

仅供中国内地公众查阅



年度报告 — 2024年9月30日（经审核）

摩根国际债券基金

内地与香港互认基金系列

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 - 未经审计	1 - 7
投资组合持有变动表 - 未经审计	8
金融衍生工具详情 - 未经审计	9
金融衍生工具风险敞口信息 - 未经审计	9
财务状况表	10
综合收益表	10
可赎回份额持有人应占净资产变动表	11
现金流量表	11
财务报表之附注	12 - 47
独立核数师报告	48 - 49
管理人及受托人的责任声明	50
受托人对份额持有人的报告	50
业绩纪录 - 未经审计	50 - 51
经营与管理	52

投资组合

于二零二四年九月三十日 (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
上市投资 (97.0%)				NBN Co Ltd Ser GMTN (Reg) (Reg S) 4.375% 15Mar2033	欧元 2,000,000	2,473,636	0.1
(I) 债务证券 (77.9%)				NBN Co Ltd Ser Regs (Reg S) 5.75% 06Oct2028	美元 3,000,000	3,250,596	0.2
澳大利亚 (3.7%)				Registry Finance Pty Ltd Ser MTN 5.472% 19Dec2031	澳元 6,800,000	4,906,714	0.2
Airservices Australia Ser MTN 5.4% 15Nov2028	澳元 7,500,000	5,494,613	0.3	SGSP Australia Assets (Reg S) 3.25% 29Jul2026	美元 1,950,000	1,924,087	0.1
APA Infrastruppcture Ltd Ser EMTN (Reg S) (Br) 2% 15Jul2030	欧元 1,500,000	1,560,772	0.1	SGSP Australia Assets Ser EMTN (Reg S) 3.5% 07Jul2027	美元 1,200,000	1,182,568	0.1
Ausgrid Finance Pty Ltd Ser MTN 5.408% 28Mar2031	澳元 3,970,000	2,799,723	0.1	Sydney Airport Finance Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4.375% 03May2033	欧元 954,000	1,150,409	0.1
Ausnet Services Holdings Ser MTN (Reg) (Reg S) 5.9812% 16May2034	澳元 2,160,000	1,586,641	0.1	Transurban Finance Co Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.713% 12Mar2032	欧元 1,186,000	1,382,115	0.1
Aust & Nz Banking Group Ser Regs (Reg S) 6.742% 08Dec2032	美元 1,620,000	1,837,309	0.1	Woolworths Group Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 0.375% 15Nov2028	欧元 826,000	825,020	0.0
Aust & NZ Banking Group Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 22Jul2030	美元 3,000,000	2,965,082	0.1	比利时 (0.1%) Dexia Credit Local Ser EMTN (Br) (Reg S) 1% 18Oct2027	欧元 1,000,000	1,082,915	0.0
Australia (Govt of) Ser 152 (Reg) (Reg S) 2.75% 21Nov2028	澳元 8,000,000	5,437,134	0.3	Kbc Group Nv (Reg S) Var Perp 31Dec2049	欧元 1,200,000	1,462,165	0.1
Australia (Govt of) Ser 166 (Reg S) 3% 21Nov2033	澳元 12,000,000	7,808,620	0.4	百慕大 (0.2%) Govt of Bermuda Ser 144A (Reg) 3.717% 25/01/2027	美元 4,000,000	3,957,258	0.2
Australia (Govt of) Ser 169 (Reg S) 4.75% 21Jun2054	澳元 1,950,000	1,410,473	0.1	巴西 (0.4%) Braskem Netherlands Ser Regs (Reg S) 7.25% 13Feb2033	美元 1,950,000	1,951,142	0.1
Australian Rail Track Ser MTN (Reg S) 5.598% 12Jun2031	澳元 5,350,000	3,877,776	0.2	Brazil (Rep of) 3.875% 12Jun2030	美元 6,900,000	6,541,819	0.3
Bank of Queensland Ltd (Reg S) (Br) 3.3004% 30Jul2029	欧元 2,712,000	3,134,184	0.2	加拿大 (4.8%) Bank of Montreal Ser EMTN (Reg) (Reg S) 0.05% 08Jun2029	欧元 2,900,000	2,877,329	0.2
Brambles Usa Inc Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.125% 23Oct2025	美元 2,700,000	2,737,372	0.1	Bank of Nova Scotia (Reg) (Reg S) 0.01% 14Sep2029	欧元 4,850,000	4,763,827	0.3
Glencore Cap Fin Dac Ser EMTN (Reg S) (Br) 1.125% 10Mar2028	欧元 1,500,000	1,578,543	0.1	British Columbia Prov of (Reg) 4.3% 18Jun2042	加元 1,000,000	771,417	0.0
Goodman Australia Fin (Reg) (Reg S) 4.25% 03May2030	欧元 918,000	1,082,286	0.0	British Columbia Prov of 2.2% 18Jun2030	加元 1,000,000	710,284	0.0
Goodman US Fin Three Ser Regs (Reg) 3.7% 15Mar2028	美元 2,000,000	1,940,301	0.1	NBN Co Ltd Ser 144A 2.625% 05May2031	美元 4,000,000	3,613,981	0.2
Macquarie Group Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 14Apr2028	美元 971,000	919,150	0.0	NBN Co Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.5% 22Mar2030	欧元 2,106,000	2,451,851	0.1
National Australia Bank (Reg S) (Br) 2.347% 30Aug2029	欧元 4,200,000	4,642,540	0.2				

投资组合 (续)

于二零二四年九月三十日 (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
加拿大 (续)				Ecopetrol SA (Reg)			
Canada (Govt of)				8.625% 19Jan2029	美元 2,375,000	2,605,014	0.1
0.25% 01Mar2026	加元 23,000,000	16,389,069	0.8				
Canada (Govt of) 3%				哥斯达黎加 (0.3%)			
01Jun2034	加元 14,500,000	10,893,206	0.6	Costa Rica			
Enbridge Inc (Reg)				Government Ser			
Var 15Jan2083	美元 3,000,000	3,144,739	0.2	Regs (Reg) (Reg S)			
Hydro-Quebec 4%				6.125% 19Feb2031	美元 6,190,000	6,478,261	0.3
15Feb2055	加元 300,000	218,297	0.0				
Hydro-Quebec Ser 19				多米尼加 (0.3%)			
6.5% 15Feb2035	加元 1,700,000	1,558,968	0.1	Dominican Republic			
Ontario (Province of)				(Reg) (Reg S) (Ser			
(Reg) 2.7%				Regs) 4.875%			
02Jun2029	加元 1,000,000	738,225	0.0	23Sep2032	美元 6,800,000	6,492,846	0.3
Ontario (Province of)							
2.6% 02Jun2025	加元 600,000	445,316	0.0	法国 (2.9%)			
Ontario (Province of)				BNP Paribas Ser			
3.65% 02Jun2033	加元 24,500,000	18,551,151	0.9	144A Var			
Province of Quebec				12Jun2029	美元 2,600,000	2,727,228	0.1
3.6% 01Sep2033	加元 22,900,000	17,082,473	0.9	BPCE Sa Ser 144A			
Royal Bank of				Var 18Jan2027	美元 2,500,000	2,568,284	0.1
Canada Ser EMTN				BPCE Sa Ser EMTN			
(Reg) (Reg S)				(Reg S) (Br) 0.5%			
0.01% 05Oct2028	欧元 4,700,000	4,743,533	0.2	15Sep2027	欧元 1,300,000	1,382,510	0.1
Toronto-Dominion				BPCE Sfh - Societe			
Bank (Reg) (Reg S)				De Fi (Reg S) (Br)			
3.666% 08Sep2031	欧元 3,900,000	4,619,610	0.2	3% 15Jan2031	欧元 4,100,000	4,748,120	0.3
Toronto-Dominion				France (Govt of) (Reg			
Bank Ser EMTN				S) 2% 25Nov2032	欧元 33,000,000	35,467,451	1.8
(Reg) (Reg S)				France (Govt of) (Reg			
3.191% 16Feb2029	欧元 6,999,000	8,149,315	0.4	S) 2.5%			
				25May2043	欧元 5,696,728	5,675,047	0.3
中国 (3.1%)				Societe Generale Ser			
China (Govt of) Ser				Regs (Regs) 4.25%			
Inbk (Reg) 2.12%				19Aug2026	美元 2,000,000	1,977,733	0.1
25Jun2031	人民币			Total Se (Reg S) (Br)			
(Interbank)	130,000,000	18,705,572	1.0	Var Per 29Dec2049	欧元 2,000,000	2,006,980	0.1
China (Govt of) Ser							
Inbk (Reg) 2.28%				德国 (4.8%)			
25Mar2031	人民币			Bundeschatzanwei			
(Interbank)	180,000,000	26,302,567	1.3	ngen (Reg S) (Br)			
China Cinda 2020 I				2.5% 15Aug2054	欧元 45,712,804	52,335,275	2.6
Management Ser				Bundeschatzanwei			
EMTN (Reg) (Reg S)				ngen (Reg S) (Br)			
5.75% 28May2029	美元 2,132,000	2,243,180	0.1	2.7% 17Sep2026	欧元 15,000,000	17,022,383	0.9
Far East Horizon Ltd				KFW Ser EMTN (Reg			
Ser EMTN (Reg)				S) (Br) 0.125%			
(Reg S) 6.625%				09Jan2032	欧元 20,000,000	18,946,979	1.0
16Apr2027	美元 3,400,000	3,546,603	0.2	Land Nordrhein-			
Meituan Ser Regs				Westfalen Ser			
(Reg) (Reg S)				EMTN (Reg S) (Br)			
3.05% 28Oct2030	美元 3,200,000	2,953,907	0.2	2.15% 21Mar2119	欧元 1,200,000	1,015,973	0.1
Prosus Nv Ser Regs				Traton Finance Lux			
(Reg S) 3.257%				Sa Ser EMTN (Reg			
19Jan2027	美元 2,500,000	2,428,617	0.1	S) 5.625%			
Prosus Nv Ser Regs				16Jan2029	英镑 1,900,000	2,662,711	0.1
(Reg S) 4.987%				Vonovia Se Ser EMTN			
19Jan2052	美元 2,225,000	1,902,423	0.1	(Reg S) (Br)			
Weibo Corp (Reg)				0.375% 16Jun2027	欧元 1,500,000	1,566,410	0.1
3.375% 08Jul2030	美元 3,000,000	2,780,803	0.1	Vonovia Se Ser EMTN			
				(Reg S) (Br)			
哥伦比亚 (0.3%)				0.625% 14Dec2029	欧元 1,000,000	981,919	0.0
Colombia (Rep of)							
(Reg) 3.25%							
22Apr2032	美元 5,000,000	4,116,346	0.2				

投资组合 (续)

于二零二四年九月三十日 (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
香港 (0.2%)				国际 (0.7%)			
Cheung Kong Infra Fin Bv (Reg) (Reg S) 1% 12Dec2024	欧元 2,530,000	2,829,749	0.1	African Export-Import Ba Ser 144A (Reg) 2.634% 17May2026	美元 2,000,000	1,930,749	0.1
Melco Resorts Finance Ser Regs (Reg) (Reg S) 7.625% 17Apr2032	美元 1,154,000	1,231,395	0.1	African Export-Import Ba Ser Regs (Reg S) 3.798% 17May2031	美元 2,000,000	1,812,489	0.1
匈牙利 (0.7%)				Banque Ouest Africaine D Ser Regs (Reg S) 2.75% 22Jan2033	欧元 4,000,000	3,810,215	0.2
Hungary (Govt of) Ser 35/A 7% 24Oct2035	匈牙利福林 2,400,000,000	7,692,977	0.4	Banque Ouest Africaine D Ser Regs (Reg S) 4.7% 22Oct2031	美元 6,200,000	5,746,831	0.3
Hungary (Govt of) Ser Regs (Reg S) 5.5% 26Mar2036	美元 5,113,000	5,162,463	0.3	爱尔兰 (0.3%)			
印度 (1.9%)				Aercap Ireland Cap/Globa (Reg) 5.75% 06Jun2028	美元 2,000,000	2,121,880	0.1
GMR Hyderabad Internatio Ser Regs (Regs) 4.25% 27Oct2027	美元 6,470,000	6,329,831	0.3	AIB Group Plc Ser EMTN (Reg S) (Br) Var 04Apr2028	欧元 1,000,000	1,107,421	0.1
Greenko Dutch BV Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.85% 29Mar2026	美元 6,250,000	5,409,653	0.3	Bank of Ireland Group (Reg S) (Br) Var 16Jul2028	欧元 2,600,000	3,071,524	0.1
Hdfc Bank Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.196% 15Feb2027	美元 3,000,000	3,063,472	0.1	以色列 (0.7%)			
HDFC Bank Ltd Ser Regs (Reg S) Var Perp	美元 3,250,000	3,118,762	0.2	Israel (Govt of) (Reg) 5.5% 12Mar2034	美元 11,265,000	11,380,103	0.6
JSW Infrastructure Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.95% 21Jan2029	美元 2,750,000	2,704,620	0.1	Israel Electric Corp Ltd (Reg) (Regs) 5% 12Nov2024	美元 2,000,000	2,041,031	0.1
Muthoot Finance Ltd Ser Regs (Reg S) 7.125% 14Feb2028	美元 4,000,000	4,221,404	0.2	意大利 (4.3%)			
NTPC Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.75% 01Feb2027	欧元 1,500,000	1,672,668	0.1	Banca Monte Dei Paschi S (Reg S) (Br) 3.5% 23Apr2029	欧元 3,540,000	4,130,496	0.2
Periama Holdings Llc/De (Reg) (Reg S) 5.95% 19Apr2026	美元 3,480,000	3,568,175	0.2	Credito Emiliano Spa Ser EMTN (Reg S) (Br) 3.25% 18Apr2029	欧元 300,000	346,776	0.0
Shriram Finance Ltd Ser Regs (Reg S) 6.625% 22Apr2027	美元 3,400,000	3,623,370	0.2	Enel Finance Intl NV Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.875% 17Jan2031	欧元 1,000,000	979,368	0.1
Shriram Finance Ltd Ser Regs (Reg) 6.15% 03Apr2028	美元 3,271,000	3,274,061	0.2	Italy (Rep of) Ser 10Y (Reg S) (Br) 4.35% 01Nov2033	欧元 14,750,000	18,168,006	0.9
印度尼西亚 (0.2%)				Italy (Rep of) Ser 11Y (Reg S) (Br) 3.85% 01Feb2035	欧元 41,000,000	47,715,638	2.4
Freeport Indonesia Pt Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.763% 14Apr2027	美元 2,000,000	2,060,696	0.1	Italy (Rep of) Ser 7Y (Reg S) (Br) 4% 15Nov2030	欧元 9,000,000	10,786,541	0.5
Perusahaan Listrik Negar Ser Regs (Reg S) 1.875% 05Nov2031	欧元 1,000,000	977,110	0.1	Unicredit SpA Ser EMTN (Reg S) (Br) Var 14Feb2030	欧元 3,250,000	3,960,648	0.2
				日本 (6.2%)			
				Japan (Govt of) 40 Year No.5 2Pct 20Mar2052	日元 1,450,000,000	10,038,351	0.5

投资组合 (续)

于二零二四年九月三十日 (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
日本 (续)				Equate Petrochemical			
Japan (Govt of) Ser 183 1.4% 20Dec2042	日元 2,742,400,000	18,598,570	0.9	BV Ser Regs (Reg) (Regs) 4.25% 03Nov2026	美元 3,000,000	3,019,582	0.1
Japan (Govt of) Ser 186 1.5% 20Sep2043	日元 2,700,000,000	18,409,027	0.9	卢森堡 (0.1%)			
Japan (Govt of) Ser 372 0.8% 20Sep2033	日元 3,900,000,000	27,356,547	1.4	Bavarian Sky Sa (Ser 8 Cl A) Frn 20Nov2031	欧元 1,900,000	2,124,212	0.1
Japan (Govt of) Ser 375 1.1% 20Jun2034	日元 1,700,000,000	12,183,288	0.6	澳门 (0.1%)			
Japan (Govt of) Ser 74 1% 20Mar2052	日元 4,100,000,000	22,385,981	1.1	Sands China Ltd Ser Wi (Reg) 5.4% 08Aug2028	美元 2,500,000	2,545,505	0.1
Jera Co. Inc. (Reg S) 3.665% 14Apr2027	美元 2,000,000	1,996,536	0.1	墨西哥 (2.3%)			
JT Intl Fin Services Bv Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.3% 14Sep2051	美元 2,750,000	1,975,096	0.1	BBVA Bancomer Sa Texas Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 13Sep2034	美元 2,350,000	2,295,366	0.1
Meiji Yasuda Life Insura Ser Regs (Reg S) Var 11Sep2054	美元 3,240,000	3,342,728	0.2	BBVA Bancomer Sa Texas Var 18Jan2033	美元 2,450,000	2,357,990	0.1
Nippon Life Insurance Ser 144A Var 16Apr2054	美元 3,000,000	3,215,919	0.2	Mexico (Utd States of) 墨西哥比索 7.75% 29May2031	7,383,900	35,995,307	1.8
Sumitomo Life Insur Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 15Apr2081	美元 3,720,000	3,427,309	0.2	Petroleos Mexicanos (Reg) 6.7% 16Feb2032	美元 5,650,000	5,116,476	0.3
韩国 (1.0%)				摩洛哥 (0.1%)			
Hanwha Life Insurance Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 04Feb2032	美元 2,000,000	1,942,974	0.1	Kingdom of Morocco Ser Regs (Reg S) 2% 30Sep2030	欧元 1,150,000	1,164,136	0.1
Hyundai Assan Otomotiv 1.625% 12/07/26-RegS	美元 1,000,000	955,699	0.0	荷兰 (0.2%)			
Korea Housing Finance Co (Reg) (Reg S) 3.124% 18Mar2029	欧元 4,745,000	5,492,431	0.3	Cooperatieve Rabobank UA (Reg S) (Br) Var Perp 31 Dec2049	欧元 1,600,000	1,763,906	0.1
Korea Housing Finance Co Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4.082% 25Sep2027	欧元 4,000,000	4,656,272	0.2	ING Groep NV Var Perp	美元 1,690,000	1,714,337	0.1
Sk Hynix Inc Ser Regs (Reg S) 5.5% 16Jan2027	美元 1,700,000	1,757,731	0.1	新西兰 (0.4%)			
Sk Hynix Inc Ser Regs (Reg S) 6.375% 17Jan2028	美元 1,970,000	2,097,091	0.1	ASB Bank Limited Ser EMTN (Reg S) (Br) 4.5% 16Mar2027	欧元 636,000	756,251	0.0
Woori Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 3,000,000	3,059,749	0.2	ASB Bank Limited Ser Regs (Reg S) 5.398% 29Nov2027	美元 2,650,000	2,802,837	0.1
科威特 (0.2%)				Auckland Council Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.125% 26Sep2029	欧元 3,000,000	2,966,497	0.2
Equate Petrochemical Bv Ser Regs (Reg S) 2.625% 28Apr2028	美元 2,000,000	1,877,900	0.1	Westpac Sec Nz/Londc (Reg S) (Br) 0.1% 13Jul2027	欧元 1,500,000	1,557,330	0.1
				巴拿马 (0.1%)			
				Panama (Govt of) (Reg) 8.875% 30Sep2027	美元 2,350,000	2,613,441	0.1
				葡萄牙 (0.1%)			
				Banco Santander Totta Sa (Reg) (Reg S) 3.25% 15Feb2031	欧元 1,200,000	1,404,834	0.1

