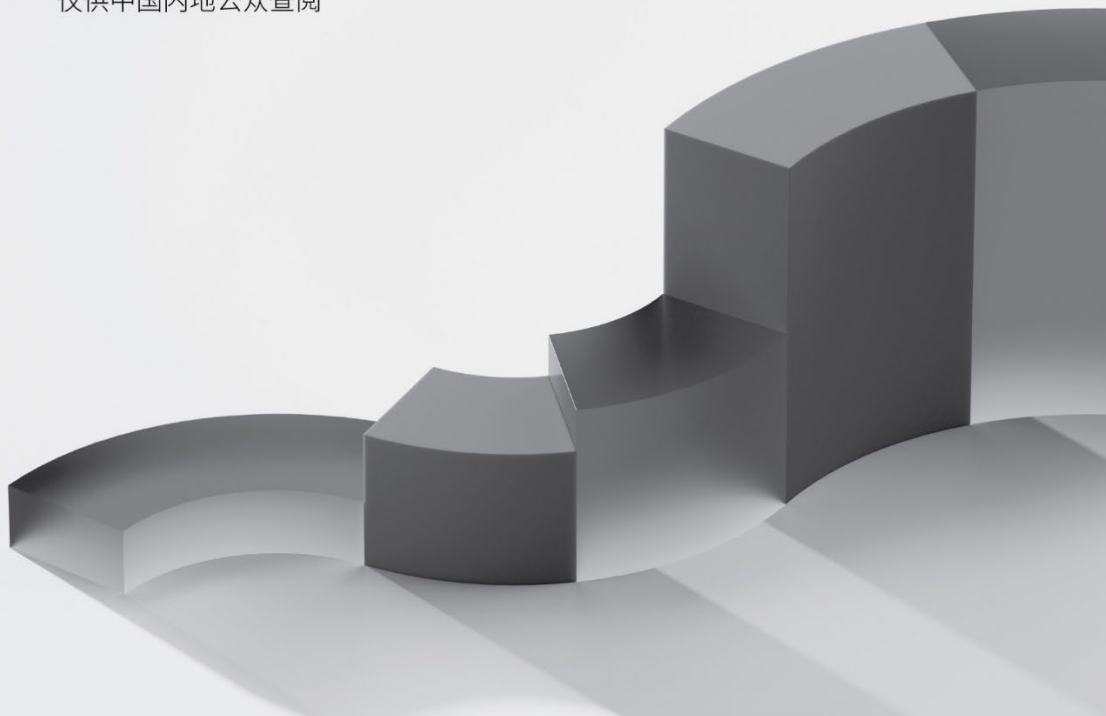


仅供中国内地公众查阅



年度报告 — 2025年9月30日（经审核）

# 摩根亚洲股息基金

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 - 2
投资组合持有变动表 - 未经审计	2
金融衍生工具详情 - 未经审计	3
金融衍生工具风险敞口信息 - 未经审计	3
财务状况表	4
综合收益表	4
可赎回份额持有人应占净资产变动表	5
现金流量表	5
财务报表之附注	6 - 42
独立核数师报告	43 - 44
管理人及受托人的责任声明	45
受托人对份额持有人的报告	45
业绩纪录 - 未经审计	46 - 47
经营与管理	48

投资组合

于二零二五年九月三十日 (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
<b>上市投资 (99.4%)</b>				<b>香港特别行政区 (7.2%)</b>			
(I) 股票 (99.4%)				友邦保险控股有限公司	4,171,400	40,023,008	2.8
<b>澳大利亚 (14.0%)</b>				香港电讯信托及香港电讯有 限公司	1,831,000	2,711,059	0.2
ANZ Banking Group Ltd	823,525	18,125,725	1.2	香港交易及结算所有限公司	474,935	26,980,781	1.9
Australian Stock Exchange Ltd	252,677	9,811,580	0.7	汇丰控股有限公司	751,600	10,568,228	0.7
BHP Group Ltd	52,689	1,485,132	0.1	领展房地产投资信托基金	1,745,000	8,971,261	0.6
Coles Group Ltd	1,035,015	15,975,920	1.1	保诚集团	1,047,346	14,677,991	1.0
GPT Group	5,514,424	19,625,656	1.4	<b>印度 (10.6%)</b>			
Medibank Private Ltd	6,362,113	20,323,484	1.4	Embassy Office Parks REIT	3,782,256	17,973,530	1.2
National Australia Bank Ltd	898,923	26,302,858	1.8	HDFC Bank Limited	5,481,857	58,715,164	4.1
QBE Insurance Group Limited	467,794	6,383,527	0.4	ICICI Bank Ltd	1,363,581	20,702,028	1.4
RIO Tinto PLC	180,910	11,903,510	0.8	Infosys Technologies Ltd			
Santos Ltd	2,208,052	9,848,591	0.7	Sponsored ADR	688,768	11,206,255	0.8
Telstra Corporation Limited	12,953,247	41,378,565	2.9	ITC Ltd	2,028,269	9,172,912	0.6
Vicinity Centres REIT	7,648,196	12,773,481	0.9	Maruti Suzuki India Ltd	77,872	14,058,203	1.0
Woolworths Group Ltd	492,533	8,715,581	0.6	Mindspace Business Parks REIT	1,516,532	7,767,917	0.5
<b>中国内地 (29.1%)</b>				Power Grid Corp of India Ltd	4,355,105	13,746,316	1.0
阿里巴巴集团控股有限公司	2,748,900	62,536,027	4.3	<b>印度尼西亚 (2.9%)</b>			
中国建设银行股份有限公司 H 股	7,989,000	7,680,546	0.5	Bank Central Asia	44,818,100	20,506,331	1.4
中国招商银行股份有限公司 A 股(C1)	1,810,157	10,262,991	0.7	Telkom Indonesia Persero	117,444,800	21,565,022	1.5
中国招商银行股份有限公司 H 股	681,000	4,092,792	0.3	<b>韩国 (13.3%)</b>			
华润置地有限公司	3,759,000	14,677,706	1.0	BGF Retail Co Ltd	45,854	3,529,619	0.2
中国铁塔股份有限公司 H 股	7,392,000	10,906,915	0.8	DB Insurance Co Ltd	144,355	14,249,790	1.0
中国长江电力股份有限公司 A 股(C1)	2,640,550	10,095,545	0.7	Hana Financial Holdings	329,762	20,494,812	1.4
宁德时代新能源科技股份有限公司 A 股(C2)	412,207	23,249,322	1.6	Hyundai Motor Co Ltd Pref	54,534	6,471,552	0.4
新奥能源控股有限公司	779,400	6,446,248	0.4	KIA Corp	183,510	13,170,918	0.9
福耀玻璃工业集团股份有限公司 A 股(C1)	603,260	6,213,390	0.4	KT Corporation	185,109	6,662,631	0.5
福耀玻璃工业集团股份有限公司 H 股	1,354,000	13,626,317	0.9	Samsung C&T Corp	67,258	8,849,169	0.6
华住集团有限公司 ADR	430,173	16,824,066	1.2	Samsung Electronics Co Ltd	724,762	43,339,533	3.0
华勤技术股份有限公司 A 股 (C1)	1,087,054	16,069,255	1.1	Samsung Electronics Co Ltd Preference Shares	297,977	14,101,902	1.0
美的集团股份有限公司 A 股 (C2)	1,512,564	15,419,775	1.1	Shinhan Financial Group Company Limited	537,675	27,131,884	1.9
网易股份有限公司	723,500	22,020,050	1.5	SK Hynix Inc	138,052	34,191,989	2.4
中国石化天然气股份有限公司 H 股	15,446,000	14,055,534	1.0	<b>新加坡 (5.1%)</b>			
中国平安保险 (集团) 股份有 限公司 H 股	2,471,500	16,851,714	1.2	Capitaland Integrated			
申洲国际集团控股有限公司	2,706,600	21,446,441	1.5	Commercial Trust REIT	15,103,100	26,827,567	1.9
腾讯控股有限公司	1,294,800	110,335,253	7.6	DBS Group Holdings Ltd	452,113	17,937,930	1.2
信义光能控股有限公司	16,090,000	7,113,979	0.5	NTT DC REIT	9,263,500	9,263,500	0.6
紫金矿业集团股份有限公司 A 股(C1)	2,813,893	11,622,893	0.8	Singapore Exchange Limited	1,604,300	20,570,182	1.4
				<b>台湾地区 (15.3%)</b>			
				研华股份有限公司	331,929	3,474,157	0.2
				日月光投资控股股份有限公 司	252,000	1,355,994	0.1
				亿丰综合工业股份有限公司	667,000	9,290,029	0.6
				谱瑞科技股份有限公司	308,000	7,488,286	0.5
				广达电脑股份有限公司	1,744,000	16,594,265	1.1

