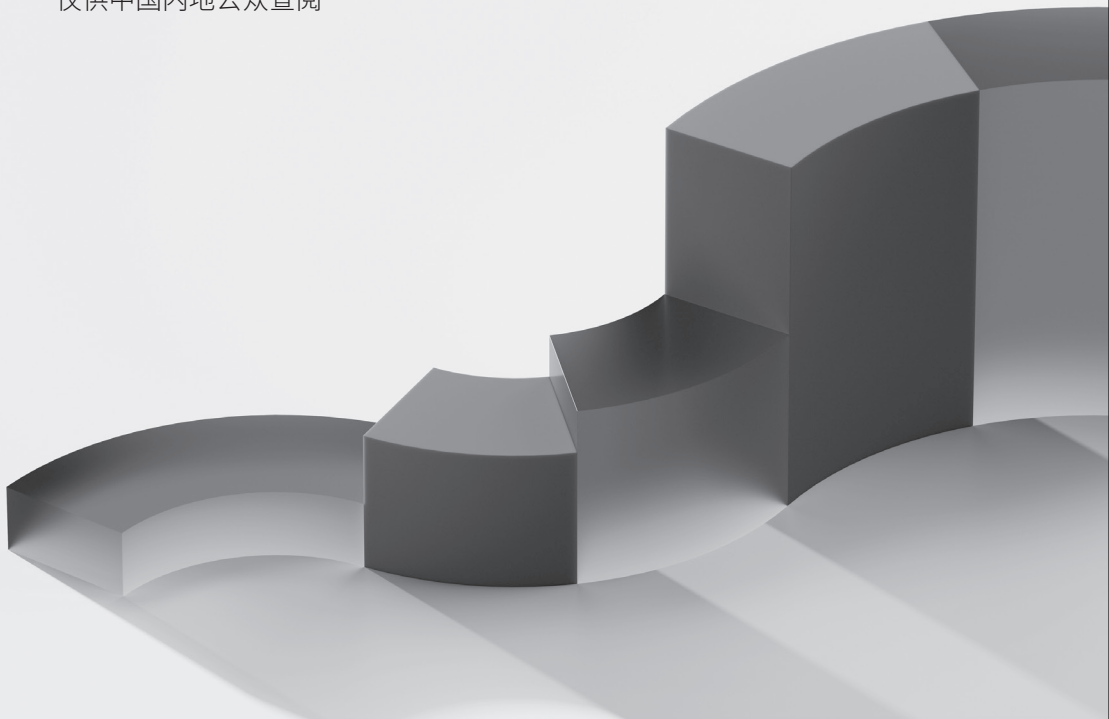


仅供中国内地公众查阅



半年度报告— 2024年3月31日（未经审核）

摩根亚洲总收益 债券基金

内地与香港互认基金系列

摩根
资产管理

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

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

内容	页
投资组合	1 - 9
投资组合持有变动表	10
金融衍生工具详情	11 - 20
抵押品持有情况	21
财务状况表	22
综合收益表	22
可赎回份额持有人应占净资产变动表	23
现金流量表	23
财务报表之附注	24 - 31

投资组合

于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

(续)

单位数目	公平值 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 (99.7%)					
(I) 债务证券 (97.6%)					
澳大利亚 (4.3%)					
Ausgrid Finance Pty Ltd Ser Mtn 5.408% 28Mar2031	澳元 2,330,000	1,527,472	0.1	Suzano Austria GmbH (Reg) 2.5% 15Sep2028	美元 2,000,000 1,772,224 0.1
Ausgrid Finance Pty Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.35% 01Aug2028	美元 6,600,000	6,394,750	0.5	Suzano Austria GmbH 3.75% 15Jan2031	美元 2,500,000 2,232,552 0.2
Aust & Nz Banking Group Ser Regs (Reg S) 2.57% 25Nov2035	美元 8,500,000	7,053,155	0.5	开曼群岛 (1.1%)	
Commonwealth Bank Aust Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.61% 12Sep2034	美元 5,300,000	4,785,342	0.3	Azure Orbit IV Intl Fin Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4% 25Jan2028	美元 1,800,000 1,735,586 0.1
GALF Bond Issuer P/L Ser Regs (Reg) (Regs) 3.4% 30Sep2026	美元 2,300,000	2,194,974	0.2	Goodman HK Finance Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3% 22Jul2030	美元 1,000,000 857,263 0.1
Macquarie Group Ltd Ser Regs (Reg S) Var 15Jun2034	美元 4,500,000	4,674,879	0.3	Melco Resorts Finance Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.625% 17Jul2027	美元 2,900,000 2,814,643 0.2
National Australia Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 02Aug2034	美元 5,300,000	4,903,808	0.3	Tencent Holdings Ltd Ser Regs (Reg S) 2.39% 03Jun2030	美元 3,700,000 3,192,195 0.2
NBN Co Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.75% 22Mar2034	欧元 2,050,000	2,239,190	0.2	Tencent Holdings Ltd Ser Regs (Reg S) 3.84% 22Apr2051	美元 8,400,000 6,538,009 0.5
Santos Finance Ltd Ser Regs (Reg S) 3.649% 29Apr2031	美元 5,000,000	4,438,319	0.3	智利 (0.2%)	
Santos Finance Ltd Ser Regs (Reg S) 6.875% 19Sep2033	美元 3,500,000	3,713,950	0.3	Codelco Inc 5.125% 02Feb2033	美元 3,000,000 2,888,662 0.2
Scentre Group Trust 1/2 Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.375% 28May2030	美元 4,000,000	3,913,722	0.3	中国 (7.3%)	
Scentre Group Trust 2 Ser Regs (Reg S) Var 24Sep2080	美元 3,500,000	3,370,831	0.2	Alibaba Group Holding (Reg) 3.6% 28/11/2024	美元 2,600,000 2,599,336 0.2
Transurban Finance Co Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.713% 12Mar2032	欧元 1,423,000	1,555,134	0.1	Alibaba Group Holding (Reg) 4.2% 06Dec2047	美元 3,400,000 2,853,060 0.2
Transurban Finance Co Ser Regs (Reg S) 2.45% 16Mar2031	美元 6,000,000	5,037,089	0.4	Central Plaza Dev Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.85% 14Jul2025	美元 1,700,000 1,575,874 0.1
Westpac Banking Corp (Reg) Var 15Nov2035	美元 4,900,000	4,098,147	0.3	China (Govt of) (Reg S) (Br) 2.45% 15Mar2034	离岸人民币 50,000,000 6,869,691 0.5
巴哈马 (0.8%)					
Compet Team Tech Ltd (Reg) (Reg S) 4.25% 12Mar2029	美元 10,700,000	10,277,811	0.8	China (Govt of) Ser Inbk (Reg) 3% 15Oct2053(Interbank)	人民币 100,000,000 15,589,779 1.1
巴西 (0.7%)					
Banco Do Brasil (Cayman) Ser Regs (Reg) 4.625% 15Jan2025	美元 2,700,000	2,699,919	0.2	China Cinda 2020 I Mngmn Ser Emtn (Reg) (Reg S) 3% 20Jan2031	美元 5,000,000 4,311,383 0.3
Brazil (Rep of) 6.125% 15Mar2034	美元 3,500,000	3,504,394	0.2	China Huadian Overseas (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 2,500,000 2,457,316 0.2
ENN Energy Holdings Ltd Ser Regs (Reg S) 2.625% 17Sep2030					
ENN Energy Holdings Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 17May2027					
Huarong Finance 2017 Co 4.75% 27Apr2027					
美元 3,700,000 3,581,117 0.3					

投资组合 (续)

于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比
中国 (续)							
Huarong Finance 2017 Co Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4.25% 07Nov2027	美元 3,000,000	2,830,680	0.2	Societe Generale Ser EMTN (Reg S) (Br) Var 22Jan2032	英镑 1,800,000	2,326,813	0.2
Huarong Finance 2019 Ser EMTN (Reg S) 3.25% 13Nov2024	美元 2,800,000	2,776,993	0.2	德国 (0.4%) Deutsche Bank AG Ser EMTN (Reg S) (Br) Var 05Apr2028	新加坡元 6,000,000	4,441,918	0.3
Huarong Finance 2019 Ser EMTN (Regs) 4.5% 29May2029	美元 2,200,000	2,047,848	0.1	Traton Finance Lux Sa Ser EMTN (Reg S) 5.625% 16Jan2029	英镑 1,100,000	1,418,240	0.1
Huarong Finance II Co Ltd (Reg) (Reg S) 4.625 03Jun2026	美元 3,000,000	2,930,789	0.2	香港 (3.9%) AIA Group Ltd Ser GMTN (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 1,900,000	1,800,345	0.1
ICBCIL Finance Co Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 1.75% 25Aug2025	美元 2,500,000	2,375,830	0.2	AIA Group Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.375% 05Apr2034	美元 2,021,000	2,027,069	0.2
Longfor Holdings Ltd (Reg) (Reg S) 3.95% 16Sep2029	美元 1,500,000	782,599	0.1	Airport Authority HK (Reg) (Reg S) VAR Perp 2.1% (Reg S) VAR Perp 2.4%	美元 1,200,000	1,136,510	0.1
SD Iron & Steel Xinheng (Reg) (Reg S) 4.8% 28Jul2024	美元 12,800,000	12,755,891	0.9	Airport Authority HK (Reg) (Reg S) VAR Perp 2.4% CMB International Leasin Ser EMTN (Reg S) 2.75% 12Aug2030	美元 8,000,000	7,276,267	0.5
Shougang Group Co Ltd (Reg) (Reg S) 4% 23May2024	美元 8,000,000	8,088,882	0.6	Dah Sing Bank Ltd Ser Emtn (Reg) (Reg S) Var 02Nov2031	美元 2,800,000	2,617,459	0.2
Tencent Music Ent Grp (Reg) 2% 03Sep2030	美元 1,700,000	1,398,756	0.1	Dah Sing Bank Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 15Nov2033	美元 2,500,000	2,687,988	0.2
Weibo Corp (Reg) 3.375% 08Jul2030	美元 2,400,000	2,106,332	0.1	GLP China Holdings Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.95% 29Mar2026	美元 800,000	648,131	0.1
Yunda Holding Inv (Reg) (Reg S) 2.25% 19Aug2025	美元 4,900,000	4,650,791	0.3	Goodman HK Finance Ser EMTN (Regs) (Reg) 4.375% 19Jun2024	美元 6,000,000	6,046,685	0.4
Zhongsheng Group (Reg) (Reg S) 3% 13Jan2026	美元 11,900,000	11,222,795	0.8	Hongkong Land Finance Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.25% 14Jul2033	美元 4,510,000	4,524,866	0.3
哥伦比亚 (0.5%) Colombia (Rep of) (Reg) 8.75% 14Nov2053	美元 3,000,000	3,366,107	0.3	Jinan URB Const Intl Inv (Reg) (Reg S) 2.4% 23Sep2026	美元 2,800,000	2,560,175	0.2
Ecopetrol Sa (Reg) 8.875% 13Jan2033	美元 3,000,000	3,233,136	0.2	Lenovo Group Ltd Ser Regs (Reg S) 3.421% 02Nov2030	美元 7,500,000	6,700,085	0.5
克罗地亚 (0.1%) Croatia (Reg) (Reg S) 3.375% 12Mar2034	欧元 1,519,000	1,643,423	0.1	Link Finance Cayman 2009 Ser EMTN (Reg) (Regs) 3.6% 03Sep2024	美元 2,600,000	2,585,778	0.2
多米尼加共和国 (0.4%) Dominican (Rep of) Ser Regs (Reg) 5.5% 27Jan2025	美元 3,500,000	3,516,722	0.3	Nan Fung Treasury Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5% 05Sep2028	美元 2,000,000	1,924,806	0.1
Dominican (Rep of) Ser Regs (Reg) 6.875% 29Jan2026	美元 2,000,000	2,046,239	0.1	Xiaomi Best Time Intl Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.1% 14Jul2051	美元 5,400,000	3,916,768	0.3
法国 (0.7%) BPCE Sa Ser 144A Var 19Oct2029	美元 2,000,000	2,154,588	0.1	匈牙利 (0.3%) Hungary (Govt of) Ser Regs (Reg S) 5.25% 16Jun2029	美元 3,600,000	3,617,435	0.3
BPCE Sa Ser EMTN (Reg S) (Br) 3.875% 11Jan2029	欧元 2,400,000	2,627,264	0.2				
Bpce Sa Ser Regs (Reg S) 3.25% 11Jan2028	美元 2,500,000	2,354,224	0.2				

