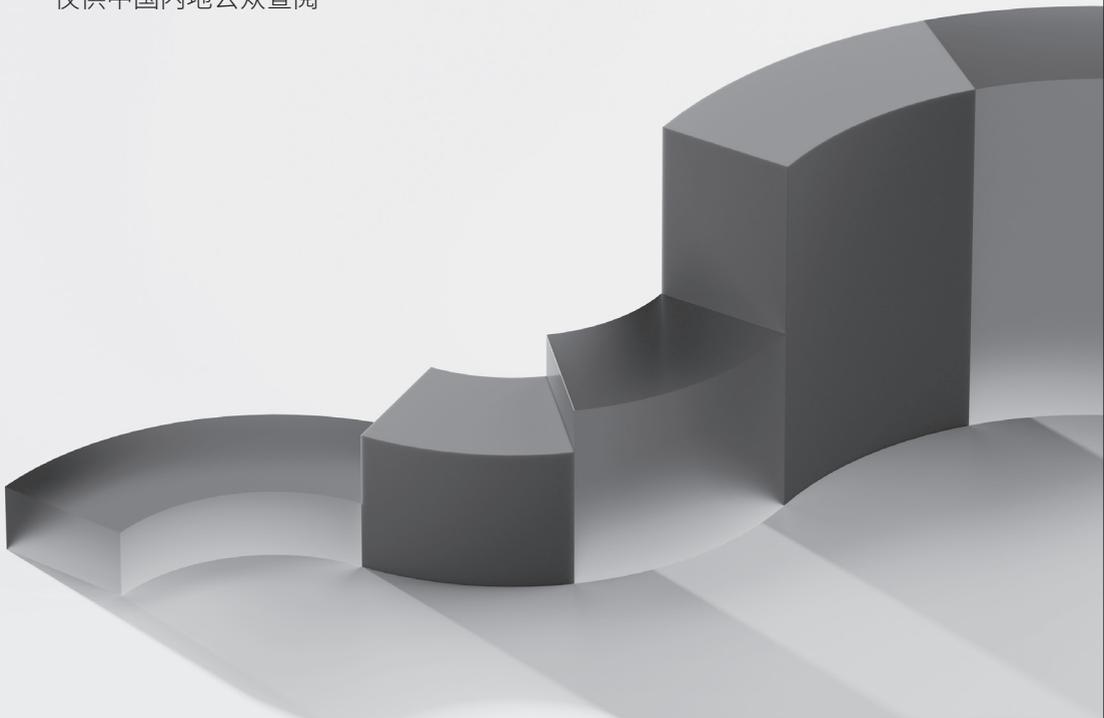


仅供中国内地公众查阅



半年度报告— 2024年3月31日（未经审核）

# 摩根国际债券基金

内地与香港互认基金系列

---

**摩根**  
资产管理

此（等）报告并不构成购买组成本文件内容的任何基金单位之邀请，也不应视作任何宣传。只有基于现时基金说明书（或同等文件）及最近之财务报告（如有）所作之认购方为有效。

本报告可能包含本基金若干并未获认可在中国内地发售或分销之股份类别。投资者应注意，本年度报告中的财务报告内若干数据以综合方法表述，因此当中包括并未在中国内地注册的股份类别之资产。

内容	页
投资组合	1 - 8
投资组合持有变动表	9
金融衍生工具详情	10 - 17
财务状况表	18
综合收益表	18
可赎回份额持有人应占净资产变动表	19
现金流量表	19
财务报表之附注	20 - 27

投资组合  
于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百分比
上市投资 (98.8%)				Transurban Finance Co Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.713% 12Mar2032	欧元 1,186,000	1,296,127	0.1
(I) 债券证券 (79.2%)				Woolworths Group Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 0.375% 15Nov2028	欧元 826,000	776,693	0.0
澳大利亚 (4.7%)				巴林 (0.2%)			
APA Infrastructure Ltd Ser EMTN (Reg S) (Br) 2% 15Jul2030	欧元 1,500,000	1,496,795	0.1	Kingdom Of Bahrain Ser Regs (Reg S) 7.5% 12Feb2036	美元 2,887,000	2,993,979	0.2
APT Pipelines Ltd Ser Regs (Regs) 4.2% 23/03/2025	美元 4,500,000	4,440,372	0.2	比利时 (0.1%)			
Ausgrid Finance Pty Ltd Ser Mtn 5.408% 28Mar2031	澳元 3,970,000	2,602,602	0.1	Kbc Group Nv (Reg S) Var Perp 31Dec2049	欧元 1,600,000	1,683,428	0.1
Aust & NZ Banking Group Ser Regs (Reg S) 6.742% 08Dec2032	美元 1,620,000	1,776,310	0.1	百慕大 (0.2%)			
Aust & NZ Banking Group Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 22Jul2030	美元 3,000,000	2,900,557	0.2	Govt of Bermuda Ser 144A (Reg) 3.717% 25/01/2027	美元 4,000,000	3,859,258	0.2
Australia (Govt of) Ser 149 (Reg S) 2.25% 21May2028	澳元 3,000,000	1,872,587	0.1	巴西 (0.5%)			
Australia (Govt of) Ser 152 (Reg) (Reg S) 2.75% 21Nov2028	澳元 8,000,000	5,080,038	0.3	Braskem Netherlands Ser Regs (Reg S) 7.25% 13Feb2033	美元 1,950,000	1,896,002	0.1
Australia (Govt of) Ser 166 (Reg S) 3% 21Nov2033	澳元 46,500,000	28,339,454	1.6	Brazil (Rep of) 3.875% 12Jun2030	美元 6,900,000	6,321,067	0.4
Australia (Govt of) Ser 169 (Reg S) 4.75% 21Jun2054	澳元 14,100,000	9,959,457	0.6	加拿大 (4.8%)			
Macquarie Bank Ltd Ser 144A (Reg) Var 03Mar2036	美元 1,500,000	1,246,062	0.1	Bank of Montreal Ser EMTN (Reg) (Reg S) 0.05% 08Jun2029	欧元 2,900,000	2,681,710	0.2
Macquarie Group Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 14Apr2028	美元 971,000	881,833	0.0	Bank of Nova Scotia (Reg) (Reg S) 0.01% 14Sep2029	欧元 4,850,000	4,439,709	0.3
National Australia Bank (Reg S) (Br) 2.347% 30Aug2029	欧元 4,200,000	4,428,833	0.2	British Columbia Prov of (Reg) 4.3% 18Jun2042	加元 1,000,000	740,411	0.0
NBN Co Ltd Ser 144A 2.625% 05May2031	美元 4,000,000	3,458,273	0.2	British Columbia Prov of 2.2% 18Jun2030	加元 1,000,000	674,607	0.0
Nbn Co Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.5% 22Mar2030	欧元 2,106,000	2,300,702	0.1	Canada (Govt of) 0.25% 01Mar2026	加元 35,000,000	24,076,369	1.3
NBN Co Ltd Ser GMTN (Reg) (Reg S) 4.375% 15Mar2033	欧元 2,000,000	2,322,045	0.1	Hydro-Quebec 4% 15Feb2055	加元 300,000	211,311	0.0
NBN Co Ltd Ser Regs (Reg S) 5.75% 06Oct2028	美元 3,000,000	3,187,063	0.2	Hydro-Quebec Ser 19 6.5% 15Feb2035	加元 1,700,000	1,508,662	0.1
Scentre Group Trust 1/2 Ser Regs (Regs) 3.5% 12Feb2025	美元 2,250,000	2,219,525	0.1	Ontario (Province of) (Reg) 2.7% 02Jun2029	加元 1,000,000	706,393	0.0
SGSP Australia Assets (Reg S) 3.25% 29Jul2026	美元 1,950,000	1,877,072	0.1	Ontario (Province of) 2.6% 02Jun2025	加元 600,000	436,922	0.0
SGSP Australia Assets Ser EMTN (Reg S) 3.5% 07Jul2027	美元 1,200,000	1,143,158	0.1	Ontario (Province of) 3.5% 02/06/2024	加元 3,750,000	2,795,786	0.2
Sydney Airport Finance Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4.375% 03May2033	欧元 954,000	1,123,965	0.1	Ontario (Province of) 3.65% 02Jun2033	加元 17,750,000	12,802,848	0.7
				Ontario Teachers' Financ (Reg) (Reg S) 0.5% 06May2025	欧元 4,009,000	4,205,415	0.2
				Province of Quebec (Reg) 2.6% 06Jul2025	加元 2,700,000	1,962,511	0.1
				Province of Quebec 3.6% 01Sep2033	加元 17,750,000	12,608,535	0.7

投资组合 (续)  
于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>加拿大 (续)</b>				<b>哥斯达黎加 (0.4%)</b>			
Province of Quebec 3.75% 01Sep2024	加元 1,250,000	921,554	0.1	Costa Rica Government Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.125% 19Feb2031	美元 6,190,000	6,327,665	0.4
Royal Bank of Canada Ser EMTN (Reg) (Reg S) 0.01% 05Oct2028	欧元 4,700,000	4,422,429	0.2	<b>克罗地亚 (0.4%)</b> Croatia (Reg) (Reg S) 3.375% 12Mar2034	欧元 5,820,000	6,296,721	0.4
Toronto-Dominion Bank (Reg) (Reg S) 3.666% 08Sep2031	欧元 3,900,000	4,476,761	0.3	<b>多米尼加共和国 (0.3%)</b> Dominican Republic (Reg) (Reg S) (Ser Regs) 4.875% 23Sep2032	美元 6,800,000	6,115,643	0.3
Toronto-Dominion Bank Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.191% 16Feb2029	欧元 6,999,000	7,625,030	0.4	<b>法国 (5.0%)</b> BNP Paribas Ser 144A Var 12Jun2029	美元 2,600,000	2,656,877	0.1
<b>开曼群岛 (0.2%)</b> CK Hutchison Finance 16 (Br) (Reg S) 0.875% 03Oct2024	欧元 1,800,000	1,919,498	0.1	BPCE SA Ser 144A Var 18Jan2027	美元 2,500,000	2,538,022	0.1
Suci Second Invest Co (Reg S) 6% 25Oct2028	美元 1,842,000	1,953,760	0.1	BPCE Sa Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.5% 15Sep2027	欧元 1,300,000	1,303,384	0.1
<b>中国 (9.4%)</b> China (Govt of) Ser Inbk (Reg) 2.62% 25Jun2030	人民币 270,000,000	38,734,884	2.1	BPCE Sfh - Societe De Fi (Reg S) (Br) 3% 15Jan2031	欧元 4,100,000	4,470,666	0.2
China (Govt of) Ser Inbk (Reg) 2.67% 25May2033	人民币 150,000,000	21,433,161	1.2	Credit Agricole SA Ser Var Perp 31Dec2049	欧元 5,400,000	5,939,237	0.3
China (Govt of) Ser Inbk (Reg) 2.8% 25Mar2030	人民币 130,000,000	18,484,302	1.0	Dexia Credit Local (Br) (Reg S) 1.25% 26Nov2024	欧元 1,200,000	1,281,404	0.1
China (Govt of) Ser Inbk (Reg) 2.79% 15Dec2029	人民币 120,000,000	17,170,069	1.0	Dexia Credit Local Ser EMTN (Br) (Reg S) 1% 18Oct2027	欧元 1,000,000	1,015,887	0.1
China (Govt of) Ser Inbk (Reg) 2.8% 15Nov2032	人民币 215,000,000	31,030,609	1.7	France (Govt of) (Reg S) 2% 25Nov2032	欧元 22,200,347	22,808,858	1.3
China (Govt of) Ser Inbk (Reg) 3.32% 15Apr2052	人民币 101,000,000	16,168,092	0.9	France (Govt of) (Reg S) 2.5% 25May2043	欧元 41,070,000	40,994,265	2.3
China Development Bank Ser 2305 (Reg) 3.02% 06Mar2033	人民币 170,000,000	24,578,565	1.4	France (Govt of) (Regs) 3.5% 25Apr2026	欧元 5,000,000	5,642,676	0.3
Zhongsheng Group (Reg) (Reg S) 3% 13Jan2026	美元 1,800,000	1,697,566	0.1	Societe Generale Ser Regs (Regs) 4.25% 19Aug2026	美元 2,000,000	1,930,110	0.1
<b>哥伦比亚 (0.3%)</b> Colombia (Rep of) (Reg) 3.25% 22Apr2032	美元 2,500,000	1,988,823	0.1	<b>德国 (1.6%)</b> Bavarian Sky Sa (Ser 8 Cl A) Frn 20Nov2031	欧元 1,900,000	2,058,686	0.1
Colombia (Rep of) (Reg) 8% 14Nov2035	美元 3,100,000	3,356,588	0.2	KFW Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.125% 09Jan2032	欧元 20,000,000	17,798,389	1.0
				KFW Ser EMTN (Reg S) (Br) 1.125% 15Sep2032	欧元 2,898,000	2,790,850	0.2