投资组合 (续)				投资组合持有变动表		
于二零二五年九月三十日 (未经审计)				截至二零二五年九月三十日止年度 (未经审计)		
	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		持有占资产净值百分比	
					2025	2024
台湾地区 (续)				上市投资		
瑞昱半导体股份有限公	719,000	12,974,933	0.9	股票		
台湾大哥大股份有限公	3,863,000	13,815,441	1.0	中国内地	29.1	22.8
台湾积体电路制造股份	3,269,000	139,971,291	9.7	台湾地区	15.3	15.6
纬颖科技服务股份有限	163,000	17,729,018	1.2	澳大利亚	14.0	19.3
				韩国	13.3	9.2
泰国 (1.9%)				印度	10.6	12.0
Advanced Information				香港特别行政区	7.2	10.6
Service PCL - NVDR	1,832,600	16,456,923	1.1	新加坡	5.1	5.7
Bangkok Dusit				印度尼西亚	2.9	4.4
Medical Services				泰国	1.9	-
PCL - NVDR	17,249,000	10,912,035	0.8			
		1,440,401,725	99.4	集体投资计划		
				卢森堡	0.0	0.0
(II) 集体投资计划 (0.0%)				衍生性产品		
卢森堡 (0.0%)				远期外汇合约	0.0	0.5
JPMLIQ-JPM USD						
Liquidity LVNAV				总上市投资	99.4	100.1
‘X’ (dist)**	70,000	70,000	0.0	其他净资产 / (负债)	0.6	(0.1)
(III) 衍生性产品 (0.0%)						
远期外汇合约 (0.0%)		275,377	0.0	于九月三十日可赎回份额持有人应		
				占净资产	100.0	100.0
总上市投资		1,440,747,102	99.4			
其他净资产		8,266,591	0.6			
于二零二五年九月三十日可赎回						
份额持有人应占净资产		1,449,013,693	100.0			
总投资, 按成本		1,156,053,513				

\* 由管理人 之 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

金融衍生工具详情  
于二零二五年九月三十日 (未经审计)

于二零二五年九月三十日，本基金持有之未平仓远期外汇合约，详情请参阅附注 11。

金融衍生工具风险敞口信息  
截至二零二五年九月三十日止年度 (未经审计)

截至二零二五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。

	2025 占资产净值百分比
最低总敞口	-
最高总敞口	0.4
平均总敞口	0.0

截至二零二五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。

	2025 占资产净值百分比
最低净敞口	-
最高净敞口	-
平均净敞口	-

# 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  
 于二零二五年九月三十日

	2025 美元	2024 美元
<b>资产</b>		
<b>流动资产</b>		
银行现金	20,525,366	18,303,097
应收经纪款项	3,468,106	1,585,970
分配应收款项	27,866,585	12,106,419
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 11]	1,207,810	5,956,560
投资 [附注 4(l)(a)]	1,440,471,725	1,047,843,133
股息、利息及其他应收款项	2,817,364	2,871,834
<b>总资产</b>	<u>1,496,356,956</u>	<u>1,088,667,013</u>
	-----	-----
<b>负债</b>		
<b>流动负债</b>		
短期银行借款 - 无抵押 [附注 9]	6,700,000	1,300,000
应付经纪款项	21,316,472	13,009,495
赎回应付款项	9,632,877	15,540,179
应付收益分配 [附注 6]	2,868,872	2,754,282
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 11]	932,433	382,648
应付税项 [附注 7]	3,765,450	2,195,267
其他应付款项	2,127,159	1,435,726
<b>总负债（不含可赎回份额持有人 应占净资产）</b>	<u>47,343,263</u>	<u>36,617,597</u>
	-----	-----
<b>可赎回份额持有人应占净资产</b> [附注 3]	<u>1,449,013,693</u>	<u>1,052,049,416</u>

由受托人及管理人于二零二六年一月二十七日批准

签署人：

汇丰机构信托服务（亚洲）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  
 截至二零二五年九月三十日止年度