投资组合 (续)
于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 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
印度 (10.8%)				JSW Infrastructure Ser			
ABJA Investment Co (Reg)				Regs (Reg) (Reg S)			
(Reg S) 5.45%				4.95% 21Jan2029	美元 9,970,000	9,463,434	0.7
24Jan2028	美元 12,200,000	12,314,815	0.9	JSW Steel Ltd (Reg S)			
Axis Bank Gift City Ser				5.95% 18Apr2024	美元 5,000,000	5,131,276	0.4
Regs (Reg S) Var Perp				Oil India Ltd (Reg) (Reg			
31Dec2049	美元 7,400,000	6,888,434	0.5	S) 5.125% 04Feb2029	美元 3,950,000	3,956,160	0.3
Bharat Petroleum Corp				State Bank India/London			
Ser Mtn (Regs) 4%				Ser EMTN (Reg) (Reg S)			
08May2025	美元 1,640,000	1,639,195	0.1	5% 17Jan2029	美元 1,886,000	1,895,103	0.1
Continuum Energy Aura				Tml Holdings Pte Ltd			
Ser Regs (Reg S) 9.5%				(Reg) (Reg S) 5.5%			
24Feb2027	美元 5,400,000	5,677,327	0.4	03Jun2024	美元 2,000,000	2,034,904	0.2
Delhi Intl Airport Ser Regs				Ultratech Cement Ltd			
(Reg) (Reg S) 6.45%				Ser Regs (Reg) (Reg S)			
04Jun2029	美元 2,700,000	2,723,794	0.2	2.8% 16Feb2031	美元 2,388,000	2,031,890	0.1
GMR Hyderabad				印度尼西亚 (11.4%)			
Internatio Ser Regs				Bank Negara Indonesia			
(Regs) 4.25%				(Reg S) Var Perp			
27Oct2027	美元 2,871,000	2,705,000	0.2	Bank Negara Indonesia			
Greenko Dutch BV Ser				Ser EMTN (Reg S)			
Regs (Reg) (Reg S)				5.28% 05Apr2029	美元 6,300,000	5,863,058	0.4
3.85% 29Mar2026	美元 11,000,000	9,430,560	0.7	Freeport Indonesia Pt			
Greenko Power II Ltd Ser				Ser Regs (Reg) (Reg S)			
Regs (Reg) (Reg S) 4.3%				6.2% 14Apr2052	美元 6,000,000	6,141,943	0.4
13Dec2028	美元 2,000,000	1,677,283	0.1	Hutama Karya Persero			
Greenko Solar Mauritius				PT Ser Regs (Reg S)			
Ser Regs (Reg) (Reg S)				3.75% 11May2030	美元 12,500,000	11,708,867	0.8
5.95% 29Jul2026	美元 5,700,000	5,620,184	0.4	Indonesia (Rep of) Ser Fr			
HDFC Bank Ltd Ser EMTN				6.625% 15Feb2034	610,000,000,000	38,464,042	2.8
(Reg) (Reg S) 5.18%				Listrindo Capital BV Ser			
15Feb2029	美元 9,600,000	9,615,714	0.7	Regs (Reg) (Reg S)			
HDFC Bank Ltd Ser Regs				4.95% 14/09/2026	美元 6,750,000	6,521,631	0.5
(Reg S) Var Perp				LLPL Capital Pte Ltd Ser			
Hindustan Petroleum				Regs (Reg) (Reg S)			
Corp (Reg) (Reg S) 4%				6.875% 04Feb2039	美元 3,500,000	2,743,228	0.2
12Jul2027	美元 3,300,000	3,182,661	0.2	Medco Laurel Tree Ser			
HPCL-Mittal Energy Ltd				Regs (Reg S) 6.95%			
(Reg) (Reg S) 5.25%				12Nov2028	美元 3,400,000	3,399,948	0.2
28Apr2027	美元 2,100,000	2,088,728	0.2	Medco Oak Tree Pte Ltd			
ICICI Bank Ltd/Dubai Ser				Ser Regs (Reg) (Reg S)			
Regs (Reg) 3.8%				7.375% 14May2026	美元 4,000,000	4,127,948	0.3
14Dec2027	美元 1,600,000	1,532,319	0.1	Minejesa Capital BV Ser			
India (Govt of) 5.22%				(Reg) (Reg S)			
印度卢比				4.625% 10Aug2030	美元 8,900,000	7,928,696	0.6
15Jun2025	1,100,000,000	13,069,217	0.9	Minejesa Capital BV Ser			
India (Govt of) 7.18%				Regs (Reg) (Reg S)			
印度卢比				5.625% 10Aug2037	美元 1,000,000	918,557	0.1
14Aug2033	560,000,000	6,820,916	0.5	Pelabuhan Indonesia III			
India Clean Energy Hldg				Ser Regs 4.875%			
Ser Regs (Reg) (Reg S)				01Oct2024	美元 2,400,000	2,449,015	0.2
4.5% 18Apr2027	美元 7,250,000	6,807,772	0.5	Pertamina Geothermal			
India Government Bond				Ene Ser Regs (Reg S)			
7.37% 23Oct2028	1,010,000,000	12,562,121	0.9	5.15% 27Apr2028	美元 700,000	714,064	0.0
India Green Power Hold				Pertamina Persero Pt			
Ser Regs (Reg) (Reg S)				Ser Regs (Reg) 6.5%			
4% 22Feb2027	美元 8,370,000	7,283,128	0.5	07Nov2048	美元 3,200,000	3,531,200	0.3
Indian Railway Finance				Pertamina Persero Ser			
(Reg) (Regs) 3.835%				(Regs) 6.45%			
13/12/2027	美元 4,200,000	4,026,171	0.3	30May2044	美元 7,400,000	8,041,426	0.6
Indian Railway Finance							
Ser Regs (Reg S)							
3.249% 13Feb2030	美元 3,300,000	2,953,239	0.2				

投资组合 (续)
于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 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
印度尼西亚 (续)							
Perusahaan Listrik Negar Ser Regs (Reg) 6.15% 21May2048	美元 5,600,000	5,807,879	0.4	Mitsubishi HC Fin Amer Ser Regs (Reg S) 5.658% 28Feb2033	美元 6,200,000	6,355,084	0.5
PT Adaro Indonesia Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.25% 31Oct2024	美元 12,000,000	12,070,493	0.9	Mitsubishi HC Fin Amer Ser Regs (Reg S) 5.807% 12Sep2028	美元 1,900,000	1,946,598	0.1
PT Bank Tabungan Negara (Reg) (Reg S) 4.2% 23Jan2025	美元 4,300,000	4,266,552	0.3	Mitsubishi Ufj Fin Grp (Reg) Var 11Oct2025	美元 4,200,000	4,112,440	0.3
PT Indonesia Asahan Aluminium and Pt Mineral Industri Indonesia (Persero) Ser Regs (Reg S) 5.45% 15May2030	美元 6,000,000	6,056,885	0.4	Mitsubishi Ufj Fin Grp (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 2,500,000	2,746,865	0.2
PT Indonesia Asahan Aluminium And Pt Mineral Industri Indonesia (Persero) Ser Regs (Reg S) 5.8% 15May2050	美元 3,000,000	2,901,684	0.2	Mizuho Financial Group (Reg) Var 16Jul2030	美元 4,500,000	4,112,270	0.3
PT Indonesia Asahan Aluminium and Pt Mineral Industri Indonesia (Persero) Ser Regs (Reg S) 6.53% 15Nov2028	美元 2,600,000	2,774,358	0.2	Mizuho Financial Group 2.564% 13Sep2031	美元 3,800,000	3,119,391	0.2
PT Indonesia Asahan Aluminium and Pt Mineral Ser Regs (Reg S) 4.75% 15May2025	美元 2,600,000	2,616,818	0.2	Nippon Life Insurance Ser Regs (Reg S) Var 13Sep2053	美元 1,000,000	1,049,300	0.1
PT Pertamina (Persero) Ser Regs (Reg S) 4.15% 25Feb2060	美元 3,400,000	2,602,360	0.2	Nippon Life Insurance Ser Regs (Reg S) Var 21Jan2051	美元 5,500,000	4,630,715	0.3
PT Pertamina (Persero) Ser Regs (Reg S) 4.175% 21Jan2050	美元 14,700,000	11,796,648	0.9	Nippon Life Insurance Ser Regs (Reg S) Var 23Jan2050	美元 3,000,000	2,685,958	0.2
PT Pertamina (Persero) Ser Regs (Reg S) 4.7% 30Jul2049	美元 2,000,000	1,733,642	0.1	Nippon Life Insurance Ser Regs (Reg S) Var 16Sep2051	美元 1,000,000	833,057	0.1
爱尔兰 (0.3%)				Nissan Motor Co Ser Regs (Reg S) 3.522% 17Sep2025	美元 2,800,000	2,704,683	0.2
Avolon Holdings Fndg Ltd Ser Regs (Reg S) 6.375% 04May2028	美元 3,500,000	3,665,353	0.3	Nomura Holdings Inc (Reg) 1.653% 14Jul2026	美元 3,100,000	2,863,469	0.2
意大利 (0.2%)				Shanghai Commercial Bank (Reg) (Reg S) Var 28Feb2033	美元 4,250,000	4,352,866	0.3
Intesa Sanpaolo Spa Ser EMTN (Reg S) (Br) 5.125% 29Aug2031	欧元 2,491,000	3,004,486	0.2	Sumitomo Life Insur Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 8,433,000	8,521,405	0.6
日本 (4.4%)				Sumitomo Mitsui Finance (Reg) (Reg S) 2.512% 22Jan2025	美元 3,400,000	3,324,859	0.3
Chiba Bank Ltd Ser EMTN (Reg S) 2.65% 30Oct2024	美元 350,000	347,237	0.0	Sumitomo Mitsui Finl Grp (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 2,700,000	2,723,008	0.2
Meiji Yasuda Life Insura Ser Regs (Regs) 5.2% 20/10/2045	美元 4,000,000	4,062,126	0.3	韩国 (10.5%)			
				Doosan Enerbility (Reg) (Reg S) 5.5% 17Jul2026	美元 3,200,000	3,255,973	0.2
				Hanwha Life Insurance Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 04Feb2032	美元 7,650,000	7,138,166	0.5
				Hyundai Capital Services Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.125% 05Feb2029	美元 3,100,000	3,095,899	0.2
				Hyundai Motor Manu Indo Ser EMTN (Reg) (Reg S) 1.75% 06May2026	美元 6,900,000	6,441,375	0.5
				KB Capital Co Ltd (Reg) (Reg S) 1.5% 28Oct2025	美元 1,360,000	1,276,994	0.1

投资组合 (续)

于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比
韩国 (续)							
KB Kookmin Card Co Ltd (Reg) (Reg S) 4% 09Jun2025	美元 5,500,000	5,461,117	0.4	Shinhan Bank Ser Regs 3.875% 24Mar2026	美元 1,500,000	1,453,501	0.1
Kodit Global 2023-1 Ltd (Reg) (Reg S) 4.954% 25May2026	美元 2,500,000	2,524,255	0.2	Shinhan Card Co Ltd (Reg) (Reg S) 2.5% 27Jan2027	美元 3,800,000	3,508,861	0.3
Kookmin Bank Ser GMTN (Reg) (Reg S) 4.5% 01Feb2029	美元 6,900,000	6,656,961	0.5	Shinhan Card Co Ltd (Reg) (Reg S) 5.5% 12Mar2029	美元 2,246,000	2,269,286	0.2
Kookmin Bank Ser Regs (Reg) (Reg_S) Var Perp 31Dec2049	美元 6,300,000	6,321,793	0.5	Shinhan Financial Group Ser Regs (Reg) (Reg S) 5% 24Jul2028	美元 3,600,000	3,607,810	0.3
Korea East-West Power Co (Reg) (Reg S) 4.875% 12Jul2028	美元 5,620,000	5,643,373	0.4	Shinhan Financial Group Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 05Feb2030	美元 3,000,000	2,953,919	0.2
Korea Housing Finance Co Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 24Feb2028	美元 1,600,000	1,600,865	0.1	SK Hynix Inc Ser Regs (Reg S) 6.5% 17Jan2033	美元 8,000,000	8,641,289	0.6
Korea Housing Finance Co Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 24Feb2033	美元 6,450,000	6,295,603	0.5	Sk Hynix Inc Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.375% 19Jan2031	美元 4,700,000	3,892,758	0.3
Korea Hydro & Nuclear Po Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.25% 27Jul2027	美元 1,000,000	981,231	0.1	Woori Bank (Reg S) 5.125% 06Aug2028	美元 4,000,000	3,978,499	0.3
Korea Hydro & Nuclear Po Ser Regs (Reg) (Reg S) 5% 18Jul2028	美元 7,400,000	7,490,227	0.5	Woori Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 6,350,000	6,415,220	0.5
Korea Inv & Secs Co Ltd (Reg) (Reg S) 1.375% 19Jul2024	美元 700,000	691,872	0.0	Woori Bank Ser Regs 4.75% 30Apr2024	美元 2,000,000	2,037,637	0.1
Korea Inv & Secs Co Ltd (Reg) (Reg S) 6.875% 06Nov2026	美元 4,600,000	4,799,870	0.3	科威特 (0.4%)			
Korea Midland Power Co (Reg) (Reg S) 3.625% 21Apr2027	美元 3,700,000	3,593,648	0.3	Equate Petrochemical BV Ser Regs (Reg) (Regs) 4.25% 03Nov2026	美元 2,850,000	2,797,076	0.2
Korea National Oil Corp Ser Regs (Reg S) 4.875% 03Apr2029	美元 5,765,000	5,724,896	0.4	Meglobal Canada Ulc Ser Regs (Reg S) 5% 18May2025	美元 2,000,000	2,013,388	0.2
Korearehahnresource (Reg) (Reg S) 5.125% 08May2029	美元 5,518,000	5,489,069	0.4	卢森堡 (0.7%)			
Kyobo Life Insurance Co Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 4,200,000	4,279,263	0.3	Eig Pearl Holdings Sarl Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.387% 30Nov2046	美元 3,500,000	2,761,149	0.2
Lotte Property & Develop (Reg S) 4.5% 01Aug2025	美元 2,500,000	2,477,837	0.2	Greensaf Pipelines Bidc Ser Regs (Reg S) 6.51% 23Feb2042	美元 7,000,000	7,330,394	0.5
Posco Ser Regs (Reg S) 5.75% 17Jan2028	美元 5,300,000	5,443,436	0.4	澳门 (5.0%)			
Posco Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.375% 04Aug2025	美元 2,600,000	2,578,089	0.2	Melco Resorts Finance 4.875% 06Jun2025	美元 4,000,000	3,970,332	0.3
Posco Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.5% 04Aug2027	美元 3,200,000	3,141,106	0.2	Melco Resorts Finance Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.25% 26Apr2026	美元 4,200,000	4,157,850	0.3
Shinhan Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.375% 13Apr2032	美元 3,700,000	3,487,515	0.2	Melco Resorts Finance Ser Regs (Regs) 5.75% 21Jul2028	美元 6,900,000	6,627,385	0.5
				MGM China Holdings Ltd Ser Regs (Reg S) 4.75% 01Feb2027	美元 1,600,000	1,539,399	0.1
				MGM China Holdings Ltd Ser Regs (Reg S) 5.25% 18Jun2025	美元 2,150,000	2,157,092	0.2
				MGM China Holdings Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.375% 15May2024	美元 9,500,000	9,680,657	0.7