投资组合 (续)

于二零二四年九月三十日 (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
沙特阿拉伯 (0.3%)				英国 (4.8%)			
Saudi International Bond Ser Regs (Reg S) 5.75% 16Jan2054	美元 4,000,000	4,142,937	0.2	Heathrow Funding Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4.5% 11Jul2035	欧元 1,000,000	1,206,500	0.1
Suci Second Invest Co (Reg S) 6% 25Oct2028	美元 1,500,000	1,622,017	0.1	HSBC Holdings Plc Var 03Nov2028	美元 1,300,000	1,447,067	0.1
新加坡 (0.2%)				Motability Operations Gr Ser EMTN (Reg S) (Br) 3.625% 24Jul2029	欧元 1,928,000	2,223,731	0.1
Temasek Financial I Ltd Ser GMTN (Reg) (Reg S) 3.5% 15Feb2033	欧元 2,791,000	3,303,769	0.2	National Grid Plc Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.553% 18Sep2029	欧元 1,000,000	985,101	0.0
斯洛伐克 (0.2%)				NatWest Group Plc Ser EMTN (Reg S) (Br) Var 06Sep2028	欧元 1,000,000	1,153,686	0.1
Vseobecna Uverova Banka Ser EMTN (Reg S) (Br) 3.875% 05Sep2028	欧元 3,600,000	4,180,915	0.2	Santander Uk Plc Ser EMTN (Reg S) (Br) 3% 12Mar2029	欧元 4,853,000	5,604,554	0.3
西班牙 (3.3%)				Standard Chartered Plc Ser 144A Var 08Feb2030	美元 2,000,000	2,197,068	0.1
Banco De Sabadell Sa Ser DMTN (Reg) (Reg S) 3.5% 28Aug2026	欧元 1,900,000	2,161,780	0.1	Thames Water Util Fin Ser EMTN (Reg S) (Br) 4.375% 18Jan2031	欧元 1,300,000	1,101,786	0.0
Banco De Sabadell Sa Ser EMTN (Reg S) (Br) Var 13Sep2030	欧元 400,000	466,070	0.0	Tsb Bank Plc (Reg S) (Br) 3.319% 05Mar2029	欧元 5,000,000	5,848,884	0.3
Spain (Govt of) (Reg S) 3.55% 31Oct2033	欧元 35,150,000	42,499,184	2.2	UK (Gilts) (Reg) (Reg S) 3.75% 22Oct2053	英镑 14,750,000	17,493,787	0.9
Spain (Govt of) 0% 31Jan2028	欧元 19,000,000	19,634,013	1.0	UK (Gilts) (Reg) (Reg S) 4.125% 22Jul2029	英镑 1,500,000	2,050,935	0.1
瑞士 (0.7%)				UK (Gilts) (Reg) (Reg S) 4.5% 07Jun2028	英镑 6,135,000	8,522,160	0.4
Credit Suisse Group Ag (Reg S) Var 30Sep2027	英镑 2,700,000	3,752,854	0.2	UK (Gilts) (Reg) (Reg S) 4.625% 31Jan2034	英镑 31,600,000	44,818,049	2.3
UBS Group Ag Ser 144A (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 1,000,000	1,217,292	0.1	美国 (27.2%)			
UBS Group Ag Ser 144A 4.703% 05Aug2027	美元 2,650,000	2,677,110	0.1	American Honda Finance 0.3% 07Jul2028	欧元 1,500,000	1,521,366	0.1
UBS Switzerland Ag (Reg S) 3.304% 05Mar2029	欧元 5,000,000	5,816,700	0.3	Bank of America Corp (Reg) Var 04Feb2028	美元 2,800,000	2,701,915	0.1
泰国 (0.3%)				Bank of America Corp (Reg) Var 15Sep2029	美元 2,000,000	2,110,508	0.1
Export-Import Bk Thailand Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.354% 16May2029	美元 2,500,000	2,651,764	0.1	Bank of America Corp (Reg) Var 20Oct2032	美元 3,150,000	2,799,134	0.1
Kasikornbank Pcl Hk Ser EMTN (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 3,000,000	3,044,067	0.2	BP Cap Markets America 4.812% 13Feb2033	美元 2,600,000	2,652,491	0.1
阿联酋 (0.2%)				Charter Comm Opt Llc/Cap (Reg) 5.25% 01Apr2053	美元 1,750,000	1,476,900	0.1
Galaxy Pipeline Assets Ser Regs (Reg S) 2.16% 31Mar2034	美元 6,820,000	4,687,735	0.2				

投资组合 (续)
于二零二四年九月三十日 (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 (续)				US Treasury 3.875%			
Credit Acceptance				15Aug2034	美元 35,000,000	35,422,049	1.8
Auto Loan Tr (Ser				US Treasury 4.375%			
1A Cl A) 5.68%				15May2034	美元 188,460,000	200,511,477	10.1
15Mar2034	美元 2,337,000	2,387,680	0.1	US Treasury 4.5%	美元 92,500,000	97,622,368	4.9
Fannie Mae 3%				31May2029			
01Aug2050	美元 50,000,000	16,488,545	0.8	US Treasury 4.625%	美元 38,000,000	40,752,626	2.1
Fannie Mae 5%				31May2031			
01Mar2053	美元 13,140,000	12,209,499	0.6	Warnermedia			
Fannie Mae 6%				Holdings Inc Ser Wi			
01Jul2053	美元 5,500,000	4,999,966	0.3	(Reg) 5.05%			
Ford Credit Auto				15Mar2042	美元 4,000,000	3,277,108	0.2
Owner Trust (Ser A							
Cl A3) 5.09%						1,543,086,818	77.9
15Dec2028	美元 2,944,000	3,001,093	0.2			-----	-----
Freddie Mac 3%							
01Jun2052	美元 23,000,000	18,032,268	0.9	(II) 集体投资计划 (19.0%)			
Freddie Mac 5.5%				卢森堡 (19.0%)			
01Apr2053	美元 7,440,000	6,797,003	0.3	JPMF-JPM Global			
Freddie Mac 6%				Corporate Bond			
01Aug2053	美元 19,000,000	17,496,983	0.9	'X' (dist)-USD*#	3,734,676	375,895,094	19.0
Freddie Mac 6%				(III) 衍生性产品 (0.1%)			
01Sep2053	美元 5,500,000	5,132,300	0.3	远期外汇合约 (0.1%)		2,806,012	0.1
Global Payments Inc				期货 (-0.0%)			
(Reg) 5.95%				3 Month Euro Euribor			
15Aug2052	美元 1,000,000	1,040,877	0.1	14/12/2026	(1,066)	(89,228)	(0.0)
Goldman Sachs				3 Month Euro Euribor	(1,066)	(88,614)	(0.0)
Group Inc Ser				15/03/2027			
EMTN (Reg) (Reg				3 Month Euro Euribor	1,066	98,603	0.0
S) Var 16Dec2025	英镑 2,000,000	2,679,513	0.1	15/09/2025			
Goldman Sachs				3 Month Euro Euribor	1,066	148,714	0.0
Group Inc Var				16/06/2025			
01May2029	美元 2,700,000	2,732,493	0.1	3 Month SOFR Fut	(797)	109,588	0.0
Goldman Sachs				15/06/2027			
Group Inc Var				3 Month SOFR Fut	(797)	119,550	0.0
21Oct2027	美元 2,040,000	1,962,756	0.1	16/03/2027			
Goldman Sachs				3 Month SOFR Fut	797	(308,837)	(0.0)
Group Inc Var				16/09/2025			
21Oct2032	美元 3,200,000	2,850,334	0.1	3 Month SOFR Fut	797	(268,988)	(0.0)
Government				16/12/2025			
National Mortgage				Euro-BOBL Future	(63)	(74,530)	(0.0)
A 5% 20Nov2052	美元 5,080,000	4,510,169	0.2	06/12/2024			
Government				Euro-Bund Future	(185)	4,129	0.0
National Mortgage				06/12/2024			
A 5.5% 20Apr2053	美元 7,470,000	6,734,500	0.3	Euro-BUXL 30Y Bnd	(63)	90,199	0.0
Government				06/12/2024			
National Mortgage				Euro-OAT Future	197	(219,862)	(0.0)
A 5.5% 20Jan2053	美元 5,500,000	4,829,311	0.3	06/12/2024			
Key Bank Na 5%				Long Gilt Future	237	(209,814)	(0.0)
26Jan2033	美元 2,800,000	2,800,515	0.1	27/12/2024			
Merchants Fleet				US 10Yr Ultra Fut	(619)	308,438	0.0
Funding Llc (Ser				19/12/2024			
1A Cl A) 5.82%				US 2Yr Note (CBT)	916	(367,914)	(0.0)
20Apr2037	美元 3,668,000	3,734,685	0.2	31/12/2024			
Morgan Stanley				US 5Yr Note (CBT)	1,026	(718,289)	(0.0)
(Reg) Var				31/12/2024			
29Oct2027	欧元 3,000,000	3,192,044	0.2	US Ultra Bond CBT	(398)	762,437	0.0
NASDAQ Inc 5.55%				19/12/2024			
15Feb2034	美元 2,600,000	2,761,965	0.1				
Tesla Auto Lease							
Trust (Ser A Cl A3)							
5.3% 21Jun2027	美元 986,000	998,320	0.1				
US Treasury 3.625%							
15Feb2053	美元 23,050,000	21,070,518	1.1				

投资组合 (续)
于二零二四年九月三十日 (未经审计)

单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
利率掉期 (0.0%)		
(D) INTEREST RATE SWAP~619~ 13 1,000,000,000.00 USD 19/08/2024 18/09/2025	(2,143,804)	(0.1)
(D) INTEREST RATE SWAP~619~ 14 1,000,000,000.00 USD 19/08/2024 18/09/2026	3,700,001	0.2
(D) INTEREST RATE SWAP~619~ 15 112,000,000.00 USD 12/09/2024 18/12/2034	899,592	0.0
(D) INTEREST RATE SWAP~619~ 16 1,320,000,000.00 CNY 12/09/2024 18/12/2029	(1,427,451)	(0.1)
(D) INTEREST RATE SWAP~619~ 17 230,000,000.00 CNY 27/09/2024 18/12/2029	(256,601)	(0.0)
	<u>2,873,331</u>	<u>0.1</u>
总上市投资	1,921,855,243	97.0
其他净资产	58,617,910	3.0
于二零二四年九月三十日可 赎回份额持有人应占净资 产	<u>1,980,473,153</u>	<u>100.0</u>
总投资, 按成本	<u>1,851,490,847</u>	

* 由管理人的关联人士发行和管理 (关联人士的定义, 参见附注 8)

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 (续)
截至二零二四年九月三十日止年度 (未经审计)

	持有占资产净值百分比		持有占资产净值百分比	
	2024	2023*	2024	2023*
上市投资				
债务证券				
美国	27.2	24.9		
日本	6.2	3.1		
英国	4.8	6.2		
德国	4.8	4.6		
加拿大	4.8	4.2		
意大利	4.3	5.4		
澳大利亚	3.7	4.3		
西班牙	3.3	2.0		
中国	3.1	7.6		
法国	2.9	4.9		
墨西哥	2.3	0.6		
印度	1.9	0.2		
韩国	1.0	0.2		
瑞士	0.7	0.5		
以色列	0.7	0.1		
匈牙利	0.7	-		
国际	0.7	-		
新西兰	0.4	0.5		
巴西	0.4	-		
沙特阿拉伯	0.3	0.5		
爱尔兰	0.3	0.3		
哥伦比亚	0.3	-		
哥斯达黎加	0.3	-		
多米尼加	0.3	-		
泰国	0.3	-		
香港	0.2	0.3		
斯洛伐克	0.2	0.3		
印度尼西亚	0.2	0.2		
新加坡	0.2	0.2		
百慕大	0.2	-		
科威特	0.2	-		
荷兰	0.2	-		
阿联酋	0.2	-		
比利时	0.1	0.2		
澳门	0.1	0.2		
葡萄牙	0.1	0.2		
摩洛哥	0.1	0.1		
卢森堡	0.1	-		
巴拿马	0.1	-		
塞尔维亚	-	4.6		
罗马尼亚	-	0.2		
集体投资计划				
卢森堡	19.0	18.1		
			衍生性产品	
			远期外汇合约	0.1
			利率掉期	0.0
			期货	(0.0)
			总上市投资	<u>97.0</u>
			其他净资产	<u>3.0</u>
			于九月三十日可赎回份额持有人应占净资产	<u>100.0</u>
				<u>100.0</u>

* 比较数字已更新，以符合本年度之呈列或分类方式。

金融衍生工具详情
于二零二四年九月三十日 (未经审计)

(a) 远期外汇合约

于二零二四年九月三十日，本基金持有之未平仓远期外汇合约，详情请参阅附注 10。

(b) 期货

于二零二四年九月三十日，本基金持有之期货合约，详情请参阅附注 10。

(c) 利率掉期合约

于二零二四年九月三十日，本基金持有之利率掉期合约，详情请参阅附注 10。

金融衍生工具风险敞口信息
截至二零二四年九月三十日止年度 (未经审计)

截至二零二四年九月三十日止年度，本基金就任何目的而使用的金融衍生工具所产生的最低、最高及平均总敞口，占本基金资产净值总额的百分比列示如下。

	2024
	占资产净值百分比
最低总敞口	70.7
最高总敞口	677.3
平均总敞口	142.3

截至二零二四年九月三十日止年度，本基金为非对冲目的而使用的金融衍生工具所产生的最低、最高及平均净敞口，占本基金资产净值总额的百分比列示如下。

	2024
	占资产净值百分比
最低净敞口	3.3
最高净敞口	44.9
平均净敞口	21.6

部分基金份额类别具有货币对冲功能。为避免疑义，在计算基金投资组合总风险敞口时不考虑该份额类别的风险敞口。

财务状况表
于二零二四年九月三十日

	2024 美元	2023 美元
资产		
流动资产		
银行现金	24,708,480	20,966,262
应收经纪款项	79,763,889	23,002,984
分配应收款项	13,979,132	11,933,567
保证金	11,657,126	1,648,621
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 10]	18,243,466	25,863,185
投资 [附注 4(l)(a)]	1,918,981,912	1,378,243,094
股息、利息及其他应收款项	38,817	7,915,781
总资产	2,067,372,822	1,469,573,494
负债		
流动负债		
透支经纪款项	-	2,469,355
应付经纪款项	45,130,988	2,997,810
赎回应付款项	18,399,384	1,552,490
应付收益分配 [附注 6]	6,342,478	2,908,531
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 10]	15,370,135	3,394,801
其他应付款项	1,656,684	1,389,555
总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)	86,899,669	14,712,542
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	1,980,473,153	1,454,860,952

由受托人及管理人于二零二五年一月二十四日批准

签署人:

东亚银行信托有限公司, 受托人

摩根基金 (亚洲) 有限公司, 管理人

综合收益表
截至二零二四年九月三十日止年度

	2024 美元	2023 美元
收入		
投资及衍生性产品净收益 / (亏损) [附注 5]	187,764,971	(32,263,377)
股息收入 [附注 8(a)]	15,778,183	6,960,396
存款利息 [附注 8(h)]	980,039	528,700
汇兑净亏损	(13,673,925)	(2,937,029)
其他收入 [附注 8(h)]	9,011	16,352
	190,858,279	(27,694,958)
支出		
管理费用 [附注 8(d)]	12,738,686	8,514,847
托管费用及银行费用 [附注 8(h)]	610,209	384,884
受托人费用 [附注 8(f)]	314,725	198,728
基金注册登记机构费用 [附注 8(g)]	275,178	184,300
交易成本 [附注 8(h)]	141,093	85,527
核数师酬金	58,874	18,627
印刷及出版支出	9,166	5,030
法律及专业费用	7,855	10,629
其他经营费用	9,713	6,556
	14,165,499	9,409,128
净经营利润 / (亏损)	176,692,780	(37,104,086)
财务成本		
收益分配 [附注 6]	(52,246,642)	(26,927,444)
	124,446,138	(64,031,530)
除税前利润 / (亏损)	124,446,138	(64,031,530)
税项 [附注 7]	(335,763)	52,592
	124,110,375	(63,978,938)
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益 / (亏损) 之增加 / (减少)	124,110,375	(63,978,938)

第十二至四十七页之附注乃属本财务报表之一部分。

可赎回份额持有人应占净资产变动表
截至二零二四年九月三十日止年度

	2024 美元	2023 美元
年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]	1,434,752,378	1,467,564,197
赎回可赎回份额 [附注 3]	(1,033,250,552)	(815,792,167)
净分配	401,501,826	651,772,030
	1,856,362,778	1,518,839,890
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益 / (亏损) 之增加 / (减少)	124,110,375	(63,978,938)
年末可赎回份额持有人应占净资产	1,980,473,153	1,454,860,952

现金流量表
截至二零二四年九月三十日止年度

	2024 美元	2023 美元
经营业务		
购入投资及衍生性产品	(2,786,063,366)	(2,936,800,398)
出售投资及衍生性产品所得款项	2,438,018,957	2,296,507,034
已收股息	22,738,579	-
已收利息	980,198	529,057
已付交易成本	(140,865)	(85,305)
已付基金注册登记机构费用	(254,772)	(162,664)
已付受托人费用	(305,357)	(190,902)
已 (付) / 退税项	(335,763)	52,592
透支经纪款项之 (减少) / 增加	(2,469,355)	1,607,400
保证金之 (增加) / 减少	(10,008,505)	1,386,249
已付管理费用	(12,322,479)	(8,246,507)
其他	(13,991,979)	(2,192,921)
经营业务所运用之现金净额	(364,154,707)	(647,596,365)
融资活动		
分配可赎回份额所得款项	1,432,706,813	1,488,166,109
赎回可赎回份额付款	(1,016,403,658)	(837,961,865)
已付收益分配	(48,812,695)	(26,019,135)
融资活动所产生之现金净额	367,490,460	624,185,109
现金及现金等价物之增加 / (减少)	3,335,753	(23,411,256)
年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 / (亏损)	406,465	(70,231)
年末现金及现金等价物	24,708,480	20,966,262
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	24,708,480	20,966,262

第十二至四十七页之附注乃属本财务报表之一部分。

财务报表附注

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。

本基金的投资目标是透过主要（即其资产净值至少 80%）投资于环球投资级别债务证券，以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 重要会计政策