	2025 美元	2024 美元
<b>收入</b>		
投资及衍生性产品净收益		
[附注 5]	166,778,791	220,018,513
股息收入 [附注 8(a)]	34,976,850	37,363,408
存款利息 [附注 8(i), 8(j)]	35,466	108,112
汇兑净亏损	(1,200,743)	(627,707)
其他收入	717	49,240
	<u>200,591,081</u>	<u>256,911,566</u>
	-----	-----
<b>支出</b>		
管理费用 [附注 8(e)]	15,071,366	14,619,729
交易成本 [附注 8(i), 8(j)]	1,758,438	1,616,711
托管费用及银行费用		
[附注 8(i), 8(j)]	546,440	561,472
基金注册登记机构费用		
[附注 8(h)]	388,333	249,696
受托人费用 [附注 8(g)]	280,877	274,466
核数师酬金	45,766	61,983
法律及专业费用	20,747	26,327
估值费用 [附注 8(e)]	17,220	17,080
印刷及出版支出	3,189	7,600
其他经营费用	8,678	10,589
	<u>18,141,054</u>	<u>17,445,653</u>
	-----	-----
<b>净经营利润</b>	<u>182,450,027</u>	<u>239,465,913</u>
	-----	-----
<b>财务成本</b>		
收益分配 [附注 6]	(29,872,923)	(34,318,570)
利息支出 [附注 8(j)]	(169,209)	(114,290)
	<u>(30,042,132)</u>	<u>(34,432,860)</u>
	-----	-----
<b>除税前利润</b>	<u>152,407,895</u>	<u>205,033,053</u>
	-----	-----
税项 [附注 7]	(4,797,202)	(5,927,581)
	<u>147,610,693</u>	<u>199,105,472</u>
	-----	-----
<b>可赎回份额持有人应占净资产 及总综合收益之增加</b>	<u>147,610,693</u>	<u>199,105,472</u>

可赎回份额持有人应占净资产变动表  
截至二零二五年九月三十日止年度

	2025 美元	2024 美元
年初可赎回份额持有人应占净资产	1,052,049,416	1,085,023,048
分配可赎回份额 [附注 3]	945,590,881	347,505,730
赎回可赎回份额 [附注 3]	(696,237,297)	(579,584,834)
净分配／（赎回）	249,353,584	(232,079,104)
	1,301,403,000	852,943,944
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加	147,610,693	199,105,472

年末可赎回份额持有人应占净资产	1,449,013,693	1,052,049,416
-----------------	---------------	---------------

现金流量表  
截至二零二五年九月三十日止年度

	2025 美元	2024 美元
经营业务		
购入投资及衍生性产品	(1,009,662,540)	(577,137,140)
出售投资及衍生性产品所得款项	795,523,950	844,337,364
已收股息	33,742,743	37,525,873
已收利息	35,632	107,988
已付基金注册登记机构费用	(244,564)	(225,051)
已付受托人费用	(272,226)	(275,599)
已付交易成本	(1,740,710)	(1,612,496)
已付税项	(3,227,019)	(3,732,314)
已付管理费用	(14,573,980)	(14,665,203)
其它	(381,651)	(3,108,174)
经营业务所（运用）／产生之现金净额	(200,800,365)	281,215,248
融资活动		
已付利息	(169,209)	(114,290)
分配可赎回份额所得款项	929,830,715	336,991,634
赎回可赎回份额付款	(702,144,599)	(568,727,538)
已付收益分配	(29,758,333)	(35,648,612)
融资活动所产生／（运用）之现金净额	197,758,574	(267,498,806)
现金及现金等价物之（减少）／增加	(3,041,791)	13,716,442
年初现金及现金等价物余额	17,003,097	2,686,918
现金及现金等价物之汇兑（亏损）／收益	(135,940)	599,737
年末现金及现金等价物	13,825,366	17,003,097
现金及现金等价物余额分析：		
银行现金	20,525,366	18,303,097
短期银行借款 - 无抵押	(6,700,000)	(1,300,000)
	13,825,366	17,003,097



## 财务报表之附注

### 1 本基金

摩根亚洲股息基金（“本基金”）根据二零一一年五月六日的信托契约（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。

本基金的投资目标为通过主要投资（即至少为资产净值总额的 70%）于亚太区（日本除外）内的、投资管理人预期会派发股息的公司的股票，以提供收益及长期资本增长。

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会计准则编制。财务报表乃按历史成本准则编制，并就按公允价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”）按照香港财务报告会计准则编制财务报表时需作出若干关键会计估计、判断和假设。

*于二零二四年十月一日生效的新准则、对现有准则的修订和解释*

并无自二零二四年十月一日起的财务年度期间生效的新准则、对现有准则的修订或诠释会对本基金产生重大影响。

*于二零二四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二零二四年十月一日起的财务年度期间生效，但在编制此等财务报表时并未提前采纳：

- 金融工具的分类和计量的修订 — 香港财务报告准则第 9 号（修订本）及香港财务报告准则第 7 号（修订本）（于二零二六年一月一日或之后开始的年度期间生效）
- 香港财务报告准则第 18 号“财务报表列报和披露”（于二零二七年一月一日或之后开始的年度期间生效）

本基金目前仍在评估即将生效的新准则和对现有准则的修订将带来的影响。

其他新准则及对现有准则的修订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。在非活跃市场中进行金融工具交易时，以市场报价、交易商／经纪报价或其他获可观察输入值支持的报价来源作为估值。

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。

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。

#### 结构性主体

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。

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) 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。

**(i) 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。

**(j) 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）

2025					
	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目：					
年初	13,087,371.878	4,242,308.151	1,088,798.871	3,202,284.859	1,057,137.848
总分配	6,497,962.704	1,951,907.880	920,472.959	1,112,154.754	936,595.156
总赎回	(7,966,707.912)	(1,942,713.699)	(831,554.026)	(1,674,293.772)	(357,711.159)
年末	11,618,626.670	4,251,502.332	1,177,717.804	2,640,145.841	1,636,021.845
	澳元	加元	欧元	英镑	港元
可赎回份额持有人应占净 资产	120,608,148	46,819,170	13,639,132	29,754,828	33,385,519
可赎回份额持有人应占净 资产（每份额）	10.38	11.01	11.58	11.27	20.41
	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	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲份额 (累计) 份额
已发行份额数目：					
年初	142,140,659.067	4,565,825.379	13,347,295.200	33,650,974.040	11,154,155.060
总分配	76,150,183.439	1,296,392.491	79,337,185.910	101,794,736.090	35,118,489.530
总赎回	(89,172,103.929)	(2,524,605.979)	(24,986,275.780)	(49,546,110.450)	(12,724,088.760)
年末	129,118,738.577	3,337,611.891	67,698,205.330	85,899,599.680	33,548,555.830
	港元	纽元	人民币	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	1,520,295,280	35,495,563	1,117,252,108	1,072,850,049	504,826,083
可赎回份额持有人应占净 资产（每份额）	11.77	10.64	16.50	12.49	15.05