投资组合 (续)
于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比
澳门 (续)				蒙古 (0.9%)			
Sands China Ltd Ser Wi (Reg) 3.8% 08Jan2026	美元 4,200,000	4,089,492	0.3	Mongolia Intl Bond Ser Regs (Reg S) 3.5% 07Jul2027	美元 8,900,000	8,102,708	0.6
Sands China Ltd Ser Wi (Reg) 4.375% 18Jun2030	美元 11,000,000	10,246,925	0.7	Mongolia Intl Bond Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.125% 07Apr2026	美元 4,800,000	4,765,300	0.3
Sands China Ltd Ser Wi (Reg) 5.125% 08Aug2025	美元 10,000,000	9,953,876	0.7	荷兰 (0.2%)			
Studio City Finance Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.5% 15Jan2028	美元 1,900,000	1,838,722	0.1	Prosus Nv Ser Regs (Reg S) 4.193% 19Jan2032	美元 1,600,000	1,407,026	0.1
Wynn Macau Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.5% 15Jan2026	美元 11,100,000	10,970,320	0.8	Prosus Nv Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.832% 08Feb2051	美元 2,200,000	1,371,811	0.1
Wynn Macau Ltd Ser Regs (Reg) 4.875% 01Oct2024	美元 3,400,000	3,448,103	0.3	巴基斯坦 (0.4%)			
马来西亚 (0.8%)				Islamic Rep of Pakistan Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.875% 05Dec2027	美元 6,000,000	5,264,357	0.4
Axiata Spv5 Labuan Ltd Ser EMTN (Reg S) 3.064% 19Aug2050	美元 2,000,000	1,362,399	0.1	Pakistan (Rep of) Ser Regs (Reg S) 6% 08Apr2026	美元 600,000	554,771	0.0
GOHL Capital Ltd 4.25% 24Jan2027	美元 10,500,000	10,188,788	0.7	秘鲁 (1.2%)			
毛里求斯 (1.4%)				Peru (Rep of) (Reg) 3% 15Jan2034	美元 3,500,000	2,897,417	0.2
Greenko Solar Mauritius Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.55% 29Jan2025	美元 5,900,000	5,897,394	0.4	Peru (Rep of) Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.4% 12Aug2034	秘鲁新索尔 12,687,000	2,962,850	0.2
Greenko Wind Projects Mu Ser Regs (Reg S) 5.5% 06Apr2025	美元 3,100,000	3,128,632	0.2	Republic of Peru Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.95% 12Aug2031	秘鲁新索尔 36,485,000	9,948,551	0.8
Network I21 Ltd Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 7,300,000	7,062,927	0.5	菲律宾 (2.3%)			
Network I21 Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 3,200,000	3,255,391	0.3	Bank of Philippine Islan Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.25% 26Mar2029	美元 4,689,000	4,693,647	0.3
墨西哥 (5.1%)				Globe Telecom Inc (Reg) (Reg S) 3% 23Jul2035	美元 1,500,000	1,161,619	0.1
BBVA Bancomer Sa Texas Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 13Sep2034	美元 2,000,000	1,901,669	0.1	Globe Telecom Inc (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 5,000,000	4,886,917	0.4
BBVA Bancomer Sa Texas Var 18Jan2033	美元 2,000,000	1,882,600	0.1	Metropolitan Bank & Trus Ser EMTN (Reg S) 5.5% 06Mar2034	美元 3,942,000	3,973,737	0.3
Mex Bonos Desarr 7.75% 23Nov2034	墨西哥比索 5,000,000	27,671,040	2.0	Metropolitan Bank & Trus Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.375% 06Mar2029	美元 5,646,000	5,677,017	0.4
Mexico (Utd States of) (Reg) 5% 27Apr2051	美元 7,737,000	6,694,036	0.5	Philippines (Rep of) 6.25Pct 14/01/2036	菲律宾比索 250,000,000	4,272,234	0.3
Mexico (Utd States of) (Reg) 6.338% 04May2053	美元 5,000,000	5,074,886	0.4	PLDT Inc (Reg) (Reg S) 2.5% 23Jan2031	美元 3,600,000	3,037,627	0.2
Mexico (Utd States of) 8.5% 01Mar2029	墨西哥比索 850,000	4,979,201	0.4	Rizal Commercial Banking (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 710,000	700,159	0.1
Mexico (Utd States of) 8.5% 31May2029	墨西哥比索 2,838,500	17,003,914	1.2	Rizal Commercial Banking Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.5% 18Jan2029	美元 500,000	508,283	0.0
Petroleos Mexicano 6.875% 04Aug2026	美元 2,500,000	2,455,266	0.2	SMC Global Power Hldgs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 2,200,000	2,258,376	0.2
Petroleos Mexicanos (Reg) 6.875% 16Oct2025	美元 3,000,000	3,061,960	0.2	卡塔尔 (0.4%)			
				ABQ Finance Ser EMTN (Reg) (Reg S) 1.875% 08Sep2025	美元 3,500,000	3,319,235	0.2

投资组合 (续)

于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 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
卡塔尔 (续)				South Africa (Rep of) (Reg)			
QNB Finance Ltd Ser				4.875% 14Apr2026	美元 5,000,000	4,982,513	0.4
EMTN (Reg) (Reg S)				西班牙 (0.3%)			
2.625% 12May2025	美元 2,600,000	2,542,463	0.2	Caixabank Sa Ser 144A Var	美元 4,300,000	4,410,379	0.3
				13Sep2027			
罗马尼亚 (0.4%)				斯里兰卡 (0.8%)			
Romania (Govt of Ser				Republic of Sri Lanka 6.2%	美元 1,200,000	710,951	0.0
Regs (Reg) (Reg S)				11May2027			
6.375% 18Sep2033	欧元 5,000,000	5,972,720	0.4	Republic of Sri Lanka Ser			
				Regs (Reg) (Reg S) 6.75%	美元 1,500,000	888,615	0.1
沙特阿拉伯 (0.3%)				18Apr2028			
Saudi International				Republic of Sri Lanka Ser	美元 2,000,000	1,179,860	0.1
Bond Ser Regs (Reg S)				Regs (Reg) (Reg S) 7.55%			
5.75% 16Jan2054	美元 4,000,000	4,015,257	0.3	28Mar2030	美元 2,600,000	1,559,927	0.1
				Sri Lanka (Rep of) Ser Regs			
新加坡 (3.5%)				(Reg) 6.85% 03/11/2025			
BOC Aviation Ltd Ser				Sri Lanka Government	美元 1,400,000	839,940	0.1
Regs (Reg) (Reg S)				International Bond Ser			
3.25% 29Apr2025	美元 3,800,000	3,756,225	0.3	Regs (Reg S) 6.825%			
BOC Aviation USA Corp				18Jul2026			
Ser Regs (Reg S)				Sri Lanka Govt Bond Ser A	斯里兰卡卢比		
1.625% 29Apr2024	美元 2,600,000	2,609,878	0.2	11.25% 15Dec2026	500,000,000	1,721,265	0.1
BOC Aviation USA Corp				Sri Lanka Govt Bond Ser A	斯里兰卡卢比		
Ser Regs (Reg) (Reg S)				18% 15Jan2028	750,000,000	3,034,015	0.2
4.875% 03May2033	美元 8,000,000	8,011,813	0.6	Sri Lanka Govt Bond Ser A	斯里兰卡卢比		
DBS Group Holdings Ltd				9% 01Feb2026	420,000,000	1,376,436	0.1
Ser Gmtn (Reg) (Reg S)				国际 (0.4%)			
Var Perp	美元 10,000,000	9,788,667	0.7	European Bk Recon & Dev			
GLP Pte Ltd Ser EMTN				Ser Gmtn (Reg) 5%	巴西雷亚尔		
(Reg) (Reg S) 3.875%				27Jan2025	30,000,000	5,887,198	0.4
04Jun2025	美元 2,400,000	2,154,225	0.2	泰国 (2.4%)			
Indika Energy Capital IV				Bangkok Bank PCL/HK Ser			
Ser Regs (Reg) (Reg S)				Regs (Reg S) Var Perp	美元 6,800,000	6,648,728	0.5
8.25% 22Oct2025	美元 7,700,000	8,105,694	0.6	Kasikornbank PCL HK Ser			
Medco Bell Pte Ltd Ser				EMTN (Reg S) Var Perp	美元 3,613,000	3,362,499	0.2
Regs (Reg) (Reg S)				31Dec2049			
6.375% 30Jan2027	美元 3,224,000	3,186,428	0.2	Kasikornbank PCL HK Ser			
Oversea-Chinese				EMTN (Reg) (Reg S) Var	美元 8,100,000	7,673,245	0.6
Banking Ser Regs (Reg				02Oct2031			
S) Var 10Sep2030	美元 4,300,000	4,070,890	0.3	Krung Thai Bank/Cayman	美元 4,200,000	4,014,080	0.3
Spore Airport Terminal S				(Reg S) Var Perp			
Ser Gmtn (Reg) (Reg S)				Thaioil Trsry Center Ser	美元 7,250,000	6,179,695	0.4
4.828% 23Jan2029	美元 600,000	602,579	0.0	Regs (Reg S) 2.5%			
TML Holdings Pte Ltd				18Jun2030			
(Reg) (Reg S) 4.35%	美元 700,000	683,748	0.0	Thaioil Trsry Center Ser	美元 3,900,000	2,856,571	0.2
09Jun2026				Regs (Reg S) 3.75%			
United Overseas Bank				18Jun2050			
Ltd Ser Regs (Reg)				Thaioil Trsry Center Ser	美元 3,000,000	2,655,925	0.2
(Reg S) Var 07Oct2032	美元 6,000,000	5,814,265	0.4	Regs (Reg S) 4.875%			
				23Jan2043			
斯洛伐克 (0.3%)				阿联酋 (1.4%)			
Slovakia Government				ADCB Finance Cayman Ltd			
Bond Ser 247 (Reg S)				Ser Emtn (Reg S) (Br)	美元 8,000,000	8,042,567	0.6
(Br) 3.625%				Frn 20Jun2024			
08Jun2033	欧元 3,000,000	3,400,163	0.3				
				南非 (0.7%)			
南非 (0.7%)				Prosus NV Ser Regs (Reg)			
Prosus NV Ser Regs (Reg)				(Reg S) 3.68%	美元 1,600,000	1,417,939	0.1
(Reg S) 3.68%				21Jan2030			
08Jun2033	欧元 3,000,000	3,400,163	0.3	Republic of South Africa	美元 3,500,000	3,306,418	0.2
				5.875% 22Jun2030			

投资组合 (续)
于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
(II) 集体投资计划 (2.4%)			
卢森堡 (2.4%)			
JPMLIQ-JPM USD Liquidity LVNAV 'X' (dist)**	33,372,547	33,372,547	2.4
(III) 衍生性产品 (-0.3%)			
信用违约掉期 (-0.0%)			
(D) Credit Default Swap Index ~604~ 14 200,000.00 USD 15/03/2024 20/12/2028		(14,886)	(0.0)
远期外汇合约 (-0.4%)		(6,079,763)	(0.4)
期货 (0.1%)			
JPN 10Y Bond (OSE) 13/06/2024	(38)	(118,801)	(0.0)
US 10yr Note (CBT) 18/06/2024	570	266,156	0.0
US 2yr Note (CBT) 28/06/2024	(358)	89,500	0.0
US 5yr Note (CBT) 28/06/2024	116	18,125	0.0
US Ultra Bond (CBT) 18/06/2024	303	549,844	0.1
利率掉期 (-0.0%)			
(D) Interest Rate Swap ~619~ 13 38,000,000,000.00 KRW 13/03/2024 13/03/2029		(72,824)	(0.0)
(D) Interest Rate Swap ~619~ 15 38,000,000,000.00 KRW 22/03/2024 19/06/2029		7,226	0.0
		(5,355,423)	(0.3)
总上市投资		1,377,604,629	99.7
其他净资产		4,793,842	0.3
于二零二四年三月三十一日 可赎回份额持有人应占 净资产		1,382,398,471	100.0
总投资, 按成本		1,363,251,773	