投资组合 (续)  
于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
<b>德国 (续)</b>				<b>爱尔兰 (0.4%)</b>			
Land Nordrhein-Westfalen Ser EMTN (Reg S) (Br) 2.15% 21Mar2119	欧元 1,200,000	982,965	0.1	Aercap Ireland Cap/Globa (Reg) 5.75% 06Jun2028	美元 2,000,000	2,064,084	0.1
Traton Finance Lux Sa Ser EMTN (Reg S) 5.625% 16Jan2029	英镑 1,900,000	2,449,687	0.1	AIB Group Plc Ser EMTN (Reg S) (Br) Var 04Apr2028	欧元 1,000,000	1,059,878	0.0
Vonovia Se Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.375% 16Jun2027	欧元 1,500,000	1,463,670	0.1	Bank of Ireland Group (Reg S) (Br) Var 16Jul2028	欧元 2,600,000	3,010,991	0.2
Vonovia Se Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.625% 14Dec2029	欧元 1,000,000	901,162	0.0	Glencore Cap Fin Dac Ser EMTN (Reg S) (Br) 1.125% 10Mar2028	欧元 1,500,000	1,475,677	0.1
<b>香港 (0.1%)</b>				<b>以色列 (0.3%)</b>			
AIA Group Ltd Ser Regs (Reg S) 5.375% 05Apr2034	美元 1,560,000	1,564,685	0.1	Israel (Govt of) (Reg) 5.375% 12Mar2029	美元 2,843,000	2,859,594	0.2
<b>匈牙利 (0.3%)</b>				Israel Electric Corp Ltd (Reg) (Regs) 5% 12Nov2024	美元 2,000,000	2,029,555	0.1
Hungary (Govt of) Ser Regs (Reg S) 5.5% 26Mar2036	美元 5,113,000	5,031,108	0.3	<b>意大利 (5.7%)</b>			
<b>印度 (0.4%)</b>				Credito Emiliano Spa Ser EMTN (Reg S) (Br) 3.25% 18Apr2029	欧元 300,000	326,380	0.0
Hdfc Bank Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.196% 15Feb2027	美元 4,500,000	4,495,857	0.2	Italy (Rep of) (Reg) 0.875% 06May2024	美元 2,000,000	1,997,782	0.1
NTPC Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.75% 01Feb2027	欧元 1,500,000	1,561,408	0.1	Italy (Rep of) (Reg) 2.375% 17Oct2024	美元 5,463,000	5,425,283	0.3
ONGC Videsh Ltd Ser Regs 4.625% 15Jul2024	美元 1,350,000	1,357,819	0.1	Italy (Rep of) 2.5% 01Dec2024	欧元 18,000,000	19,465,998	1.1
<b>印度尼西亚 (2.4%)</b>				Italy (Rep of) Ser 10Y (Reg S) (Br) 4.35% 01Nov2033	欧元 14,750,000	17,190,299	1.0
Bank Negara Indonesia Ser EMTN (Reg S) 5.28% 05Apr2029	美元 3,749,000	3,745,251	0.2	Italy (Rep of) Ser 5Y (Reg S) (Br) 3.4% 01Apr2028	欧元 17,000,000	18,859,227	1.0
Freeport Indonesia Pt Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.763% 14Apr2027	美元 2,740,000	2,742,847	0.2	Italy (Rep of) Ser 5Y (Reg S) (Br) 4.1% 01Feb2029	欧元 21,000,000	23,755,332	1.3
Indonesia (Rep of) 1.45% 18Sep2026	欧元 2,000,000	2,058,837	0.1	Italy (Rep of) Ser 7Y (Reg S) (Br) 4% 15Nov2030	欧元 9,000,000	10,243,003	0.6
Indonesia (Rep of) Ser Fr 6.625% 15Feb2034	389,000,000,000	24,528,708	1.4	Unicredit SpA (Reg S) (Br) Var Perp	欧元 1,000,000	1,146,893	0.1
Indonesia (Rep of) Ser Regs (Reg S) 5.4% 15Nov2028	美元 8,463,000	8,781,734	0.5	Unicredit SpA Ser EMTN (Reg S) (Br) Var 14Feb2030	欧元 3,250,000	3,692,485	0.2
Perusahaan Listrik Negera Ser Regs (Reg S) 1.875% 05Nov2031	欧元 1,000,000	899,866	0.0	<b>日本 (9.0%)</b>			
				Development Bk of Japan Ser GMTN (Reg) (Reg S) 0.875% 10Oct2025	欧元 400,000	417,445	0.0

投资组合 (续)  
于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
<b>日本 (续)</b>				SK Battery America Inc (Reg) (Reg S) 4.875% 23Jan2027			
Japan (Govt of) 40 Year No.5 2Pct 20Mar2052	日元 1,450,000,000	10,166,304	0.6	美元 1,728,000	1,728,602	0.1	
Japan (Govt of) Ser 164 0.2% 20Dec2028	日元 2,000,000,000	13,132,128	0.7	SK Hynix Inc Ser Regs (Reg S) 6.375% 17Jan2028	美元 1,970,000	2,054,853	0.1
Japan (Govt of) Ser 183 1.4% 20Dec2042	日元 2,742,400,000	18,179,553	1.0	<b>科威特 (0.2%)</b> Equate Petrochemical BV Ser Regs (Reg) (Regs) 4.25% 03Nov2026			
Japan (Govt of) Ser 186 1.5% 20Sep2043	日元 3,200,000,000	21,314,012	1.2	美元 3,000,000	2,944,291	0.2	
Japan (Govt of) Ser 361 0.1% 20Dec2030	日元 4,900,000,000	31,643,049	1.8	<b>卢森堡 (0.1%)</b> European Investment Bank 4.875Pct 15/02/2036			
Japan (Govt of) Ser 370 0.5% 20Mar2033	日元 1,600,000,000	10,448,186	0.6	美元 800,000	841,677	0.0	
Japan (Govt of) Ser 372 0.8% 20Sep2033	日元 3,900,000,000	26,045,883	1.5	Traton Finance Luxembg Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.125% 24Mar2025			
Japan (Govt of) Ser 74 1% 20Mar2052	日元 2,750,000,000	15,270,370	0.8	欧元 1,200,000	1,249,796	0.1	
Japan Treasury Bill Ser 1216 0% 10Jun2024	日元 1,750,000,000	11,562,985	0.6	<b>澳门 (0.3%)</b> Sands China Ltd Ser Wi (Reg) 5.125% 08Aug2025			
Sumitomo Life Insur Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 15Apr2081	美元 3,720,000	3,282,753	0.2	美元 2,720,000	2,707,454	0.2	
<b>泽西市 (0.3%)</b>				美元 2,500,000	2,473,958	0.1	
Galaxy Pipeline Assets Ser Regs (Reg S) 2.16% 31Mar2034	美元 6,820,000	4,769,440	0.3	<b>墨西哥 (2.5%)</b> BBVA Bancomer Sa Texas Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 13Sep2034			
<b>韩国 (1.1%)</b>				美元 2,450,000	2,306,184	0.1	
Hanwha Life Insurance Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 04Feb2032	美元 2,000,000	1,866,187	0.1	美元 7,500,000	6,292,357	0.4	
KB Capital Co Ltd (Reg) (Reg S) 1.5% 28Oct2025	美元 800,000	751,173	0.0	墨西哥比索 7.75% 29May2031	4,883,900	27,761,026	1.5
Korea Housing Finance Co (Reg) (Reg S) 3.124% 18Mar2029	欧元 4,745,000	5,138,591	0.3	Petroleos Mexicanos (Reg) 6.5% 13Mar2027	美元 1,500,000	1,419,159	0.1
Korea Housing Finance Co Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4.082% 25Sep2027	欧元 4,000,000	4,529,501	0.3	Petroleos Mexicanos (Reg) 6.84% 23Jan2030	美元 5,800,000	5,193,993	0.3
Korea Housing Finance Co Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.375% 15Nov2026	美元 3,553,000	3,662,172	0.2	<b>摩洛哥 (0.1%)</b> Kingdom of Morocco Ser Regs (Reg S) 2% 30Sep2030			
				欧元 1,150,000	1,070,872	0.1	
				<b>荷兰 (0.4%)</b> Cooperatieve Rabobank UA (Reg S) (Br) Var Perp 31 Dec2049			
				欧元 1,600,000	1,675,082	0.1	

投资组合 (续)  
于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
<b>荷兰 (续)</b>				<b>Spore Airport</b>			
Enel Finance Intl NV Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.875% 17Jan2031	欧元 1,000,000	918,648	0.0	Terminal S Ser GMTN (Reg) (Reg S) 4.828% 23Jan2029	美元 1,814,000	1,821,798	0.1
ING Groep Nv (Reg S) (Br) Var Perp 31Dec2049	美元 1,000,000	1,028,389	0.1	Temasek Financial I Ltd Ser GMTN (Reg) (Reg S) 3.5% 15Feb2033	欧元 2,791,000	3,099,020	0.2
ING Groep NV Var Perp	美元 1,690,000	1,646,762	0.1	United Overseas Bank Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 07Oct2032	美元 2,480,000	2,403,229	0.1
JT Intl Fin Services Bv Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.3% 14Sep2051	美元 2,750,000	1,897,424	0.1	<b>斯洛伐克 (0.2%)</b>			
NXP Bv/Nxp Fdg/Nxp USA (Reg) 2.65% 15Feb2032	美元 1,000,000	836,337	0.0	Vseobecna Uverova Banka Ser EMTN (Reg S) (Br) 3.875% 05Sep2028	欧元 3,600,000	4,054,847	0.2
<b>新西兰 (0.4%)</b>				<b>西班牙 (3.7%)</b>			
ASB Bank Limited Ser EMTN (Reg S) (Br) 4.5% 16Mar2027	欧元 636,000	708,224	0.0	Banco Bilbao Vizcaya Arg Var Perp 31Dec2049	美元 1,550,000	1,675,810	0.1
ASB Bank Limited Ser Regs (Reg S) 5.398% 29Nov2027	美元 2,650,000	2,718,536	0.1	Banco De Sabadell Sa Ser DMTN (Reg) (Reg S) 3.5% 28Aug2026	欧元 1,900,000	2,093,019	0.1
Auckland Council Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.125% 26Sep2029	欧元 3,000,000	2,789,590	0.2	Banco De Sabadell Sa Ser EMTN (Reg S) (Br) Var 13Sep2030	欧元 400,000	437,119	0.0
Westpac Sec Nz/London (Reg S) (Br) 0.1% 13Jul2027	欧元 1,500,000	1,457,298	0.1	Caixabank Sa Ser (Reg S) Var Perp 31Dec2049	欧元 1,000,000	1,075,519	0.1
<b>罗马尼亚 (0.3%)</b>				<b>Iberdrola Finanzas</b>			
Romania (Govt of) Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.625% 27Sep2029	欧元 2,879,000	3,474,995	0.2	Sau Ser EMTN (Reg S) (Br) Var Perp 31Dec2049	欧元 1,600,000	1,766,408	0.1
Romania Ser Regs (Reg) 3.875% 29Oct2035	欧元 2,146,000	2,044,830	0.1	Spain (Govt of) (Reg S) 3.55% 31Oct2033	欧元 35,150,000	39,799,912	2.2
<b>沙特阿拉伯 (0.4%)</b>				<b>Spain (Govt of) 0%</b>			
Gacii First Investment (Reg) (Reg S) 4.75% 14Feb2030	美元 2,788,000	2,749,917	0.1	31Jan2028	欧元 19,000,000	18,446,454	1.0
Saudi International Bond Ser Regs (Reg S) 5.75% 16Jan2054	美元 4,700,000	4,717,927	0.3	Telefonica Europe Bv Ser (Reg S) (Br) Var Perp 31Dec2049	欧元 1,000,000	1,097,250	0.1
<b>新加坡 (0.5%)</b>				<b>国际 (4.1%)</b>			
Boc Aviation Usa Corp Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.75% 09Nov2028	美元 2,010,000	2,108,668	0.1	African Export- Import Ba Ser 144A (Reg) 2.634% 17May2026	美元 2,000,000	1,890,705	0.1
				Banque Ouest Africaine D Ser Regs (Reg S) 2.75% 22Jan2033	欧元 4,000,000	3,383,422	0.2