2025

	PRC 人民币对冲类别 (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	人民币对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	19,795,085.800	1,121,210.560	1,871,741.890	2,062,203.857	100,982,354.440
总分配 总赎回	21,067,172.970 (17,627,630.770)	3,648,823.520 (1,204,098.290)	3,936,285.290 (1,853,785.320)	1,542,514.372 (641,939.761)	15,376,521.113 (39,520,674.626)
年末	23,234,628.000	3,565,935.790	3,954,241.860	2,962,778.468	76,838,200.927
	人民币	美元	美元	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	268,520,378	55,413,002	46,561,728	67,191,500	919,856,562
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	11.56	15.54	11.78	22.68	11.97
	新加坡元对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每季派息) 份额	美元 C 类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	693,045.979	407,352.841	23,502,233.227	5,057,258.609	2,914,606.505
总分配 总赎回	357,582.018 (578,178.283)	274,632.169 (236,549.419)	17,489,481.310 (15,905,516.912)	991,889.730 (1,696,477.653)	136,014.944 (372,774.667)
年末	472,449.714	445,435.591	25,086,197.625	4,352,670.686	2,677,846.782
	新加坡元	美元	美元	美元	美元
可赎回份额持有人应占 净资产	5,316,400	9,101,226	294,816,523	60,777,891	33,982,986
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	11.25	20.43	11.75	13.96	12.69

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	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	18,668,628.267	7,129,849.925	1,876,213.986	5,375,874.707	1,592,778.198
总分配	4,081,618.312	1,064,445.154	229,104.447	782,230.007	116,405.327
总赎回	(9,662,874.701)	(3,951,986.928)	(1,016,519.562)	(2,955,819.855)	(652,045.677)
年末	13,087,371.878	4,242,308.151	1,088,798.871	3,202,284.859	1,057,137.848
	澳元	加元	欧元	英镑	港元
可赎回份额持有人应占净 资产	120,369,763	40,955,854	11,017,196	31,775,385	18,142,343
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	9.20	9.65	10.12	9.92	17.16
	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	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲份额 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	210,188,512.688	5,357,054.288	1,179,706.490	2,055,696.020	4,909,576.790
总分配	48,136,398.488	1,724,226.709	15,600,316.190	36,573,225.490	9,428,838.610
总赎回	(116,184,252.109)	(2,515,455.618)	(3,432,727.480)	(4,977,947.470)	(3,184,260.340)
年末	142,140,659.067	4,565,825.379	13,347,295.200	33,650,974.040	11,154,155.060
	港元	纽元	人民币	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	1,461,539,883	42,961,423	182,312,726	361,177,704	145,006,167
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	10.28	9.41	13.66	10.73	13.00

2024

	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	人民币对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	9,791,594.140	1,198,075.420	1,244,852.250	1,556,954.695	139,332,098.316
总分配	16,902,847.500	552,296.790	1,138,922.830	1,304,281.476	11,345,403.577
总赎回	(6,899,355.840)	(629,161.650)	(512,033.190)	(799,032.314)	(49,695,147.453)
年末	19,795,085.800	1,121,210.560	1,871,741.890	2,062,203.857	100,982,354.440
	人民币	美元	美元	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	200,486,668	14,683,349	19,294,877	40,402,462	1,059,588,613
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	10.13	13.10	10.31	19.59	10.49
	新加坡元对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每季派息) 份额	美元 C 类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	767,961.479	524,804.307	32,514,811.126	7,530,185.266	2,982,849.433
总分配	86,006.584	42,220.916	8,668,863.457	64,611.161	391,747.362
总赎回	(160,922.084)	(159,672.382)	(17,681,441.356)	(2,537,537.818)	(459,990.290)
年末	693,045.979	407,352.841	23,502,233.227	5,057,258.609	2,914,606.505
	新加坡元	美元	美元	美元	美元
可赎回份额持有人应占净 资产	6,820,316	7,008,760	241,599,859	61,267,181	32,110,026
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	9.84	17.21	10.28	12.11	11.02

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。截至二零二五年九月三十日止年度，对集体投资计划的购买总额为126,510,000 美元（二零二四年：93,370,000 美元）。截至二零二五年及二零二四年九月三十日止年度，投资集体投资计划未获得净收益或未产生净亏损。

(a) 市场风险

(i) 市场价格风险

本基金的投资及衍生性产品须面对在所有投资及衍生性产品中所固有的市场价格风险，即持有投资及衍生性产品的价值可升可跌。本基金的市场风险按照特定的投资限制及指南，通过以下方式管理：(i) 审慎的股票选择，及(ii) 分散的投资组合。

本基金的投资管理人主要通过本基金的 Beta 值定期监测本基金的市场价格敏感度。Beta 值计量基金回报与投资管理人选择的相关基准指数之间的统计关系。

于九月三十日，投资及衍生性产品之公平值及其估计市场敏感度如下：

	2025		2024	
	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				
股票				
- 中国内地	421,546,759	29.1	240,155,798	22.8
- 台湾地区	222,693,414	15.3	164,179,235	15.6
- 澳大利亚	202,653,610	14.0	202,688,575	19.3
- 韩国	192,193,799	13.3	96,400,685	9.2
- 印度	153,342,325	10.6	126,886,667	12.0
- 香港特别行政区	103,932,328	7.2	111,749,245	10.6
- 新加坡	74,599,179	5.1	59,596,441	5.7
- 其他	69,440,311	4.8	46,176,487	4.4
	1,440,401,725	99.4	1,047,833,133	99.6
集体投资计划				
- 其他	70,000	0.0	10,000	0.0
衍生性产品				
- 远期外汇合约	1,207,810	0.1	5,956,560	0.5
	1,441,679,535	99.5	1,053,799,693	100.1
负债				
衍生性产品				
- 远期外汇合约	(932,433)	(0.1)	(382,648)	(0.0)
总上市投资	1,440,747,102	99.4	1,053,417,045	100.1