* 由管理人的关联人士发行和管理

在香港未获认可及并非供香港公众投资

投资组合持有变动表

截至二零二四年三月三十一日止期间 (未经审计)

(续)

	持有占资产净值百分比		持有占资产净值百分比	
	31.3.2024	30.9.2023	31.3.2024	30.9.2023
上市投资				
债券证券				
印度尼西亚	11.4	6.4		
印度	10.8	7.0		
韩国	10.5	14.0		
中国	7.3	7.7		
墨西哥	5.1	3.3		
澳门	5.0	2.1		
日本	4.4	2.7		
澳大利亚	4.3	4.3		
维京群岛	3.9	8.3		
香港	3.9	6.6		
英国	3.8	4.2		
新加坡	3.5	5.3		
泰国	2.4	2.9		
美国	2.3	2.0		
菲律宾	2.3	1.0		
毛里求斯	1.4	1.7		
阿联酋	1.4	1.3		
秘鲁	1.2	-		
开曼群岛	1.1	4.8		
蒙古	0.9	0.3		
马来西亚	0.8	1.3		
巴哈马	0.8	0.7		
斯里兰卡	0.8	-		
法国	0.7	0.2		
巴西	0.7	-		
卢森堡	0.7	-		
南非	0.7	-		
哥伦比亚	0.5	-		
国际	0.4	1.3		
巴基斯坦	0.4	0.2		
多米尼加共和国	0.4	-		
德国	0.4	-		
科威特	0.4	-		
卡塔尔	0.4	-		
罗马尼亚	0.4	-		
爱尔兰	0.3	0.3		
西班牙	0.3	0.3		
匈牙利	0.3	-		
沙特阿拉伯	0.3	-		
斯洛伐克	0.3	-		
荷兰	0.2	0.8		
意大利	0.2	0.2		
智利	0.2	-		
克罗地亚	0.1	-		
新西兰	0.0	1.5		
加拿大	0.0	0.3		
丹麦	0.0	0.3		
集体投资计划				
卢森堡	2.4	6.1		
衍生性产品				
期货			0.1	(0.1)
信用违约掉期			(0.0)	-
利率掉期			(0.0)	-
远期外汇合约			(0.4)	0.2
总上市投资			99.7	99.5
其他净资产			0.3	0.5
可赎回份额持有人应占净资产			100.0	100.0

金融衍生工具详情

于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

于二零二四年三月三十一日，本基金持有之金融衍生工具汇总如下：

(a) 信用违约掉期

以下为于二零二四年三月三十一日未平仓之信用违约掉期合约：

	标的资产	交易对手	公允价值 美元
于 2024 年 3 月 31 日			
金融负债：			
(D) Credit Default Swap Index -604~ 14 200,000.00 USD 15/03/2024 20/12/2028	CDX.NA.HY.41	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	(14,886)
		总金融负债	(14,886)
		净金融负债	(14,886)

(b) 远期外汇合约

以下为于二零二四年三月三十一日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
于 2024 年 3 月 31 日				
澳元 1,941	美元 1,269	2024 年 4 月 2 日	法国巴黎银行	3
离岸人民币 28,061	美元 3,873	2024 年 4 月 2 日	法国巴黎银行	8
离岸人民币 7,835,488	美元 1,081,535	2024 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	2,319
离岸人民币 5,931,400	美元 818,713	2024 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	1,756
离岸人民币 10,000	美元 1,380	2024 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	3
美元 99,050	加元 134,409	2024 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	274
美元 1,098	澳元 1,683	2024 年 4 月 3 日	巴克莱银行, 伦敦	0
澳元 76,814	美元 50,219	2024 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	101
美元 63,470	澳元 97,278	2024 年 4 月 5 日	巴克莱银行, 伦敦	0
美元 1,100	澳元 1,686	2024 年 4 月 5 日	巴克莱银行, 伦敦	0
美元 1,097	纽元 1,833	2024 年 4 月 5 日	巴克莱银行, 伦敦	0
离岸人民币 5,717,326	美元 789,229	2024 年 4 月 8 日	法国巴黎银行	1,735
离岸人民币 4,814,116	美元 664,549	2024 年 4 月 8 日	法国巴黎银行	1,461
离岸人民币 194,403	美元 26,836	2024 年 4 月 8 日	法国巴黎银行	59
离岸人民币 60,597	美元 8,352	2024 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	6
美元 371,478	离岸人民币 2,697,110	2024 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	17
美元 139,126	离岸人民币 1,010,121	2024 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	6
美元 13,164	离岸人民币 95,579	2024 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	1
美元 8,589	离岸人民币 62,362	2024 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	0
离岸人民币 12,237,450	美元 1,686,772	2024 年 4 月 9 日	巴克莱银行, 伦敦	822
离岸人民币 7,894,738	美元 1,088,186	2024 年 4 月 9 日	巴克莱银行, 伦敦	530
美元 9,786	离岸人民币 71,051	2024 年 4 月 9 日	巴克莱银行, 伦敦	2
美元 5,059	离岸人民币 36,732	2024 年 4 月 9 日	巴克莱银行, 伦敦	1
离岸人民币 95,000,000	美元 13,369,329	2024 年 4 月 16 日	美国道富银行	277,750
澳元 8,022,932	美元 5,437,978	2024 年 4 月 18 日	美国道富银行	201,426
澳元 5,800,000	美元 3,966,320	2024 年 4 月 18 日	美国道富银行	180,672
澳元 10,000,000	美元 6,623,172	2024 年 4 月 18 日	Citibank N.A., 伦敦	96,192
澳元 3,100,000	美元 2,084,949	2024 年 4 月 18 日	美国道富银行	61,585
澳元 6,000,000	美元 3,953,796	2024 年 4 月 18 日	Citibank N.A., 伦敦	37,608
澳元 10,000,000	美元 6,549,654	2024 年 4 月 18 日	Citibank N.A., 伦敦	22,674
澳元 9,500,000	美元 6,210,316	2024 年 4 月 18 日	Citibank N.A., 伦敦	9,685
巴西雷亚尔 50,257,675	美元 10,085,584	2024 年 4 月 18 日	高盛国际, 伦敦	61,215
离岸人民币 221,711,924	美元 31,241,781	2024 年 4 月 18 日	美国道富银行	686,227
离岸人民币 100,000,000	美元 14,090,163	2024 年 4 月 18 日	渣打银行, 伦敦	308,516
离岸人民币 75,000,000	美元 10,594,037	2024 年 4 月 18 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	257,802
离岸人民币 150,000,000	美元 20,917,223	2024 年 4 月 18 日	美林国际, 伦敦	244,753

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 95,000,000	美元 13,224,777	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	132,213
离岸人民币 95,000,000	美元 13,223,536	2024年4月18日	法国巴黎银行	130,972
离岸人民币 90,000,000	美元 12,533,019	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	129,537
离岸人民币 95,000,000	美元 13,214,818	2024年4月18日	美国道富银行	122,254
离岸人民币 42,000,000	美元 5,901,930	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	113,639
离岸人民币 45,000,000	美元 6,285,022	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	83,281
离岸人民币 50,000,000	美元 6,962,431	2024年4月18日	法国巴黎银行	71,607
离岸人民币 50,000,000	美元 6,961,781	2024年4月18日	法国巴黎银行	70,958
离岸人民币 50,000,000	美元 6,960,207	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	69,384
离岸人民币 46,000,000	美元 6,400,472	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	60,915
离岸人民币 23,000,000	美元 3,214,765	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	44,987
离岸人民币 150,000,000	美元 20,698,126	2024年4月18日	HSBC Bank Plc, 伦敦	25,656
			澳大利亚和新西兰	
			银行集团有限公司	410,736
欧元 21,210,000	美元 23,332,234	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	153,183
欧元 21,200,000	美元 23,063,874	2024年4月18日	法国巴黎银行	42,966
欧元 6,000,000	美元 6,527,124	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	29,885
欧元 4,300,000	美元 4,676,865	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	29,782
欧元 8,000,000	美元 8,675,326	2024年4月18日	美国道富银行	1,982
英镑 7,100,000	美元 8,971,852	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	793,528
印尼盾 562,000,000,000	美元 36,222,777	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	170,023
印尼盾 250,000,000,000	美元 15,930,365	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	73,008
印尼盾 100,000,000,000	美元 6,377,144	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	68,659
印尼盾 100,000,000,000	美元 6,372,796	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	23,731
印尼盾 200,000,000,000	美元 12,632,004	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	19,163
印度卢比 1,070,000,000	美元 12,842,980	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	17,498
印度卢比 1,100,000,000	美元 13,200,861	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	9,246
印度卢比 950,000,000	美元 11,394,877	2024年4月18日	法国巴黎银行	571,167
日元 1,460,000,000	美元 10,241,517	2024年4月18日	法国巴黎银行	341,696
日元 950,000,000	美元 6,634,048	2024年4月18日	法国巴黎银行	226,534
日元 1,000,000,000	美元 6,850,062	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	171,544
日元 445,000,000	美元 3,119,014	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	149,383
日元 470,000,000	美元 3,262,441	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	136,345
日元 370,000,000	美元 2,587,051	2024年4月18日	法国巴黎银行	95,609
日元 950,000,000	美元 6,387,961	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	80,207
日元 1,080,000,000	美元 7,233,617	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	67,652
日元 1,000,000,000	美元 6,691,180	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	174,581
韩元 8,600,000,000	美元 6,568,395	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	136,693
韩元 4,800,000,000	美元 3,705,333	2024年4月18日	美国道富银行	104,003
韩元 9,320,000,000	美元 7,033,113	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	96,547
韩元 8,500,000,000	美元 6,416,014	2024年4月18日	美国道富银行	88,999
韩元 8,000,000,000	美元 6,036,734	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	79,304
韩元 8,500,000,000	美元 6,398,771	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	77,992
韩元 8,200,000,000	美元 6,174,420	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	76,879
韩元 4,200,000,000	美元 3,199,439	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	50,521
韩元 2,100,000,000	美元 1,611,801	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	43,081
韩元 4,500,000,000	美元 3,388,682	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	39,603
韩元 8,600,000,000	美元 6,433,418	2024年4月18日	法国巴黎银行	278,913
马来西亚林吉特 50,670,945	美元 10,996,299	2024年4月18日	法国巴黎银行	176,153
马来西亚林吉特 30,500,000	美元 6,627,193	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	69,227
马来西亚林吉特 31,500,000	美元 6,731,776	2024年4月18日	美国道富银行	586,314
纽元 21,240,255	美元 13,291,406	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	189,740
纽元 10,200,000	美元 6,290,983	2024年4月18日	澳大利亚和新西兰	
			银行集团有限公司	139,052
纽元 5,200,000	美元 3,249,489	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	121,952
纽元 10,300,000	美元 6,283,010	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	103,827
纽元 5,300,000	美元 3,274,080	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	76,364
纽元 6,800,000	美元 4,143,859	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	71,820
纽元 5,400,000	美元 3,301,889	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	71,698
纽元 5,850,000	美元 3,570,939	2024年4月18日	HSBC Bank Plc, 伦敦	52,570
纽元 11,500,000	美元 6,931,421	2024年4月18日	法国巴黎银行	423,758
新加坡元 35,000,000	美元 26,376,694	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	244,417
新加坡元 19,000,000	美元 14,333,154	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	222,480
新加坡元 24,700,000	美元 18,537,837	2024年4月18日	美国道富银行	134,580
新加坡元 12,650,000	美元 9,514,713	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	123,773
新加坡元 18,000,000	美元 13,470,997	2024年4月18日	法国巴黎银行	112,052
新加坡元 17,000,000	美元 12,717,764	2024年4月18日		