以下为本财务报表采纳之重要会计政策。除另有注明外，该等政策与所呈列年度采纳者一致。

(a) 财务报表之编制基础

本基金之财务报表乃按照香港会计师公会颁布的香港财务报告准则编制。财务报表乃按历史成本准则编制，并就按公平值透过损益列账的金融资产及金融负债（包括衍生金融工具）之重估而做出调整。

管理人及受托人（“管理层”）按照香港财务报告准则编制财务报表时需作出若干关键会计估算、判断和假设。

于二零二三年十月一日生效的新准则及对现有准则的修订

本基金于二零二三年十月一日开始的财政年度首次采纳以下准则和修订：

- 会计政策披露 - 香港会计准则第 1 号（修订本）及香港财务报告准则实务报告第 2 号
- 会计估计定义 - 香港会计准则第 8 号（修订本）
- 与单项交易产生的资产和负债相关的递延所得税 - 香港会计准则第 12 号（修订本）

上述修订对当前或以前期间确认的金额没有任何重大影响，预计不会对未来期间产生重大影响。

于二零二三年十月一日后生效且并未提早采纳的新准则、对准则的修订和解释

若干新准则、对准则的修订和解释在二零二三年十月一日开始的年度期间生效，但在编制此等财务报表时并未提前采纳。此等新准则、对准则的修订和解释预期不会对本基金的财务报表产生重大影响。

(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。本基金按公平值对金融资产组合进行管理并评估业绩。本基金主要关注公平值信息，并运用该等信息对资产业绩进行评估，从而作出相应决策。

公平值为负数的衍生性产品合约列示为按公平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。卖空被分类为按公平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平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每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。

公允价值级次分层间的转拨

在公允价值级次分层之间的转拨视为于报告期间开始时已发生。

结构化主体

本基金将其他基金(“被投资基金”)中的所有投资视为对非合并结构化主体的投资。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) 金融工具抵销

若存在法律上可行使的权利，可对已确认入账的项目进行抵销，且有意以净额方式结算，或将资产变现并同时清偿债务，则金融资产及负债可予抵销，并把净额于财务状况表内列账。

(d) 收入及支出

股息收入乃于除息日当日入账，而相应的海外预缴税则入账为支出，并在综合收益表确认。

投资利息收入乃作为投资及衍生性产品净收益／亏损的一部分，在综合收益表确认。

银行现金及短期存款利息收入乃按实际利息法在综合收益表确认。

支出乃按应计基准在综合收益表确认。

(e) 交易成本

交易成本是指为购入／出售按公允价值透过损益列账的金融资产或负债而发生的成本。这些成本包括支付给代理机构、经纪和交易商之手续费和佣金。交易成本于发生时在综合收益表支销。

(f) 外币交易

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。

(g) 现金及现金等价物

为了编制现金流量表，现金及现金等价物指银行现金及于存放日期起在三个月或以内到期之银行存款，扣除本基金通常作为隔夜银行借款的某些短期银行借款。

(h) 保证金

本基金提供的现金抵押品在财务状况表中确认为保证金，不计入现金及现金等价物。

(i) 应收／应付经纪款项

应收／应付经纪款项指就年末已签订合同但尚未付款的投资和衍生性产品的应收款项，及就已购投资和衍生性产品的应付款项。

该等金额按公允价值进行初始确认，并以摊余成本进行后续计量。于每一报告日期，若信贷风险自初始确认后显著增加，本基金应按与存续期预期信贷损失相当的金额，对应收经纪款项计量损失准备金。计量损失准备金需考虑的因素包括经纪出现重大财务困难、破产、进行财务重组或拖欠付款的可能性。

(j) 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。

(k) 应付可赎回份额持有人的收益分配

拟分配至可赎回份额持有人的收益分配应于适当授权时在综合收益表中列账。就可赎回份额的收益分配在综合收益表中列账为财务成本。

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）

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：					
年初	10,250,082.410	8,156,098.967	141,354,598.971	3,970,675.479	139,899,405.190
总分配 总赎回	7,418,849.222 (6,497,631.067)	6,593,271.462 (5,188,247.719)	167,150,030.137 (75,403,112.785)	5,193,205.955 (3,636,397.401)	88,200,847.910 (101,426,162.450)
年末	11,171,300.565	9,561,122.710	233,101,516.323	5,527,484.033	126,674,090.650
	澳元	加元	港元	纽元	人民币
可赎回份额持有人应占净资产	92,929,710	79,825,260	1,957,676,239	45,998,058	1,380,651,140
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	8.32	8.35	8.40	8.32	10.90
	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：					
年初	14,001,444.780	280,562,546.870	15,135,518.530	1,955,285.800	2,379,751.280
总分配 总赎回	58,164,438.120 (11,866,278.250)	95,482,737.810 (176,368,874.990)	37,327,835.290 (12,567,672.370)	1,002,261.720 (687,538.760)	2,961,627.440 (547,863.100)
年末	60,299,604.650	199,676,409.690	39,895,681.450	2,270,008.760	4,793,515.620
	人民币	人民币	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应占净资产	537,625,559	2,172,533,788	341,260,761	24,343,504	41,077,325
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	8.92	10.88	8.55	10.72	8.57

2024

	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：					
年初	1,249,185.846	89,613,254.027	34,024,836.348	438,038.285	14,570,259.405
总分配 总赎回	5,445,046.285 (3,955,749.543)	90,783,283.241 (51,249,413.416)	59,662,354.574 (26,413,186.242)	2,965,525.383 (2,813,681.693)	6,744,168.225 (8,102,312.679)
年末	2,738,482.588	129,147,123.852	67,274,004.680	589,881.975	13,212,114.951
	人民币	人民币	美元	美元	美元
可赎回份额持有人应占净资产	35,643,177	1,064,869,277	563,879,497	11,144,682	144,647,818
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	13.02	8.25	8.38	18.89	10.95

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：					
年初	8,060,861.614	6,016,628.632	142,548,699.569	2,926,967.623	61,293,278.840
总分配 总赎回	7,058,954.430 (4,869,733.634)	5,605,449.917 (3,465,979.582)	68,079,455.060 (69,273,555.658)	2,319,944.785 (1,276,236.929)	191,574,759.270 (112,968,632.920)
年末	10,250,082.410	8,156,098.967	141,354,598.971	3,970,675.479	139,899,405.190
	澳元	加元	港元	纽元	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

2023

	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：					
年初	7,999,704.740	75,868,784.020	6,589,201.510	1,908,749.630	2,071,460.200
总分配 总赎回	7,613,422.140 (1,611,682.100)	386,115,529.890 (181,421,767.040)	10,110,063.560 (1,563,746.540)	662,708.180 (616,172.010)	557,991.170 (249,700.090)
年末	14,001,444.780	280,562,546.870	15,135,518.530	1,955,285.800	2,379,751.280
	人民币	人民币	人民币	美元	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) 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：					
年初	592,313.986	86,540,605.204	30,400,817.360	423,135.614	-
总分配 总赎回	1,128,258.511 (471,386.651)	48,500,411.097 (45,427,762.274)	19,773,863.550 (16,149,844.562)	2,411,173.143 (2,396,270.472)	15,230,578.405 (660,319.000)
年末	1,249,185.846	89,613,254.027	34,024,836.348	438,038.285	14,570,259.405
	人民币	人民币	美元	美元	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 财务风险管理

(I) 财务风险因素

本基金面临各种财务风险：市场风险（包括市场价格风险、利率风险及汇兑风险）、信贷风险及流动性风险。

本基金于集体投资计划中持有的单位数目占集体投资计划的净资产值总额的百分比将根据集体投资计划的分配与赎回数量随时变化。本基金有可能会在任何时点持有集体投资计划的大多数已发行的份额。本基金在被投资基金中的权益所面临的最大损失风险敞口等于其对集体投资计划投资的公平值总额。截至二零二四年九月三十日止年度，对集体投资计划的购买总额为 92,041,833 美元（二零二三年：348,457,288）。截至二零二四年九月三十日止年度，投资集体投资计划所产生的净收益总额为 30,559,500 美元（二零二三年：净损失总额为 6,491,564 美元）。

(a) 市场风险

(i) 市场价格风险

本基金主要投资债务证券，此等债券须承担利率风险。利率风险请参阅附注 4(I)(a)(ii)。

(ii) 利率风险

利率风险指金融工具的价值或未来现金流量因市场利率变动而波动不定的风险。本基金须承担现行市场利率水平波动对其投资、衍生性产品及现金存款造成影响的风险。

下表按剩余到期日分类，概述于九月三十日本基金须承担现行市场利率水平波动影响风险的金融资产及负债。

	1 年以内 美元	1 至 5 年 美元	5 年以上 美元	无确定到期日 美元	总额 美元
<u>2024</u>					
银行现金	24,708,480	-	-	-	24,708,480
保证金	11,657,126	-	-	-	11,657,126
衍生性产品	67,319	-	-	-	67,319
投资 (注*)	5,316,096	389,085,798	1,148,684,924	375,895,094	1,918,981,912
总利率敏感性缺口	41,749,021	389,085,798	1,148,684,924	375,895,094	1,955,414,837
<u>2023</u>					
银行现金	20,966,262	-	-	-	20,966,262
保证金	1,648,621	-	-	-	1,648,621
衍生性产品	1,975,521	-	-	-	1,975,521
投资 (注*)	91,754,767	367,171,873	655,479,588	263,836,866	1,378,243,094
总利率敏感性缺口	116,345,171	367,171,873	655,479,588	263,836,866	1,402,833,498

注：

* 投资的票面息率范围介乎年率 0.00% – 9.25%（二零二三年：年率 0.00% – 7.75%）。

于九月三十日，本基金投资及衍生性产品之公平值如下：

	2024		2023*	
	投资之公平值 美元	占资产净 值百分比	投资之公平值 美元	占资产净 值百分比
上市投资				
资产				
债务证券				
- 美国	539,291,279	27.2	362,909,329	24.9
- 日本	122,929,352	6.2	45,713,094	3.1
- 英国	94,653,308	4.8	90,343,959	6.2
- 意大利	86,087,473	4.3	77,950,031	5.4
- 中国	60,863,672	3.1	110,045,924	7.6
- 其他	639,261,734	32.3	427,443,891	29.4
	<u>1,543,086,818</u>	<u>77.9</u>	<u>1,114,406,228</u>	<u>76.6</u>
集体投资计划				
- 卢森堡	375,895,094	19.0	263,836,866	18.1
衍生性产品				
- 远期外汇合约	12,002,215	0.6	23,731,332	1.6
- 期货	1,641,658	0.1	2,131,853	0.2
- 利率掉期	4,599,593	0.2	-	-
	<u>18,243,466</u>	<u>0.9</u>	<u>25,863,185</u>	<u>1.8</u>
	<u>1,937,225,378</u>	<u>97.8</u>	<u>1,404,106,279</u>	<u>96.5</u>
负债				
衍生性产品				
- 远期外汇合约	(9,196,203)	(0.5)	(3,238,469)	(0.2)
- 期货	(2,346,076)	(0.1)	(156,332)	(0.0)
- 利率掉期	(3,827,856)	(0.2)	-	-
	<u>(15,370,135)</u>	<u>(0.8)</u>	<u>(3,394,801)</u>	<u>(0.2)</u>
总上市投资	<u>1,921,855,243</u>	<u>97.0</u>	<u>1,400,711,478</u>	<u>96.3</u>

* 比较数字已更新，以符合本年度之呈列或分类方式。

有关衍生性产品的风险亦请参阅附注 10。

投资管理主要通过本基金的修正久期定期监控本基金的利率风险敏感度。修正久期计量某项债券的价格相对于利率变动的敏感度。于二零二四年九月三十日，投资管理人估计本基金的修正久期为 8.96（二零二三年：5.65）。为了披露相关敏感度，采用的利率合理变动百分比为二十五个基点，不包括不大可能出现或“最恶劣”情况或“压力测试”下之变动，也不代表投资管理人对本基金未来回报的预测。若利率上升二十五个基点，其他变量保持稳定，则将致使本基金的资产净值减少约 44,362,599 美元（二零二三年：20,549,911 美元）。若利率下降二十五个基点，则将致使本基金的资产净值增加相同金额。

任何现金及现金等价物及保证金均以短期市场利率进行存放/借入。由于现行市场利率水平平稳且波动较低，投资管理人认为本基金不存在重大风险。

(iii) 汇兑风险

本基金持有以若干币种计价的资产及负债。香港财务报告准则第 7 号认为与非货币资产及负债相关的外汇承担属于市场价格风险，而非汇兑风险。但是，投资管理人监控所有以外币计价的资产及负债（包括货币及非货币资产及负债）的汇兑风险承担。

本基金订立了若干远期外汇合约，以对冲若干外汇承担以维持有限的非美元风险承担。年末未平仓远期外汇合约请参阅附注 10(a)。

下表概述于九月三十日本基金的汇兑风险承担、外币合理变动百分比以及对本基金资产净值的估计影响。

汇兑风险承担净值(注*)	美元等值	与美元比较之合理变动百分比(注**)	估计对资产净值的影响 美元
<u>2024</u>			
澳元	66,284,786	+7.5	4,971,359
加元	61,247,051	+0.1	61,247
人民币 (离岸)	469,629,941	+4.1	19,254,828
人民币 (在岸)	43,292,085	+4.1	1,774,975
欧元	(503,973)	+5.4	(27,215)
港元	3,744,896	+0.8	29,959
匈牙利福林	483,809	+3.1	14,998
日元	(795,496)	+4.3	(34,206)
韩元	2	+3.2	0
墨西哥比索	2,187,160	-11.3	(247,149)
纽元	29,285,839	+5.9	1,727,865
挪威克朗	945	+1.0	9
英镑	544,219	+9.9	53,878
土耳其里拉	31	-19.8	(6)
	<u>675,401,295</u>		<u>27,580,542</u>
<u>2023</u>			
澳元	52,447,491	+0.4	209,790
加元	46,642,971	+1.6	746,288
人民币 (离岸)	395,172,890	-2.1	(8,298,631)
人民币 (在岸)	107,224,540	-2.9	(3,109,512)
欧元	2,709,753	+8.1	219,490
港元	176,501	+0.2	353
日元	(2,218,764)	-3.0	66,563
韩元	2	+6.0	0
墨西哥比索	(1,033,483)	+15.7	(162,257)
纽元	18,934,116	+6.2	1,173,915
挪威克朗	935	+2.4	22
英镑	(825,021)	+9.3	(76,727)
土耳其里拉	39	-32.4	(13)
	<u>619,231,970</u>		<u>(9,230,719)</u>

假定影响本基金资产净值的其他变量保持不变，若外币呈反方向波动，则将导致本基金的资产净值以相同金额呈反向变动。

注：

* 资产及负债汇兑风险承担净值包括货币及非货币资产及负债。

** 合理变动百分比基于各货币于过去十二个月较本基金功能货币之实际历史变动，不包括不大可能出现或“最恶劣”情况或“压力测试”下之变动，也不代表投资管理人对本基金未来回报的预测。

(b) 信贷风险

信贷风险指交易对手无法于到期日支付全数金额的风险。

管理人会参考交易对手的违约历史及其信贷评级等因素进行信贷风险监控。由于过去 5 年内，本基金在分配应收款项、应收经纪款项或股息、利息及其他应收款项等应收款项未发生历史违约，故管理人认为该等应收款项不存在重大信贷风险。总体而言，由于该等工具违约风险较低，且本基金交易对手均有足够能力在短期内履行其合同义务，故管理人认为违约概率近乎零。因此，未对十二个月内的预期信贷损失确认损失准备金。

于二零二四年及二零二三年九月三十日，本基金的最高信贷风险承担为财务状况表中金融资产的账面价值。

所有投资及衍生性产品交易均由经核准的经纪按照货银交付原则进行结算。由于本基金的托管银行只会在收取款项后开始交付有关投资及衍生性产品，所以违约风险甚低。就购买而言，本基金的托管银行会在收到投资及衍生性产品后即时付款。若任何一方不能履行其责任，交易将告失效。

本基金主要投资债务证券，因此，本基金须承担信贷风险，即发行机构可能无法于到期时偿还本金及利息。本基金通过参考信贷评级机构提供的信贷评级及信贷展望（如有）以及内部信贷分析，持续管理并监控债务证券之信贷风险。

下表概述于九月三十日按照信贷评级的债务证券。

	2024 占资产净值百分比	2023 占资产净值百分比
标准普尔(AAA)/穆迪(Aaa)/惠誉(AAA)	31.5	28.9
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	9.8	12.2
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	5.8	5.0
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	10.8	6.0
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	3.3	0.1
标准普尔(B)/穆迪(B)/惠誉(B)	-	0.5
未评级	16.7	23.9
	77.9	76.6

于九月三十日，按照发行机构的信贷评级，下表概述上述未评级债务证券。

	2024 占资产净值百分比	2023 占资产净值百分比
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	4.1	6.9
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	10.4	12.1
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	1.4	3.3
未评级	0.8	1.6
	16.7	23.9

为监测无评级债务证券的信用质量，投资管理将依据内部研究为没有公开信用评级的债务证券划定内部专有评级。投资管理人审查发行的关键财务指标和债务证券的结构特征，以计算每支债务证券的隐含评级。

下表概述本基金于九月三十日存放金融资产的银行/经纪/托管机构的信贷评级。

	2024 交易对手风险承担 美元	2023 交易对手风险承担 美元
银行结余 标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	24,708,480	20,966,262
存放经纪之保证金及经纪持有/发行的衍生性产品		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	5,329,946	7,093,407
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	20,870,645	20,418,399
标准普尔(BBB)/穆迪(BBB)/惠誉(BBB)	3,700,001	-
托管机构的投资余额 标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	1,918,981,912	1,378,243,094

(c) 流动性风险

本基金须面对份额每日赎回的风险，而其大多数投资资产均在活跃市场交易，并可随时出售。管理人亦可将任何一个交易日之赎回份额总数限制为本基金已发行份额的百分之十或更高。

在投资限制和指南的规限下，本基金有能力订立借款安排。

下表概述本基金的金融负债，按九月三十日距约定到期日的尚余期间分为有关期限组别。下表所载金额乃约定未折现现金流量。

	2024		2023	
	1 个月以内 美元	1 至 12 个月 美元	1 个月以内 美元	1 至 12 个月 美元
透支经纪款项	-	-	2,469,355	-
应付经纪款项	45,130,988	-	2,997,810	-
赎回应付款项	18,399,384	-	1,552,490	-
应付收益分配	6,342,478	-	2,908,531	-
衍生性产品	9,009,175	6,360,960	2,541,385	853,416
其他应付款项	1,656,684	-	1,389,555	-
可赎回份额持有人应占净资产	1,980,473,153	-	1,454,860,952	-
总金融负债	2,061,011,862	6,360,960	1,468,720,078	853,416