有关衍生性产品的风险亦请参阅附注 11。



	资产净值 美元	本基金相关基准指数 (注*)	Beta 值 (注**)	占相关基准指数 之合理变动百分 比 (注***)	估计对资产净值 的影响 (注****) 美元
		MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index (Total Return Net)			
于二零二五年九月三十日	1,449,013,693		0.87	+14.9	187,835,645
		MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index (Total Return Net)			
于二零二四年九月三十日	1,052,049,416		0.85	+29.4	262,907,149

假定所有其他可能影响本基金资产净值的变量保持不变，若相关基准指数收益呈反方向波动，则将导致本基金的资产净值以相同金额呈反向变动。

注：

- \* 本基金相关基准指数指投资管理人监测本基金市场价格风险时所使用的有关市场指数。
- \*\* Beta 值计量了在过去最长三十六个月期间或自组合启动后的数月期间，本基金回报与各基准指数之间的统计关系。对于推出期间少于十二个月内推出的基金，将采用本基金的每周回报计算 Beta 值。
- \*\*\* 合理变动百分比取决于过去十二个月的基准指数之实际历史变动，但不包括不大可能出现或“最恶劣”情况或“压力测试”下之变动，亦不代表投资管理人对本基金未来回报的预测。对于推出期间少于十二个月的基金，将采用自经营开始后基准指数之实际历史变动计算合理变动百分比。
- \*\*\*\* 假定所有其他变量保持不变，对本基金资产净值的估计影响按照本基金资产净值乘以相关 Beta 值再乘以相关基准指数之合理变动百分比计算。

(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。

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。

	2025 1 个月以内 美元	2024 1 个月以内 美元
银行现金	20,525,366	18,303,097
短期银行借款 - 无抵押	(6,700,000)	(1,300,000)
总利率敏感性缺口	13,825,366	17,003,097

任何现金及现金等价物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 11。

下表概述截至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 <sup>*</sup> ）	美元等值	与美元比较之合理变动百分比（注 <sup>**</sup> ）	估计对资产净值的影响 美元
<u>2025</u>			
澳元	271,052,270	-4.5	(12,197,352)
加元	33,690,516	-2.9	(977,025)
人民币（离岸）	356,136,782	-1.8	(6,410,462)
欧元	16,047,295	+5.3	850,507
港元	401,055,022	-0.2	(802,110)
印度卢比	137,789,763	-5.6	(7,716,227)
印尼盾	42,071,353	-9.2	(3,870,564)
韩元	191,997,190	-6.8	(13,055,809)
纽元	20,647,242	-8.7	(1,796,310)
新加坡元	69,454,931	-0.6	(416,730)
英镑	66,694,336	+0.4	266,777
台币	220,063,689	+3.8	8,362,420
泰铢	27,081,225	-0.7	(189,569)
	1,853,781,614		(37,952,454)
<u>2024</u>			
澳元	269,816,909	+7.5	20,236,268
加元	30,528,601	+0.1	30,529
人民币（离岸）	254,224,051	+4.1	10,423,186
欧元	12,430,541	+5.4	671,249
港元	302,022,043	+0.8	2,416,176
印度卢比	100,235,016	-0.9	(902,115)
印尼盾	46,176,487	+2.1	969,706
韩元	96,522,569	+3.2	3,088,722
纽元	27,742,948	+5.9	1,636,834
新加坡元	65,147,912	+6.5	4,234,614
英镑	60,483,267	+9.9	5,987,843
台币	164,407,414	+2.0	3,288,148
	1,429,737,758		52,081,160

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，本基金在应收经纪款项、分配应收款项或股息、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。

于二零二五年及二零二四年九月三十日，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。

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。

	2025 交易对手风险承担 美元	2024 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)	55,888	5,064,482
标准普尔(A)／穆迪(A)／惠誉(A)	20,469,478	13,238,615
经纪发行的衍生性产品		
标准普尔(AA)／穆迪(Aa)／惠誉(AA)	51,570	2,019,308
标准普尔(A)／穆迪(A)／惠誉(A)	1,156,240	3,937,252
托管机构的投资余额		
标准普尔(A)／穆迪(A)／惠誉(A)	1,440,471,725	1,047,843,133

(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。

	2025		2024	
	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
短期银行借款 - 无抵押	6,700,000	-	1,300,000	-
应付经纪款项	21,316,472	-	13,009,495	-
赎回应付款项	9,632,877	-	15,540,179	-
应付收益分配	2,868,872	-	2,754,282	-
衍生性产品	931,479	954	381,090	1,558
其他应付款项	2,127,159	-	1,435,726	-
可赎回份额持有人应占净资产	1,449,013,693	-	1,052,049,416	-
总金融负债	1,492,590,552	954	1,086,470,188	1,558

投资管理通过投资于预期一般在一个月内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

于二零二五年及二零二四年九月三十日，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
2025				
资产 衍生性产品	123,291	(123,291)	-	-
	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
负债 衍生性产品	899,992	(123,291)	-	776,701
	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
2024				
资产 衍生性产品	3,562,935	(283,738)	-	3,279,197
	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
负债 衍生性产品	377,684	(283,738)	-	93,946

(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示，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，监测基金的投资指南及限制条件，以透过分散投资维持足够的资金流通性。

(III) 公平值估计

于二零二五年及二零二四年九月三十日，管理层认为资产及负债的账面价值与公平值相若。

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

- 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）按公平值级次计量之公平值：

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
2025				
资产				
股票	1,440,401,725	-	-	1,440,401,725
集体投资计划	70,000	-	-	70,000
衍生性产品	-	1,207,810	-	1,207,810
按公平值透过损益列账的总金融资产	1,440,471,725	1,207,810	-	1,441,679,535
负债				
衍生性产品	-	932,433	-	932,433
按公平值透过损益列账的总金融负债	-	932,433	-	932,433
2024				
资产				
股票	1,047,833,133	-	-	1,047,833,133
集体投资计划	10,000	-	-	10,000
衍生性产品	-	5,956,560	-	5,956,560
按公平值透过损益列账的总金融资产	1,047,843,133	5,956,560	-	1,053,799,693
负债				
衍生性产品	-	382,648	-	382,648
按公平值透过损益列账的总金融负债	-	382,648	-	382,648

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及集体投资计划。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。

截至二零二五年及二零二四年九月三十日止年度，公平值层次之间并无转拨。

于二零二五年及二零二四年九月三十日，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

	2025 美元	2024 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益／亏损之变动	113,727,542	194,153,858
投资及衍生性产品销售之实现收益	53,051,249	25,864,655
	166,778,791	220,018,513