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
新加坡元 17,000,000	美元 12,694,070	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	88,358
新加坡元 17,200,000	美元 12,835,898	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	81,883
新加坡元 8,800,000	美元 6,595,762	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	70,453
新加坡元 8,500,000	美元 6,329,515	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	26,659
新加坡元 18,500,000	美元 13,734,500	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	16,519
泰铢 350,000,000	美元 9,808,867	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	204,257
台币 420,000,000	美元 13,740,982	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	592,658
台币 400,000,000	美元 12,806,967	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	284,753
台币 215,000,000	美元 6,944,220	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	213,530
台币 210,000,000	美元 6,779,267	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	205,105
台币 103,000,000	美元 3,418,690	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	194,220
台币 200,000,000	美元 6,417,806	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	156,699
台币 100,000,000	美元 3,229,974	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	99,421
台币 202,000,000	美元 6,416,059	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	92,341
台币 100,000,000	美元 3,216,386	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	85,832
台币 100,000,000	美元 3,201,947	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	71,393
台币 210,000,000	美元 6,640,946	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	66,784
台币 100,000,000	美元 3,173,848	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	43,294
美元 3,149,748	墨西哥比索 55,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	150,961
美元 16,107,373	墨西哥比索 270,000,000	2024年4月18日	法国巴黎银行	96,111
美元 2,906,915	墨西哥比索 50,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	93,730
美元 6,670,580	秘鲁新索尔 25,000,000	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	46,540
美元 13,144,483	印度卢比 1,100,000,000	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	38,880
美元 6,697,206	秘鲁新索尔 25,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	19,914
美元 6,640,074	澳元 10,200,000	2024年4月18日	HSBC Bank Plc, 伦敦	17,446
美元 3,625,209	巴西雷亚尔 18,257,675	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	16,457
美元 6,522,873	澳元 10,000,000	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	4,107
美元 6,524,190	澳元 10,000,000	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	2,790
澳元 148,581	美元 98,163	2024年4月19日	法国巴黎银行	1,182
澳元 322,032	美元 211,332	2024年4月19日	法国巴黎银行	1,137
澳元 310,931	美元 203,333	2024年4月19日	法国巴黎银行	383
澳元 68,595	美元 45,095	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	322
澳元 37,441	美元 24,678	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	240
澳元 20,766	美元 13,756	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	202
澳元 37,134	美元 24,419	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	181
澳元 9,587	美元 6,372	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	115
澳元 11,983	美元 7,928	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	106
澳元 71,919	美元 47,037	2024年4月19日	法国巴黎银行	94
澳元 398,125	美元 259,945	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	82
澳元 20,587	美元 13,517	2024年4月19日	法国巴黎银行	79
澳元 110,541	美元 72,221	2024年4月19日	法国巴黎银行	69
澳元 1,663	美元 1,105	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	20
澳元 1,675	美元 1,110	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	16
澳元 1,657	美元 1,096	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	15
澳元 219,978	美元 143,598	2024年4月19日	法国巴黎银行	14
澳元 1,687	美元 1,109	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	8
澳元 1,687	美元 1,104	2024年4月19日	法国巴黎银行	2
澳元 1,685	美元 1,101	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	1
加元 385,336	美元 285,297	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	478
加元 314,771	美元 232,966	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	305
加元 26,771	美元 19,911	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	123
加元 504,452	美元 372,979	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	116
加元 1,487	美元 1,104	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	5
加元 1,480	美元 1,098	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	4
加元 1,493	美元 1,105	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	2
离岸人民币 12,040,348	美元 1,669,995	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	10,574
离岸人民币 6,549,445	美元 912,780	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	10,124
离岸人民币 5,082,844	美元 706,849	2024年4月19日	法国巴黎银行	6,323
离岸人民币 4,763,690	美元 662,728	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	6,188
离岸人民币 4,473,614	美元 622,373	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	5,812
离岸人民币 18,431,529	美元 2,545,940	2024年4月19日	法国巴黎银行	5,676
离岸人民币 4,288,276	美元 596,336	2024年4月19日	法国巴黎银行	5,319
离岸人民币 4,226,883	美元 587,814	2024年4月19日	法国巴黎银行	5,258
离岸人民币 4,084,780	美元 568,133	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	5,161
离岸人民币 3,320,246	美元 462,680	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	5,078
离岸人民币 4,087,144	美元 568,363	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	5,066

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 2,604,619	美元 363,358	2024年4月19日	法国巴黎银行	4,385
离岸人民币 3,006,679	美元 418,502	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	4,116
离岸人民币 3,172,939	美元 440,768	2024年4月19日	法国巴黎银行	3,468
离岸人民币 2,692,993	美元 374,586	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	3,433
离岸人民币 2,792,371	美元 387,985	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	3,135
离岸人民币 2,270,259	美元 315,999	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	3,108
离岸人民币 2,656,776	美元 369,144	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	2,983
离岸人民币 2,323,875	美元 323,191	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	2,910
离岸人民币 1,562,240	美元 217,726	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	2,415
离岸人民币 1,683,213	美元 234,352	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	2,369
离岸人民币 1,824,573	美元 253,767	2024年4月19日	法国巴黎银行	2,301
离岸人民币 1,799,580	美元 250,315	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	2,294
离岸人民币 1,263,697	美元 176,424	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	2,259
离岸人民币 1,204,290	美元 168,130	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	2,153
离岸人民币 1,487,756	美元 207,014	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	1,969
离岸人民币 1,384,761	美元 192,799	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	1,949
离岸人民币 1,390,492	美元 193,446	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	1,806
离岸人民币 1,195,960	美元 166,309	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	1,480
离岸人民币 1,160,481	美元 161,406	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	1,466
离岸人民币 1,130,919	美元 157,281	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	1,416
离岸人民币 1,088,444	美元 151,359	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	1,348
离岸人民币 896,964	美元 124,884	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	1,262
离岸人民币 1,011,704	美元 140,689	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,254
离岸人民币 924,267	美元 128,550	2024年4月19日	法国巴黎银行	1,166
离岸人民币 3,396,333	美元 469,134	2024年4月19日	法国巴黎银行	1,046
离岸人民币 927,436	美元 128,862	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	1,041
离岸人民币 988,969	美元 137,288	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	987
离岸人民币 2,876,502	美元 397,273	2024年4月19日	法国巴黎银行	829
离岸人民币 527,031	美元 73,442	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	806
离岸人民币 598,264	美元 83,198	2024年4月19日	法国巴黎银行	744
离岸人民币 1,931,620	美元 266,776	2024年4月19日	法国巴黎银行	556
离岸人民币 619,480	美元 85,922	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	544
离岸人民币 360,039	美元 50,098	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	477
离岸人民币 310,559	美元 43,272	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	470
离岸人民币 1,512,934	美元 208,981	2024年4月19日	法国巴黎银行	466
离岸人民币 402,378	美元 55,896	2024年4月19日	法国巴黎银行	440
离岸人民币 244,798	美元 34,151	2024年4月19日	法国巴黎银行	412
离岸人民币 210,950	美元 29,451	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	377
离岸人民币 231,806	美元 32,306	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	358
离岸人民币 279,208	美元 38,831	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	350
离岸人民币 269,233	美元 37,449	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	343
离岸人民币 263,724	美元 36,680	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	333
离岸人民币 247,352	美元 34,418	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	327
离岸人民币 317,984	美元 44,142	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	317
离岸人民币 224,107	美元 31,194	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	307
离岸人民币 156,419	美元 21,714	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	156
离岸人民币 119,673	美元 16,645	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	151
离岸人民币 2,487,883	美元 343,025	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	141
离岸人民币 73,127	美元 10,202	2024年4月19日	法国巴黎银行	123
离岸人民币 106,678	美元 14,819	2024年4月19日	法国巴黎银行	117
离岸人民币 90,157	美元 12,537	2024年4月19日	法国巴黎银行	112
离岸人民币 122,909	美元 17,047	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	108
离岸人民币 91,277	美元 12,660	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	80
离岸人民币 37,068	美元 5,157	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	48
离岸人民币 437,119	美元 60,269	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	25
离岸人民币 432,949	美元 59,694	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	25
离岸人民币 72,839	美元 10,060	2024年4月19日	法国巴黎银行	21
离岸人民币 13,157	美元 1,830	2024年4月19日	法国巴黎银行	17
离岸人民币 7,915	美元 1,105	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	14
离岸人民币 7,915	美元 1,105	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	14
离岸人民币 7,925	美元 1,104	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	12
离岸人民币 7,925	美元 1,104	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	12
离岸人民币 7,925	美元 1,104	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	12
离岸人民币 7,930	美元 1,104	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	11
离岸人民币 7,930	美元 1,104	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	11
离岸人民币 7,939	美元 1,105	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	10

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 7,939	美元 1,105	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 7,939	美元 1,105	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 7,931	美元 1,103	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 7,931	美元 1,103	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 7,931	美元 1,103	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 7,931	美元 1,103	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 7,931	美元 1,103	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 7,931	美元 1,103	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 7,926	美元 1,102	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 7,926	美元 1,102	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 7,926	美元 1,102	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 7,935	美元 1,102	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	8
离岸人民币 7,935	美元 1,102	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	8
离岸人民币 7,935	美元 1,102	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	8
离岸人民币 7,940	美元 1,101	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	7
离岸人民币 7,940	美元 1,101	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	7
离岸人民币 7,940	美元 1,101	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	7
离岸人民币 56,601	美元 7,804	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	3
离岸人民币 7,998	美元 1,105	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	7
离岸人民币 7,998	美元 1,105	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	2
离岸人民币 8,291	美元 1,143	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	2
英镑 39,647	美元 51,083	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	0
英镑 39,804	美元 50,719	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	994
英镑 31,120	美元 39,629	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	432
英镑 31,382	美元 39,861	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	314
英镑 48,057	美元 60,799	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	214
英镑 20,762	美元 26,314	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	85
英镑 1,690	美元 2,153	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	83
英镑 854	美元 1,094	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	18
纽元 584,616	美元 356,528	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	15
纽元 189,998	美元 116,047	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	6,834
纽元 148,463	美元 90,446	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	2,398
纽元 46,344	美元 28,401	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	1,642
纽元 75,862	美元 45,790	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	680
纽元 19,894	美元 12,105	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	412
纽元 15,414	美元 9,416	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	205
纽元 15,798	美元 9,625	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	196
纽元 15,373	美元 9,360	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	175
纽元 82,453	美元 49,443	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	165
纽元 5,461	美元 3,303	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	123
纽元 1,795	美元 1,107	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	37
纽元 1,776	美元 1,096	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	33
纽元 1,784	美元 1,097	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	30
纽元 12,235	美元 7,341	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	33
纽元 1,801	美元 1,098	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	23
纽元 1,807	美元 1,101	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	21
纽元 1,834	美元 1,101	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	20
美元 1,277,230	离岸人民币 9,274,510	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	4
美元 1,143,144	离岸人民币 8,300,856	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	999
美元 964,367	离岸人民币 7,001,940	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	894
美元 215,004	加元 291,746	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	652
美元 930,873	离岸人民币 6,758,749	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	639
美元 260,479	加元 353,171	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	629
美元 104,808	加元 142,404	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	566
美元 134,996	加元 183,223	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	449
美元 255,126	澳元 391,381	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	432
美元 1,181,482	离岸人民币 8,574,825	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	335
美元 62,703	英镑 49,828	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	315
美元 309,456	离岸人民币 2,246,857	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	247
美元 720,556	离岸人民币 5,229,571	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	209
美元 159,279	澳元 244,280	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	192
美元 68,314	加元 92,640	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	167
美元 30,707	英镑 24,338	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	160
美元 14,756	加元 20,000	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	41
美元 11,023	离岸人民币 80,000	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	27
美元 4,794	离岸人民币 34,806	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	3
美元 1,377	离岸人民币 10,000	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	3
			Citibank N.A., 伦敦	1