投资组合 (续)  
于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
<b>国际 (续)</b>				Heathrow Funding Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S)			
Banque Ouest Africaine D Ser Regs (Reg S) 4.7% 22Oct2031	美元 6,200,000	5,492,966	0.3	4.5% 11Jul2035	欧元 1,000,000	1,175,857	0.1
European Union Ser Ngeu (Reg S) (Br) 1% 06Jul2032	欧元 6,000,000	5,699,471	0.3	HSBC Holdings Plc (Reg) Var Perp 29Dec2049	美元 1,500,000	1,474,019	0.1
European Union Ser Ngeu (Reg S) (Br) 3.25% 04Jul2034	欧元 50,000,000	57,623,028	3.2	HSBC Holdings Plc Var 03Nov2028	美元 1,300,000	1,423,145	0.1
<b>瑞士 (0.8%)</b>				Imperial Brands Fin Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.125% 26Jul2024	美元 2,080,000	2,074,020	0.1
Credit Suisse Group Ag (Reg S) Var 30Sep2027	英镑 2,700,000	3,625,022	0.2	Motability Operations Gr Ser EMTN (Reg S) (Br) 3.625% 24Jul2029	欧元 1,928,000	2,124,589	0.1
UBS Group Ag Ser 144A (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 1,000,000	2,287,866	0.2	National Grid Plc Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.553% 18Sep2029	欧元 1,000,000	926,696	0.0
UBS Group Ag Ser 144A 4.703% 05Aug2027	美元 2,650,000	2,620,626	0.1	NatWest Group Plc Ser EMTN (Reg S) (Br) Var 06Sep2028	欧元 1,000,000	1,122,948	0.1
UBS Switzerland Ag (Reg S) 3.304% 05Mar2029	欧元 5,000,000	5,474,011	0.3	Santander Uk Plc Ser EMTN (Reg S) (Br) 3% 12Mar2029	欧元 4,853,000	5,251,118	0.3
<b>台湾 (0.2%)</b>				Standard Chartered Plc Ser 144A Var 08Feb2030	美元 2,000,000	2,173,657	0.1
Foxconn Far East Ltd (Reg) (Reg S) 2.5% 28Oct2030	美元 4,800,000	4,131,504	0.2	Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 1,000,000	1,025,146	0.1
<b>土耳其 (0.1%)</b>				Thames Water Util Fin Ser EMTN (Reg S) (Br) 4.375% 18Jan2031	欧元 1,300,000	1,321,705	0.1
Hyundai Assan Otomotiv 1.625% 12/07/26-RegS	美元 1,000,000	917,111	0.1	Tsb Bank Plc (Reg S) (Br) 3.319% 05Mar2029	欧元 5,000,000	5,472,280	0.3
<b>阿联酋 (0.4%)</b>				UK (Gilts) (Reg) (Reg S) 3.25% 31Jan2033	英镑 27,500,000	33,388,299	1.9
Emirates NBD Bank PJSC 5.875% 11Oct2028	美元 3,100,000	3,285,411	0.2	UK (Gilts) (Reg) (Reg S) 3.75% 22Oct2053	英镑 12,750,000	14,727,145	0.8
Mdgh GMTN Rsc Ltd Ser 144A (Reg) 2.875% 07Nov2029	美元 4,500,000	4,109,310	0.2	UK (Gilts) (Reg) (Reg S) 4.5% 07Jun2028	英镑 6,135,000	8,036,450	0.4
<b>英国 (4.8%)</b>							
BP Cap Markets America 4.812% 13Feb2033	美元 2,600,000	2,583,760	0.1				

投资组合 (续)  
于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比
美国 (11.5%)				Goodman US Fin Three Ser Regs (Reg) 3.7% 15Mar2028	美元 2,000,000	1,862,315	0.1
American Honda Finance 0.3% 07Jul2028	欧元 1,500,000	1,436,814	0.1	Government National Mortgage A 5% 20Nov2052	美元 5,080,000	4,655,750	0.3
Bank of America Corp (Reg) Var 04Feb2028	美元 2,800,000	2,615,714	0.1	Government National Mortgage A 5.5% 20Apr2053	美元 7,470,000	7,073,549	0.4
Bank of America Corp (Reg) Var 15Sep2029	美元 2,000,000	2,056,596	0.1	Morgan Stanley (Reg) Var 29Oct2027	欧元 3,000,000	2,997,782	0.2
Bank of America Corp (Reg) Var 20Oct2032	美元 3,150,000	2,651,891	0.1	NASDAQ Inc 5.55% 15Feb2034	美元 2,600,000	2,662,134	0.1
Bonos Y Oblig Del Estado 0% 31May2025	欧元 10,000,000	10,396,987	0.6	Tesla Auto Lease Trust (Ser A Cl A3) 5.3% 21Jun2027	美元 986,000	987,301	0.1
Brambles Usa Inc Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.125% 23Oct2025	美元 2,700,000	2,691,741	0.2	US Treasury 2.375% 15Feb2042	美元 5,000,000	3,736,099	0.2
Charter Comm Opt Llc/Cap (Reg) 5.25% 01Apr2053	美元 1,750,000	1,433,684	0.1	US Treasury 3.375% 15Aug2042	美元 10,500,000	9,124,002	0.5
Credit Acceptance Auto Loan Tr (Ser 1A Cl A) 5.68% 15Mar2034	美元 2,337,000	2,344,159	0.1	US Treasury 3.625% 15Feb2053	美元 28,800,000	25,446,688	1.4
Fannie Mae 3% 01Aug2050	美元 50,000,000	16,414,769	0.9	Warnermedia Holdings Inc Ser Wi (Reg) 5.05% 15Mar2042	美元 4,000,000	3,448,680	0.2
Fannie Mae 3% 01Dec2051	美元 20,850,000	15,667,011	0.9	维京群岛 (0.1%) Cheung Kong Infra Fin Bv (Reg) (Reg S) 1% 12Dec2024	欧元 2,530,000	2,672,084	0.1
Fannie Mae 5% 01Mar2053	美元 13,140,000	12,489,601	0.7			1,423,113,943	79.2
Ford Credit Auto Owner Trust (Ser A Cl A3) 5.09% 15Dec2028	美元 2,944,000	2,950,768	0.2	(II) 集体投资计划 (19.6%)			
Freddie Mac 3% 01Jun2052	美元 23,000,000	18,027,821	1.0	卢森堡 (19.6%)			
Freddie Mac 5.5% 01Apr2053	美元 7,440,000	7,026,383	0.4	JPMF-JPM Global Corporate Bond 'X' (dist)-USD*#	美元 3,537,819	351,765,361	19.6
Freddie Mac 5.5% 01May2053	美元 19,000,000	17,698,096	1.0	(III) 衍生性产品 (-0.0%)			
Freddie Mac 6% 01Aug2053	美元 19,000,000	18,044,511	1.0	信用违约掉期 (-0.0%) (D) Credit Default Swap Index-604~ 3 2,800,000.00 美元 15/03/2024 20/12/2028		(208,405)	(0.0)
Global Payments Inc (Reg) 5.95% 15Aug2052	美元 1,000,000	1,006,576	0.1	远期外汇合约 (-0.0%)		(279,143)	(0.0)
Goldman Sachs Group Inc Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 16Dec2025	英镑 2,000,000	2,459,142	0.1				
Goldman Sachs Group Inc Var 01May2029	美元 2,700,000	2,647,109	0.1				
Goldman Sachs Group Inc Var 21Oct2027	美元 2,040,000	1,893,880	0.1				
Goldman Sachs Group Inc Var 21Oct2032	美元 3,200,000	2,700,983	0.1				

投资组合 (续)  
于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
<b>(III) 衍生性产品 (续)</b>			
<b>期货 (0.0%)</b>			
Can 10Yr Bond Fut 19/06/2024	82	8,720	0.0
Euro-Bund Future 06/06/2024	(283)	(265,777)	(0.0)
Euro-BUXL 30Y Bnd 06/06/2024	206	578,448	0.0
US 10Yr Ultra Fut 18/06/2024	(162)	(91,641)	(0.0)
US 2Yr Note (CBT) 28/06/2024	410	(99,296)	(0.0)
US 10Yr Note (CBT) 18/06/2024	(764)	47,344	0.0
US Ultra Bond (CBT) 18/06/2024	242	310,062	0.0
<b>利率掉期 (-0.0%)</b>			
<b>(D) INTEREST RATE</b>			
SWAP ~619~ 1 20,000,000.00 CNY 12/03/2024 19/06/2029		(1,528)	(0.0)
<b>(D) INTEREST RATE</b>			
SWAP~619~ 2 500,000,000.00 CNY 13/03/2024 19/06/2029		36,580	0.0
<b>(D) INTEREST RATE</b>			
SWAP ~619~ 4 115,000,000.00 USD 28/06/2024 15/11/2033		(604,815)	(0.0)
		<u>(569,451)</u>	<u>(0.0)</u>
<b>总上市投资</b>		1,774,309,853	98.8
<b>其他净资产</b>		22,080,290	1.2
<b>于二零二四年三月三十一日 可赎回份额持有人应占净 资产</b>		<u>1,796,390,143</u>	<u>100.0</u>
<b>总投资, 按成本</b>		<u>1,756,484,166</u>	

\* 由管理人的关联人士发行和管理

# 在香港未获认可及并非供香港公众投资

投资组合持有变动表

截至二零二四年三月三十一日止 (未经审计)

(续)