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（二零二四年：无）。

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
2025					
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	澳元 0.0245	13,132,198.889	(210,739)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	加元 0.0222	4,162,788.090	(66,296)
欧元对冲类别（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	欧元 0.0183	1,144,328.967	(22,735)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	英镑 0.0312	3,171,972.833	(127,235)
港元类别（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	港元 0.0320	139,907,517.441	(575,869)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	纽元 0.0280	4,529,308.166	(75,477)
PRC 人民币份额（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	人民币 0.0340	39,766,026.970	(189,685)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	人民币 0.0065	21,724,458.940	(19,811)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	美元 0.0321	2,197,173.730	(70,529)
人民币对冲类别（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	人民币 0.0067	98,164,964.340	(92,273)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	新加坡元 0.0159	693,111.181	(8,330)
美元类别（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	美元 0.0320	23,999,752.037	(767,991)
美元 C 类别（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	美元 0.0343	2,914,836.006	(99,979)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	澳元 0.0261	13,086,203.023	(222,502)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	加元 0.0216	4,193,440.587	(64,692)
欧元对冲类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	欧元 0.0197	1,186,186.337	(24,681)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	英镑 0.0314	3,067,676.236	(122,434)
港元类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	港元 0.0321	138,056,828.558	(569,504)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	纽元 0.0273	3,810,752.501	(61,541)
PRC 人民币份额（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	人民币 0.0346	42,573,661.080	(203,162)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	人民币 0.0160	21,716,918.210	(47,923)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	美元 0.0321	2,350,862.320	(75,463)
人民币对冲类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	人民币 0.0166	95,793,422.086	(219,316)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	新加坡元 0.0181	693,164.706	(9,358)
美元类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	美元 0.0320	23,571,312.838	(754,281)
美元 C 类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	美元 0.0343	3,040,738.426	(104,297)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	澳元 0.0267	12,977,743.418	(214,539)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	加元 0.0191	4,141,302.276	(54,998)
欧元对冲类别（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	欧元 0.0186	1,221,154.908	(23,520)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	英镑 0.0317	3,060,221.408	(121,494)
港元类别（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	港元 0.0320	135,184,653.097	(556,892)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	纽元 0.0260	3,763,386.930	(54,819)
PRC 人民币份额（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	人民币 0.0348	41,967,457.260	(198,933)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	人民币 0.0181	20,961,682.860	(51,680)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	美元 0.0321	2,332,275.030	(74,866)
人民币对冲类别（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	人民币 0.0187	93,529,900.778	(238,236)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	新加坡元 0.0182	693,205.595	(9,248)
美元类别（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	美元 0.0320	22,770,668.290	(728,660)
美元 C 类别（每季派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	美元 0.1141	4,520,745.969	(515,817)
美元 C 类别（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	美元 0.0343	3,048,043.852	(104,548)
澳元对冲类别（每月派息）	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	澳元 0.0284	12,877,599.178	(228,376)
加元对冲类别（每月派息）	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	加元 0.0198	4,171,222.158	(57,382)
欧元对冲类别（每月派息）	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	欧元 0.0193	1,180,625.576	(23,753)
英镑对冲类别（每月派息）	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	英镑 0.0331	3,078,745.871	(126,700)
港元类别（每月派息）	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	港元 0.0321	137,983,269.260	(568,532)
纽元对冲类别（每月派息）	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 11 日	纽元 0.0277	3,700,233.556	(57,998)
PRC 人民币份额（每月派息）	2025 年 1 月 24 日	2025 年 2 月 10 日	人民币 0.0350	43,126,052.520	(208,462)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2025 年 1 月 24 日	2025 年 2 月 10 日	人民币 0.0239	20,762,607.840	(68,533)
PRC 美元份额（每月派息）	2025 年 1 月 24 日	2025 年 2 月 10 日	美元 0.0321	2,450,493.260	(78,661)
人民币对冲类别（每月派息）	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	人民币 0.0248	90,532,131.475	(308,455)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	新加坡元 0.0193	667,152.898	(9,522)
美元类别（每月派息）	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	美元 0.0320	22,307,634.421	(713,843)
美元 C 类别（每月派息）	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	美元 0.0344	3,048,314.117	(104,862)
澳元对冲类别（每月派息）	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	澳元 0.0276	12,929,845.965	(221,916)