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 1,321	加元 1,788	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	0
离岸人民币 104,213,790	美元 15,000,000	2024年7月26日	高盛国际, 伦敦	547,074
台币 420,000,000	美元 13,807,705	2024年11月15日	Citibank N.A., 伦敦	346,059
			未实现总收益	15,502,633
离岸人民币 10,000	美元 1,376	2024年4月2日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 8,300,856	美元 1,142,063	2024年4月2日	Citibank N.A., 伦敦	(1,243)
离岸人民币 9,274,510	美元 1,276,022	2024年4月2日	Citibank N.A., 伦敦	(1,388)
美元 208,830	离岸人民币 1,512,934	2024年4月2日	法国巴黎银行	(448)
美元 468,795	离岸人民币 3,396,333	2024年4月2日	法国巴黎银行	(1,006)
美元 2,544,099	离岸人民币 18,431,529	2024年4月2日	法国巴黎银行	(5,461)
美元 10,053	离岸人民币 72,839	2024年4月3日	法国巴黎银行	(20)
美元 60,245	离岸人民币 437,119	2024年4月3日	巴克莱银行, 伦敦	(38)
美元 59,670	离岸人民币 432,949	2024年4月3日	巴克莱银行, 伦敦	(38)
美元 47,017	澳元 71,919	2024年4月3日	法国巴黎银行	(96)
美元 342,885	离岸人民币 2,487,883	2024年4月3日	巴克莱银行, 伦敦	(218)
美元 266,592	离岸人民币 1,931,620	2024年4月3日	法国巴黎银行	(542)
美元 397,000	离岸人民币 2,876,502	2024年4月3日	法国巴黎银行	(807)
美元 7,341	纽元 12,235	2024年4月5日	巴克莱银行, 伦敦	(23)
美元 1,143	离岸人民币 8,291	2024年4月8日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
美元 7,802	离岸人民币 56,601	2024年4月8日	巴克莱银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 80,000	美元 11,019	2024年4月9日	巴克莱银行, 伦敦	(3)
离岸人民币 5,229,571	美元 720,312	2024年4月10日	巴克莱银行, 伦敦	(192)
离岸人民币 8,574,825	美元 1,181,081	2024年4月10日	巴克莱银行, 伦敦	(315)
美元 13,286,604	离岸人民币 95,000,000	2024年4月16日	美林国际, 伦敦	(195,025)
澳元 12,600,000	美元 8,216,309	2024年4月18日	澳大利亚和新西兰 银行集团有限公司	(7,686)
离岸人民币 50,000,000	美元 6,889,624	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	(1,199)
日元 520,000,000	美元 3,438,078	2024年4月18日	法国巴黎银行	(6,156)
日元 1,250,000,000	美元 8,268,075	2024年4月18日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(11,335)
墨西哥比索 57,000,000	美元 3,329,248	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(91,487)
墨西哥比索 110,000,000	美元 6,460,771	2024年4月18日	法国巴黎银行	(140,649)
墨西哥比索 110,000,000	美元 6,437,764	2024年4月18日	法国巴黎银行	(163,656)
墨西哥比索 320,922,420	美元 19,027,447	2024年4月18日	美国道富银行	(232,039)
墨西哥比索 380,000,000	美元 21,936,557	2024年4月18日	法国巴黎银行	(868,347)
马来西亚林吉特 43,000,000	美元 9,063,126	2024年4月18日	法国巴黎银行	(31,783)
马来西亚林吉特 26,000,000	美元 5,460,005	2024年4月18日	法国巴黎银行	(39,242)
秘鲁新索尔 50,000,000	美元 13,199,578	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(234,663)
台币 110,000,000	美元 3,434,859	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	(8,749)
台币 220,000,000	美元 6,870,062	2024年4月18日	美国道富银行	(17,156)
美元 11,101,646	澳元 17,000,000	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	(5,780)
美元 8,043,179	马来西亚林吉特 38,000,000	2024年4月18日	法国巴黎银行	(5,818)
美元 6,420,642	印度卢比 535,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(8,734)
美元 3,142,123	澳元 4,800,000	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	(9,173)
美元 7,162,735	日元 1,080,000,000	2024年4月18日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(9,325)
美元 3,355,580	韩元 4,500,000,000	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	(9,979)
美元 7,416,826	马来西亚林吉特 35,000,000	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	(13,993)
美元 6,319,115	印尼盾 100,000,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(14,979)
美元 6,543,080	澳元 10,000,000	2024年4月18日	澳大利亚和新西兰 银行集团有限公司	(16,100)
美元 6,429,578	印度卢比 535,000,000	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	(17,669)
美元 3,355,707	新加坡元 4,500,000	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	(18,901)
美元 6,072,564	欧元 5,600,000	2024年4月18日	美国道富银行	(20,683)
美元 3,440,641	韩元 4,600,000,000	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	(20,694)
美元 3,677,584	澳元 5,600,000	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	(22,476)
美元 3,117,782	英镑 2,450,000	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	(22,545)
美元 6,874,214	纽元 11,450,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(25,270)
美元 3,275,103	欧元 3,000,000	2024年4月18日	法国巴黎银行	(33,024)
美元 3,018,866	离岸人民币 21,650,000	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	(35,140)
美元 3,299,105	澳元 5,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(35,615)
美元 3,234,303	澳元 4,900,000	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	(36,083)
美元 6,117,997	新加坡元 8,200,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(37,595)
美元 3,236,782	韩元 4,300,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(39,875)
美元 7,153,588	菲律宾比索 400,000,000	2024年4月18日	美国道富银行	(39,939)
美元 6,534,911	印尼盾 103,000,000,000	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	(41,650)

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 5,859,167	马来西亚林吉 27,500,000	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	(42,656)
美元 13,825,140	离岸人民币 100,000,000	2024年4月18日	法国巴黎银行	(43,493)
美元 6,350,565	印尼盾 100,000,000,000	2024年4月18日	美国道富银行	(46,428)
美元 3,179,044	台币 100,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(48,490)
美元 6,102,600	印尼盾 96,000,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(50,629)
美元 7,125,247	秘鲁新索尔 26,300,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(58,837)
美元 13,406,713	新加坡元 18,000,000	2024年4月18日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(59,488)
美元 6,606,259	韩元 8,800,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(63,752)
美元 6,390,524	台币 202,000,000	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	(66,806)
美元 6,389,969	韩元 8,500,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(70,501)
美元 12,677,334	新加坡元 17,000,000	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	(71,622)
美元 6,066,819	离岸人民币 43,500,000	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	(71,802)
美元 6,392,419	韩元 8,500,000,000	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	(72,952)
美元 6,395,065	韩元 8,500,000,000	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	(75,597)
美元 6,368,119	日元 950,000,000	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	(75,767)
美元 3,363,423	台币 105,000,000	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	(76,341)
美元 13,573,864	新加坡元 18,200,000	2024年4月18日	法国巴黎银行	(78,337)
美元 6,341,777	台币 200,000,000	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	(80,670)
美元 6,065,030	纽元 10,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(83,420)
美元 3,194,685	纽元 5,200,000	2024年4月18日	美国道富银行	(84,248)
美元 6,468,763	巴西雷亚尔 32,000,000	2024年4月18日	美国道富银行	(86,060)
美元 6,629,951	韩元 8,800,000,000	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	(87,443)
美元 6,393,563	印尼盾 100,000,000,000	2024年4月18日	澳大利亚和新西兰 银行集团有限公司	(89,427)
美元 6,410,208	韩元 8,500,000,000	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	(90,740)
美元 6,766,297	新加坡元 9,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(92,684)
美元 6,355,198	台币 200,000,000	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	(94,091)
美元 3,070,955	台币 95,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(96,929)
美元 3,230,602	澳元 4,800,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(97,651)
美元 3,905,402	马来西亚林吉 18,000,000	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	(98,231)
美元 3,450,576	韩元 4,500,000,000	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	(104,976)
美元 3,550,059	台币 110,000,000	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	(106,450)
美元 5,741,663	台币 180,000,000	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	(106,667)
美元 3,424,329	日元 500,000,000	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	(112,565)
美元 13,207,044	离岸人民币 95,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(114,480)
美元 6,690,455	台币 210,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(116,293)
美元 8,221,141	韩元 10,900,000,000	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	(117,353)
美元 9,723,032	泰铢 350,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(118,422)
美元 6,708,248	纽元 11,000,000	2024年4月18日	澳大利亚和新西兰 银行集团有限公司	(128,477)
美元 6,229,885	纽元 10,200,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(128,642)
美元 6,658,636	纽元 10,900,000	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	(138,681)
美元 3,493,364	纽元 5,600,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(143,662)
美元 13,125,289	新加坡元 17,500,000	2024年4月18日	法国巴黎银行	(148,821)
美元 13,249,818	离岸人民币 95,000,000	2024年4月18日	法国巴黎银行	(157,253)
美元 7,046,562	台币 220,000,000	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	(159,344)
美元 13,128,898	欧元 12,000,000	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	(160,582)
美元 16,678,337	印尼盾 262,000,000,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(161,499)
美元 3,369,167	韩元 4,300,000,000	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	(172,259)
美元 13,727,125	印尼盾 215,000,000,000	2024年4月18日	美国道富银行	(173,231)
美元 6,805,064	日元 1,000,000,000	2024年4月18日	法国巴黎银行	(181,536)
美元 10,358,333	纽元 17,000,000	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	(189,596)
美元 19,106,791	新加坡元 25,500,000	2024年4月18日	法国巴黎银行	(198,223)
美元 19,777,752	离岸人民币 142,000,000	2024年4月18日	美国道富银行	(207,813)
美元 11,555,857	欧元 10,500,000	2024年4月18日	美林国际, 伦敦	(208,580)
美元 6,839,853	日元 1,000,000,000	2024年4月18日	澳大利亚和新西兰 银行集团有限公司	(216,325)
美元 6,317,210	日元 920,000,000	2024年4月18日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(223,565)
美元 12,912,025	离岸人民币 92,000,000	2024年4月18日	美国道富银行	(232,911)
美元 26,207,393	新加坡元 35,000,000	2024年4月18日	法国巴黎银行	(254,457)
美元 7,015,964	台币 215,000,000	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	(285,274)
美元 18,216,212	离岸人民币 130,000,000	2024年4月18日	渣打银行, 伦敦	(300,072)
美元 13,692,036	马来西亚林吉特 63,170,945	2024年4月18日	法国巴黎银行	(330,781)
美元 21,071,423	离岸人民币 150,000,000	2024年4月18日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(398,953)
美元 17,167,072	台币 523,000,000	2024年4月18日	Citibank N.A., 伦敦	(794,277)
美元 16,278,452	日元 2,275,000,000	2024年4月18日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,209,927)
美元 59,592,364	新加坡元 78,700,000	2024年4月18日	高盛国际, 伦敦	(1,235,333)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
澳元 1,686	美元 1,100	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
澳元 1,683	美元 1,098	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
澳元 1,674	美元 1,092	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
澳元 97,278	美元 63,495	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
澳元 1,694	美元 1,105	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
澳元 55,682	美元 36,329	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(15)
澳元 159,449	美元 103,805	2024年4月19日	摩根士丹利国际股份有限公司	(270)
加元 1,492	美元 1,103	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
加元 1,491	美元 1,100	2024年4月19日	法国巴黎银行	(2)
加元 1,489	美元 1,096	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
加元 39,022	美元 28,837	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(6)
加元 16,589	美元 12,235	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(27)
加元 33,664	美元 24,824	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(58)
加元 240,217	美元 177,385	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(170)
加元 275,568	美元 203,471	2024年4月19日	高盛国际, 伦敦	(213)
加元 134,409	美元 99,070	2024年4月19日	法国巴黎银行	(278)
加元 117,291	美元 86,414	2024年4月19日	法国巴黎银行	(282)
加元 577,944	美元 426,735	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(449)
离岸人民币 7,981	美元 1,100	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
离岸人民币 7,981	美元 1,100	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
离岸人民币 7,946	美元 1,094	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 7,946	美元 1,094	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 7,946	美元 1,094	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 36,732	美元 5,061	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
离岸人民币 20,019	美元 2,757	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 71,051	美元 9,789	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(3)
离岸人民币 62,362	美元 8,592	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(3)
离岸人民币 95,579	美元 13,168	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 144,186	美元 19,854	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(18)
离岸人民币 1,010,121	美元 139,169	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(48)
离岸人民币 2,697,110	美元 371,593	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(127)
离岸人民币 1,651,305	美元 227,382	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(204)
离岸人民币 2,154,457	美元 296,665	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(266)
纽元 1,833	美元 1,097	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
美元 1,381	离岸人民币 10,000	2024年4月19日	法国巴黎银行	(3)
美元 1,270	澳元 1,941	2024年4月19日	法国巴黎银行	(3)
美元 8,356	离岸人民币 60,597	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(4)
美元 3,876	离岸人民币 28,061	2024年4月19日	法国巴黎银行	(8)
美元 4,881	离岸人民币 35,351	2024年4月19日	摩根士丹利国际股份有限公司	(9)
美元 1,198	离岸人民币 8,613	2024年4月19日	美国道富银行	(11)
美元 1,395	离岸人民币 10,000	2024年4月19日	法国巴黎银行	(17)
美元 1,518	澳元 2,289	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(24)
美元 1,763	纽元 2,898	2024年4月19日	法国巴黎银行	(30)
美元 5,223	加元 7,022	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(32)
美元 3,947	离岸人民币 28,388	2024年4月19日	高盛国际, 伦敦	(35)
美元 4,043	离岸人民币 29,077	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(36)
美元 1,944	英镑 1,509	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(38)
美元 4,663	离岸人民币 33,525	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(42)
美元 26,850	离岸人民币 194,403	2024年4月19日	法国巴黎银行	(57)
美元 10,699	离岸人民币 77,067	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(78)
美元 50,240	澳元 76,814	2024年4月19日	法国巴黎银行	(102)
美元 126,917	澳元 194,268	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	(115)
美元 38,923	英镑 30,717	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(115)
美元 20,387	澳元 31,010	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(146)
美元 13,691	离岸人民币 98,233	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(153)
美元 20,443	离岸人民币 147,000	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(183)
美元 54,236	纽元 90,338	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	(199)
美元 18,734	离岸人民币 134,408	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(210)
美元 27,266	离岸人民币 196,000	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(253)
美元 163,152	离岸人民币 1,181,558	2024年4月19日	摩根士丹利国际股份有限公司	(308)
美元 40,842	离岸人民币 294,000	2024年4月19日	法国巴黎银行	(323)
美元 18,674	澳元 28,093	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(337)
美元 37,651	英镑 29,511	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	(369)
美元 132,623	加元 178,906	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(386)
美元 110,221	纽元 183,559	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	(423)
美元 121,324	加元 163,443	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	(515)
美元 18,138	纽元 29,407	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(548)