投资管理人通过投资于预期一般在一个月内在变现到期的资产和借入短期银行借款以偿还金融负债来管理本基金的流动性风险。

(d) 受总净额结算协议及类似协议规限的抵销与金额

于二零二四年及二零二三年九月三十日，本基金受制于与若干衍生品交易对手的总净额结算协议。

若发生违约，本基金及其交易对手有权按净额结算该等交易。违约事件可能包括付款或交付失败、违反协议或破产。

下表按金融工具类型概述于九月三十日本基金受抵销和总净额结算协议及类似协议规限的金融资产及负债。

	财务状况表中列示的 经确认金融资产 总额 美元	受总净额结算协议及类似协议规 限的相关金额 金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	净额 美元
<u>2024</u>				
<u>资产</u>				
保证金	11,657,126	(2,850,937)	-	8,806,189
衍生性产品	12,005,570	(2,574,805)	-	9,430,765
	财务状况表中列示的 经确认金融负债 总额 美元	受总净额结算协议及类似协议规 限的相关金额 金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	净额 美元
<u>负债</u>				
衍生性产品	10,662,494	(2,574,805)	(2,850,937)	5,236,752
	财务状况表中列示的 经确认金融资产 总额 美元	受总净额结算协议及类似协议规 限的相关金额 金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	净额 美元
<u>2023</u>				
<u>资产</u>				
保证金	1,648,621	(1,648,621)	-	-
衍生性产品	24,075,147	(2,743,228)	(820,734)	20,511,185
	财务状况表中列示的 经确认金融负债 总额 美元	受总净额结算协议及类似协议规 限的相关金额 金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	净额 美元
<u>2023</u>				
<u>负债</u>				
透支经纪款项	2,469,355	(820,734)	(1,648,621)	-
衍生性产品	3,393,946	(2,743,228)	-	650,718

(II) 资本风险管理

本基金的资本是以可赎回份额持有人应占净资产呈现，基金的分配和赎回乃由份额持有人决定。本基金以保障为份额持有人提供回报和长期资本增值为目标。

为了维持资本结构，本基金的政策执行如下：

- 监测相对于流动性资产的分配和赎回活动。
- 为了保护份额持有人在特殊情况下的利益，管理人亦可将任何一个交易日之赎回份额总数限制为本基金已发行份额的百分之十或更高。
- 按照宪制性文件，监测基金的投资指引及限制条件，以透过分散投资维持足够的资金流通性。

(III) 公允价值估计

于二零二四年及二零二三年九月三十日，管理层认为资产及负债的账面价值与公允价值相若。

香港财务报告准则第 13 号要求本基金根据公允价值级次进行分类从而反映公允价值在计量时所使用的输入值的重要性。公允价值级次分层如下：

- 第一层次 - 相同资产或负债在活跃市场中的报价（未经调整）。
- 第二层次 - 直接（即按照价格）或间接（即源于价格）地使用除第一层次中的资产或负债的市场报价以外的其他可观察输入值。
- 第三层次 - 资产或负债使用了非基于可观察市场数据（即不可观察的输入值）。

下表概述本基金于九月三十日的投资及衍生性产品（按类别）按公允价值级次计量之公允价值：

上市投资	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总额 美元
<u>2024</u>				
资产				
债务证券	-	1,543,086,818	-	1,543,086,818
集体投资计划	375,895,094	-	-	375,895,094
衍生性产品	1,641,658	16,601,808	-	18,243,466
按公允价值透过损益列账的总金融资产	<u>377,536,752</u>	<u>1,559,688,626</u>	-	<u>1,937,225,378</u>

上市投资	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总额 美元
<u>2024</u>				
<u>负债</u>				
衍生性产品	2,346,076	13,024,059	-	15,370,135
按公平值透过损益列账的总金融负债	2,346,076	13,024,059	-	15,370,135
<u>2023</u>				
<u>资产</u>				
债务证券	-	1,114,406,228	-	1,114,406,228
集体投资计划	263,836,866	-	-	263,836,866
衍生性产品	2,131,853	23,731,332	-	25,863,185
按公平值透过损益列账的总金融资产	265,968,719	1,138,137,560	-	1,404,106,279
<u>负债</u>				
衍生性产品	156,332	3,238,469	-	3,394,801
按公平值透过损益列账的总金融负债	156,332	3,238,469	-	3,394,801

由于投资价值是基于活跃市场的报价，因此分类为第一层次，并包括活跃上市股票证券、集体投资计划及交易所交易衍生性产品。本基金没有调整这些工具的报价。

于非活跃市场交易的金融投资但以市场报价、交易商/经纪报价或其他报价来源作为可观察输入值，此等投资分类为第二层次。

被分类为第三层次的投资，由于其交易次数疏落，故此有显著的不可观察输入值。

截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，公平值层次之间并无转拨

于二零二四年及二零二三年九月三十日，以摊余成本计量的资产和负债，其账面价值为其公平值的合理约数。

5 投资及衍生性产品净收益/（亏损）

	2024 美元	2023 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益/亏损之变动	121,476,920	56,527,057
投资及衍生性产品销售之实现收益/（亏损）	66,288,051	(88,790,434)
	187,764,971	(32,263,377)

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。

本年末未结转未分配收入（二零二三年：无）。

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
<u>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)
纽元对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	纽元 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)

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 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)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	纽元 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)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	纽元 0.0328	4,273,656.024	(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)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 9 日	纽元 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)
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	(186,861)
加元对冲类别 (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)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	澳元 0.0364	10,691,831.741	(252,716)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	加元 0.0401	7,892,248.603	(230,359)
港元类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	港元 0.0445	148,530,145.175	(845,087)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	纽元 0.0435	5,342,503.609	(137,522)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	人民币 0.0485	66,481,183.980	(444,555)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	人民币 0.0355	46,984,460.750	(229,968)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	美元 0.0450	5,086,484.070	(228,892)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	人民币 0.0343	110,101,255.192	(520,681)
美元类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	美元 0.0440	46,495,862.146	(2,045,817)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	澳元 0.0359	9,898,250.060	(236,324)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	加元 0.0399	7,863,579.760	(230,170)
港元类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	港元 0.0443	159,276,047.297	(901,906)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	纽元 0.0437	5,286,017.563	(141,926)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	人民币 0.0485	66,017,680.550	(440,545)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	人民币 0.0293	46,169,863.830	(186,129)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	美元 0.0450	5,036,464.420	(226,641)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	人民币 0.0281	106,823,663.202	(413,011)
美元类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	美元 0.0440	48,137,112.213	(2,118,032)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	澳元 0.0364	10,858,718.013	(263,973)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	加元 0.0388	8,289,357.284	(235,047)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
港元类别 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	港元 0.0443	175,665,432.433	(996,744)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	纽元 0.0437	5,301,562.818	(141,173)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	人民币 0.0486	65,187,035.800	(433,934)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	人民币 0.0233	44,988,705.760	(143,577)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	美元 0.0450	4,985,357.290	(224,341)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	人民币 0.0224	112,902,759.290	(346,401)
美元类别 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	美元 0.0440	51,442,826.357	(2,263,484)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	澳元 0.0367	11,198,764.646	(268,379)
加元对冲类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	加元 0.0378	8,278,239.734	(226,514)
港元类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	港元 0.0443	185,440,910.277	(1,051,591)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	纽元 0.0437	4,617,924.817	(119,861)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	人民币 0.0488	63,715,863.700	(430,203)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	人民币 0.0268	43,722,009.910	(162,122)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	美元 0.0450	4,932,632.240	(221,968)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	人民币 0.0257	116,750,342.164	(415,142)
美元类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	美元 0.0440	56,706,047.019	(2,495,065)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	澳元 0.0366	12,022,055.283	(298,545)
加元对冲类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	加元 0.0361	8,717,545.135	(233,503)
港元类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	港元 0.0443	218,776,398.782	(1,242,474)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	纽元 0.0429	5,061,253.172	(135,846)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	人民币 0.0477	62,352,711.000	(419,673)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	人民币 0.0200	41,936,571.860	(118,348)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	美元 0.0450	4,863,311.220	(218,849)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	人民币 0.0193	125,753,980.140	(342,465)
美元类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	美元 0.0440	63,454,441.734	(2,791,995)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月10日	澳元 0.0378	11,127,268.490	(291,799)
加元对冲类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	加元 0.0363	9,540,133.582	(256,343)
港元类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	港元 0.0443	231,220,698.723	(1,318,710)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	纽元 0.0432	5,510,964.968	(151,474)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	人民币 0.0473	60,590,595.250	(409,498)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	人民币 0.0157	39,947,761.540	(89,614)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	美元 0.0450	4,799,860.240	(215,994)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	人民币 0.0152	130,046,241.882	(282,441)
美元类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	美元 0.0440	67,294,796.650	(2,960,970)
美元类别 (每半年派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	美元 0.6218	588,029.262	(365,635)
可赎回份额持有人之总收益分配					(52,246,642)

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)
加元对冲类别 (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)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
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)
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)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	澳元 0.0242	10,144,126.282	(162,231)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	加元 0.0301	6,944,434.064	(154,116)
港元类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	港元 0.0344	143,064,203.828	(626,939)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	纽元 0.0343	3,342,148.523	(70,805)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	人民币 0.0357	7,262,823.830	(37,451)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	人民币 0.0129	6,862,411.970	(12,787)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	美元 0.0348	1,971,547.520	(68,610)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	人民币 0.0125	80,200,862.185	(144,803)
美元类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	美元 0.0340	29,968,714.649	(1,018,936)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	澳元 0.0236	8,953,189.778	(136,740)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	加元 0.0287	7,254,893.621	(153,178)
港元类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	港元 0.0343	152,644,401.459	(668,822)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	纽元 0.0348	3,509,000.458	(73,188)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	人民币 0.0364	7,293,986.920	(37,259)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	人民币 0.0133	6,776,955.880	(12,649)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	美元 0.0348	1,964,357.320	(68,360)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	人民币 0.0129	82,161,497.874	(148,739)
美元类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	美元 0.0340	30,278,578.274	(1,029,471)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	澳元 0.0253	9,096,327.863	(153,191)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	加元 0.0287	7,690,277.635	(166,795)
港元类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	港元 0.0343	150,055,305.771	(656,777)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	纽元 0.0351	3,778,384.489	(81,250)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	人民币 0.0372	7,361,724.290	(37,644)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	人民币 0.0139	6,854,727.790	(13,097)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	美元 0.0348	1,962,188.590	(68,284)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	人民币 0.0135	87,814,481.272	(162,959)
美元类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	美元 0.0340	32,590,916.042	(1,108,090)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	澳元 0.0258	9,930,227.647	(172,640)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	加元 0.0304	7,990,250.382	(184,542)
港元类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	港元 0.0342	152,045,642.333	(666,773)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	纽元 0.0348	3,871,044.689	(83,838)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	人民币 0.0371	8,513,339.300	(44,214)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	人民币 0.0127	9,889,617.220	(17,582)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	美元 0.0348	2,045,127.810	(71,170)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	人民币 0.0122	88,404,674.661	(150,981)
美元类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	美元 0.0340	32,183,910.118	(1,094,252)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	澳元 0.0249	10,149,406.292	(163,674)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	加元 0.0305	7,989,423.713	(180,108)
港元类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	港元 0.0344	144,466,421.703	(633,742)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	纽元 0.0337	4,115,729.324	(82,589)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	人民币 0.0378	10,401,020.120	(54,016)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	人民币 0.0141	12,814,697.710	(24,825)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	美元 0.0348	2,188,192.430	(76,149)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	人民币 0.0135	87,251,727.333	(161,833)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
美元类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	美元 0.0340	31,770,319.010	(1,080,190)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	澳元 0.0249	10,250,082.410	(164,723)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月11日	加元 0.0304	8,156,098.967	(183,392)
港元类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	港元 0.0343	141,293,702.600	(618,803)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	纽元 0.0336	3,965,625.440	(80,060)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年9月28日	2023年10月11日	人民币 0.0377	13,925,168.040	(72,056)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年9月28日	2023年10月11日	人民币 0.0250	15,035,921.770	(51,594)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年9月28日	2023年10月11日	美元 0.0348	2,378,576.900	(82,774)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月11日	人民币 0.0241	89,648,326.980	(296,541)
美元类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月11日	美元 0.0340	34,006,356.138	(1,156,215)
美元类别 (每半年派息)	2023年9月29日	2023年10月11日	美元 0.4620	438,038.285	(202,373)
可赎回份额持有人的总收益分配					(26,927,444)

7 税项

澳大利亚税项

本基金对澳大利亚证券交易所上市的证券进行投资。处置澳大利亚境内投资所得的收益可能需要缴纳百分之三十的澳大利亚所得税。二零一二年九月，澳大利亚政府出台法规，豁免境外基金就二零一一年六月三十日或之前实现的收益缴纳所得税，前提是必须满足若干所有权条件和其他标准。二零一五年六月，澳大利亚政府进一步出台被称为“投资管理人制度”的法规（“法规”），豁免受境外管理的基金就二零一一年七月一日或之后实现的收益缴纳所得税，前提是必须满足若干所有权条件和其他标准。

管理人认为，于二零二四年及二零二三年九月三十日，在该等财务报表批准之日，本基金所投资的澳大利亚境内投资不太可能被征收资本收益税。此外，管理人认为本基金应符合法规相关标准并获得免税资格。因此，于二零二四年及二零二三年九月三十日并无税项拨备。该评估为管理人的最佳估计。

中国税项

在编制该等财务报表时，管理人就未来可能发生的情况，对税务风险做出若干假设并使用不同的估计。由此产生的会计估计可能与相关的实际结果并不一致。

根据《中华人民共和国企业所得税法》（“中国企业所得税法”）的一般税务规定，除非根据中国境内现行税收法律法规或相关税收协定获得豁免或减免，否则在中国境内无实际管理、设立或营业地点的中国境内非居民企业可能需要对出售证券所得的资本收益缴纳百分之十的中国境内预提所得税（“预提所得税”）。

此外，中国境内非居民企业须就债务证券所得的利息收入缴纳百分之十的预提所得税。根据中国企业所得税法，中国境内的债务证券发行人有义务就该等境外债务证券持有人的利息收入预扣百分之十的中国境内预提所得税。然而，根据中国企业所得税法，由国务院财政部门发行的政府债券和/或经国务院批准的地方政府债券所产生的利息收入可获豁免缴纳中国境内预提所得税。此外，银行存款利息收入以及从政府债券和地方政府债券所获得的利息亦可免征增值税（“增值税”）。

此外，根据财税二零一六年第三十六号通知（“三十六号通知”），自二零一六年五月一日起，将该等有价证券的买卖价差征收百分之六的增值税。此外，如果适用增值税，则根据增值税负债（“增值税相关税项”）征收地方附加税，包括城市维护建设税（当前税率为百分之一至百分之七）、教育费附加（当前税率为百分之三）和地方教育费附加（当前税率为百分之二）。根据新颁布的《城市维护建设税法》以及财政部和中国国家税务总局（“国税总局”）联合发布的二零二一年第二十八号公告，自二零二一年九月一日起，对境外单位向中国境内提供服务和销售无形资产所支付的增值税不征收城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。然而，实际上，获豁免的情况可能会因当地的实际情况而有所不同。

截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，本基金通过债券通投资中国境内的债务证券。管理人认为，对中国境内债务证券所得的收益征收中国境内税项的情况于本财务报表批准之日尚不明确，并已运用判断评估本基金是否可能就其收益缴纳中国所得税、其潜在负债金额及截至报告日征收该等税项的可能性。然而，因存在重大不确定性，管理人的估计可能与实际情况大相径庭。

根据国税总局和中国境内地方税务机关现行的非书面解释，税务机关认为海外投资者从中国境内债务证券投资中获得的资本收益不应视为来自中国境内的收入，因此不需要缴纳中国境内预提所得税。然而，中国境内税务机关并未颁布成文税务法规确认这一解释。实际上，中国境内税务机关并未严格执行对中国境内非税务居民企业从交易该等中国境内债务证券所实现的资本收益征收百分之十的中国境内预提所得税。管理人已考虑中国内地与香港特别行政区关于避免双重征税和防止偷漏税的协定对本基金的适用性，并评估截至本基金财务报表批准之日征收该等税项的可能性相当低。基于上述所有因素，管理人已重新评估拨备方法，并继续对本基金从中国境内债务证券所得的收益不作中国境内预提所得税税项拨备。

香港税项

由于本基金根据证券及期货条例第 104 条获认可为集体投资计划，根据税务条例第 26A(1A)条，本基金获豁免缴纳香港利得税，因此并无税项拨备。

其他司法管辖区

截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，已就若干收到的利息收入预扣或缴付海外税项。

8 与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之交易

以下是本基金与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之间于年度内订立的重大关联方交易摘要。受托人及管理人之关联人士是根据证监会所颁布的单位信托及互惠基金守则中的定义。所有该等交易均于正常业务过程中按一般商业条款订立。

(a) 以下为与管理人之关联人士之投资交易：

本基金投资于管理人之关联人士管理的各类基金（“相关基金”）。相关基金各管理人免除本基金应付相关基金的所有分配和赎回费用。

截至二零二四年九月三十日止年度，综合收益表中的股息收入为 15,778,183 美元（二零二三年：6,960,396 美元），为管理人之关联人士发行和管理的集体投资计划的投资分配。

公司名称	投资买卖 总价值 美元	占本基金本年度 之总交易价值百 分比	支付佣金 美元	占本基金本年度 支付之总佣金百 分比	平均佣金率 百分比
<u>2024</u>					
JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l.	93,767,150	0.54	-	-	-
J.P. Morgan Securities plc	212,193,127	1.23	-	-	-
<u>2023</u>					
JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l.	469,179,945	3.82	-	-	-
J.P. Morgan Securities plc	84,793,337	0.69	-	-	-

(b) 与管理人及其关联人士之年末结余：

	2024 美元	2023 美元
银行现金	24,708,480	20,966,262
应收款项	6	165
应付款项	(1,402,819)	(943,637)

于二零二四年九月三十日，本基金的投资结余 375,895,094 美元（二零二三年：263,836,866 美元），为管理人之关联人士发行和管理的集体投资计划的投资。

于二零二四年九月三十日，本基金的投资结余 1,918,981,912 美元（二零二三年：1,378,243,094 美元），为托管人摩根大通银行（管理人之关联人士）持有的投资。

(c) 截至二零二四年九月三十日止年度，扣除支付给代理机构的佣金后，管理人取得本基金分配及赎回收益为 230 美元（二零二三年：298 美元）。

(d) 支付给摩根基金（亚洲）有限公司美元 X 类别（累计）之管理费和其他基金份额类别之管理费分别按各类别资产净值的年率百分之零和百分之零点八计算。此管理费于每个交易日累计，并于每月月底支付。如果本基金投资管理或其关联人士管理的集体投资计划，在考虑针对该集体投资计划中归属于本基金的利益已征收的管理费以后，相应减少支付给管理人的管理费用。