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）	2025年2月28日	2025年3月10日	加元	0.0192	4,178,844.501	(55,696)
欧元对冲类别（每月派息）	2025年2月28日	2025年3月10日	欧元	0.0187	1,153,902.824	(22,441)
英镑对冲类别（每月派息）	2025年2月28日	2025年3月10日	英镑	0.0319	3,028,896.766	(121,661)
港元类别（每月派息）	2025年2月28日	2025年3月10日	港元	0.0321	131,876,497.845	(544,362)
纽元对冲类别（每月派息）	2025年2月28日	2025年3月10日	纽元	0.0262	3,577,645.804	(52,524)
PRC 人民币份额（每月派息）	2025年2月28日	2025年3月10日	人民币	0.0348	44,336,050.020	(211,571)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2025年2月28日	2025年3月10日	人民币	0.0169	18,301,478.500	(42,412)
PRC 美元份额（每月派息）	2025年2月28日	2025年3月10日	美元	0.0321	2,525,216.870	(81,059)
人民币对冲类别（每月派息）	2025年2月28日	2025年3月10日	人民币	0.0175	89,412,618.452	(214,564)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2025年2月28日	2025年3月10日	新加坡元	0.0191	668,291.483	(9,463)
美元类别（每月派息）	2025年2月28日	2025年3月10日	美元	0.0320	21,983,613.832	(703,475)
美元 C 类别（每月派息）	2025年2月28日	2025年3月10日	美元	0.0344	3,048,836.807	(104,880)
澳元对冲类别（每月派息）	2025年3月31日	2025年4月9日	澳元	0.0264	12,668,195.934	(208,406)
加元对冲类别（每月派息）	2025年3月31日	2025年4月9日	加元	0.0171	4,264,784.146	(50,671)
欧元对冲类别（每月派息）	2025年3月31日	2025年4月9日	欧元	0.0160	1,148,825.562	(19,855)
英镑对冲类别（每月派息）	2025年3月31日	2025年4月9日	英镑	0.0316	3,055,848.639	(124,641)
港元类别（每月派息）	2025年3月31日	2025年4月9日	港元	0.0320	129,793,330.361	(533,834)
纽元对冲类别（每月派息）	2025年3月31日	2025年4月9日	纽元	0.0241	3,501,686.044	(47,795)
PRC 人民币份额（每月派息）	2025年3月31日	2025年4月9日	人民币	0.0346	52,934,209.980	(252,071)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2025年3月31日	2025年4月9日	人民币	0.0105	18,783,498.290	(27,144)
PRC 美元份额（每月派息）	2025年3月31日	2025年4月9日	美元	0.0321	2,700,821.500	(86,696)
人民币对冲类别（每月派息）	2025年3月31日	2025年4月9日	人民币	0.0108	88,271,036.210	(131,206)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2025年3月31日	2025年4月9日	新加坡元	0.0161	611,895.668	(7,329)
美元类别（每月派息）	2025年3月31日	2025年4月9日	美元	0.0320	21,723,255.825	(695,143)
美元 C 类别（每月派息）	2025年3月31日	2025年4月9日	美元	0.0344	3,049,101.668	(104,889)
澳元对冲类别（每月派息）	2025年4月30日	2025年5月12日	澳元	0.0265	12,540,586.320	(212,638)
加元对冲类别（每月派息）	2025年4月30日	2025年5月12日	加元	0.0165	4,078,258.844	(48,716)
欧元对冲类别（每月派息）	2025年4月30日	2025年5月12日	欧元	0.0157	1,113,547.438	(19,873)
英镑对冲类别（每月派息）	2025年4月30日	2025年5月12日	英镑	0.0311	2,965,959.222	(123,206)
港元类别（每月派息）	2025年4月30日	2025年5月12日	港元	0.0320	128,249,894.567	(529,227)
纽元对冲类别（每月派息）	2025年4月30日	2025年5月12日	纽元	0.0225	3,443,630.354	(45,981)
PRC 人民币份额（每月派息）	2025年4月30日	2025年5月12日	人民币	0.0349	53,951,027.610	(258,881)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2025年4月30日	2025年5月12日	人民币	0.0106	18,744,730.110	(27,319)
PRC 美元份额（每月派息）	2025年4月30日	2025年5月12日	美元	0.0321	2,730,242.960	(87,641)
人民币对冲类别（每月派息）	2025年4月30日	2025年5月12日	人民币	0.0111	86,184,941.727	(131,531)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2025年4月30日	2025年5月13日	新加坡元	0.0162	695,494.365	(8,629)
美元类别（每月派息）	2025年4月30日	2025年5月12日	美元	0.0320	21,355,495.846	(683,375)
美元 C 类别（每月派息）	2025年4月30日	2025年5月12日	美元	0.0344	3,049,403.060	(104,899)
澳元对冲类别（每月派息）	2025年5月30日	2025年6月10日	澳元	0.0251	12,231,909.635	(197,583)
加元对冲类别（每月派息）	2025年5月30日	2025年6月9日	加元	0.0149	4,202,164.295	(45,538)
欧元对冲类别（每月派息）	2025年5月30日	2025年6月9日	欧元	0.0121	1,053,432.878	(14,470)
英镑对冲类别（每月派息）	2025年5月30日	2025年6月9日	英镑	0.0295	2,910,701.574	(115,794)
港元类别（每月派息）	2025年5月30日	2025年6月9日	港元	0.0323	127,720,060.354	(526,089)
纽元对冲类别（每月派息）	2025年5月30日	2025年6月9日	纽元	0.0203	3,533,102.615	(42,822)
PRC 人民币份额（每月派息）	2025年5月30日	2025年6月9日	人民币	0.0344	50,878,541.930	(243,031)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2025年5月30日	2025年6月9日	人民币	0.0051	17,757,004.170	(12,575)
PRC 美元份额（每月派息）	2025年5月30日	2025年6月9日	美元	0.0321	2,540,430.970	(81,548)
人民币对冲类别（每月派息）	2025年5月30日	2025年6月9日	人民币	0.0053	84,333,112.988	(62,064)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2025年5月30日	2025年6月9日	新加坡元	0.0124	705,762.172	(6,786)
美元类别（每月派息）	2025年5月30日	2025年6月9日	美元	0.0320	21,143,703.025	(676,597)
美元 C 类别（每月派息）	2025年5月30日	2025年6月9日	美元	0.0345	2,982,992.367	(102,913)
澳元对冲类别（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	澳元	0.0242	13,294,654.483	(210,846)
加元对冲类别（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	加元	0.0147	4,230,688.965	(45,578)
欧元对冲类别（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	欧元	0.0104	950,375.796	(11,602)
英镑对冲类别（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	英镑	0.0292	2,842,552.048	(113,742)
港元类别（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	港元	0.0323	123,841,255.063	(509,563)
纽元对冲类别（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	纽元	0.0192	3,600,589.258	(41,966)
PRC 人民币份额（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	人民币	0.0343	52,110,758.910	(249,527)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	人民币	0.0055	16,806,279.360	(12,904)
PRC 美元份额（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	美元	0.0321	2,521,703.470	(80,947)
人民币对冲类别（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	人民币	0.0057	82,583,528.658	(65,715)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	新加坡元	0.0101	621,167.984	(4,926)
美元类别（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	美元	0.0320	22,273,587.234	(712,754)
美元 C 类别（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	美元	0.0344	4,261,914.024	(148,763)
澳元对冲类别（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	澳元	0.0233	12,117,473.172	(181,783)
加元对冲类别（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	加元	0.0139	4,422,264.879	(44,461)
欧元对冲类别（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	欧元	0.0089	1,071,429.145	(10,914)
英镑对冲类别（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	英镑	0.0289	2,677,819.110	(102,412)
港元类别（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	港元	0.0323	126,797,157.516	(521,726)
纽元对冲类别（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	纽元	0.0189	3,472,818.130	(38,748)
PRC 人民币份额（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	人民币	0.0342	60,198,120.120	(285,537)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	人民币	0.0051	16,956,918.370	(11,994)
PRC 美元份额（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	美元	0.0321	2,875,885.950	(92,316)
人民币对冲类别（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	人民币	0.0052	80,103,107.659	(57,770)