	持有占资产净值百分比		持有占资产净值百分比	
	31.3.2024	30.9.2023	31.3.2024	30.9.2023
<b>上市投资</b>				
<b>债务证券</b>				
美国	11.5	25.8		
中国	9.4	7.4		
日本	9.0	3.0		
意大利	5.7	5.3		
法国	5.0	5.1		
英国	4.8	5.9		
加拿大	4.8	4.2		
澳大利亚	4.7	3.9		
国际	4.1	4.4		
西班牙	3.7	1.7		
墨西哥	2.5	0.6		
印度尼西亚	2.4	0.2		
德国	1.6	4.5		
韩国	1.1	0.2		
瑞士	0.8	0.4		
新加坡	0.5	0.2		
巴西	0.5	-		
爱尔兰	0.4	0.5		
新西兰	0.4	0.5		
沙特阿拉伯	0.4	0.5		
荷兰	0.4	0.4		
印度	0.4	0.2		
哥斯达黎加	0.4	-		
克罗地亚	0.4	-		
阿联酋	0.4	-		
澳门	0.3	0.2		
罗马尼亚	0.3	0.2		
以色列	0.3	0.1		
哥伦比亚	0.3	-		
多米尼加共和国	0.3	-		
匈牙利	0.3	-		
泽西市	0.3	-		
斯洛伐克	0.2	0.2		
开曼群岛	0.2	0.1		
巴林	0.2	-		
百慕大	0.2	-		
科威特	0.2	-		
台湾	0.2	-		
卢森堡	0.1	0.2		
维京群岛	0.1	0.2		
香港	0.1	0.1		
摩洛哥	0.1	0.1		
土耳其	0.1	0.1		
比利时	0.1	-		
葡萄牙	-	0.2		
<b>集体投资计划</b>				
卢森堡	19.6	18.1		
<b>衍生性产品</b>				
期货			0.0	0.2
远期外汇合约			(0.0)	1.4
信用违约掉期			(0.0)	-
利率掉期			(0.0)	-
<b>总上市投资</b>			98.8	96.3
<b>其他净资产</b>			1.2	3.7
<b>可赎回份额持有人应占净资产</b>			100.0	100.0

金融衍生工具详情  
于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

于二零二四年三月三十一日，本基金持有之金融衍生工具汇总如下：

(a) 信用违约掉期

以下为于二零二四年三月三十一日未平仓之信用违约掉期合约：

	标的资产	交易对手	公允价值 美元
于 2024 年 3 月 31 日			
(D) CREDIT DEFAULT SWAP INDEX -604~3 2,800,000.00 USD 15/03/2024 20/12/2028	CDX.NA.HY.41	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	(208,405)
		总金融负债	(208,405)
		净金融负债	(208,405)

(b) 远期外汇合约

以下为于二零二四年三月三十一日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
于 2024 年 3 月 31 日				
未平仓合约：				
澳元 70,234,336	美元 45,877,918	2024 年 4 月 2 日	Citibank N.A., 伦敦	57,037
离岸人民币 1,093,023,420	美元 151,992,677	2024 年 4 月 2 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,446,782
离岸人民币 125,063,249	美元 17,368,632	2024 年 4 月 2 日	美国道富银行	143,238
离岸人民币 17,423,504	美元 2,420,455	2024 年 4 月 2 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	20,656
离岸人民币 2,856,076	美元 397,703	2024 年 4 月 2 日	摩根士丹利国际股份有限公司	4,325
离岸人民币 2,615,830	美元 363,826	2024 年 4 月 2 日	法国巴黎银行	3,539
离岸人民币 2,381,133	美元 331,188	2024 年 4 月 2 日	摩根士丹利国际股份有限公司	3,226
离岸人民币 2,627,101	美元 364,848	2024 年 4 月 2 日	美国道富银行	3,008
欧元 468,556,331	美元 508,095,457	2024 年 4 月 2 日	巴克莱银行, 伦敦	2,054,620
欧元 9,334,260	美元 10,173,968	2024 年 4 月 2 日	美林国际, 伦敦	92,967
欧元 5,398,276	美元 5,910,252	2024 年 4 月 2 日	法国巴黎银行	80,114
欧元 2,605,882	美元 2,851,723	2024 年 4 月 2 日	美林国际, 伦敦	37,370
欧元 3,650,000	美元 3,966,695	2024 年 4 月 2 日	渣打银行, 伦敦	24,695
欧元 150,000	美元 162,915	2024 年 4 月 2 日	美国道富银行	915
英镑 56,532,311	美元 71,667,113	2024 年 4 月 2 日	巴克莱银行, 伦敦	252,671
日元 22,296,877,679	美元 149,965,699	2024 年 4 月 2 日	巴克莱银行, 伦敦	2,640,861
日元 3,000,253,107	美元 20,416,517	2024 年 4 月 2 日	Citibank N.A., 伦敦	592,584
美元 21,772	加元 29,545	2024 年 4 月 2 日	法国巴黎银行	60
美元 1,101	加元 1,496	2024 年 4 月 2 日	法国巴黎银行	4
离岸人民币 105,729	美元 14,594	2024 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	31
纽元 7,858	美元 4,717	2024 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	16
澳元 62,564	美元 40,902	2024 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	82
加元 282,284	美元 208,610	2024 年 4 月 5 日	巴克莱银行, 伦敦	4
纽元 218,051	美元 130,831	2024 年 4 月 5 日	巴克莱银行, 伦敦	403
纽元 14,823	美元 8,909	2024 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	43
美元 870,208	澳元 1,333,787	2024 年 4 月 5 日	巴克莱银行, 伦敦	27
美元 30,501	纽元 50,993	2024 年 4 月 5 日	巴克莱银行, 伦敦	0
离岸人民币 3,174,133	美元 437,505	2024 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	305
离岸人民币 1,647,210	美元 227,042	2024 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	158
美元 2,541	离岸人民币 18,451	2024 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	0
美元 1,388	离岸人民币 10,081	2024 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	0
澳元 657,544	美元 432,272	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	3,082
澳元 258,854	美元 171,291	2024 年 4 月 19 日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,332
澳元 443,749	美元 291,806	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	2,164
澳元 342,219	美元 224,580	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	1,208

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
澳元 777,152	美元 508,412	2024年4月19日	法国巴黎银行	1,151
澳元 81,077	美元 53,708	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	787
澳元 89,916	美元 59,112	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	422
澳元 23,717	美元 15,765	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	285
澳元 27,275	美元 17,936	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	133
澳元 7,112	美元 4,712	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	69
澳元 52,600	美元 34,384	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	51
澳元 12,149	美元 7,977	2024年4月19日	法国巴黎银行	47
澳元 52,659	美元 34,404	2024年4月19日	法国巴黎银行	33
澳元 286,970	美元 187,328	2024年4月19日	法国巴黎银行	18
澳元 1,667	美元 1,105	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	17
澳元 1,675	美元 1,110	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	16
澳元 1,657	美元 1,096	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	15
澳元 1,685	美元 1,108	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	8
澳元 1,689	美元 1,105	2024年4月19日	法国巴黎银行	3
澳元 1,687	美元 1,104	2024年4月19日	法国巴黎银行	2
澳元 2,066	美元 1,350	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	1
澳元 3,100	美元 2,024	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	0
加元 649,131	美元 481,551	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	1,749
加元 214,546	美元 159,342	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	762
加元 211,676	美元 157,152	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	693
加元 695,031	美元 514,401	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	673
加元 140,926	美元 104,550	2024年4月19日	加拿大皇家银行	385
加元 75,944	美元 56,483	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	350
加元 147,684	美元 109,193	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	34
加元 1,483	美元 1,103	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	7
加元 1,487	美元 1,104	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	5
加元 1,480	美元 1,098	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	4
加元 1,484	美元 1,100	2024年4月19日	法国巴黎银行	3
加元 1,493	美元 1,105	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	2
离岸人民币 48,560,330	美元 6,779,478	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	86,812
离岸人民币 34,761,669	美元 4,834,752	2024年4月19日	法国巴黎银行	43,841
离岸人民币 23,107,527	美元 3,223,615	2024年4月19日	法国巴黎银行	38,897
离岸人民币 21,623,921	美元 3,007,144	2024年4月19日	法国巴黎银行	26,899
离岸人民币 10,596,356	美元 1,474,173	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	13,766
离岸人民币 9,292,535	美元 1,292,350	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	11,637
离岸人民币 4,878,843	美元 679,277	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	6,867
离岸人民币 4,752,745	美元 661,839	2024年4月19日	摩根士丹利国际股份有限公司	6,808
离岸人民币 4,255,161	美元 592,962	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	6,509
离岸人民币 3,569,249	美元 496,807	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	4,887
离岸人民币 3,497,845	美元 486,623	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	4,544
离岸人民币 2,614,732	美元 364,409	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	4,042
离岸人民币 2,934,623	美元 408,130	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	3,675
离岸人民币 2,817,440	美元 391,858	2024年4月19日	法国巴黎银行	3,554
离岸人民币 2,374,741	美元 330,318	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	3,027
离岸人民币 2,319,249	美元 322,547	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	2,904
离岸人民币 2,865,582	美元 397,798	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	2,859
离岸人民币 2,496,783	美元 346,840	2024年4月19日	法国巴黎银行	2,729
离岸人民币 3,051,762	美元 423,277	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	2,678
离岸人民币 1,581,535	美元 220,235	2024年4月19日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,265
离岸人民币 1,859,623	美元 258,357	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	2,061
离岸人民币 1,585,872	美元 220,628	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	2,060
离岸人民币 1,472,930	美元 205,018	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	2,017
离岸人民币 1,589,592	美元 221,089	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	2,009
离岸人民币 1,541,017	美元 214,297	2024年4月19日	法国巴黎银行	1,911
离岸人民币 1,089,077	美元 151,747	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	1,649
离岸人民币 981,645	美元 136,809	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	1,517
离岸人民币 5,074,160	美元 700,791	2024年4月19日	法国巴黎银行	1,462
离岸人民币 1,008,973	美元 140,478	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	1,420
离岸人民币 1,076,070	美元 149,653	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	1,348
离岸人民币 1,041,831	美元 144,879	2024年4月19日	法国巴黎银行	1,292
离岸人民币 1,067,082	美元 148,233	2024年4月19日	法国巴黎银行	1,166
离岸人民币 865,796	美元 120,477	2024年4月19日	法国巴黎银行	1,150
离岸人民币 725,316	美元 101,003	2024年4月19日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,039
离岸人民币 851,108	美元 118,150	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	849
离岸人民币 565,915	美元 78,717	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	721
离岸人民币 526,453	美元 73,210	2024年4月19日	法国巴黎银行	653
离岸人民币 449,194	美元 62,524	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	615