(e) 本基金允许受托人及其关联人士、管理人及其关联人士认购/申购及赎回本基金份额。

于本年度内，若干管理人董事及其公司集团成员持有本基金份额，并有权获取本基金份额之交易利润，详情如下：

	年初	本年度内因董事任命而增加	总分配	总赎回	本年度内因董事离任而减少	年末	交易利润 美元
<u>2024</u>							
<u>管理人董事</u>							
- 港元类别 (每月派息)	234,487.147	-	5,926.213	(240,413.360)	-	-	5,267
- 美元类别 (每月派息)	20.606	-	1.176	-	-	21.782	10
<u>摩根资产管理 (亚太) 有限公司</u>							
- 美元类别 (每半年派息)	984.003	不适用	32.927	(701.477)	不适用	315.453	345
- 美元 X 类别 (累计)	-	不适用	8,497.225	-	不适用	8,497.225	-
<u>2023</u>							
<u>管理人董事</u>							
- 港元类别 (每月派息)	-	-	234,487.147	-	-	234,487.147	6,988
- 美元类别 (每月派息)	19.720	-	0.886	-	-	20.606	8
<u>摩根资产管理 (亚太) 有限公司</u>							
- 美元类别 (每半年派息)	1,657.679	不适用	49.832	(723.508)	不适用	984.003	848

(f) 受托人费用按本基金资产净值的年率百分之零点零一八计算。受托人费用于每个交易日累计，并于每月月底支付。

(g) 摩根基金 (亚洲) 有限公司，即登记代理人及管理人，根据本基金份额持有人的数量及发生交易的数量收取注册费。与受托人商定的收费比率为本基金资产净值的年率介乎百分之零点零一五至百分之零点五不等。基金注册登记机构费用于每季季末支付。

(h) 截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，除附注 8(d)和 8(g)披露的管理费用及基金注册登记机构费用外，已收/ (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：

	2024 美元	2023 美元
存款利息	585,516	410,848
其他收入	-	8,978
交易成本	(6,459)	(4,977)
托管费用及银行费用	(400,759)	(278,048)

9 非金钱收益/佣金共享安排

截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，投资管理及其关联人士未有就本基金通过经纪或交易商指示交易而签订任何非金钱收益/佣金共享安排。

10 衍生性产品

(a) 以下为截至九月三十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
<u>2024</u>				
未平仓合约：				
加元 20,000	美元 14,844	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	39
美元 149,068	澳元 235,999	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	1,086
美元 16,984	澳元 24,658	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	123
加元 316,409	美元 235,154	2024 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	937
美元 63,310	澳元 91,347	2024 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	63
加元 28,000	美元 20,791	2024 年 10 月 4 日	法国巴黎银行	64
美元 1,101	澳元 1,587	2024 年 10 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	0
加元 449,244	美元 333,197	2024 年 10 月 7 日	Citibank N.A., 伦敦	623
加元 264,348	美元 195,700	2024 年 10 月 7 日	巴克莱银行, 伦敦	4
加元 77,858,804	美元 57,843,939	2024 年 10 月 8 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	204,139
加元 10,438,400	美元 7,763,240	2024 年 10 月 8 日	Citibank N.A., 伦敦	35,568
离岸人民币 2,572,249	美元 15,293,633	2024 年 10 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	952
欧元 29,512,809	美元 33,016,974	2024 年 10 月 8 日	摩根士丹利国际股份有限公司	71,501
匈牙利福林 2,569,207,200	美元 7,247,834	2024 年 10 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	29,749
美元 39,437,047	欧元 35,750,499	2024 年 10 月 8 日	摩根士丹利国际股份有限公司	471,628
美元 9,990,456	澳元 15,033,141	2024 年 10 月 8 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	439,823
美元 10,199,736	澳元 15,220,577	2024 年 10 月 8 日	摩根士丹利国际股份有限公司	360,589
美元 10,271,892	澳元 15,293,633	2024 年 10 月 8 日	摩根士丹利国际股份有限公司	339,121
美元 29,086,828	欧元 26,202,350	2024 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	163,144
美元 65,298,735	加元 88,297,204	2024 年 10 月 8 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	68,737
美元 31,612,769	澳元 45,643,142	2024 年 10 月 8 日	摩根士丹利国际股份有限公司	55,310
美元 2,122,795	澳元 3,125,970	2024 年 10 月 8 日	摩根士丹利国际股份有限公司	46,062
美元 81,873,040	英镑 61,072,339	2024 年 10 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	46,036
美元 3,283,757	欧元 2,970,095	2024 年 10 月 8 日	摩根士丹利国际股份有限公司	31,793
美元 33,963,891	墨西哥比索 666,714,915	2024 年 10 月 8 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	16,611
美元 463,865	离岸人民币 3,294,366	2024 年 10 月 8 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	7,053
加元 264,383	美元 196,563	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	773
加元 179,858	美元 133,659	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	463
加元 211,523	美元 157,051	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	406
加元 79,613	美元 59,156	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	198
加元 317,632	美元 235,386	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	162
加元 5,023	美元 3,732	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	12
加元 3,594	美元 2,670	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	8
加元 1,482	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4
加元 5,792	美元 4,292	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
加元 14,612	美元 10,823	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2
加元 1,482	美元 1,099	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2
加元 8,623	美元 6,387	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1
加元 1,493	美元 1,107	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1
离岸人民币 18,516,666	美元 2,653,410	2024 年 10 月 21 日	美国道富银行	3,249
离岸人民币 2,654,073	美元 380,798	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	939
离岸人民币 3,939,108	美元 564,608	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	831
离岸人民币 1,733,446	美元 248,711	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	615
离岸人民币 2,492,135	美元 357,119	2024 年 10 月 21 日	美国道富银行	437
离岸人民币 984,232	美元 141,216	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	349
离岸人民币 625,056	美元 89,592	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	132
离岸人民币 256,364	美元 36,761	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	69
美元 2,975	美元 1,894	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1
美元 317,131,055	离岸人民币 2,237,039,289	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,040,683
美元 67,368,565	澳元 99,998,583	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	2,027,751
美元 146,670,323	离岸人民币 1,034,610,988	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,406,289
美元 26,244,905	美元 42,162,251	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	581,966
美元 50,742,994	离岸人民币 357,940,572	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	486,529
美元 4,960,094	离岸人民币 34,988,456	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	47,558
美元 734,994	澳元 1,093,350	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	23,761
美元 525,855	澳元 790,321	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	22,606
美元 699,683	澳元 1,038,343	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	20,899
美元 647,417	澳元 962,248	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	20,357

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 556,382	澳元 830,858	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	20,211
美元 1,337,738	离岸人民币 9,480,331	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	19,116
美元 1,454,925	离岸人民币 10,273,374	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	15,431
美元 1,407,275	离岸人民币 9,931,814	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	14,196
美元 489,441	纽元 790,941	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	13,816
美元 904,827	离岸人民币 6,411,776	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	12,845
美元 489,067	纽元 788,177	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	12,432
美元 850,499	离岸人民币 6,029,044	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	12,396
美元 877,521	离岸人民币 6,209,018	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	11,132
美元 295,203	纽元 480,466	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	10,506
美元 807,969	离岸人民币 5,714,513	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	9,909
美元 235,706	澳元 353,254	2024 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	9,442
美元 316,662	纽元 510,000	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	7,840
美元 615,102	澳元 897,541	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	7,767
美元 160,228	澳元 241,333	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	7,250
美元 239,795	澳元 355,729	2024 年 10 月 21 日	美国道富银行	7,072
美元 669,252	离岸人民币 4,723,235	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	6,751
美元 397,661	离岸人民币 2,825,178	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	6,687
美元 413,360	离岸人民币 2,930,244	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	6,025
美元 346,402	离岸人民币 2,461,542	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	5,902
美元 131,137	澳元 196,769	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	5,416
美元 183,643	澳元 272,403	2024 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	5,398
美元 544,124	离岸人民币 3,838,518	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	5,257
美元 396,458	离岸人民币 2,804,022	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	4,862
美元 303,609	离岸人民币 2,154,052	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4,686
美元 319,511	离岸人民币 2,263,024	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	4,380
美元 120,958	澳元 180,000	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3,957
美元 152,255	澳元 224,990	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3,882
美元 112,616	纽元 182,901	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3,760
美元 643,609	加元 874,123	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3,729
美元 103,206	纽元 167,809	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3,567
美元 254,647	离岸人民币 1,802,048	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3,267
美元 339,429	离岸人民币 2,394,068	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,217
美元 149,170	纽元 239,350	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3,123
美元 134,077	澳元 197,390	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2,906
美元 172,777	纽元 275,605	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,584
美元 234,990	离岸人民币 1,658,438	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,371
美元 77,906	纽元 125,869	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,182
美元 91,565	纽元 147,211	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2,102
美元 145,702	离岸人民币 1,032,544	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,079
美元 87,909	纽元 141,327	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2,014
美元 136,465	离岸人民币 967,377	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,989
美元 114,170	纽元 182,457	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,923
美元 259,611	纽元 411,002	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,901
美元 52,799	纽元 85,963	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,898
美元 335,830	加元 455,990	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,857
美元 85,144	纽元 136,596	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,769
美元 170,982	纽元 271,338	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,664
美元 282,166	加元 383,229	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,637
美元 128,960	离岸人民币 912,092	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	1,582
美元 57,607	纽元 93,016	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,576
美元 228,713	离岸人民币 1,608,441	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,492
美元 102,130	离岸人民币 723,315	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,393
美元 354,810	离岸人民币 2,488,438	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,343
美元 45,243	澳元 67,107	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,327
美元 61,826	澳元 90,973	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,307
美元 272,725	加元 370,000	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,281
美元 362,367	加元 490,922	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,189
美元 170,558	离岸人民币 1,200,000	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,189
美元 172,104	加元 234,000	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,186
美元 183,375	加元 249,191	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,166
美元 42,506	澳元 62,811	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,083
美元 431,842	加元 584,400	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	940
美元 22,228	澳元 33,383	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	939
美元 25,485	纽元 41,443	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	884
美元 185,106	加元 250,982	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	761
美元 145,761	加元 197,800	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	721

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 150,041	加元 203,572	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	716
美元 121,200	加元 164,552	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	660
美元 91,030	纽元 144,000	2024年10月21日	法国巴黎银行	594
美元 42,559	离岸人民币 301,178	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	546
美元 108,888	加元 147,769	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	543
美元 26,272	澳元 38,589	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	508
美元 10,567	纽元 17,277	2024年10月21日	法国巴黎银行	426
美元 27,485	离岸人民币 195,000	2024年10月21日	法国巴黎银行	424
美元 34,326	澳元 50,000	2024年10月21日	法国巴黎银行	373
美元 45,855	离岸人民币 322,624	2024年10月21日	法国巴黎银行	320
美元 62,651	加元 85,000	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	297
美元 27,642	离岸人民币 195,000	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	267
美元 56,640	离岸人民币 397,242	2024年10月21日	法国巴黎银行	214
美元 13,349	离岸人民币 94,626	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	195
美元 12,635	离岸人民币 89,360	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	155
美元 10,421	离岸人民币 73,806	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	143
美元 13,977	离岸人民币 98,645	2024年10月21日	法国巴黎银行	141
美元 7,459	离岸人民币 52,986	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	124
美元 9,077	离岸人民币 64,259	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	120
美元 15,481	离岸人民币 108,871	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	101
美元 2,255	纽元 3,646	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	64
美元 4,991	离岸人民币 35,318	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	63
美元 4,480	离岸人民币 31,695	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	56
美元 22,571	离岸人民币 158,037	2024年10月21日	法国巴黎银行	48
美元 2,062	澳元 3,032	2024年10月21日	法国巴黎银行	43
美元 23,037	澳元 33,230	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	23
美元 1,732	离岸人民币 12,251	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	22
美元 1,720	离岸人民币 12,144	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	18
美元 1,357	离岸人民币 9,569	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	13
美元 1,107	离岸人民币 7,805	2024年10月21日	法国巴黎银行	11
美元 1,106	离岸人民币 7,781	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	7
离岸人民币 655,835,167	美元 94,094,430	2024年11月8日	巴克莱银行, 伦敦	80,149
欧元 364,807,727	美元 408,935,234	2024年11月8日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,131,998
匈牙利福林 2,569,207,200	美元 7,226,622	2024年11月8日	HSBC Bank Plc, 伦敦	17,453
日元 15,616,144,549	美元 110,119,579	2024年11月8日	巴克莱银行, 伦敦	352,315
美元 3,569,246	离岸人民币 24,953,099	2024年11月8日	法国巴黎银行	7,792
美元 88,325	纽元 138,813	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	0
			未实现总收益	12,002,215

澳元 50,000	美元 34,316	2024年10月2日	法国巴黎银行	(372)
纽元 144,000	美元 91,027	2024年10月2日	法国巴黎银行	(593)
纽元 271,338	美元 170,978	2024年10月2日	法国巴黎银行	(1,661)
美元 196,484	加元 264,383	2024年10月2日	法国巴黎银行	(783)
纽元 411,002	美元 259,607	2024年10月3日	法国巴黎银行	(1,892)
美元 1,894	纽元 2,975	2024年10月3日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
美元 2,668	加元 3,594	2024年10月3日	法国巴黎银行	(8)
澳元 33,230	美元 23,031	2024年10月4日	Citibank N.A., 伦敦	(23)
美元 66,700	加元 90,103	2024年10月4日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
美元 1,099	加元 1,482	2024年10月4日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
纽元 138,813	美元 88,318	2024年10月7日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
澳元 373,661	美元 259,253	2024年10月8日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
澳元 94,316,463	美元 64,254,297	2024年10月8日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,184,256)
离岸人民币 158,037	美元 22,541	2024年10月8日	法国巴黎银行	(50)
离岸人民币 397,242	美元 56,569	2024年10月8日	法国巴黎银行	(216)
离岸人民币 2,488,438	美元 50,623,362	2024年10月8日	法国巴黎银行	(1,351)
离岸人民币 659,129,533	美元 93,387,780	2024年10月8日	美国道富银行	(832,442)
欧元 5,824,772	美元 6,478,465	2024年10月8日	巴克莱银行, 伦敦	(23,792)
欧元 394,393,090	美元 437,850,949	2024年10月8日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2,414,396)
英镑 239,074	美元 316,233	2024年10月8日	巴克莱银行, 伦敦	(4,447)
英镑 22,459,219	美元 29,714,369	2024年10月8日	摩根士丹利国际股份有限公司	(411,192)
英镑 38,374,046	美元 50,623,092	2024年10月8日	巴克莱银行, 伦敦	(849,743)
日元 166,122,517	美元 1,157,164	2024年10月8日	法国巴黎银行	(5,162)
日元 479,607,082	美元 3,310,535	2024年10月8日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(45,181)
日元 14,970,414,950	美元 103,710,437	2024年10月8日	巴克莱银行, 伦敦	(1,034,588)
墨西哥比索 666,714,915	美元 33,767,702	2024年10月8日	巴克莱银行, 伦敦	(212,800)

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 7,234,782	匈牙利福林 2,569,207,200	2024 年 10 月 8 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(16,697)
美元 109,654,904	日元 15,616,144,549	2024 年 10 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	(391,836)
美元 408,402,250	欧元 364,807,727	2024 年 10 月 8 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,163,372)
澳元 1,619	美元 1,110	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(14)
澳元 1,616	美元 1,098	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(23)
澳元 2,234	美元 1,519	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(31)
澳元 1,638	美元 1,104	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(32)
澳元 1,633	美元 1,099	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(35)
澳元 1,654	美元 1,100	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(47)
澳元 7,122	美元 4,889	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(53)
澳元 91,347	美元 63,328	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(65)
澳元 4,720	美元 3,206	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(70)
澳元 24,658	美元 16,989	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(123)
澳元 8,025	美元 5,431	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(138)
澳元 7,187	美元 4,829	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(158)
澳元 10,400	美元 7,012	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(206)
澳元 7,426	美元 4,930	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(223)
澳元 32,753	美元 22,446	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(284)
澳元 44,856	美元 30,499	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(630)
澳元 29,029	美元 19,328	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(817)
澳元 47,599	美元 32,211	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(821)
澳元 63,918	美元 43,440	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(918)
澳元 101,635	美元 69,194	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,338)
澳元 316,659	美元 216,489	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(3,264)
澳元 898,614	美元 616,907	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(6,706)
澳元 629,852	美元 427,829	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(9,272)
澳元 440,007	美元 295,790	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(9,563)
澳元 501,473	美元 337,111	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(10,897)
澳元 996,889	美元 677,485	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(14,329)
澳元 7,306,266	美元 5,019,785	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(50,567)
澳元 3,365,978	美元 2,268,131	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(67,767)
加元 1,496	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
加元 1,494	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
加元 1,497	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
加元 1,494	美元 1,100	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
加元 2,004	美元 1,477	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
加元 1,492	美元 1,098	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(7)
加元 2,006	美元 1,477	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(9)
加元 2,239	美元 1,647	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(11)
加元 4,173	美元 3,071	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(19)
加元 15,482	美元 11,441	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(25)
加元 5,057	美元 3,719	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(26)
加元 8,148	美元 6,001	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(33)
加元 31,078	美元 22,902	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(113)
加元 33,685	美元 24,829	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(117)
加元 45,201	美元 33,316	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(158)
加元 244,410	美元 180,751	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(248)
加元 122,131	美元 90,150	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(296)
加元 128,588	美元 94,677	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(550)
加元 272,984	美元 201,206	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(954)
加元 809,327	美元 598,052	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,300)
离岸人民币 8,728	美元 1,247	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 11,881	美元 1,697	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 7,722	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 7,722	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 7,722	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 7,722	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 7,780	美元 1,106	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
离岸人民币 7,780	美元 1,106	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
离岸人民币 7,757	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(8)
离岸人民币 9,271	美元 1,318	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(9)
离岸人民币 7,804	美元 1,106	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(11)
离岸人民币 8,841	美元 1,253	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(12)
离岸人民币 7,821	美元 1,108	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(12)
离岸人民币 7,821	美元 1,108	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(12)
离岸人民币 7,821	美元 1,108	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(12)
离岸人民币 7,821	美元 1,108	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(12)