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 1,088,620	离岸人民币 7,894,738	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(554)
美元 39,247	英镑 30,545	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	(657)
美元 1,687,445	离岸人民币 12,237,450	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(859)
美元 472,727	离岸人民币 3,423,525	2024年4月19日	摩根士丹利国际股份有限公司	(891)
美元 488,048	离岸人民币 3,534,478	2024年4月19日	摩根士丹利国际股份有限公司	(920)
美元 129,173	澳元 196,427	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(962)
美元 53,026	欧元 86,907	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(1,042)
美元 31,256	欧元 50,472	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(1,065)
美元 138,483	离岸人民币 995,945	2024年4月19日	高盛国际, 伦敦	(1,221)
美元 69,533	欧元 114,184	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	(1,232)
美元 143,304	离岸人民币 1,030,310	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,305)
美元 664,899	离岸人民币 4,814,116	2024年4月19日	法国巴黎银行	(1,409)
美元 133,626	离岸人民币 958,734	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(1,491)
美元 113,396	澳元 171,239	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	(1,625)
美元 789,645	离岸人民币 5,717,326	2024年4月19日	法国巴黎银行	(1,673)
美元 819,329	离岸人民币 5,931,400	2024年4月19日	法国巴黎银行	(1,853)
美元 68,379	欧元 110,986	2024年4月19日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,992)
美元 156,679	澳元 236,897	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2,052)
美元 73,918	欧元 119,629	2024年4月19日	摩根士丹利国际股份有限公司	(2,361)
美元 1,082,348	离岸人民币 7,835,488	2024年4月19日	法国巴黎银行	(2,448)
美元 284,878	离岸人民币 2,048,200	2024年4月19日	法国巴黎银行	(2,592)
美元 431,103	离岸人民币 3,099,418	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(3,936)
美元 432,937	离岸人民币 3,110,399	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(4,257)
美元 468,025	离岸人民币 3,364,948	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(4,262)
美元 507,879	离岸人民币 3,647,592	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(5,162)
美元 605,176	离岸人民币 4,352,309	2024年4月19日	高盛国际, 伦敦	(5,334)
美元 593,650	离岸人民币 4,268,147	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(5,406)
美元 600,048	离岸人民币 4,314,354	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(5,436)
美元 735,615	离岸人民币 5,290,401	2024年4月19日	高盛国际, 伦敦	(6,483)
美元 842,280	离岸人民币 6,056,666	2024年4月19日	法国巴黎银行	(7,540)
美元 951,572	离岸人民币 6,841,558	2024年4月19日	法国巴黎银行	(8,657)
美元 990,642	离岸人民币 7,121,279	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(9,175)
美元 1,340,509	离岸人民币 9,655,918	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(9,714)
美元 1,118,171	离岸人民币 8,039,786	2024年4月19日	法国巴黎银行	(10,114)
美元 1,320,865	离岸人民币 9,507,755	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(10,490)
美元 944,069	离岸人民币 6,767,056	2024年4月19日	法国巴黎银行	(11,422)
美元 1,337,614	离岸人民币 9,617,093	2024年4月19日	法国巴黎银行	(12,170)
美元 1,090,311	离岸人民币 7,822,726	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(12,170)
美元 1,353,478	离岸人民币 9,729,550	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(12,536)
美元 1,039,588	离岸人民币 7,445,853	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(13,388)
美元 1,498,576	离岸人民币 10,775,709	2024年4月19日	法国巴黎银行	(13,450)
美元 1,420,511	离岸人民币 10,205,530	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(13,968)
美元 2,201,584	离岸人民币 15,872,062	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(14,070)
美元 1,164,782	离岸人民币 8,349,121	2024年4月19日	法国巴黎银行	(14,092)
美元 1,482,227	离岸人民币 10,647,970	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(14,706)
美元 1,716,284	离岸人民币 12,326,357	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(17,445)
美元 1,958,799	离岸人民币 14,085,436	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(17,521)
美元 1,713,262	离岸人民币 12,290,887	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(19,312)
美元 2,690,316	离岸人民币 19,378,815	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(19,495)
美元 1,898,418	离岸人民币 13,620,707	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(21,189)
美元 2,522,425	离岸人民币 18,136,897	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(22,768)
美元 2,763,086	离岸人民币 19,865,249	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(25,224)
美元 3,908,840	离岸人民币 28,137,555	2024年4月19日	法国巴黎银行	(30,875)
美元 4,786,061	离岸人民币 34,414,781	2024年4月19日	法国巴黎银行	(42,958)
美元 4,960,407	离岸人民币 35,662,921	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(45,284)
美元 4,590,060	离岸人民币 32,931,895	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(51,331)
美元 8,602,812	离岸人民币 62,021,585	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(54,893)
美元 15,817,564	英镑 12,403,186	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	(147,763)
美元 15,913,742	离岸人民币 114,320,218	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(157,939)
美元 54,677,114	加元 73,756,534	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(160,360)
美元 13,331,772	离岸人民币 95,485,987	2024年4月19日	Citibank N.A., 伦敦	(171,733)
美元 56,994,603	离岸人民币 409,839,814	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(509,795)
美元 64,905,325	澳元 98,299,014	2024年4月19日	美林国际, 伦敦	(743,888)
美元 28,367,260	欧元 46,065,546	2024年4月19日	巴克莱银行, 伦敦	(812,647)
美元 189,303,490	离岸人民币 1,361,253,567	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,693,249)
美元 242,548,981	离岸人民币 1,744,134,065	2024年4月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2,169,510)
美元 14,663,748	离岸人民币 104,213,790	2024年7月26日	渣打银行, 伦敦	(210,822)

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 3,143,922	印尼盾 50,000,000,000	2024 年 7 月 30 日	渣打银行, 伦敦	(763)
菲律宾比索 250,000,000	美元 4,417,898	2024 年 7 月 31 日	Citibank N.A., 伦敦	(20,891)
美元 13,816,244	台币 420,000,000	2024 年 11 月 15 日	高盛国际, 伦敦	(354,599)
			未实现总亏损	<u>(21,582,396)</u>
			未实现净亏损	<u>(6,079,763)</u>

(c) 期货

以下为于二零二四年三月三十一日未平仓之期货合约:

	标的资产	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
于 2024 年 3 月 31 日			
US Ultra Bond (CBT) 18/06/2024	30 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	549,844
US 10yr Note (CBT) 18/06/2024	10 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	266,156
US 2yr Note (CBT) 28/06/2024	2 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	89,500
US 5yr Note (CBT) 28/06/2024	5 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	18,125
		未实现总收益	<u>923,625</u>
JPN 10Y Bond (OSE) 13/06/2024	10 年期日本国债	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	(118,801)
		未实现总亏损	<u>(118,801)</u>
		未实现净收益	<u>804,824</u>

(d) 利率掉期

以下为于二零二四年三月三十一日未平仓之利率掉期合约:

	标的资产	交易对手	公平值 美元
于 2024 年 3 月 31 日			
(D) Interest Rate Swap ~619~ 15 38,000,000,000.00 KRW 22/03/2024 19/06/2029	KRW/CD/91D/Reuters	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	7,226
		总金融资产	<u>7,226</u>
(D) Interest Rate Swap ~619~ 13 38,000,000,000.00 KRW 13/03/2024 13/03/2029	KRW/CD/91D/Reuters	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	(72,824)
		总金融负债	<u>(72,824)</u>
		净金融负债	<u>(65,598)</u>

抵押品持有情况

于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

抵押品提供方	抵押品的性质	到期期限	计价货币	抵押品所涵盖 资产净值百分比	抵押品价值 美元
美林国际, 伦敦	现金	不适用	美元	0.1	833,071
渣打银行, 伦敦	现金	不适用	美元	0.1	510,000
				<u>0.2</u>	<u>1,343,071</u>

现金抵押品再投资详情

截至二零二四年三月三十一日止期间, 未进行现金抵押品再投资。

托管/保管安排

现金抵押品的托管机构	收到/持有的抵押品金额 31.3.2024 美元	计划下提供的抵押品所占比例 31.3.2024 百分比
隔离账户 香港上海汇丰银行有限公司	<u>1,343,071</u>	<u>100.0</u>

财务状况表

于二零二四年三月三十一日 (未经审计)

	31.3.2024 美元	30.9.2023 美元
资产		
流动资产		
银行现金	25,082,277	24,735,540
现金抵押品	1,394,971	485,000
应收经纪款项	6,657,108	2,685,949
分配应收款项	11,826,269	2,507,017
保证金	7,082,710	3,604,964
衍生性产品	16,433,484	6,774,766
投资	1,382,960,052	1,375,968,393
股息及其他应收款项	477,056	442,009
总资产	<u>1,451,913,927</u>	<u>1,417,203,638</u>
负债		
流动负债		
应付经纪款项	31,164,265	12,505,661
赎回应付款项	10,276,207	7,943,307
应付收益分配 [附注 6]	4,907,376	5,768,606
衍生性产品	21,788,907	5,073,759
其他应付款项	1,378,701	1,610,737
总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)	<u>69,515,456</u>	<u>32,902,070</u>
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	<u>1,382,398,471</u>	<u>1,384,301,568</u>

综合收益表

截至二零二四年三月三十一日止期间 (未经审计)

	1.10.2023 至 31.3.2024 美元	1.10.2022 至 31.3.2023 美元
收入		
投资及衍生性产品净收益 [附注 4]	91,788,310	95,725,146
股息收入	1,866,027	-
存款利息	220,679	779,259
汇兑净亏损	(1,088,904)	(2,556,316)
其他收入	20,541	11,041
	<u>92,806,653</u>	<u>93,959,130</u>
支出		
管理费用 [附注 5(a)]	6,572,661	7,041,378
受托人费用 [附注 5(b)]	173,428	185,340
托管费用及银行费用 [附注 5(a), 5(b)]	144,659	138,542
交易成本 [附注 5(b)]	59,640	63,523
核数师酬金	53,056	4,616
基金注册登记机构费用 [附注 5(a)]	49,519	47,541
法律及专业服务费	14,062	9,258
估值费用 [附注 5(a)]	8,540	8,610
印刷及出版支出	4,976	2,246
其他经营费用	5,522	3,530
	<u>7,086,063</u>	<u>7,504,584</u>
净经营利润	<u>85,720,590</u>	<u>86,454,546</u>
财务成本		
收益分配 [附注 6]	(30,749,848)	(33,281,863)
利息支出 [附注 5(b)]	-	(61)
	<u>(30,749,848)</u>	<u>(33,281,924)</u>
除税前利润	<u>54,970,742</u>	<u>53,172,622</u>
税项	(225,155)	(463,572)
可赎回份额持有人应占净资产 及总综合收益之增加	<u>54,745,587</u>	<u>52,709,050</u>

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

	1.10.2023 至 31.3.2024 美元	1.10.2022 至 31.3.2023 美元
期初可赎回份额持有人应占净资产	1,384,301,568	1,361,534,429
分配可赎回份额 [附注 3]	238,543,351	418,322,895
赎回可赎回份额 [附注 3]	(295,192,035)	(201,525,894)
净(赎回) / 分配	(56,648,684)	216,797,001
	1,327,652,884	1,578,331,430
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加	54,745,587	52,709,050
期末可赎回份额持有人应占净资产	1,382,398,471	1,631,040,480

现金流量表
截至二零二四年三月三十一日止期间 (未经审计)

	1.10.2023 至 31.3.2024 美元	1.10.2022 至 31.3.2023 美元
经营业务		
购入投资及衍生性产品	(1,635,438,258)	(1,141,253,629)
出售投资及衍生性产品所得款项	1,741,909,825	1,012,048,349
已收股息	1,866,027	-
已收利息	220,679	778,665
已付交易成本	(62,365)	(65,434)
已付基金注册登记机构费用	(102,244)	(101,624)
已付受托人费用	(175,985)	(181,285)
已付税项	(225,155)	(463,572)
现金抵押品之(增加) / 减少	(909,971)	3,274,748
保证金之(增加) / 减少	(3,477,746)	20,318
已付管理费用	(6,671,761)	(6,858,322)
其他	(1,427,602)	(3,153,900)
经营业务所产生 / (运用) 之现金净额	95,505,444	(135,955,686)
融资活动		
已付利息	-	(61)
分配可赎回份额所得款项	229,224,099	404,678,391
赎回可赎回份额付款	(292,859,135)	(210,143,890)
已付收益分配	(31,611,078)	(33,896,723)
融资活动所(运用) / 产生之现金净额	(95,246,114)	160,637,717
现金及现金等价物之增加	295,330	24,682,031
期初现金及现金等价物	24,735,540	110,369,125
现金及现金等价物之汇兑收益	87,407	370,284
期末现金及现金等价物	25,082,277	135,421,440
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	25,082,277	135,421,440

财务报表之附注

1 本基金

摩根亚洲总收益债券基金（“本基金”）根据二零零四年十一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。

本基金之投资目标为通过一个主要投资（即至少为资产净值总额的 70%）于亚洲债券及其他债务证券之主动管理组合，致力提供具竞争力的总回报（包括资本增长及定息收益）。

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

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

2 主要会计政策

(a) 中期财务报表会计政策

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

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公允价值为负数的衍生性产品合约列示为按公允价值透过损益列账的负债。