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
离岸人民币 561,397	美元 77,986	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	613
离岸人民币 455,107	美元 63,327	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	603
离岸人民币 437,721	美元 60,881	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	553
离岸人民币 1,735,549	美元 239,731	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	535
离岸人民币 1,642,343	美元 226,856	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	506
离岸人民币 396,696	美元 55,107	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	434
离岸人民币 453,657	美元 62,922	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	398
离岸人民币 393,694	美元 54,652	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	393
离岸人民币 211,925	美元 29,565	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	357
离岸人民币 267,422	美元 37,149	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	292
离岸人民币 206,385	美元 28,735	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	290
离岸人民币 180,819	美元 25,200	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	280
离岸人民币 214,840	美元 29,889	2024 年 4 月 19 日	美林国际, 伦敦	279
离岸人民币 192,029	美元 26,736	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	270
离岸人民币 203,035	美元 28,235	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	253
离岸人民币 185,035	美元 25,732	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	230
离岸人民币 710,229	美元 98,090	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	205
离岸人民币 136,368	美元 18,976	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	181
离岸人民币 142,052	美元 19,756	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	178
离岸人民币 557,170	美元 76,962	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	172
离岸人民币 133,694	美元 18,595	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	169
离岸人民币 115,215	美元 16,044	2024 年 4 月 19 日	摩根士丹利国际股份有限公司	165
离岸人民币 119,221	美元 16,594	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	163
离岸人民币 121,583	美元 16,910	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	153
离岸人民币 74,801	美元 10,443	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	134
离岸人民币 119,622	美元 16,592	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	105
离岸人民币 292,549	美元 40,410	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	90
离岸人民币 64,577	美元 8,982	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	82
离岸人民币 1,128,651	美元 155,617	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	64
离岸人民币 41,287	美元 5,748	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	58
离岸人民币 35,266	美元 4,905	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	45
离岸人民币 149,797	美元 20,688	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	43
离岸人民币 27,425	美元 3,821	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	42
离岸人民币 30,598	美元 4,251	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	33
离岸人民币 18,213	美元 2,538	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	28
离岸人民币 437,292	美元 60,293	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	25
离岸人民币 22,003	美元 3,057	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	24
离岸人民币 14,456	美元 2,011	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	18
离岸人民币 13,622	美元 1,895	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	17
离岸人民币 8,657	美元 1,208	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	15
离岸人民币 10,124	美元 1,409	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	14
离岸人民币 8,033	美元 1,122	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	14
离岸人民币 7,915	美元 1,105	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	14
离岸人民币 7,915	美元 1,105	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	14
离岸人民币 7,915	美元 1,105	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	14
离岸人民币 10,707	美元 1,489	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	14
离岸人民币 7,901	美元 1,102	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	13
离岸人民币 7,925	美元 1,104	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	13
离岸人民币 7,925	美元 1,104	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	12
离岸人民币 7,925	美元 1,104	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	12
离岸人民币 7,925	美元 1,104	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	12
离岸人民币 7,925	美元 1,104	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	12
离岸人民币 8,124	美元 1,130	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	11
离岸人民币 7,930	美元 1,104	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	11
离岸人民币 7,930	美元 1,104	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	11
离岸人民币 7,930	美元 1,104	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	11
离岸人民币 7,931	美元 1,103	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 7,931	美元 1,103	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 7,931	美元 1,103	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 7,931	美元 1,103	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 7,931	美元 1,103	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 7,926	美元 1,102	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	10
离岸人民币 9,142	美元 1,269	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	9
离岸人民币 7,928	美元 1,101	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	9
离岸人民币 7,928	美元 1,101	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	9
离岸人民币 7,928	美元 1,101	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	9
离岸人民币 7,928	美元 1,101	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	9
离岸人民币 147,928	美元 20,396	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	8
离岸人民币 7,935	美元 1,102	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	8

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
离岸人民币 7,935	美元 1,102	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	8
离岸人民币 7,935	美元 1,102	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	8
离岸人民币 7,940	美元 1,101	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	7
离岸人民币 11,589	美元 1,601	2024年4月19日	法国巴黎银行	4
离岸人民币 58,074	美元 8,007	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	3
离岸人民币 9,007	美元 1,244	2024年4月19日	法国巴黎银行	3
离岸人民币 7,998	美元 1,105	2024年4月19日	法国巴黎银行	2
离岸人民币 7,972	美元 1,101	2024年4月19日	法国巴黎银行	2
纽元 898,519	美元 548,868	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	11,409
纽元 182,657	美元 111,393	2024年4月19日	法国巴黎银行	2,135
纽元 159,009	美元 96,871	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,758
纽元 93,848	美元 57,703	2024年4月19日	法国巴黎银行	1,567
纽元 85,570	美元 52,720	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,536
纽元 61,284	美元 37,796	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	1,139
纽元 83,944	美元 51,144	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	932
纽元 24,494	美元 15,107	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	455
纽元 21,491	美元 13,308	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	453
纽元 36,413	美元 22,207	2024年4月19日	法国巴黎银行	426
纽元 156,721	美元 94,033	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	288
纽元 25,660	美元 15,520	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	172
纽元 13,861	美元 8,434	2024年4月19日	法国巴黎银行	143
纽元 4,887	美元 3,014	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	91
纽元 2,335	美元 1,440	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	43
纽元 1,784	美元 1,104	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	38
纽元 1,784	美元 1,104	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	38
纽元 1,776	美元 1,096	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	33
纽元 1,787	美元 1,096	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	27
纽元 1,794	美元 1,092	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	19
纽元 1,808	美元 1,094	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	12
纽元 1,808	美元 1,094	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	12
纽元 1,833	美元 1,101	2024年4月19日	法国巴黎银行	5
美元 311,662	加元 423,008	2024年4月19日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,002
美元 143,646	加元 195,173	2024年4月19日	摩根士丹利国际股份有限公司	615
美元 681,747	离岸人民币 4,949,929	2024年4月19日	加拿大皇家银行	461
美元 103,206	澳元 158,766	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	423
美元 82,047	加元 111,513	2024年4月19日	高盛国际, 伦敦	377
美元 69,916	加元 95,023	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	320
美元 167,586	加元 227,138	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	302
美元 155,460	加元 210,706	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	282
美元 85,849	加元 116,492	2024年4月19日	法国巴黎银行	255
美元 129,199	澳元 198,203	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	172
美元 229,776	离岸人民币 1,668,327	2024年4月19日	加拿大皇家银行	155
美元 195,722	离岸人民币 1,421,222	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	153
美元 36,808	加元 50,000	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	149
美元 82,275	加元 111,427	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	86
美元 101,946	离岸人民币 740,197	2024年4月19日	加拿大皇家银行	69
美元 200,078	加元 270,744	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	41
美元 80,383	澳元 123,203	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	34
美元 55,409	加元 75,000	2024年4月19日	法国巴黎银行	27
美元 23,413	澳元 35,905	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	23
美元 13,737	离岸人民币 99,738	2024年4月19日	加拿大皇家银行	9
美元 14,929	离岸人民币 108,349	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	4
澳元 70,234,336	美元 45,882,687	2024年5月3日	巴克莱银行, 伦敦	20,508
澳元 3,967,233	美元 2,596,491	2024年5月3日	美国道富银行	5,935
欧元 434,619,191	美元 470,885,555	2024年5月3日	摩根士丹利国际股份有限公司	901,835
欧元 2,068,486	美元 2,259,979	2024年5月3日	美国道富银行	23,182
英镑 53,549,923	美元 67,670,769	2024年5月3日	多伦多道明银行	11,995
墨西哥比索 465,875,290	美元 27,942,846	2024年5月3日	摩根士丹利国际股份有限公司	54,793
美元 4,840,978	英镑 3,831,736	2024年5月3日	摩根士丹利国际股份有限公司	310
			未实现总收益	8,835,480
澳元 123,203	美元 80,344	2024年4月2日	Citibank N.A., 伦敦	(34)
加元 95,023	美元 69,899	2024年4月2日	Citibank N.A., 伦敦	(319)
加元 81,192,296	美元 59,931,041	2024年4月2日	加拿大皇家银行	(66,962)
离岸人民币 1,421,222	美元 195,537	2024年4月2日	Citibank N.A., 伦敦	(213)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
墨西哥比索 465,875,290	美元 27,180,282	2024年4月2日	美国道富银行	(847,771)
美元 1,104	离岸人民币 7,998	2024年4月2日	法国巴黎银行	(2)
美元 1,103	澳元 1,687	2024年4月2日	法国巴黎银行	(2)
美元 20,673	离岸人民币 149,797	2024年4月2日	法国巴黎银行	(41)
美元 98,018	离岸人民币 710,229	2024年4月2日	法国巴黎银行	(196)
美元 700,279	离岸人民币 5,074,160	2024年4月2日	法国巴黎银行	(1,397)
美元 432,505	离岸人民币 3,107,863	2024年4月2日	摩根士丹利国际股份有限公司	(4,449)
美元 3,773,303	英镑 2,982,389	2024年4月2日	Citibank N.A., 伦敦	(5,801)
美元 6,488,649	欧元 5,988,844	2024年4月2日	Citibank N.A., 伦敦	(20,697)
美元 16,595,937	欧元 15,213,698	2024年4月2日	摩根士丹利国际股份有限公司	(165,143)
美元 8,427,776	日元 1,249,970,000	2024年4月2日	摩根士丹利国际股份有限公司	(168,699)
美元 37,063,147	欧元 33,873,017	2024年4月2日	摩根士丹利国际股份有限公司	(480,289)
美元 1,100	离岸人民币 7,972	2024年4月3日	法国巴黎银行	(2)
美元 8,004	离岸人民币 58,074	2024年4月3日	巴克莱银行, 伦敦	(5)
美元 1,101	纽元 1,833	2024年4月3日	法国巴黎银行	(5)
美元 20,388	离岸人民币 147,928	2024年4月3日	巴克莱银行, 伦敦	(13)
美元 60,269	离岸人民币 437,292	2024年4月3日	巴克莱银行, 伦敦	(38)
美元 155,553	离岸人民币 1,128,651	2024年4月3日	巴克莱银行, 伦敦	(99)
美元 94,033	纽元 156,721	2024年4月3日	巴克莱银行, 伦敦	(290)
加元 50,000	美元 36,800	2024年4月5日	巴克莱银行, 伦敦	(149)
纽元 1,326,907	美元 793,691	2024年4月8日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
离岸人民币 108,349	美元 14,923	2024年4月9日	巴克莱银行, 伦敦	(4)
澳元 1,333,787	美元 870,543	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(43)
加元 1,492	美元 1,103	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
加元 2,330	美元 1,721	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
加元 1,491	美元 1,100	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
加元 1,858	美元 1,371	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
加元 2,402	美元 1,771	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
加元 1,496	美元 1,102	2024年4月19日	法国巴黎银行	(4)
加元 1,490	美元 1,097	2024年4月19日	法国巴黎银行	(4)
加元 2,355	美元 1,733	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
加元 22,028	美元 16,264	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(17)
加元 11,782	美元 8,678	2024年4月19日	法国巴黎银行	(31)
加元 129,584	美元 95,733	2024年4月19日	法国巴黎银行	(48)
加元 29,545	美元 21,777	2024年4月19日	法国巴黎银行	(61)
加元 55,532	美元 40,950	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(96)
加元 42,881	美元 31,591	2024年4月19日	法国巴黎银行	(104)
加元 255,035	美元 188,328	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(180)
加元 226,710	美元 167,267	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(305)
加元 268,609	美元 198,075	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(466)
加元 618,515	美元 456,176	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(996)
离岸人民币 10,081	美元 1,389	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
离岸人民币 7,981	美元 1,100	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
离岸人民币 18,451	美元 2,542	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
离岸人民币 7,946	美元 1,094	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 7,946	美元 1,094	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 7,946	美元 1,094	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 7,946	美元 1,094	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
离岸人民币 125,645	美元 17,311	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(6)
离岸人民币 92,102	美元 12,682	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(11)
离岸人民币 786,382	美元 108,343	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(37)
离岸人民币 3,071,199	美元 423,133	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(145)
离岸人民币 3,168,920	美元 436,354	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(392)
离岸人民币 4,735,734	美元 652,101	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(585)
纽元 1,833	美元 1,097	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
纽元 50,993	美元 30,501	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
美元 862	澳元 1,321	2024年4月19日	法国巴黎银行	(0)
美元 1,858	加元 2,513	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
美元 208,654	加元 282,284	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(5)
美元 1,676	加元 2,260	2024年4月19日	法国巴黎银行	(5)
美元 4,657	加元 6,290	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(8)
美元 992	离岸人民币 7,125	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(10)
美元 2,002	加元 2,692	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(12)
美元 793,717	纽元 1,326,907	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(13)
美元 1,652	离岸人民币 11,892	2024年4月19日	法国巴黎银行	(13)
美元 13,607	澳元 20,826	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(14)
美元 2,626	澳元 4,000	2024年4月19日	法国巴黎银行	(15)
美元 4,717	纽元 7,858	2024年4月19日	法国巴黎银行	(17)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 2,561	离岸人民币 18,411	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(23)
美元 14,605	离岸人民币 105,729	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(33)
美元 34,462	澳元 52,745	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(34)
美元 3,036	离岸人民币 21,779	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(34)
美元 8,909	纽元 14,823	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(43)
美元 23,092	离岸人民币 167,232	2024 年 4 月 19 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(44)
美元 35,757	加元 48,312	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(47)
美元 40,919	澳元 62,564	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(83)
美元 14,884	离岸人民币 107,307	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(95)
美元 12,846	离岸人民币 92,480	2024 年 4 月 19 日	美林国际, 伦敦	(100)
美元 12,134	离岸人民币 87,269	2024 年 4 月 19 日	美国道富银行	(106)
美元 227,137	离岸人民币 1,647,210	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(116)
美元 122,462	澳元 187,435	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(120)
美元 13,629	离岸人民币 98,000	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(122)
美元 14,422	离岸人民币 103,636	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(138)
美元 39,051	纽元 65,034	2024 年 4 月 19 日	美林国际, 伦敦	(150)
美元 12,746	离岸人民币 91,365	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(154)
美元 16,149	澳元 24,500	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(157)
美元 15,020	离岸人民币 107,671	2024 年 4 月 19 日	加拿大皇家银行	(181)
美元 236,007	澳元 361,294	2024 年 4 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(184)
美元 14,555	离岸人民币 104,249	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(187)
美元 16,895	离岸人民币 121,203	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(190)
美元 13,666	澳元 20,629	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(201)
美元 242,460	澳元 371,125	2024 年 4 月 19 日	美林国际, 伦敦	(221)
美元 437,687	离岸人民币 3,174,133	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(223)
美元 79,451	加元 107,177	2024 年 4 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(231)
美元 102,064	澳元 156,009	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(234)
美元 33,826	离岸人民币 243,369	2024 年 4 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(284)
美元 66,928	加元 90,147	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(296)
美元 83,551	纽元 139,166	2024 年 4 月 19 日	美林国际, 伦敦	(307)
美元 34,515	离岸人民币 248,183	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(310)
美元 173,408	离岸人民币 1,255,831	2024 年 4 月 19 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(327)
美元 44,374	纽元 73,630	2024 年 4 月 19 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(332)
美元 130,835	纽元 218,051	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(406)
美元 96,228	加元 129,636	2024 年 4 月 19 日	美林国际, 伦敦	(409)
美元 42,300	离岸人民币 303,800	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(430)
美元 28,107	澳元 42,393	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(436)
美元 48,161	离岸人民币 346,247	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(440)
美元 21,969	纽元 35,828	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(538)
美元 86,490	离岸人民币 622,594	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(683)
美元 41,802	纽元 68,737	2024 年 4 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(686)
美元 57,149	澳元 86,499	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(690)
美元 380,130	离岸人民币 2,752,926	2024 年 4 月 19 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(717)
美元 98,203	离岸人民币 706,974	2024 年 4 月 19 日	美林国际, 伦敦	(766)
美元 27,319	纽元 44,372	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(778)
美元 26,652	纽元 43,212	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(804)
美元 92,100	离岸人民币 662,170	2024 年 4 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(839)
美元 46,816	澳元 70,430	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(845)
美元 73,505	离岸人民币 526,879	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(889)
美元 100,595	离岸人民币 722,888	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(965)
美元 57,490	纽元 94,482	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(975)
美元 111,789	离岸人民币 803,600	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(1,035)
美元 39,675	纽元 64,396	2024 年 4 月 19 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,156)
美元 91,130	澳元 137,788	2024 年 4 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,194)
美元 3,689,738	澳元 5,650,960	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(1,260)
美元 150,421	离岸人民币 1,081,649	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(1,346)
美元 217,959	离岸人民币 1,570,000	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(1,579)
美元 209,878	离岸人民币 1,510,938	2024 年 4 月 19 日	美林国际, 伦敦	(1,638)
美元 133,259	离岸人民币 954,445	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(1,716)
美元 195,647	离岸人民币 1,406,636	2024 年 4 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,782)
美元 54,568	纽元 88,117	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,859)
美元 59,055	纽元 95,575	2024 年 4 月 19 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,886)
美元 72,560	纽元 118,006	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(1,974)
美元 213,531	离岸人民币 1,534,978	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(1,978)
美元 139,902	澳元 211,267	2024 年 4 月 19 日	美林国际, 伦敦	(2,004)
美元 274,253	澳元 417,043	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(2,042)
美元 1,143,966	离岸人民币 8,284,687	2024 年 4 月 19 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(2,157)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 110,920	纽元 181,774	2024 年 4 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2,190)
美元 248,239	离岸人民币 1,782,855	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,523)
美元 195,293	澳元 295,197	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(2,612)
美元 291,128	离岸人民币 2,093,216	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,638)
美元 361,593	离岸人民币 2,601,590	2024 年 4 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3,038)
美元 340,959	离岸人民币 2,451,219	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(3,128)
美元 491,160	离岸人民币 3,541,000	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(3,134)
美元 278,893	离岸人民币 1,999,096	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(3,374)
美元 412,957	离岸人民币 2,969,421	2024 年 4 月 19 日	法国巴黎银行	(3,706)
美元 169,393	纽元 276,396	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(4,064)
美元 453,791	离岸人民币 3,259,928	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(4,502)
美元 662,663	离岸人民币 4,770,600	2024 年 4 月 19 日	美林国际, 伦敦	(5,171)
美元 627,342	离岸人民币 4,510,387	2024 年 4 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(5,713)
美元 745,772	离岸人民币 5,363,836	2024 年 4 月 19 日	美国道富银行	(6,519)
美元 783,013	离岸人民币 5,633,619	2024 年 4 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(6,578)
美元 603,677	离岸人民币 4,330,761	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(6,805)
美元 1,137,573	澳元 1,730,343	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(8,148)
美元 756,631	离岸人民币 5,428,650	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(8,445)
美元 1,775,872	离岸人民币 12,777,035	2024 年 4 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(14,919)
美元 853,139	纽元 1,401,189	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(15,003)
美元 7,608,814	离岸人民币 54,713,862	2024 年 4 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(68,058)
美元 50,014,785	加元 67,467,300	2024 年 4 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(146,686)
美元 58,275,223	离岸人民币 419,048,563	2024 年 4 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(521,250)
美元 55,338,907	澳元 83,810,689	2024 年 4 月 19 日	美林国际, 伦敦	(634,246)
美元 25,937,321	纽元 42,119,572	2024 年 4 月 19 日	巴克莱银行, 伦敦	(743,036)
美元 125,655,438	离岸人民币 903,569,785	2024 年 4 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,123,941)
美元 404,278,261	离岸人民币 2,907,105,546	2024 年 4 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3,616,118)
加元 81,192,296	美元 59,838,264	2024 年 5 月 3 日	法国巴黎银行	(187,284)
欧元 3,660,089	美元 3,957,540	2024 年 5 月 3 日	法国巴黎银行	(366)
印尼盾 388,894,017,187	美元 24,438,762	2024 年 5 月 3 日	渣打银行, 伦敦	(67,839)
美元 3,239,206	欧元 2,990,083	2024 年 5 月 3 日	美林国际, 伦敦	(5,823)
日元 24,047,160,786	美元 159,744,352	2024 年 5 月 7 日	Citibank N.A., 伦敦	(35,236)
离岸人民币 1,242,882,450	美元 171,677,620	2024 年 6 月 5 日	高盛国际, 伦敦	(42,031)
			未实现总亏损	(9,114,623)
			未实现净亏损	(279,143)