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 7,834	美元 1,107	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,834	美元 1,107	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,808	美元 1,104	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,808	美元 1,104	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,808	美元 1,104	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,808	美元 1,104	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 16,105	美元 2,290	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(15)
离岸人民币 7,806	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 7,806	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 7,806	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 7,792	美元 1,100	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
离岸人民币 7,792	美元 1,100	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
离岸人民币 7,792	美元 1,100	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
离岸人民币 7,848	美元 1,106	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(17)
离岸人民币 8,657	美元 1,221	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(18)
离岸人民币 7,837	美元 1,104	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(18)
离岸人民币 19,869	美元 2,825	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(19)
离岸人民币 10,038	美元 1,417	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(19)
离岸人民币 7,829	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(19)
离岸人民币 15,347	美元 2,176	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(21)
离岸人民币 14,749	美元 2,089	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(22)
离岸人民币 9,726	美元 1,369	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(23)
离岸人民币 19,376	美元 2,747	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(27)
离岸人民币 16,436	美元 2,323	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(30)
离岸人民币 16,532	美元 2,327	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(39)
离岸人民币 45,245	美元 6,407	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(68)
离岸人民币 229,436	美元 32,767	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(70)
离岸人民币 261,095	美元 37,289	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(80)
离岸人民币 84,392	美元 11,973	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(106)
离岸人民币 106,192	美元 15,083	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(115)
离岸人民币 93,526	美元 13,257	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(129)
离岸人民币 94,430	美元 13,345	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(170)
离岸人民币 233,447	美元 33,197	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(215)
离岸人民币 138,662	美元 19,578	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(268)
离岸人民币 545,688	美元 77,805	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(296)
离岸人民币 1,059,801	美元 151,357	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(325)
离岸人民币 193,345	美元 27,324	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(348)
离岸人民币 367,086	美元 52,173	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(365)
离岸人民币 256,441	美元 36,316	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(387)
离岸人民币 296,309	美元 41,962	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(447)
离岸人民币 667,348	美元 94,899	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(613)
离岸人民币 357,448	美元 50,514	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(645)
离岸人民币 490,303	美元 69,513	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(660)
离岸人民币 372,703	美元 52,677	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(665)
离岸人民币 388,896	美元 54,909	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(751)
离岸人民币 321,627	美元 45,271	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(761)
离岸人民币 449,345	美元 63,406	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(905)
离岸人民币 3,003,612	美元 428,966	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(920)
离岸人民币 630,222	美元 89,248	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(951)
离岸人民币 534,479	美元 75,534	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(962)
离岸人民币 862,958	美元 122,426	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,083)
离岸人民币 493,387	美元 69,479	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,136)
离岸人民币 524,680	美元 73,952	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,142)
离岸人民币 1,246,466	美元 177,232	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,165)
离岸人民币 736,444	美元 103,981	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,421)
离岸人民币 1,561,413	美元 222,039	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,435)
离岸人民币 841,042	美元 118,858	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,515)
离岸人民币 2,922,398	美元 416,678	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,584)
离岸人民币 3,011,577	美元 429,393	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,633)
离岸人民币 1,078,400	美元 152,402	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,942)
离岸人民币 980,229	美元 138,313	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,981)
离岸人民币 1,087,404	美元 153,266	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,366)
离岸人民币 1,816,639	美元 257,504	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,499)
离岸人民币 1,158,251	美元 162,988	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,785)
离岸人民币 2,947,474	美元 418,918	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,933)
离岸人民币 2,148,984	美元 304,613	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,956)
离岸人民币 3,340,692	美元 475,006	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3,124)

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 2,542,654	美元 360,721	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3,191)
离岸人民币 3,622,374	美元 515,058	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3,387)
离岸人民币 3,303,279	美元 469,198	2024年10月21日	法国巴黎银行	(3,577)
离岸人民币 1,660,905	美元 233,802	2024年10月21日	法国巴黎银行	(3,911)
离岸人民币 2,039,496	美元 287,778	2024年10月21日	法国巴黎银行	(4,121)
离岸人民币 3,139,853	美元 445,157	2024年10月21日	法国巴黎银行	(4,228)
离岸人民币 2,426,567	美元 342,928	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(4,370)
离岸人民币 4,885,506	美元 693,097	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(6,131)
离岸人民币 4,526,988	美元 641,689	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(6,227)
离岸人民币 3,263,707	美元 460,571	2024年10月21日	法国巴黎银行	(6,540)
离岸人民币 3,895,172	美元 550,458	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(7,030)
离岸人民币 4,207,322	美元 594,571	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(7,594)
离岸人民币 4,155,351	美元 586,378	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(8,348)
离岸人民币 5,317,175	美元 751,435	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(9,575)
离岸人民币 8,978,055	美元 1,266,928	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(18,038)
纽元 4,024	美元 2,544	2024年10月21日	法国巴黎银行	(17)
纽元 2,249	美元 1,410	2024年10月21日	法国巴黎银行	(21)
纽元 1,758	美元 1,096	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(23)
纽元 1,765	美元 1,098	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(25)
纽元 1,778	美元 1,104	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(27)
纽元 1,778	美元 1,101	2024年10月21日	法国巴黎银行	(30)
纽元 1,784	美元 1,103	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(32)
纽元 4,025	美元 2,518	2024年10月21日	法国巴黎银行	(42)
纽元 2,426	美元 1,501	2024年10月21日	法国巴黎银行	(42)
纽元 1,789	美元 1,094	2024年10月21日	法国巴黎银行	(44)
纽元 4,961	美元 3,080	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(76)
纽元 5,050	美元 3,133	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(80)
纽元 4,778	美元 2,938	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(102)
纽元 26,899	美元 16,730	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(385)
纽元 46,242	美元 28,935	2024年10月21日	法国巴黎银行	(488)
纽元 35,476	美元 21,877	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	(695)
纽元 54,858	美元 33,947	2024年10月21日	法国巴黎银行	(958)
纽元 235,999	美元 149,068	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,093)
纽元 94,830	美元 58,986	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,352)
纽元 138,074	美元 86,443	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,410)
纽元 128,521	美元 79,582	2024年10月21日	法国巴黎银行	(2,193)
纽元 216,844	美元 134,185	2024年10月21日	法国巴黎银行	(3,788)
纽元 223,632	美元 138,336	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3,956)
美元 14,850	加元 20,000	2024年10月21日	法国巴黎银行	(38)
美元 20,798	加元 28,000	2024年10月21日	法国巴黎银行	(63)
美元 462,771	加元 624,776	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(89)
美元 253,198	加元 341,708	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	(143)
美元 333,295	加元 449,244	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(604)
美元 920,422	加元 1,242,012	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(641)
美元 353,727	离岸人民币 2,466,717	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(683)
美元 235,244	加元 316,409	2024年10月21日	法国巴黎银行	(925)
美元 369,082	离岸人民币 2,572,249	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	(934)
美元 490,966	加元 660,752	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,641)
美元 1,225,934	加元 1,651,980	2024年10月21日	法国巴黎银行	(2,549)
美元 54,024,071	加元 72,864,090	2024年10月21日	法国巴黎银行	(64,061)
澳元 45,643,142	美元 31,627,598	2024年11月8日	摩根士丹利国际股份有限公司	(54,904)
加元 88,297,204	美元 65,351,545	2024年11月8日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(67,505)
欧元 4,267,233	美元 4,769,674	2024年11月8日	高盛国际, 伦敦	(486)
英镑 61,072,339	美元 81,871,049	2024年11月8日	巴克莱银行, 伦敦	(44,852)
墨西哥比索 666,714,915	美元 33,801,829	2024年11月8日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(6,318)
美元 8,736,197	离岸人民币 60,872,774	2024年11月8日	Citibank N.A., 伦敦	(10,056)
澳元 1,587	美元 1,102	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
加元 90,103	美元 66,777	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
离岸人民币 446,847	美元 64,068	2024年11月21日	法国巴黎银行	(49)
离岸人民币 7,472,208	美元 1,071,304	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(880)
离岸人民币 16,465,642	美元 2,360,676	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,971)
美元 259,393	澳元 373,661	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
美元 195,922	加元 264,348	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	(5)
			未实现总亏损	(9,196,203)
			未实现净收益	2,806,012

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
<u>2023</u>				
未平仓合约:				
加元 180,000	美元 133,482	2023年10月3日	Citibank N.A., 伦敦	344
美元 28,912	澳元 45,330	2023年10月3日	法国巴黎银行	345
美元 1,096	纽元 1,845	2023年10月3日	Citibank N.A., 伦敦	13
美元 1,103	纽元 1,852	2023年10月3日	Citibank N.A., 伦敦	10
美元 1,106	澳元 1,725	2023年10月3日	Citibank N.A., 伦敦	7
美元 1,102	澳元 1,717	2023年10月3日	法国巴黎银行	6
澳元 51,163,299	美元 33,143,115	2023年10月4日	摩根士丹利国际股份有限公司	120,019
欧元 361,096,136	美元 393,491,154	2023年10月4日	HSBC Bank Plc, 伦敦	11,149,927
欧元 20,004,730	美元 21,358,898	2023年10月4日	渣打银行, 伦敦	177,190
欧元 3,591,648	美元 3,878,909	2023年10月4日	美国道富银行	75,946
欧元 3,031,028	美元 3,260,213	2023年10月4日	法国巴黎银行	50,855
欧元 544,986	美元 591,968	2023年10月4日	美国道富银行	14,918
英镑 54,942,346	美元 69,719,865	2023年10月4日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,659,215
英镑 16,570,092	美元 20,674,826	2023年10月4日	美国道富银行	449,968
英镑 13,082,363	美元 16,371,529	2023年10月4日	法国巴黎银行	403,668
英镑 2,768,128	美元 3,477,938	2023年10月4日	法国巴黎银行	99,260
英镑 1,951,284	美元 2,398,652	2023年10月4日	HSBC Bank Plc, 伦敦	16,986
日元 9,381,370,116	美元 64,616,689	2023年10月4日	巴克莱银行, 伦敦	1,729,384
墨西哥比索 370,596,168	美元 22,035,736	2023年10月4日	美国道富银行	717,941
美元 21,300,460	墨西哥比索 370,596,168	2023年10月4日	美国道富银行	17,335
美元 50,448	纽元 84,688	2023年10月4日	Citibank N.A., 伦敦	437
加元 350,000	美元 258,953	2023年10月5日	Citibank N.A., 伦敦	66
离岸人民币 136,494,011	美元 18,807,823	2023年10月10日	美林国际, 伦敦	69,649
离岸人民币 4,216,555	美元 581,110	2023年10月10日	巴克莱银行, 伦敦	2,253
美元 26,024,480	离岸人民币 189,911,141	2023年10月10日	巴克莱银行, 伦敦	46,906
美元 4,756,856	离岸人民币 34,880,000	2023年10月10日	美国道富银行	31,541
美元 8,511,790	离岸人民币 62,153,909	2023年10月10日	美国道富银行	20,825
美元 3,365,091	离岸人民币 24,581,693	2023年10月10日	美国道富银行	9,534
美元 2,804,440	离岸人民币 20,469,000	2023年10月10日	巴克莱银行, 伦敦	5,586
美元 3,675,358	离岸人民币 26,800,734	2023年10月10日	巴克莱银行, 伦敦	3,901
美元 1,371,875	离岸人民币 10,000,000	2023年10月10日	美国道富银行	945
美元 103,000	离岸人民币 753,044	2023年10月10日	法国巴黎银行	379
美元 1,961	离岸人民币 14,340	2023年10月10日	法国巴黎银行	7
美元 1,458	离岸人民币 10,657	2023年10月10日	法国巴黎银行	5
美元 1,896	离岸人民币 13,865	2023年10月11日	法国巴黎银行	7
美元 1,100	离岸人民币 8,042	2023年10月11日	法国巴黎银行	4
美元 1,998	离岸人民币 14,580	2023年10月12日	Citibank N.A., 伦敦	4
美元 1,102	离岸人民币 8,043	2023年10月12日	Citibank N.A., 伦敦	2
美元 2,227	离岸人民币 16,226	2023年10月13日	法国巴黎银行	1
美元 1,102	离岸人民币 8,028	2023年10月13日	法国巴黎银行	0
澳元 276,426	美元 179,778	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	1,251
澳元 110,042	美元 71,385	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	316
澳元 289,218	美元 187,057	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	268
澳元 251,871	美元 162,902	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	234
澳元 243,391	美元 157,372	2023年10月20日	法国巴黎银行	180
澳元 192,574	美元 124,414	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	43
澳元 14,876	美元 9,631	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	23
澳元 2,848	美元 1,852	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	13
澳元 1,693	美元 1,099	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	5
澳元 1,693	美元 1,099	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	5
澳元 1,708	美元 1,105	2023年10月20日	法国巴黎银行	1
加元 191,649	美元 142,409	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	620
加元 130,936	美元 97,396	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	525
加元 111,839	美元 82,964	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	222
加元 96,463	美元 71,526	2023年10月20日	法国巴黎银行	159
加元 81,390	美元 60,331	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	115
加元 66,176	美元 49,043	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	84
加元 248,116	美元 183,641	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	76
加元 398,223	美元 294,692	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	73
加元 167,902	美元 124,281	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	62
加元 43,966	美元 32,583	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	56
加元 1,822	美元 1,359	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	11
加元 1,484	美元 1,107	2023年10月20日	法国巴黎银行	9

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
加元 2,660	美元 1,972	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	4
加元 2,364	美元 1,752	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3
加元 1,754	美元 1,301	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3
加元 6,767	美元 5,008	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	2
加元 1,488	美元 1,103	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	2
加元 1,475	美元 1,093	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 18,338,844	美元 2,523,198	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	4,653
离岸人民币 2,796,171	美元 384,984	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	975
离岸人民币 699,564	美元 96,389	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	315
离岸人民币 1,224,550	美元 168,483	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	311
离岸人民币 290,800	美元 40,068	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	131
离岸人民币 266,328	美元 36,696	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	120
离岸人民币 326,529	美元 44,957	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	114
离岸人民币 2,107,910	美元 289,528	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	40
离岸人民币 79,941	美元 11,015	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	36
离岸人民币 828,100	美元 113,749	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	23
离岸人民币 24,619	美元 3,390	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	9
离岸人民币 30,392	美元 4,182	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	8
离岸人民币 7,996	美元 1,102	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	4
离岸人民币 13,447	美元 1,850	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 8,027	美元 1,105	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 8,027	美元 1,105	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 8,054	美元 1,108	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 8,039	美元 1,106	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 21,865	美元 3,003	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	1
离岸人民币 17,762	美元 2,440	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	0
离岸人民币 11,020	美元 1,514	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	0
离岸人民币 8,729	美元 1,199	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	0
离岸人民币 8,017	美元 1,101	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	0
离岸人民币 8,017	美元 1,101	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	0
美元 396,666,291	离岸人民币 2,903,275,954	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	2,051,992
美元 52,998,054	澳元 82,935,223	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	564,830
美元 96,250,840	离岸人民币 704,478,185	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	497,915
美元 19,832,772	纽元 33,723,010	2023 年 10 月 20 日	加拿大皇家银行	429,867
美元 48,086,354	加元 65,561,854	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	418,554
美元 14,673,655	离岸人民币 107,399,272	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	75,908
美元 826,109	澳元 1,293,713	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	9,422
美元 1,743,364	离岸人民币 12,760,010	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	9,019
美元 313,064	纽元 533,358	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	7,406
美元 1,474,190	离岸人民币 10,781,000	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	6,407
美元 404,643	澳元 633,719	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	4,638
美元 188,553	纽元 319,652	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3,512
美元 511,206	离岸人民币 3,745,517	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	3,181
美元 300,179	加元 410,034	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	3,178
美元 201,216	纽元 340,000	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3,075
美元 110,012	纽元 187,005	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	2,351
美元 642,293	离岸人民币 4,693,583	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	2,295
美元 190,587	加元 260,274	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	1,972
美元 201,942	加元 275,198	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	1,659
美元 85,776	纽元 144,859	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	1,264
美元 143,686	离岸人民币 1,052,762	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	894
美元 194,574	离岸人民币 1,422,951	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	846
美元 279,732	离岸人民币 2,042,733	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	804
美元 200,469	离岸人民币 1,465,246	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	759
美元 380,705	离岸人民币 2,777,323	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	716
美元 44,592	纽元 75,361	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	689
美元 166,136	离岸人民币 1,214,712	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	685
美元 232,425	离岸人民币 1,697,328	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	676
美元 467,615	离岸人民币 3,409,636	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	643
美元 212,250	离岸人民币 1,550,000	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	617
美元 161,582	离岸人民币 1,180,766	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	578
美元 377,626	离岸人民币 2,753,800	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	564
美元 194,841	离岸人民币 1,422,820	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	560
美元 106,597	澳元 165,911	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	554
美元 41,168	纽元 69,365	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	511
美元 153,952	离岸人民币 1,124,228	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	443
美元 268,570	离岸人民币 1,958,680	2023 年 10 月 20 日	美林国际, 伦敦	423
美元 159,157	加元 215,693	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	420

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 31,332	纽元 52,833	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	413
美元 327,344	离岸人民币 2,386,564	2023年10月20日	法国巴黎银行	412
美元 258,177	离岸人民币 1,882,510	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	355
美元 93,472	离岸人民币 683,052	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	334
美元 44,425	澳元 69,298	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	330
美元 211,869	离岸人民币 1,545,120	2023年10月20日	法国巴黎银行	328
美元 108,252	离岸人民币 790,534	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	315
美元 181,207	离岸人民币 1,321,503	2023年10月20日	法国巴黎银行	281
美元 30,825	纽元 51,763	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	277
美元 22,984	澳元 36,000	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	266
美元 40,613	离岸人民币 297,565	2023年10月20日	法国巴黎银行	253
美元 114,516	离岸人民币 835,634	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	244
美元 54,887	离岸人民币 401,399	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	239
美元 578,560	加元 782,333	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	237
美元 53,633	离岸人民币 392,010	2023年10月20日	法国巴黎银行	203
美元 67,101	离岸人民币 490,000	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	193
美元 99,671	离岸人民币 727,129	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	189
美元 94,078	离岸人民币 686,331	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	178
美元 443,720	离岸人民币 3,232,152	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	164
美元 73,083	离岸人民币 533,294	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	156
美元 105,030	离岸人民币 765,906	2023年10月20日	美林国际, 伦敦	155
美元 35,643	离岸人民币 260,607	2023年10月20日	法国巴黎银行	147
美元 18,783	纽元 31,505	2023年10月20日	法国巴黎银行	147
美元 109,866	离岸人民币 801,000	2023年10月20日	法国巴黎银行	138
美元 80,760	离岸人民币 588,863	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	111
美元 26,816	离岸人民币 196,000	2023年10月20日	法国巴黎银行	102
美元 258,167	离岸人民币 1,880,543	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	95
美元 56,384	离岸人民币 411,196	2023年10月20日	法国巴黎银行	87
美元 148,926	离岸人民币 1,085,011	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	82
美元 54,801	离岸人民币 399,540	2023年10月20日	法国巴黎银行	69
美元 30,835	澳元 47,851	2023年10月20日	法国巴黎银行	69
美元 89,591	澳元 138,818	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	63
美元 11,222	加元 15,251	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	61
美元 2,360	纽元 3,995	2023年10月20日	法国巴黎银行	41
美元 13,672	离岸人民币 99,844	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	40
美元 70,157	离岸人民币 511,134	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	39
美元 77,153	离岸人民币 562,000	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	28
美元 13,983	离岸人民币 102,010	2023年10月20日	法国巴黎银行	26
美元 41,637	离岸人民币 303,352	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	23
美元 14,174	离岸人民币 103,353	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	20
美元 8,875	离岸人民币 64,717	2023年10月20日	法国巴黎银行	13
美元 36,258	加元 49,017	2023年10月20日	法国巴黎银行	7
美元 3,118	离岸人民币 22,743	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	5
美元 5,578	离岸人民币 40,639	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	3
美元 1,890	离岸人民币 13,783	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	3
美元 1,108	离岸人民币 8,095	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	3
美元 1,577	离岸人民币 11,504	2023年10月20日	法国巴黎银行	2
美元 1,682	加元 2,274	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	0
澳元 51,163,299	美元 33,211,991	2023年11月3日	HSBC Bank Plc, 伦敦	150,983
加元 74,811,267	美元 55,728,867	2023年11月3日	法国巴黎银行	369,867
欧元 336,860,909	美元 357,763,735	2023年11月3日	法国巴黎银行	625,483
英镑 89,314,213	美元 109,549,867	2023年11月3日	HSBC Bank Plc, 伦敦	515,522
美元 3,726,309	离岸人民币 27,235,451	2023年11月3日	美国道富银行	16,071
美元 10,093,279	欧元 9,520,910	2023年11月3日	HSBC Bank Plc, 伦敦	743
日元 8,174,687,474	美元 55,164,882	2023年11月6日	法国巴黎银行	44,466
美元 11,782,841	日元 1,748,194,656	2023年11月6日	渣打银行, 伦敦	4,915
			未实现总收益	23,731,332
澳元 69,298	美元 44,399	2023年10月3日	Citibank N.A., 伦敦	(328)
纽元 31,505	美元 18,782	2023年10月3日	法国巴黎银行	(148)
美元 1,972	加元 2,660	2023年10月3日	法国巴黎银行	(4)
美元 294,623	加元 398,223	2023年10月3日	Citibank N.A., 伦敦	(75)
加元 74,811,267	美元 55,306,885	2023年10月4日	法国巴黎银行	(28,448)
美元 49,033	加元 66,176	2023年10月4日	Citibank N.A., 伦敦	(84)
美元 2,215,944	欧元 2,076,850	2023年10月4日	美国道富银行	(16,902)
美元 54,875,371	日元 8,174,687,474	2023年10月4日	法国巴黎银行	(76,972)