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。

确认、取消确认及计量

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

公允价值估计

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

债务证券和货币市场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。

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

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

结构性主体

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

(c) 外币折算

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

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

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

(d) 分配份额所得款项及赎回份额支付款项

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

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

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

1.10.2023 至 31.3.2024

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (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
已发行份额数目:					
期初	19,098,165.720	13,957,815.202	1,756,326.936	298,113,944.487	8,681,253.030
总分配	851,230.893	535,650.417	273,292.000	10,528,691.757	589,895.021
总赎回	(4,491,856.826)	(3,196,533.456)	(186,850.100)	(63,773,161.979)	(2,032,096.128)
期末	15,457,539.787	11,296,932.163	1,842,768.836	244,869,474.265	7,239,051.923
	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	人民币对冲类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	123,401,721.060	41,841,452.530	10,230,867.790	2,019,087.710	4,469,155.559
总分配	71,723,490.710	54,032,277.310	622,519.020	2,480,677.390	376,518.475
总赎回	(42,120,449.090)	(7,524,096.390)	(1,181,369.460)	(187,629.940)	(3,726,411.616)
期末	153,004,762.680	88,349,633.450	9,672,017.350	4,312,135.160	1,119,262.418

1.10.2023 至 31.3.2024

	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:			
期初	294,546,700.947	1,090,950.638	42,825,272.750
总分配 总赎回	8,894,339.001 (43,081,465.370)	272,996.029 (436,053.548)	1,472,682.062 (7,577,458.978)
期末	<u>260,359,574.578</u>	<u>927,893.119</u>	<u>36,720,495.834</u>

1.10.2022 至 31.3.2023

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (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
已发行份额数目:					
期初	16,616,653.699	12,215,191.070	830,208.683	293,204,611.211	7,329,451.810
总分配 总赎回	2,950,992.717 (2,996,308.965)	2,325,006.595 (1,913,233.033)	593,582.123 (42,918.419)	59,508,058.935 (46,111,723.193)	2,031,956.677 (987,190.829)
期末	<u>16,571,337.451</u>	<u>12,626,964.632</u>	<u>1,380,872.387</u>	<u>306,600,946.953</u>	<u>8,374,217.658</u>

	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	人民币对冲类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	38,776,163.540	49,195,372.500	12,999,636.350	2,370,246.030	949,029.054
总分配 总赎回	140,498,633.550 (14,286,624.550)	666,348.320 (4,422,027.840)	381,347.940 (1,493,310.880)	18,188.480 (183,241.530)	224,707.769 (203,689.900)
期末	<u>164,988,172.540</u>	<u>45,439,692.980</u>	<u>11,887,673.410</u>	<u>2,205,192.980</u>	<u>970,046.923</u>

	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:			
期初	344,611,366.002	950,698.459	44,993,626.466
总分配 总赎回	21,972,175.022 (46,512,647.841)	38,483.902 (62,416.089)	6,968,839.003 (5,467,774.127)
期末	<u>320,070,893.183</u>	<u>926,766.272</u>	<u>46,494,691.342</u>

31.3.2024

	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	英镑对冲类别 (每月派息) 英镑	港元类别 (每月派息) 港元	纽元对冲类别 (每月派息) 纽元
可赎回份额持有人应占 净资产	97,415,011	72,205,990	12,298,704	1,681,929,339	45,408,047
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	6.30	6.39	6.67	6.87	6.27
	PRC 人民币对冲 份额 (累计) 人民币	PRC 人民币对冲 份额 (每月派息) 人民币	PRC 美元份额 (累计) 美元	PRC 美元份额 (每月派息) 美元	人民币对冲类别 (累计) 人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	1,823,173,220	624,478,649	104,562,399	30,753,681	15,589,176
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	11.92	7.07	10.81	7.13	13.93
	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	美元类别 (累计) 美元	美元类别 (每月派息) 美元		
可赎回份额持有人应占 净资产	1,703,291,152	11,231,325	287,468,774		
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	6.54	12.10	7.83		

30.9.2023

	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	英镑对冲类别 (每月派息) 英镑	港元类别 (每月派息) 港元	纽元对冲类别 (每月派息) 纽元
可赎回份额持有人应占 净资产	116,529,684	86,315,208	11,342,201	1,980,906,422	52,716,264
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	6.10	6.18	6.46	6.64	6.07

30.9.2023

	PRC 人民币对冲 份额 (累计) 人民币	PRC 人民币对冲 份额 (每月派息) 人民币	PRC 美元份额 (累计) 美元	PRC 美元份额 (每月派息) 美元	人民币对冲类别 (累计) 人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	<u>1,389,825,131</u>	<u>285,946,232</u>	<u>103,363,951</u>	<u>13,922,104</u>	<u>52,730,828</u>
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	<u>11.26</u>	<u>6.83</u>	<u>10.10</u>	<u>6.90</u>	<u>11.80</u>
	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	美元类别 (累计) 美元	美元类别 (累计) 美元	美元类别 (每月派息) 美元	
可赎回份额持有人应占 净资产	<u>1,863,716,717</u>	<u>12,341,257</u>	<u>324,128,294</u>		
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	<u>6.33</u>	<u>11.31</u>	<u>7.57</u>		

4 投资及衍生性产品净收益

	1.10.2023 至 31.3.2024 美元	1.10.2022 至 31.3.2023 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益/亏损之变动	94,073,705	132,067,563
投资及衍生性产品销售之实现亏损	(2,285,395)	(36,342,417)
	<u>91,788,310</u>	<u>95,725,146</u>

5 与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之交易

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

	1.10.2023 至 31.3.2024 美元	1.10.2022 至 31.3.2023 美元
管理费用	6,572,661	7,041,378
基金注册登记机构费用	49,519	47,541
托管费用及银行费用	11,100	11,480
估值费用	8,540	8,610
	<u>6,641,820</u>	<u>7,109,009</u>

(b) 截至二零二四年及二零二三年三月三十一日止期间，已付受托人汇丰机构信托服务（亚洲）有限公司及其关联人士的金额列示如下：

	1.10.2023 至 31.3.2024 美元	1.10.2022 至 31.3.2023 美元
受托人费用	173,428	185,340
托管费用及银行费用	112,802	109,318
交易成本	11,795	7,914
利息支出	-	61

6 收益分配

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

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
<u>1.10.2023 至 31.3.2024</u>					
澳元对冲类别 (每月派息)	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	澳元 0.0285	19,079,707.027	(344,289)
加元对冲类别 (每月派息)	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	加元 0.0332	13,421,046.121	(320,964)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	英镑 0.0364	1,775,966.701	(78,444)
港元类别 (每月派息)	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	港元 0.0386	286,193,667.797	(1,411,839)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	纽元 0.0351	8,375,319.424	(170,990)
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 0.0331	41,395,671.400	(186,623)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	美元 0.0400	1,963,240.930	(78,530)
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 0.0306	289,613,393.950	(1,207,043)
美元类别 (每月派息)	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	美元 0.0440	42,054,795.563	(1,850,409)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	澳元 0.0294	17,983,177.047	(350,558)
加元对冲类别 (每月派息)	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	加元 0.0334	12,924,380.802	(318,379)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	英镑 0.0364	1,831,560.472	(84,399)
港元类别 (每月派息)	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	港元 0.0384	274,078,481.908	(1,347,530)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	纽元 0.0348	8,012,008.442	(172,212)
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 0.0265	41,103,943.900	(152,535)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	美元 0.0401	1,940,841.620	(77,828)
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 0.0244	286,400,645.833	(978,599)
美元类别 (每月派息)	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	美元 0.0440	41,153,915.390	(1,810,770)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	澳元 0.0288	17,664,887.867	(347,144)
加元对冲类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	加元 0.0330	12,137,795.820	(303,767)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	英镑 0.0357	1,813,188.634	(82,519)
港元类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	港元 0.0385	266,288,877.038	(1,312,935)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	纽元 0.0345	7,774,798.117	(169,830)
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 0.0239	40,726,636.420	(136,697)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	美元 0.0401	1,895,299.660	(76,001)
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 0.0221	283,260,423.084	(879,147)
美元类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	美元 0.0440	40,500,343.991	(1,782,013)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	澳元 0.0289	16,688,076.003	(318,815)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	加元 0.0330	11,927,494.959	(294,605)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	英镑 0.0362	1,875,260.099	(86,447)
港元类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	港元 0.0386	253,089,752.210	(1,249,706)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 9 日	纽元 0.0345	7,443,473.484	(158,073)
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 0.0236	45,103,173.600	(148,380)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	美元 0.0401	2,261,777.670	(90,697)
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 0.0218	271,154,596.012	(824,006)
美元类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	美元 0.0440	37,817,695.784	(1,663,977)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	澳元 0.0296	15,614,009.806	(300,945)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	加元 0.0335	11,542,188.267	(285,076)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	英镑 0.0363	1,858,345.040	(85,331)
港元类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	港元 0.0386	250,369,586.699	(1,234,450)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	纽元 0.0352	7,341,003.261	(157,432)
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 0.0272	58,133,166.730	(219,454)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	美元 0.0401	3,053,355.800	(122,440)
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 0.0251	267,202,836.845	(930,820)
美元类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	美元 0.0440	37,268,781.105	(1,639,824)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	澳元 0.0294	15,457,539.787	(296,484)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
加元对冲类别 (每月派息)	2024年3月28日	2024年4月10日	加元 0.0331	11,296,932.163	(276,319)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024年3月28日	2024年4月10日	英镑 0.0363	1,842,768.836	(84,502)
港元类别 (每月派息)	2024年3月28日	2024年4月10日	港元 0.0385	246,548,795.624	(1,212,827)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024年3月28日	2024年4月10日	纽元 0.0351	7,239,051.923	(151,984)
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 0.0242	87,157,514.740	(290,509)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024年3月28日	2024年4月10日	美元 0.0401	4,255,249.760	(170,636)
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 0.0225	260,758,441.817	(808,091)
美元类别 (每月派息)	2024年3月28日	2024年4月10日	美元 0.0440	36,727,873.433	(1,616,024)

可赎回份额持有人之总收益分配

(30,749,848)

1.10.2022 至 31.3.2023

澳元对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	澳元 0.0321	16,031,733.123	(329,073)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	加元 0.0363	11,903,583.157	(316,777)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	英镑 0.0332	830,522.264	(31,746)
港元类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	港元 0.0387	283,939,159.316	(1,399,829)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	纽元 0.0345	7,267,755.380	(145,666)
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 0.0332	48,415,211.570	(219,285)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	美元 0.0401	2,308,869.180	(92,586)
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 0.0307	335,786,294.188	(1,406,344)
美元类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	美元 0.0440	43,810,078.239	(1,927,641)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	澳元 0.0300	15,584,433.207	(313,107)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	加元 0.0352	11,638,931.096	(302,198)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	英镑 0.0323	882,671.807	(33,953)
港元类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	港元 0.0385	278,467,611.869	(1,373,519)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	纽元 0.0329	7,310,581.009	(149,386)
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 0.0263	48,156,378.010	(178,796)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	美元 0.0401	2,273,174.780	(91,154)
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 0.0243	329,560,391.315	(1,130,551)
美元类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	美元 0.0440	43,019,753.278	(1,892,867)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	澳元 0.0273	15,402,499.612	(285,154)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	加元 0.0333	11,670,257.016	(286,815)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	英镑 0.0299	888,834.189	(31,968)
港元类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	港元 0.0384	276,172,844.005	(1,358,758)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	纽元 0.0322	7,165,360.778	(145,922)
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 0.0213	47,272,058.670	(145,529)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	美元 0.0401	2,258,190.020	(90,553)
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 0.0198	325,821,398.894	(932,419)
美元类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	美元 0.0440	42,704,805.293	(1,879,009)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	澳元 0.0271	15,955,192.209	(304,680)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	加元 0.0348	12,173,358.592	(317,483)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	英镑 0.0316	885,490.606	(34,448)
港元类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	港元 0.0386	281,455,890.539	(1,385,996)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月9日	纽元 0.0321	7,573,923.563	(157,118)
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 0.0228	46,808,434.330	(157,949)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	美元 0.0401	2,257,858.620	(90,540)
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 0.0212	323,651,947.748	(1,015,484)
美元类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	美元 0.0440	43,365,864.969	(1,908,096)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	澳元 0.0281	15,886,572.230	(301,038)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	加元 0.0349	12,357,114.812	(316,767)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	英镑 0.0333	1,333,064.712	(53,742)
港元类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	港元 0.0387	300,024,726.090	(1,479,197)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	纽元 0.0334	7,797,424.230	(161,352)
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 0.0268	46,582,102.230	(179,582)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	美元 0.0401	2,268,951.820	(90,985)
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 0.0249	322,707,269.252	(1,155,891)
美元类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	美元 0.0440	44,996,252.332	(1,979,833)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	澳元 0.0281	16,570,095.275	(311,849)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	加元 0.0339	12,354,174.329	(309,459)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	英镑 0.0330	1,380,872.387	(56,343)
港元类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	港元 0.0387	306,626,589.787	(1,511,659)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	纽元 0.0353	8,310,502.953	(183,541)
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 0.0240	45,441,635.210	(158,810)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	美元 0.0401	2,206,148.280	(88,467)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	人民币 0.0222	320,156,885.788	(1,034,975)
美元类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	美元 0.0440	46,499,464.329	(2,045,974)
可赎回份额持有人的总收益分配					<u>(33,281,863)</u>