(c) 期货

以下对于二零二四年三月三十一日未平仓之期货合约:

	标的资产	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
<u>于 2024 年 3 月 31 日</u>			
US 10Yr Note (CBT) 18/06/2024	10 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	47,344
Can 10Yr Bond Fut 19/06/2024	10 年超长期加拿大国债期货	Citigroup Global Markets Ltd	8,720
US Ultra Bond (CBT) 18/06/2024	30 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	310,062
	由联邦德国、意大利共和国、法兰西共和国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 30 年期债务工具		
Euro-BUXL 30Y Bnd 06/06/2024		Citigroup Global Markets Ltd	578,448
		未实现总收益	944,574

	标的资产	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
US 2Yr Note (CBT) 28/06/2024	2 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	(99,296)
US 10Yr Ultra Fut 18/06/2024	10 年超长期美国国债期货	Citigroup Global Markets Ltd	(91,641)
Euro-Bund Future 06/06/2024	10 年期德国欧元债券期货	Citigroup Global Markets Ltd	(265,777)
		未实现总亏损	(456,714)
		未实现净收益	487,860

(d) 利率掉期

以下为于二零二四年三月三十一日未平仓之利率掉期合约:

	标的资产	交易对手	公平值 美元
于 2024 年 3 月 31 日			
(D) INTEREST RATE SWAP~619~ 2 500,000,000.00 CNY 13/03/2024 19/06/2029	CNY/REPO7/1W/Reuters	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	36,580
		总金融资产	36,580
(D) INTEREST RATE SWAP ~619~ 4 115,000,000.00 USD 28/06/2024 15/11/2033	USD/SOFR/1D/Reuters	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	(604,815)
(D) INTEREST RATE SWAP ~619~ 1 20,000,000.00 CNY 12/03/2024 19/06/2029	CNY/REPO7/1W/Reuters	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	(1,528)
		总金融负债	(606,343)
		净金融负债	(569,763)

财务状况表

于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

综合收益表

截至二零二四年三月三十一日止期间 (未经审计)

	31.3.2024 美元	30.9.2023 美元	1.10.2023 至 31.3.2024 美元	1.10.2022 至 31.3.2023 美元
<b>资产</b>				
<b>流动资产</b>				
银行现金	23,184,840	20,966,262		
应收经纪款项	266,526	23,002,984		
分配应收款项	6,766,325	11,933,567		
保证金	7,902,286	1,648,621		
衍生性产品	9,816,634	25,863,185		
投资	1,774,879,304	1,378,243,094		
股息、利息及其他应收款项	312,243	7,915,781		
<b>总资产</b>	<u>1,823,128,158</u>	<u>1,469,573,494</u>		
<b>负债</b>				
<b>流动负债</b>				
透支经纪款项	-	2,469,355		
应付经纪款项	5,294,742	2,997,810		
赎回应付款项	4,833,643	1,552,490		
应付收益分配 [附注 6]	4,106,061	2,908,531		
衍生性产品	10,386,085	3,394,801		
其他应付款项	2,117,484	1,389,555		
<b>总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)</b>	<u>26,738,015</u>	<u>14,712,542</u>		
<b>可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]</b>	<u>1,796,390,143</u>	<u>1,454,860,952</u>		
<b>收入</b>				
投资及衍生性产品净收益 [附注 4]			103,444,936	41,207,023
存款利息			396,972	196,399
汇兑净亏损			(9,280,231)	(2,220,128)
其他收入			8,521	11,247
			<u>94,570,198</u>	<u>39,194,541</u>
<b>支出</b>				
管理费用 [附注 5(a)]			5,937,120	3,718,590
托管费用及银行费用 [附注 5(a)]			225,672	130,630
受托人费用 [附注 5(b)]			148,476	83,673
基金注册登记机构费用 [附注 5(a)]			67,483	34,849
交易成本 [附注 5(a)]			58,601	51,003
核数师酬金			36,961	4,516
印刷及出版支出			5,390	1,763
法律及专业费用			3,688	5,183
其他经营费用			3,674	1,823
			<u>6,487,065</u>	<u>4,032,030</u>
<b>净经营利润</b>			<u>88,083,133</u>	<u>35,162,511</u>
<b>财务成本</b>				
收益分配 [附注 6]			(19,832,665)	(12,002,624)
<b>除税前利润</b>			<u>68,250,468</u>	<u>23,159,887</u>
税项			(188,244)	16,549
<b>可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加</b>			<u>68,062,224</u>	<u>23,176,436</u>