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 8,226,562	日元 1,206,682,642	2023 年 10 月 4 日	美国道富银行	(137,656)
美元 33,177,865	澳元 51,163,299	2023 年 10 月 4 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(154,769)
美元 109,530,262	英镑 89,314,213	2023 年 10 月 4 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(516,549)
美元 357,322,784	欧元 336,860,909	2023 年 10 月 4 日	法国巴黎银行	(642,663)
美元 52,944,750	欧元 49,330,768	2023 年 10 月 4 日	渣打银行, 伦敦	(711,606)
美元 1,752	加元 2,364	2023 年 10 月 5 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
纽元 41,121	美元 24,707	2023 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 64,717	美元 8,872	2023 年 10 月 10 日	法国巴黎银行	(13)
离岸人民币 196,000	美元 26,808	2023 年 10 月 10 日	法国巴黎银行	(99)
离岸人民币 765,906	美元 104,999	2023 年 10 月 10 日	美林国际, 伦敦	(147)
离岸人民币 401,399	美元 54,869	2023 年 10 月 10 日	Citibank N.A., 伦敦	(236)
离岸人民币 1,958,680	美元 268,490	2023 年 10 月 10 日	美林国际, 伦敦	(401)
离岸人民币 2,753,800	美元 377,500	2023 年 10 月 10 日	法国巴黎银行	(547)
离岸人民币 1,422,951	美元 194,509	2023 年 10 月 10 日	Citibank N.A., 伦敦	(836)
离岸人民币 10,781,000	美元 1,473,700	2023 年 10 月 10 日	Citibank N.A., 伦敦	(6,337)
离岸人民币 88,909,407	美元 12,193,335	2023 年 10 月 10 日	法国巴黎银行	(12,328)
离岸人民币 32,692,536	美元 4,451,052	2023 年 10 月 10 日	美国道富银行	(37,045)
离岸人民币 1,023,719,181	美元 140,470,263	2023 年 10 月 10 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(67,976)
美元 596,343	离岸人民币 4,339,492	2023 年 10 月 10 日	巴克莱银行, 伦敦	(609)
美元 15,976,936	离岸人民币 116,281,056	2023 年 10 月 10 日	美国道富银行	(13,637)
离岸人民币 392,010	美元 53,618	2023 年 10 月 11 日	法国巴黎银行	(200)
离岸人民币 1,465,246	美元 200,412	2023 年 10 月 11 日	法国巴黎银行	(748)
离岸人民币 260,607	美元 35,638	2023 年 10 月 12 日	法国巴黎银行	(141)
离岸人民币 1,214,712	美元 166,114	2023 年 10 月 12 日	法国巴黎银行	(657)
离岸人民币 533,294	美元 73,073	2023 年 10 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(147)
离岸人民币 835,634	美元 114,500	2023 年 10 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(231)
澳元 1,706	美元 1,100	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(2)
澳元 1,717	美元 1,103	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(6)
澳元 1,709	美元 1,098	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
澳元 1,725	美元 1,107	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
澳元 1,703	美元 1,092	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
澳元 1,726	美元 1,102	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
澳元 2,634	美元 1,682	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(19)
澳元 31,525	美元 20,255	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(105)
澳元 53,305	美元 34,272	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(154)
澳元 54,628	美元 35,051	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(230)
澳元 88,623	美元 56,938	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(299)
澳元 45,330	美元 28,928	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(348)
澳元 48,431	美元 30,924	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(355)
澳元 48,992	美元 31,278	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(363)
澳元 321,976	美元 207,460	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(485)
澳元 138,109	美元 88,604	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(592)
澳元 313,040	美元 200,352	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,822)
澳元 1,284,552	美元 827,727	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(1,888)
加元 1,573	美元 1,163	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(0)
加元 1,488	美元 1,101	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
加元 1,487	美元 1,100	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(0)
加元 3,720	美元 2,751	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
加元 2,874	美元 2,121	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
加元 1,494	美元 1,099	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
加元 1,496	美元 1,098	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(9)
加元 63,186	美元 46,736	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(10)
加元 2,059	美元 1,507	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(16)
加元 3,467	美元 2,538	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(26)
加元 212,215	美元 156,938	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(66)
加元 242,404	美元 177,875	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,463)
加元 238,137	美元 174,479	2023 年 10 月 20 日	加拿大皇家银行	(1,702)
加元 833,910	美元 613,924	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(3,031)
离岸人民币 22,416	美元 3,077	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(1)
离岸人民币 12,014	美元 1,649	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 8,298	美元 1,139	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 8,030	美元 1,102	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 8,030	美元 1,102	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 8,011	美元 1,099	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 7,998	美元 1,098	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 8,097	美元 1,110	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 8,097	美元 1,110	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 8,043	美元 1,102	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)

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 8,023	美元 1,100	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 8,005	美元 1,098	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 41,043	美元 5,633	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 14,812	美元 2,031	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 10,555	美元 1,447	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(3)
离岸人民币 8,041	美元 1,101	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 8,030	美元 1,099	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 20,191	美元 2,769	2023 年 10 月 20 日	加拿大皇家银行	(4)
离岸人民币 18,501	美元 2,537	2023 年 10 月 20 日	加拿大皇家银行	(4)
离岸人民币 15,688	美元 2,150	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 14,580	美元 1,998	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
离岸人民币 8,022	美元 1,098	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
离岸人民币 8,022	美元 1,098	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
离岸人民币 8,022	美元 1,098	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
离岸人民币 8,022	美元 1,098	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
离岸人民币 8,022	美元 1,098	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
离岸人民币 25,943	美元 3,558	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(5)
离岸人民币 20,589	美元 2,823	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(5)
离岸人民币 8,042	美元 1,100	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(5)
离岸人民币 8,026	美元 1,097	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
离岸人民币 8,026	美元 1,097	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
离岸人民币 8,026	美元 1,097	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
离岸人民币 15,409	美元 2,110	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
离岸人民币 10,657	美元 1,458	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(6)
离岸人民币 8,052	美元 1,099	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(7)
离岸人民币 8,052	美元 1,099	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(7)
离岸人民币 42,737	美元 5,861	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
离岸人民币 41,781	美元 5,730	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(8)
离岸人民币 40,148	美元 5,505	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(8)
离岸人民币 35,337	美元 4,845	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	(8)
离岸人民币 19,477	美元 2,667	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
离岸人民币 14,340	美元 1,962	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(8)
离岸人民币 13,865	美元 1,896	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(8)
离岸人民币 50,149	美元 6,878	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(9)
离岸人民币 34,485	美元 4,727	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(9)
离岸人民币 41,004	美元 5,619	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	(12)
离岸人民币 30,198	美元 4,135	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
离岸人民币 29,966	美元 4,103	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(13)
离岸人民币 67,771	美元 9,293	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 28,133	美元 3,849	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(14)
离岸人民币 36,863	美元 5,048	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(15)
离岸人民币 65,843	美元 9,023	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(20)
离岸人民币 253,059	美元 34,731	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(23)
离岸人民币 57,911	美元 7,930	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(24)
离岸人民币 27,843	美元 3,799	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(24)
离岸人民币 142,963	美元 19,608	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(26)
离岸人民币 29,617	美元 4,042	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(26)
离岸人民币 138,589	美元 19,005	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(28)
离岸人民币 186,192	美元 25,533	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(37)
离岸人民币 180,509	美元 24,753	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(37)
离岸人民币 203,089	美元 27,850	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(41)
离岸人民币 240,410	美元 32,972	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(45)
离岸人民币 215,942	美元 29,608	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	(48)
离岸人民币 80,680	美元 11,031	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(49)
离岸人民币 622,288	美元 85,406	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(55)
离岸人民币 183,842	美元 25,192	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(55)
离岸人民币 184,690	美元 25,267	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(97)
离岸人民币 197,507	美元 27,024	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(100)
离岸人民币 172,000	美元 23,519	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(102)
离岸人民币 249,660	美元 34,181	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(106)
离岸人民币 351,633	美元 48,185	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	(107)
离岸人民币 123,681	美元 16,877	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(108)
离岸人民币 1,844,844	美元 253,218	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(142)
离岸人民币 737,633	美元 101,153	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(149)
离岸人民币 847,909	美元 116,267	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(179)
离岸人民币 2,138,373	美元 293,481	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(191)

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 737,759	美元 101,125	2023年10月20日	法国巴黎银行	(195)
离岸人民币 543,768	美元 74,457	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(221)
离岸人民币 1,177,184	美元 161,429	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(238)
离岸人民币 438,799	美元 59,992	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(270)
离岸人民币 1,224,723	美元 167,920	2023年10月20日	法国巴黎银行	(276)
离岸人民币 943,659	美元 129,313	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(284)
离岸人民币 585,129	美元 80,065	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(293)
离岸人民币 1,415,048	美元 194,038	2023年10月20日	美国道富银行	(296)
离岸人民币 1,794,541	美元 246,055	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(396)
离岸人民币 753,044	美元 103,022	2023年10月20日	法国巴黎银行	(397)
离岸人民币 746,575	美元 102,100	2023年10月20日	法国巴黎银行	(430)
离岸人民币 1,096,675	美元 150,131	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(480)
离岸人民币 2,556,043	美元 350,517	2023年10月20日	法国巴黎银行	(514)
离岸人民币 1,317,137	美元 180,353	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(535)
离岸人民币 1,305,469	美元 178,743	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(542)
离岸人民币 3,154,030	美元 432,591	2023年10月20日	法国巴黎银行	(564)
离岸人民币 1,168,333	美元 159,858	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(594)
离岸人民币 1,419,764	美元 194,378	2023年10月20日	法国巴黎银行	(604)
离岸人民币 1,999,303	美元 273,966	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(606)
离岸人民币 713,772	美元 97,401	2023年10月20日	法国巴黎银行	(624)
离岸人民币 9,093,897	美元 1,248,200	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(701)
离岸人民币 2,632,973	美元 360,805	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(792)
离岸人民币 2,036,783	美元 278,874	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(845)
离岸人民币 3,334,437	美元 457,022	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(910)
离岸人民币 1,613,151	美元 220,580	2023年10月20日	法国巴黎银行	(960)
离岸人民币 7,363,609	美元 1,009,647	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(1,626)
离岸人民币 7,943,194	美元 1,089,077	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1,793)
离岸人民币 10,009,782	美元 1,372,827	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,855)
离岸人民币 9,418,082	美元 1,291,526	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1,896)
离岸人民币 4,488,450	美元 614,452	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(1,965)
离岸人民币 3,909,290	美元 534,475	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2,404)
离岸人民币 4,734,865	美元 647,851	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2,407)
离岸人民币 5,817,334	美元 796,443	2023年10月20日	法国巴黎银行	(2,474)
离岸人民币 8,174,722	美元 1,120,189	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(2,477)
离岸人民币 5,804,949	美元 794,306	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2,911)
离岸人民币 6,893,755	美元 943,119	2023年10月20日	法国巴黎银行	(3,628)
纽元 1,864	美元 1,115	2023年10月20日	法国巴黎银行	(5)
纽元 1,852	美元 1,103	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(10)
纽元 1,845	美元 1,096	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
纽元 1,841	美元 1,092	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
纽元 1,859	美元 1,097	2023年10月20日	法国巴黎银行	(20)
纽元 2,220	美元 1,309	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(24)
纽元 1,854	美元 1,089	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(24)
纽元 3,165	美元 1,872	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(30)
纽元 3,366	美元 1,987	2023年10月20日	法国巴黎银行	(36)
纽元 20,968	美元 12,490	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(108)
纽元 51,826	美元 30,894	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(246)
纽元 36,633	美元 21,741	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(270)
纽元 84,688	美元 50,448	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(437)
纽元 64,632	美元 38,372	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(462)
纽元 94,090	美元 56,033	2023年10月20日	美林国际, 伦敦	(502)
纽元 168,862	美元 100,868	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(594)
纽元 86,371	美元 50,961	2023年10月20日	美国道富银行	(936)
纽元 137,034	美元 81,327	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,010)
纽元 128,474	美元 75,889	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1,305)
纽元 151,599	美元 89,717	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,372)
纽元 124,484	美元 73,300	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,497)
纽元 203,968	美元 120,313	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2,243)
纽元 534,507	美元 316,487	2023年10月20日	法国巴黎银行	(4,674)
纽元 1,626,602	美元 960,027	2023年10月20日	法国巴黎银行	(17,325)
美元 4,096	离岸人民币 29,811	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2)
美元 12,588	离岸人民币 91,637	2023年10月20日	法国巴黎银行	(3)
美元 41,150	离岸人民币 299,563	2023年10月20日	法国巴黎银行	(10)
美元 5,215	离岸人民币 37,813	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(22)
美元 120,644	加元 163,000	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(51)
美元 27,942	离岸人民币 203,051	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(57)
美元 259,008	加元 350,000	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(66)
美元 221,351	离岸人民币 1,611,035	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(101)

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 85,524	加元 115,459	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(104)
美元 351,970	离岸人民币 2,562,110	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(105)
美元 58,490	离岸人民币 425,032	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(118)
美元 451,118	离岸人民币 3,283,845	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(135)
美元 53,063	离岸人民币 385,324	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(145)
美元 102,798	加元 138,633	2023年10月20日	法国巴黎银行	(233)
美元 133,514	加元 180,000	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(344)
美元 191,143	离岸人民币 1,389,000	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(387)
美元 911,480	离岸人民币 6,633,923	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(418)
美元 237,488	澳元 366,829	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(575)
美元 211,250	离岸人民币 1,534,018	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(578)
美元 70,870	加元 95,000	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(585)
美元 139,793	加元 188,069	2023年10月20日	法国巴黎银行	(653)
美元 294,498	离岸人民币 2,137,148	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(995)
美元 540,460	离岸人民币 3,927,412	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,093)
美元 476,555	离岸人民币 3,458,320	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,610)
美元 201,260	加元 269,842	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1,622)
美元 402,214	澳元 620,019	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,781)
美元 1,146,999	离岸人民币 8,323,673	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(3,876)
美元 1,194,899	离岸人民币 8,664,159	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(5,016)
美元 2,142,717	离岸人民币 15,559,588	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(5,858)
离岸人民币 6,580,089	美元 902,232	2023年11月3日	加拿大皇家银行	(1,928)
离岸人民币 40,019,306	美元 5,486,860	2023年11月3日	加拿大皇家银行	(12,130)
离岸人民币 796,614,667	美元 109,049,709	2023年11月3日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(411,860)
欧元 14,286,666	美元 15,080,722	2023年11月3日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(65,930)
墨西哥比索 370,596,168	美元 21,193,721	2023年11月3日	美国道富银行	(14,073)
美元 27,559,201	英镑 22,521,954	2023年11月3日	美国道富银行	(64,512)
美元 15,752,250	墨西哥比索 273,269,638	2023年11月3日	高盛国际, 伦敦	(114,079)
澳元 732,623	美元 472,123	2023年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,548)
加元 662,592	美元 488,936	2023年11月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,494)
离岸人民币 8,028	美元 1,104	2023年11月21日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 16,226	美元 2,230	2023年11月21日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 276,032	美元 37,944	2023年11月21日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 1,058,966	美元 145,340	2023年11月21日	美林国际, 伦敦	(287)
离岸人民币 6,871,183	美元 943,052	2023年11月21日	美林国际, 伦敦	(1,859)
离岸人民币 25,639,120	美元 3,518,902	2023年11月21日	美林国际, 伦敦	(6,937)
纽元 374,421	美元 224,546	2023年11月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(429)
美元 24,709	纽元 41,121	2023年11月21日	法国巴黎银行	(1)
			未实现总亏损	(3,238,469)
			未实现净收益	20,492,863

(b) 以下为于九月三十日之未平仓期货合约：

	长仓／（短仓） 的合约数目	合约金额 美元	交割日期	标的资产	交易对手	未实现收益／（亏损） 美元
<u>2024</u>						
3 Month Euro Euribor 15/09/2025	1,066	291,939,791	2025 年 9 月	3 个月欧元银行同业 拆借利率	Citigroup Global Markets Ltd	98,603
3 Month Euro Euribor 16/06/2025	1,066	291,568,007	2025 年 6 月	3 个月欧元银行同业 拆借利率	Citigroup Global Markets Ltd	148,714
3 Month SOFR Fut 15/06/2027	(797)	(193,133,025)	2027 年 6 月	3 个月担保隔夜融资 利率	Citigroup Global Markets Ltd	109,588
3 Month SOFR Fut 16/03/2027	(797)	(193,192,800)	2027 年 3 月	3 个月担保隔夜融资 利率	Citigroup Global Markets Ltd	119,550
Euro-Bund Future 06/12/2024	(185)	(27,856,831)	2024 年 12 月	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 10 年 期债务工具	Citigroup Global Markets Ltd	4,129
Euro-BUXL 30Y Bnd 06/12/2024	(63)	(9,582,004)	2024 年 12 月	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	Citigroup Global Markets Ltd	90,199
US 10Yr Ultra Fut 19/12/2024	(619)	(73,225,766)	2024 年 12 月	10 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	308,438
US Ultra Bond CBT 19/12/2024	(398)	(52,971,313)	2024 年 12 月	30 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	762,437
					未实现总收益	<u>1,641,658</u>
3 Month Euro Euribor 14/12/2026	(1,066)	(291,582,878)	2026 年 12 月	3 个月欧元银行同业 拆借利率	Citigroup Global Markets Ltd	(89,228)
3 Month Euro Euribor 15/03/2027	(1,066)	(291,449,036)	2027 年 3 月	3 个月欧元银行同业 拆借利率	Citigroup Global Markets Ltd	(88,614)
3 Month SOFR Fut 16/09/2025	797	192,854,075	2025 年 9 月	3 个月担保隔夜融资 利率	Citigroup Global Markets Ltd	(308,837)
3 Month SOFR Fut 16/12/2025	797	193,142,988	2025 年 12 月	3 个月担保隔夜融资 利率	Citigroup Global Markets Ltd	(268,988)
Euro-BOBL Future 06/12/2024	(63)	(8,440,854)	2024 年 12 月	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 5 年期 债务工具	Citigroup Global Markets Ltd	(74,530)