可赎回份额持有人应占净资产变动表  
截至二零二四年三月三十一日止期间 (未经审计)

	1.10.2023 至 31.3.2024 美元	1.10.2022 至 31.3.2023 美元
期初可赎回份额持有人应占净资产	1,454,860,952	867,067,860
分配可赎回份额 [附注 3]	846,502,539	598,817,294
赎回可赎回份额 [附注 3]	(573,035,572)	(370,700,439)
净分配	273,466,967	228,116,855
	1,728,327,919	1,095,184,715
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加	68,062,224	23,176,436
期末可赎回份额持有人应占净资产	1,796,390,143	1,118,361,151

现金流量表  
截至二零二四年三月三十一日止期间 (未经审计)

	1.10.2023 至 31.3.2024 美元	1.10.2022 至 31.3.2023 美元
<b>经营业务</b>		
购入投资及衍生性产品	(1,516,690,123)	(1,491,469,805)
出售投资及衍生性产品所得款项	1,271,444,780	1,311,339,072
已收股息	6,960,396	1,049,532
已收利息	397,123	196,817
已付交易成本	(58,759)	(50,717)
已付基金注册登记机构费用	(121,918)	(67,647)
已付受托人费用	(144,361)	(80,017)
已(付) / 退税项	(188,244)	16,549
透支经纪款项之减少	(2,469,355)	(861,955)
已付管理费用	(5,760,872)	(3,546,688)
保证金之(增加) / 减少	(6,253,665)	871,307
其他	(8,198,135)	(2,611,284)
<b>经营业务所运用之现金净额</b>	<b>(261,083,133)</b>	<b>(185,214,836)</b>
<b>融资活动</b>		
分配可赎回份额所得款项	851,669,781	613,291,788
赎回可赎回份额付款	(569,754,419)	(387,049,406)
已付收益分配	(18,635,134)	(11,839,615)
<b>融资活动所产生之现金净额</b>	<b>263,280,228</b>	<b>214,402,767</b>
<b>现金及现金等价物之增加</b>	<b>2,197,095</b>	<b>29,187,931</b>
期初现金及现金等价物	20,966,262	44,447,749
现金及现金等价物之汇兑收益	21,483	205,083
<b>期末现金及现金等价物</b>	<b>23,184,840</b>	<b>73,840,763</b>
<b>现金及现金等价物余额分析:</b>		
银行现金	23,184,840	73,840,763

财务报表之附注

1 本基金

摩根国际债券基金（“本基金”）根据一九七九年四月三十日的信托契约（经修订）（“信托契约”）成立，受香港法律监管。本基金已获香港证券及期货事务监察委员会（“证监会”）认可。

本基金的投资目标旨在通过主要投资（即至少为资产净值总额的 80%）于环球投资级别债务证券，取得比环球债券市场更高的回报。

根据信托契约，管理人可决定发行不同产品类别（分别称为“类别”），虽然各类别之资产将作共同投资，但各类别可应用特定的收费结构、货币或收益分配政策。由于各类别有不同的收费结构，因此每类别应占之资产净值可能不同。

所有基金份额持有人于份额持有人会议上的权利是相同的，包括召开会议、表决或以其他方式行事的权利。

2 主要会计政策

(a) 中期财务报表会计政策

编制本未经审计的简明中期财务报表所使用的会计政策和计算方法与截至二零二三年九月三十日止年度财务报表所采纳的会计政策和计算方法一致。

(b) 投资及衍生性产品

分类

对于投资及衍生性产品，本基金基于其管理该等金融资产的经营模式及该等金融资产的合同现金流量特点进行分类。本基金按公允价值对金融资产组合进行管理并评估业绩。本基金主要关注公允价值信息，并运用该等信息对资产业绩进行评估，从而作出相应决策。

公允价值为负数的衍生性产品合约列示为按公允价值透过损益列账的负债。

当预期某一借入证券的市值将会下跌时，本基金出售该证券进行卖空，或通过卖空进行套汇交易。卖空被分类为按公允价值透过损益列账的金融负债。

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。

确认、取消确认及计量

投资及衍生性产品之买卖于交易日确认。投资及衍生性产品先以公允价值确认，其后以公允价值重新计量。投资及衍生性产品所产生之已实现及未实现收益及亏损确认于综合收益表内。当收取投资及衍生性产品现金流量的权利已终止或本基金已转移差不多所有风险和回报时，即终止确认投资及衍生性产品。

公允价值估计

公允价值指在计量日期，于一项有序交易中由市场参与者出售一项资产而应收取或转让一项负债而应支付的价格。在活跃市场中买卖的金融资产和负债的公允价值，按最后交易价计算。当被投资公司的证券交易暂停，该投资的价值按基金管理人估计的公允价值计算。

债务证券的公允价值按包括应计利息的报价计算。

集体投资计划的投资以基于相关基金管理人决定的各基金份额净资产价值得出的公允价值而计算，或如集体投资计划为上市或在交易所买卖，则以最后交易价计算。

未平仓期货合约和掉期合约是以在估值日的长短仓最后交易价估值。最后交易价与合约价格之间的差额在综合收益表确认。

远期外汇合约是以估值日的远期利率定价。远期利率与合约利率之间的差额在综合收益表确认。

结构性主体

本基金中的所有其他基金（“被投资基金”）投资将被视为对非合并结构性主体的投资。本基金所投资的被投资基金的目标是达成中长期资本增值。

(c) 证券借贷

本基金可订立以卖空为目的之证券借贷安排。短仓指提供已售，但尚未购买的证券之责任，并以投资的公允价值列账。于期／年内借来的证券为资产负债表外交易，因此不包括在本基金的投资组合中。证券借贷有关的抵押品一般包括现金抵押，并分开纳入财务状况表内。

(d) 外币折算

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按期末／年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

与现金及现金等价物有关的汇兑盈亏在综合收益表内的“汇兑净收益／亏损”中呈列。与按公允价值透过损益列账的金融资产及金融负债有关的汇兑盈亏在综合收益表内的“投资及衍生性产品净收益／亏损”中呈列。

(e) 分配份额所得款项及赎回份额支付款项

每份额资产净值于每个交易日计算。分配或赎回份额的价格将通过参考相关交易日营业时间结束时每份额资产净值计算。这是按照信托契约的条文计算，因而可能与财务报表中的会计政策不同。

可赎回份额持有人有权选择赎回份额，此等份额在财务状况表上分类为金融负债，代表可赎回份额持有人应占净资产（或“资产净值”或“净资产”或“NAV”）。如果可赎回份额持有人行使他的赎回权，则将可赎回金额以应付账款的形式在财务状况表入账。

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

1.10.2023 至 31.3.2024

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	10,250,082.410	8,156,098.967	141,354,598.971	3,970,675.479	139,899,405.190
总分配	3,540,124.702	3,505,479.057	39,913,696.158	2,545,719.383	88,200,847.910
总赎回	(2,952,544.371)	(3,702,928.023)	(31,497,229.658)	(1,148,729.073)	(81,541,358.370)
期末	<u>10,837,662.741</u>	<u>7,958,650.001</u>	<u>149,771,065.471</u>	<u>5,367,665.789</u>	<u>146,558,894.730</u>

1.10.2023 至 31.3.2024

	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲 份额 (累计) 份额	PRC 人民币对冲 份额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
期初	14,001,444.780	280,562,546.870	15,135,518.530	1,955,285.800	2,379,751.280
总分配	58,164,438.120	95,482,737.810	37,327,835.290	1,002,261.720	2,961,627.440
总赎回	(5,025,274.540)	(115,848,976.490)	(3,386,822.240)	(306,861.030)	(203,114.860)
期末	<u>67,140,608.360</u>	<u>260,196,308.190</u>	<u>49,076,531.580</u>	<u>2,650,686.490</u>	<u>5,138,263.860</u>
	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元类别 (每半年派息) 份额	美元 X 类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	1,249,185.846	89,613,254.027	34,024,836.348	438,038.285	14,570,259.405
总分配	4,432,111.253	44,459,269.249	24,226,620.837	1,288,989.319	5,045,496.225
总赎回	(1,212,847.041)	(21,928,544.095)	(11,014,178.434)	(1,195,923.975)	(5,271,841.000)
期末	<u>4,468,450.058</u>	<u>112,143,979.181</u>	<u>47,237,278.751</u>	<u>531,103.629</u>	<u>14,343,914.630</u>

1.10.2022 至 31.3.2023

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	8,060,861.614	6,016,628.632	142,548,699.569	2,926,967.623	61,293,278.840
总分配	3,453,273.173	2,213,268.622	30,594,680.250	766,444.027	34,969,380.770
总赎回	(2,142,335.987)	(1,494,771.320)	(37,231,109.494)	(500,572.948)	(62,226,409.050)
期末	<u>9,371,798.800</u>	<u>6,735,125.934</u>	<u>135,912,270.325</u>	<u>3,192,838.702</u>	<u>34,036,250.560</u>
	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲 份额 (累计) 份额	PRC 人民币对冲 份额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
期初	7,999,704.740	75,868,784.020	6,589,201.510	1,908,749.630	2,071,460.200
总分配	327,693.870	246,008,947.610	1,126,168.380	282,391.340	33,833.780
总赎回	(1,054,683.940)	(67,389,681.810)	(857,763.970)	(311,591.610)	(112,836.450)
期末	<u>7,272,714.670</u>	<u>254,488,049.820</u>	<u>6,857,605.920</u>	<u>1,879,549.360</u>	<u>1,992,457.530</u>

1.10.2022 至 31.3.2023

	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元类别 (每半年派息) 份额
已发行份额数目:				
期初	592,313.986	86,540,605.204	30,400,817.360	423,135.614
总分配	279,533.347	22,496,787.935	7,010,595.062	780,069.724
总赎回	(213,608.085)	(28,072,549.175)	(7,120,331.079)	(731,904.605)
期末	<u>658,239.248</u>	<u>80,964,843.964</u>	<u>30,291,081.343</u>	<u>471,300.733</u>

31.3.2024

	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	港元类别 (每月派息) 港元	纽元对冲类别 (每月派息) 纽元	PRC 人民币份额 (累计) 人民币
可赎回份额持有人应占净资产	<u>89,603,369</u>	<u>66,033,991</u>	<u>1,259,293,937</u>	<u>44,412,245</u>	<u>1,595,124,037</u>
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	<u>8.27</u>	<u>8.30</u>	<u>8.41</u>	<u>8.27</u>	<u>10.88</u>
	PRC 人民币份额 (每月派息) 人民币	PRC 人民币对冲 份额 (累计) 人民币	PRC 人民币对冲 份额 (每月派息) 人民币	PRC 美元份额 (累计) 美元	PRC 美元份额 (每月派息) 美元
可赎回份额持有人应占净资产	<u>617,136,189</u>	<u>2,761,184,116</u>	<u>416,817,864</u>	<u>27,360,720</u>	<u>43,756,377</u>
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	<u>9.19</u>	<u>10.61</u>	<u>8.49</u>	<u>10.32</u>	<u>8.52</u>
	人民币对冲类别 (累计) 人民币	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	美元类别 (每月派息) 美元	美元类别 (每半年派息) 美元	美元 X 类别 (累计) 美元
可赎回份额持有人应占净资产	<u>56,752,023</u>	<u>917,817,248</u>	<u>393,403,960</u>	<u>9,974,625</u>	<u>150,522,878</u>
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	<u>12.70</u>	<u>8.18</u>	<u>8.33</u>	<u>18.78</u>	<u>10.49</u>

30.9.2023

	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	港元类别 (每月派息) 港元	纽元对冲类别 (每月派息) 纽元	PRC 人民币份额 (累计) 人民币
可赎回份额持有人应占净资产	82,138,289	65,556,132	1,151,643,442	31,824,571	1,443,606,142
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	8.01	8.04	8.15	8.01	10.32
	PRC 人民币份额 (每月派息) 人民币	PRC 人民币对冲 份额 (累计) 人民币	PRC 人民币对冲 份额 (每月派息) 人民币	PRC 美元份额 (累计) 美元	PRC 美元份额 (每月派息) 美元
可赎回份额持有人应占净资产	125,036,624	2,844,180,398	124,492,098	19,062,251	19,625,761
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	8.93	10.14	8.23	9.75	8.25
	人民币对冲类别 (累计) 人民币	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	美元类别 (每月派息) 美元	美元类别 (每半年派息) 美元	美元 X 类别 (累计) 美元
可赎回份额持有人应占净资产	15,157,142	710,226,476	274,377,383	7,968,792	143,830,823
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	12.13	7.93	8.06	18.19	9.87

#### 4 投资及衍生性产品净收益

	1.10.2023 至 31.3.2024 美元	1.10.2022 至 31.3.2023 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益/亏损之变动	68,938,211	95,165,202
投资及衍生性产品销售之实现收益/(亏损)	34,506,725	(53,958,179)
	103,444,936	41,207,023

5 与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之交易

(a) 截至二零二四年及二零二三年三月三十一日止期间，已付管理人摩根基金（亚洲）有限公司及其关联人士的金额列示如下：

	1.10.2023 至 31.3.2024 美元	1.10.2022 至 31.3.2023 美元
管理费用	5,937,120	3,718,590
托管费用及银行费用	175,181	95,930
基金注册登记机构费用	67,483	34,849
交易成本	2,926	11,845

(b) 截至二零二四年及二零二三年三月三十一日止期间，已付受托人东亚银行（信托）有限公司及其关联人士的金额列示如下：

	1.10.2023 至 31.3.2024 美元	1.10.2022 至 31.3.2023 美元
受托人费用	148,476	83,673

6 收益分配

一旦该金额不足够支付本基金宣布之收益分配时，管理人可酌情决定从资本中拨款支付该等收益分配。

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
<u>1.10.2023 至 31.3.2024</u>					
澳元对冲类别（每月派息）	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	澳元 0.0248	9,900,944.749	(155,466)
加元对冲类别（每月派息）	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	加元 0.0304	8,940,487.801	(195,779)
港元类别（每月派息）	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	港元 0.0343	143,882,254.493	(630,724)
纽约对冲类别（每月派息）	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	纽约 0.0335	4,180,375.436	(81,456)
PRC 人民币份额（每月派息）	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	人民币 0.0379	23,623,609.250	(121,946)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	人民币 0.0267	18,139,888.280	(65,967)
PRC 美元份额（每月派息）	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	美元 0.0348	2,646,529.610	(92,099)
人民币对冲类别（每月派息）	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	人民币 0.0257	87,367,703.826	(305,821)
美元类别（每月派息）	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	美元 0.0340	33,464,963.745	(1,137,808)
澳元对冲类别（每月派息）	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	澳元 0.0259	10,187,850.421	(174,956)
加元对冲类别（每月派息）	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	加元 0.0307	8,683,971.014	(196,628)
港元类别（每月派息）	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	港元 0.0342	140,511,075.691	(615,274)
纽约对冲类别（每月派息）	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	纽约 0.0333	4,416,489.851	(90,837)
PRC 人民币份额（每月派息）	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	人民币 0.0369	36,250,654.340	(187,320)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	人民币 0.0187	26,033,122.410	(68,172)
PRC 美元份额（每月派息）	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	美元 0.0348	3,287,856.100	(114,417)
人民币对冲类别（每月派息）	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	人民币 0.0181	93,890,985.997	(237,982)
美元类别（每月派息）	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	美元 0.0340	34,386,437.136	(1,169,138)
澳元对冲类别（每月派息）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	澳元 0.0250	9,726,513.059	(165,922)
加元对冲类别（每月派息）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	加元 0.0300	8,103,499.748	(184,366)
港元类别（每月派息）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	港元 0.0342	140,711,767.553	(616,291)
纽约对冲类别（每月派息）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	纽约 0.0328	4,273,496.024	(88,749)
PRC 人民币份额（每月派息）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	人民币 0.0370	37,357,602.590	(194,117)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	人民币 0.0156	32,791,542.960	(71,841)
PRC 美元份额（每月派息）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	美元 0.0348	3,690,765.350	(128,439)
人民币对冲类别（每月派息）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	人民币 0.0151	98,133,580.464	(208,103)
美元类别（每月派息）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	美元 0.0340	35,825,392.168	(1,218,063)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	澳元 0.0251	10,023,697.502	(166,317)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	加元 0.0302	7,953,905.102	(179,790)
港元类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	港元 0.0343	141,530,642.364	(620,999)
纽约对冲类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 9 日	纽约 0.0329	5,079,358.766	(102,865)
PRC 人民币份额（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	人民币 0.0372	69,691,782.560	(361,394)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	人民币 0.0153	49,973,634.220	(106,583)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	美元 0.0348	5,221,655.000	(181,714)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
人民币对冲类别 (每月派息)	2024年1月31日	2024年2月8日	人民币 0.0147	105,691,669.369	(216,578)
美元类别 (每月派息)	2024年1月31日	2024年2月8日	美元 0.0340	41,402,602.104	(1,407,688)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024年2月29日	2024年3月8日	澳元 0.0282	10,176,245.954	(186,860)
港元对冲类别 (每月派息)	2024年2月29日	2024年3月8日	加元 0.0329	8,156,048.537	(197,835)
港元类别 (每月派息)	2024年2月29日	2024年3月8日	港元 0.0364	147,422,620.045	(685,441)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024年2月29日	2024年3月8日	纽元 0.0358	5,102,148.407	(111,284)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024年2月29日	2024年3月8日	人民币 0.0395	69,168,865.510	(379,192)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024年2月29日	2024年3月8日	人民币 0.0217	49,588,491.450	(149,345)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024年2月29日	2024年3月8日	美元 0.0369	5,186,907.120	(191,397)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024年2月29日	2024年3月8日	人民币 0.0209	110,968,843.062	(321,883)
美元类别 (每月派息)	2024年2月29日	2024年3月8日	美元 0.0361	45,478,086.288	(1,641,758)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024年3月28日	2024年4月10日	澳元 0.0280	10,998,553.773	(200,913)
加元对冲类别 (每月派息)	2024年3月28日	2024年4月10日	加元 0.0322	7,924,882.435	(188,569)
港元类别 (每月派息)	2024年3月28日	2024年4月10日	港元 0.0364	149,666,896.016	(696,085)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024年3月28日	2024年4月10日	纽元 0.0357	5,214,173.857	(111,343)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024年3月28日	2024年4月10日	人民币 0.0396	67,144,898.920	(366,225)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024年3月28日	2024年4月10日	人民币 0.0182	49,091,254.920	(123,059)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024年3月28日	2024年4月10日	美元 0.0369	5,138,263.860	(189,602)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024年3月28日	2024年4月10日	人民币 0.0175	112,226,828.101	(270,504)
美元类别 (每月派息)	2024年3月28日	2024年4月10日	美元 0.0361	47,176,731.982	(1,703,079)
美元类别 (每半年派息)	2024年3月28日	2024年4月10日	美元 0.4833	531,104.637	(256,682)

可赎回份额持有人之总收益分配 (19,832,665)

1.10.2022 至 31.3.2023

澳元对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	澳元 0.0241	8,310,141.526	(128,065)
美元对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	加元 0.0293	6,283,298.216	(134,966)
港元类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	港元 0.0294	144,334,101.500	(540,574)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	纽元 0.0277	3,025,523.586	(48,688)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	人民币 0.0319	7,979,687.880	(34,727)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	人民币 0.0214	6,217,904.230	(18,153)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	美元 0.0297	2,032,842.460	(60,375)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	人民币 0.0206	88,429,660.790	(248,517)
美元类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	美元 0.0290	30,593,619.130	(887,214)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	澳元 0.0215	8,287,164.356	(119,323)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	加元 0.0279	6,276,553.615	(129,170)
港元类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	港元 0.0292	134,676,260.500	(503,817)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	纽元 0.0257	3,030,318.152	(48,371)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	人民币 0.0317	7,384,246.210	(33,046)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	人民币 0.0130	6,163,723.180	(11,312)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	美元 0.0297	2,036,173.550	(60,474)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	人民币 0.0125	89,622,789.050	(158,153)
美元类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	美元 0.0290	29,500,883.620	(855,525)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	澳元 0.0181	8,166,589.554	(100,241)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	加元 0.0254	6,360,361.143	(119,232)
港元类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	港元 0.0291	135,013,501.500	(503,385)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	纽元 0.0247	3,065,565.574	(47,889)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	人民币 0.0308	7,179,929.980	(31,962)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	人民币 0.0077	6,618,403.260	(7,366)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	美元 0.0297	2,035,065.360	(60,441)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	人民币 0.0073	91,941,468.590	(97,006)
美元类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	美元 0.0290	29,260,241.550	(848,546)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	澳元 0.0190	8,743,192.339	(117,057)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	加元 0.0285	6,561,225.511	(140,139)
港元类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	港元 0.0302	133,851,837.400	(515,698)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月9日	纽元 0.0257	2,982,406.809	(49,534)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	人民币 0.0309	7,161,936.400	(32,753)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	人民币 0.0109	6,631,511.130	(10,698)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	美元 0.0307	2,016,800.520	(61,916)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	人民币 0.0105	89,671,103.900	(139,348)
美元类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	美元 0.0300	30,282,918.240	(908,487)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	澳元 0.0204	8,937,280.739	(122,948)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	加元 0.0285	6,745,907.461	(141,216)
港元类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	港元 0.0304	134,235,143.300	(519,874)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	纽元 0.0275	3,154,578.405	(53,746)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	人民币 0.0314	7,211,908.100	(32,575)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	人民币 0.0156	6,931,345.810	(15,554)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	美元 0.0307	2,015,656.860	(61,881)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	人民币 0.0150	84,884,180.970	(183,158)
美元类别 (每月派息)	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	美元 0.0300	29,875,811.140	(896,274)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	澳元 0.0203	8,495,206.891	(115,500)
加元对冲类别 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	加元 0.0272	6,617,582.865	(133,002)
港元类别 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	港元 0.0304	135,821,743.500	(525,988)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	纽元 0.0300	3,189,399.786	(59,863)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	人民币 0.0314	7,272,680.800	(33,254)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	人民币 0.0119	6,857,604.760	(11,883)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	美元 0.0307	1,992,457.530	(61,168)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	人民币 0.0115	82,272,426.980	(137,774)
美元类别 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	美元 0.0300	30,109,891.540	(903,296)
美元类别 (每半年派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	美元 0.4080	444,860.541	(181,502)
可赎回份额持有人的总收益分配					<u>(12,002,624)</u>