	长仓／(短仓) 的合约数目	合约金额 美元	交割日期	标的资产	交易对手	未实现收益／(亏损) 美元
Euro-OAT Future 06/12/2024	197	27,887,277	2024年12月	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5年期债务工具	Citigroup Global Markets Ltd	(219,862)
Long Gilt Future 27/12/2024	237	31,290,892	2024年12月	10年期英国国债	Citigroup Global Markets Ltd	(209,814)
US 2Yr Note (CBT) 31/12/2024	916	190,749,844	2024年12月	2年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	(367,914)
US 5Yr Note (CBT) 31/12/2024	1,026	112,739,766	2024年12月	5年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	(718,289)
					未实现总亏损	(2,346,076)
					未实现净亏损	(704,418)
<u>2023</u>						
Euro-BTP Future 07/12/2023	(302)	(35,085,345)	2023年12月	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10年期债务工具	Citigroup Global Markets Ltd	746,705
US Ultra Bond (CBT) 19/12/2023	(141)	(16,734,938)	2023年12月	30年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	1,314,164
US 10Yr Ultra Fut 19/12/2023	163	18,184,688	2023年12月	10年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	70,984
					未实现总收益	2,131,853
Aust 10Yr Bond Future 15/12/2023	(263)	(19,006,282)	2023年12月	10年期澳大利亚国债	Citigroup Global Markets Ltd	(16,535)
Euro-Bund Future 07/12/2023	(27)	(3,677,335)	2023年12月	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10年期债务工具	Citigroup Global Markets Ltd	(12,578)
US 2Yr Note (CBT) 29/12/2023	138	27,974,109	2023年12月	2年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	(127,219)
					未实现总亏损	(156,332)
					未实现净收益	1,975,521

(c) 以下为于九月三十日之未平仓利率掉期合约：

	标的资产	交易对手	公平值 美元
<u>2024</u>			
(D) INTEREST RATE SWAP~619~ 14 1,000,000,000.00 USD 19/08/2024 18/09/2026	USD/SOFR/1D/Reuters	Citadel Securities Llc	3,700,001
(D) INTEREST RATE SWAP~619~ 15 112,000,000.00 USD 12/09/2024 18/12/2034	USD/SOFR/1D/Reuters	Citibank N.A., 伦敦	899,592
		金融资产总额	<u>4,599,593</u>
(D) INTEREST RATE SWAP~619~ 13 1,000,000,000.00 USD 19/08/2024 18/09/2025	USD/SOFR/1D/Reuters	Citadel Securities Llc	(2,143,804)
(D) INTEREST RATE SWAP~619~ 16 1,320,000,000.00 CNY 12/09/2024 18/12/2029	CNY/REPO7/1W/Reuters	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,427,451)
(D) INTEREST RATE SWAP~619~ 17 230,000,000.00 CNY 27/09/2024 18/12/2029	CNY/REPO7/1W/Reuters	Citibank N.A., 伦敦	(256,601)
		金融负债总额	<u>(3,827,856)</u>
		金融资产净额	<u>771,737</u>

2023

无

独立核数师报告

致摩根国际债券基金（“贵基金”）份额持有人

就财务报表审计作出的报告

意见

我们已审计的内容

摩根国际债券基金列载于第十页至第四十七页的财务报表，包括：

- 于二零二四年九月三十日的财务状况表；
- 截至该日止年度的综合收益表；
- 截至该日止年度的可赎回份额持有人应占净资产变动表；
- 截至该日止年度的现金流量表；及
- 财务报表附注，包括重要会计政策信息及其他解释信息。

我们的意见

我们认为，该等财务报表已根据香港会计师公会颁布的《香港财务报告准则》真实而中肯地反映了贵基金于二零二四年九月三十日的财务状况及其截至该日止年度的财务交易及现金流量。

意见的基础

我们已根据香港会计师公会颁布的《香港审计准则》进行审计。我们在该等准则下承担的责任已在本报告“核数师就审计财务报表承担的责任”部分中作进一步阐述。

我们相信，我们所获得的审计凭证能充足及适当地为我们的审计意见提供基础。

独立性

根据香港会计师公会颁布的《专业会计师道德守则》（“守则”），我们独立于贵基金，并已履行守则中的其他专业道德责任。

其他信息

贵基金受托人及管理人（“管理层”）须对其他信息负责。其他信息包括年报内的所有信息，但不包括财务报表及我们的核数师报告。

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

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

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

管理层就财务报表需承担的责任

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

在拟备财务报表时，贵基金管理层负责评估贵基金持续经营的能力，并在适用情况下披露与持续经营有关的事项，以及使用持续经营为会计基础，除非管理层有意将贵基金清盘或停止经营或别无其他实际的替代方案。

此外，贵基金管理层负责确保财务报表已遵照一九七九年四月三十日订立的信托契约（经修订）（“信托契约”）以及香港证券及期货事务监察委员会颁布的单位信托及互惠基金守则（“证监会守则”）附录 E 的相关披露条文适当地拟备。

核数师就审计财务报表承担的责任

我们的目标，是对财务报表整体是否不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述取得合理保证，并出具包括我们意见的核数师报告。我们仅向阁下（作为整体）报告我们的意见，除此之外本报告别无其他目的。我们不会就本报告的内容向任何其他人士负责或承担任何责任。合理保证是高水平的保证，但不能保证按照《香港审计准则》进行的审计，在某一重大错误陈述存在时总能发现。错误陈述可以由欺诈或错误所引起，如果合理预期它们单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依赖财务报表所作出的经济决定，则有关的错误陈述可以被视作重大。此外，我们必须评估贵基金的财务报表在所有重大方面是否已根据信托契约及证监会守则附录 E 的相关披露条文适当地拟备。

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

- 识别和评估由于欺诈或错误而导致财务报表存在重大错误陈述的风险，设计及执行审计程序以应对这些风险，以及获取充足和适当的审计凭证，作为我们意见的基础。由于欺诈可能涉及串谋、伪造、蓄意遗漏、虚假陈述，或凌驾于内部控制之上，因此未能发现因欺诈而导致的重大错误陈述的风险高于未能发现因错误而导致的重大错误陈述的风险。
- 了解与审计相关的内部控制，以设计适当的审计程序，但目的并非对贵基金内部控制的有效性发表意见。
- 评价管理层所采用会计政策的恰当性及作出会计估计及相关披露的合理性。

独立核数师报告 (续)

致摩根国际债券基金 (“贵基金”) 份额持有人

核数师就审计财务报表承担的责任 (续)

- 对管理层采用持续经营会计基础的恰当性作出结论。根据所获取的审计凭证，确定是否存在与事项或情况有关的重大不确定性，从而可能导致对贵基金的持续经营能力产生重大疑虑。如果我们认为存在重大不确定性，则有必要在核数师报告中提请使用者注意财务报表中的相关披露。假若有关的披露不足，则我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于核数师报告日止所取得的审计凭证。然而，未来事项或情况可能导致贵基金不能持续经营。
- 评价财务报表的整体列报方式、结构和内容，包括披露，以及财务报表是否中肯反映交易和事项。

除其他事项外，我们与管理层沟通了计划的审计范围、时间安排、重大审计发现等，包括我们在审计中识别出的内部控制的任何重大缺陷。

根据信托契约与证监会守则附录 E 的相关披露条文就相关事项作出的报告

我们认为，财务报表在各重大方面已根据信托契约及证监会守则附录 E 的相关披露条文适当地拟备。

罗兵咸永道会计师事务所
执业会计师

香港，二零二五年一月二十四日

管理人及受托人的责任声明

管理人的责任

基金管理人务必遵照香港证券及期货事务监察委员会所颁布的单位信托及互惠基金守则和信托契约编制各年度会计期间的财务报表，该等财务报表真实而中肯地反映本基金于该期末的财务状况及截至该日止年度的财务交易。编制该等财务报表时，管理人务必：

- 选择并贯彻地应用适当的会计政策；
- 作出审慎和合理的判断；及
- 按持续营运的基准编制财务报表，除非该假设不恰当。

管理人亦务必遵照信托契约，采取合理措施预防和监测欺诈及其他不法行为。

受托人的责任

基金受托人务必：

- 确保管理人遵照信托契约管理本基金且确保投资及借款能力符合要求；
- 确保已保留充分的会计记录及其他记录；
- 保护本基金的财产及附带权利；及
- 就每一个会计年度，向份额持有人报告关于管理人管理本基金的行为操守。

受托人对份额持有人的报告

本受托人谨确认管理人于截至二零二四年九月三十日止财政年度在各个重要方面均依照一九七九年四月三十日所订立之信托契约（经修订）之条款管理本基金。

东亚银行信托有限公司，受托人

二零二五年一月二十四日

业绩记录 (未经审计)

资产净值

财务期结算日	本基金资产净值	每份额资产净值
30/9/24 - 澳元对冲类别 (每月派息) - 加元对冲类别 (每月派息) - 港元类别 (每月派息) - 纽元对冲类别 (每月派息) - PRC 人民币份额 (累计) - PRC 人民币份额 (每月派息) - PRC 人民币对冲份额 (累计) - PRC 人民币对冲份额 (每月派息) - PRC 美元份额 (累计) - PRC 美元份额 (每月派息) - 人民币对冲类别 (累计) - 人民币对冲类别 (每月派息) - 美元类别 (每月派息) - 美元类别 (每半年派息) - 美元 X 类别 (累计)	澳元 92,929,710 加元 79,825,260 港元 1,957,676,239 纽元 45,998,058 人民币 1,380,651,140 人民币 537,625,559 人民币 2,172,533,788 人民币 341,260,761 美元 24,343,504 美元 41,077,325 人民币 35,643,177 人民币 1,064,869,277 美元 563,879,497 美元 11,144,682 美元 144,647,818	澳元 8.32 加元 8.35 港元 8.40 纽元 8.32 人民币 10.9 人民币 8.92 人民币 10.88 人民币 8.55 美元 10.72 美元 8.57 人民币 13.02 人民币 8.25 美元 8.38 美元 18.89 美元 10.95
30/9/23* - 澳元对冲类别 (每月派息) - 加元对冲类别 (每月派息) - 港元类别 (每月派息) - 纽元对冲类别 (每月派息) - PRC 人民币份额 (累计) - PRC 人民币份额 (每月派息) - PRC 人民币对冲份额 (累计) - PRC 人民币对冲份额 (每月派息) - PRC 美元份额 (累计) - PRC 美元份额 (每月派息) - 人民币对冲类别 (累计) - 人民币对冲类别 (每月派息) - 美元类别 (每月派息) - 美元类别 (每半年派息) - 美元 X 类别 (累计)	澳元 82,138,289 加元 65,556,132 港元 1,151,643,442 纽元 31,824,571 人民币 1,443,606,142 人民币 125,036,624 人民币 2,844,180,398 人民币 124,492,098 美元 19,062,251 美元 19,625,761 人民币 15,157,142 人民币 710,226,476 美元 274,377,383 美元 7,968,792 美元 143,830,823	澳元 8.01 加元 8.04 港元 8.15 纽元 8.01 人民币 10.32 人民币 8.93 人民币 10.14 人民币 8.23 美元 9.75 美元 8.25 人民币 12.13 人民币 7.93 美元 8.06 美元 18.19 美元 9.87
30/9/22 - 澳元对冲类别 (每月派息) - 加元对冲类别 (每月派息) - 港元类别 (每月派息) - 纽元对冲类别 (每月派息) - PRC 人民币份额 (累计) - PRC 人民币份额 (每月派息) - PRC 人民币对冲份额 (累计) - PRC 人民币对冲份额 (每月派息) - PRC 美元份额 (累计) - PRC 美元份额 (每月派息) - 人民币对冲类别 (累计) - 人民币对冲类别 (每月派息) - 美元类别 (每月派息) - 美元类别 (每半年派息)	澳元 67,478,146 加元 50,530,106 港元 1,215,536,657 纽元 24,543,394 人民币 623,278,553 人民币 73,049,501 人民币 788,053,057 人民币 56,611,430 美元 18,573,701 美元 17,846,002 人民币 7,369,196 人民币 716,726,787 美元 255,990,653 美元 8,045,375	澳元 8.37 加元 8.40 港元 8.53 纽元 8.39 人民币 10.17 人民币 9.13 人民币 10.39 人民币 8.59 美元 9.73 美元 8.62 人民币 12.44 人民币 8.28 美元 8.42 美元 19.01

业绩记录 (未经审计) (续)

最高卖出价/最低买入价

(续)

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价	财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
30/9/24			30/9/20		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.41	澳元 7.93	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.32	澳元 9.55
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 8.45	加元 7.96	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.33	加元 9.59
- 港元类别 (每月派息)	港元 8.55	港元 8.06	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.36	港元 9.64
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.43	纽元 7.94	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.32	纽元 9.56
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 11.12	人民币 10.27	- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 11.50	人民币 10.76
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 9.24	人民币 8.86	- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 11.08	人民币 10.38
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 10.95	人民币 10.02	- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.14	人民币 10.29
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 8.64	人民币 8.14	- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.58	人民币 9.87
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.78	美元 9.65	- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.99	美元 10.19
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 8.67	美元 8.16	- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.58	美元 9.86
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.1	人民币 12.00	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.42	人民币 12.39
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 8.33	人民币 7.84	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.19	人民币 9.51
- 美元类别 (每月派息)	美元 8.48	美元 7.98	- 美元类别 (每月派息)	美元 10.33	美元 9.63
- 美元类别 (每半年派息)	美元 19.61	美元 18.00	- 美元类别 (每半年派息)	美元 23.71	美元 22.11
- 美元 X 类别 (累计)	美元 11.00	美元 9.77			
30/9/23 [#]			30/9/19		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.55	澳元 8.01	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.25	澳元 9.41
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 8.58	加元 8.04	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.26	加元 9.43
- 港元类别 (每月派息)	港元 8.70	港元 8.15	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.40	港元 9.54
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.57	纽元 8.02	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.26	纽元 9.43
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 10.54	人民币 9.74	- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 11.39	人民币 9.90
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 9.38	人民币 8.72	- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 11.22	人民币 9.90
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 10.67	人民币 10.10	- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 10.69	人民币 9.96
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 8.79	人民币 8.20	- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.53	人民币 9.96
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.08	美元 9.58	- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.65	美元 9.96
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 8.81	美元 8.22	- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.52	美元 9.96
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.77	人民币 12.09	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.88	人民币 11.41
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 8.47	人民币 7.92	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.15	人民币 9.31
- 美元类别 (每月派息)	美元 8.61	美元 8.06	- 美元类别 (每月派息)	美元 10.28	美元 9.45
- 美元类别 (每半年派息)	美元 19.70	美元 18.19	- 美元类别 (每半年派息)	美元 23.55	美元 21.37
- 美元 X 类别 (累计)	美元 10.11	美元 9.84			
30/9/22			30/9/18		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.82	澳元 8.37	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.82	澳元 9.49
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.84	加元 8.40	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.83	加元 9.50
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.91	港元 8.53	- 港元类别 (每月派息)	港元 9.93	港元 9.61
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.83	纽元 8.39	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.83	纽元 9.50
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 10.54	人民币 9.74	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 11.58	人民币 11.29
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 9.63	人民币 8.82	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.74	人民币 9.39
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.60	人民币 10.36	- 美元类别 (每月派息)	美元 9.85	美元 9.52
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.07	人民币 8.59	- 美元类别 (每半年派息)	美元 22.38	美元 21.52
- PRC 美元份额 (累计)	美元 11.06	美元 9.72			
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.09	美元 8.61	30/9/17		
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.98	人民币 12.42	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.49	澳元 9.69
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.70	人民币 8.28	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.51	加元 9.69
- 美元类别 (每月派息)	美元 9.86	美元 8.42	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.53	港元 9.74
- 美元类别 (每半年派息)	美元 22.33	美元 19.01	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.51	纽元 9.70
			- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 11.38	人民币 10.63
			- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.43	人民币 9.59
			- 美元类别 (每月派息)	美元 10.52	美元 9.72
			- 美元类别 (每半年派息)	美元 23.79	美元 22.15
30/9/21			30/9/16		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.15	澳元 9.77	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.64	澳元 9.81
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.17	加元 9.79	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.66	加元 9.82
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.20	港元 9.83	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.69	港元 9.83
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.16	纽元 9.78	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.67	纽元 9.83
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 10.98	人民币 10.33	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 11.42	人民币 10.10
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.38	人民币 9.55	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.60	人民币 9.73
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.57	人民币 11.10	- 美元类别 (每月派息)	美元 10.68	美元 9.82
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.45	人民币 10.02	- 美元类别 (每半年派息)	美元 24.31	美元 22.30
- PRC 美元份额 (累计)	美元 11.15	美元 10.83			
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.44	美元 10.04	30/9/15		
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.93	人民币 13.34	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.38	澳元 9.86
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.06	人民币 9.65	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.38	加元 9.85
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.20	美元 9.81	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.37	港元 9.86
- 美元类别 (每半年派息)	美元 23.20	美元 22.16	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.40	纽元 9.87
			- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 10.41	人民币 9.89
			- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.38	人民币 9.86
			- 美元类别 (每月派息)	美元 10.38	美元 9.86
			- 美元类别 (每半年派息)	美元 24.94	美元 22.38

* 本基金的每份额资产净值于非交易日予以披露。

本基金的每份额资产净值于交易日予以披露。

经营与管理

管理人及服务提供者

摩根基金（亚洲）有限公司
香港
中环干诺道中 8 号
遮打大厦 19 楼

投资管理

摩根资产管理（亚太）有限公司
香港
中环干诺道中 8 号
遮打大厦 19 楼

管理人董事

于二零二五年一月二十四日
Christopher David SPELMAN
Daniel James WATKINS
Ka Li NG
Kit Yee Elka LEUNG
Stiofan Seamus DEBURCA
Tsun Kay Edwin CHAN

受托人

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

基金注册登记机构

East Asia International
Trustees Limited
East Asia Chambers
P.O. Box 901
Road Town, Tortola
British Virgin Islands

核数师

罗兵咸永道会计师事务所
执业会计师
香港
中环中环德辅道中 1 号
太子大厦 22 楼