收益分配类别	除息日		支付日	比率	份额	美元
新加坡元对冲类别（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	新加坡元 0.0067	391,939.772	(2,024)	
美元类别（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	美元 0.0320	23,491,642.813	(751,731)	
美元 C 类别（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	美元 0.0345	2,803,374.686	(96,716)	
澳元对冲类别（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	澳元 0.0225	12,184,507.697	(179,432)	
加元对冲类别（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	加元 0.0142	4,218,651.699	(43,632)	
欧元对冲类别（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	欧元 0.0088	1,207,138.546	(12,434)	
英镑对冲类别（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	英镑 0.0274	2,757,434.133	(102,076)	
港元类别（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	港元 0.0322	127,187,224.248	(525,334)	
纽元对冲类别（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	纽元 0.0178	3,632,946.636	(38,156)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	人民币 0.0342	71,835,000.110	(344,915)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	人民币 0.0046	20,036,326.780	(12,940)	
PRC 美元份额（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	美元 0.0321	3,413,518.970	(109,574)	
人民币对冲类别（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	人民币 0.0047	78,449,654.840	(51,765)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	新加坡元 0.0054	398,858.102	(1,679)	
美元类别（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	美元 0.0320	23,483,498.822	(751,471)	
美元 C 类别（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	美元 0.0345	2,677,613.831	(92,378)	
澳元对冲类别（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	澳元 0.0230	11,621,921.265	(177,156)	
加元对冲类别（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	加元 0.0139	4,251,502.332	(42,472)	
欧元对冲类别（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	欧元 0.0091	1,179,708.253	(12,614)	
英镑对冲类别（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	英镑 0.0280	2,640,145.841	(99,520)	
港元类别（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	港元 0.0321	128,794,583.910	(531,375)	
纽元对冲类别（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	纽元 0.0174	3,329,640.444	(33,640)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	人民币 0.0340	85,410,632.020	(407,436)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	人民币 0.0034	23,294,316.400	(11,112)	
PRC 美元份额（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	美元 0.0321	3,940,182.290	(126,480)	
人民币对冲类别（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	人民币 0.0035	76,937,651.255	(37,781)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	新加坡元 0.0029	472,449.714	(1,063)	
美元类别（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	美元 0.0320	24,893,308.549	(796,586)	
美元 C 类别（每季派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	美元 0.1147	4,352,670.686	(499,251)	
美元 C 类别（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	美元 0.0345	2,677,846.782	(92,386)	
可赎回份额持有人之总收益分配						(29,872,923)

2024

澳元对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	澳元 0.0201	17,866,955.532	(227,380)	
加元对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	加元 0.0266	6,742,702.890	(129,196)	
欧元对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	欧元 0.0207	1,799,288.084	(39,368)	
英镑对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	英镑 0.0296	5,003,766.484	(179,726)	
港元类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	港元 0.0323	205,670,064.609	(849,007)	
纽元对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	纽元 0.0292	5,125,591.456	(87,054)	
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 0.0351	2,117,091.230	(10,121)	
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 0.0232	9,674,826.360	(30,571)	
PRC 美元份额（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	美元 0.0321	1,252,630.900	(40,209)	
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 0.0240	137,287,229.554	(448,770)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	新加坡元 0.0194	700,673.447	(9,922)	
美元类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	美元 0.0320	31,601,227.623	(1,011,238)	
美元 C 类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	美元 0.0341	3,038,755.395	(103,622)	
澳元对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	澳元 0.0210	17,801,833.560	(247,873)	
加元对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	加元 0.0268	6,716,868.994	(132,767)	
欧元对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	欧元 0.0207	1,751,744.541	(39,564)	
英镑对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	英镑 0.0295	4,866,457.074	(181,740)	
港元类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	港元 0.0321	201,712,079.136	(829,028)	
纽元对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	纽元 0.0290	4,864,529.789	(87,133)	
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 0.0341	2,241,068.230	(10,702)	
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 0.0147	9,449,025.570	(19,451)	
PRC 美元份额（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	美元 0.0321	1,254,705.450	(40,276)	
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 0.0152	132,890,222.356	(282,864)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	新加坡元 0.0192	706,356.400	(10,162)	
美元类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	美元 0.0320	30,978,916.828	(991,324)	
美元 C 类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	美元 0.0341	3,109,536.516	(106,035)	
澳元对冲类别（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	澳元 0.0203	17,382,771.713	(240,781)	
加元对冲类别（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	加元 0.0262	6,590,187.624	(130,944)	
欧元对冲类别（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	欧元 0.0193	1,756,197.812	(37,441)	
英镑对冲类别（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	英镑 0.0287	4,768,030.017	(174,446)	
港元类别（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	港元 0.0321	193,886,844.692	(797,045)	
纽元对冲类别（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	纽元 0.0284	4,915,885.993	(88,395)	
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 0.0341	2,255,995.060	(10,804)	
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 0.0121	9,340,739.750	(15,873)	
PRC 美元份额（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	美元 0.0321	1,232,844.530	(39,574)	
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 0.0125	131,010,555.887	(229,985)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	新加坡元 0.0193	702,552.275	(10,279)	
美元类别（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	美元 0.0320	30,077,283.805	(962,247)	
美元 C 类别（每季派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	美元 0.1132	7,086,990.325	(802,247)	
美元 C 类别（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	美元 0.0341	3,149,528.610	(107,399)	



收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	澳元 0.0206	16,575,627.545	(225,721)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	加元 0.0264	6,288,048.939	(124,250)
欧元对冲类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	欧元 0.0204	1,621,318.073	(35,927)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	英镑 0.0294	4,573,033.220	(171,211)
港元类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	港元 0.0322	188,612,393.906	(776,912)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 14 日	纽元 0.0285	4,394,824.446	(77,099)
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 0.0344	2,608,247.470	(12,507)
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 0.0120	9,716,832.460	(16,254)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	美元 0.0321	1,243,996.080	(39,932)
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 0.0124	126,711,455.342	(219,025)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	新加坡元 0.0191	697,980.540	(9,976)
美元类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	美元 0.0320	29,028,117.296	(928,899)
美元 C 类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	美元 0.0341	3,066,336.953	(104,562)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	澳元 0.0212	16,252,760.841	(224,359)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	加元 0.0268	6,160,022.060	(121,715)
欧元对冲类别（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	欧元 0.0208	1,618,894.770	(36,439)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	英镑 0.0294	4,385,889.641	(163,109)
港元类别（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	港元 0.0322	180,376,943.828	(741,894)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	纽元 0.0293	4,340,276.720	(77,478)
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 0.0344	2,660,484.970	(12,702)
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 0.0154	9,860,761.130	(21,076)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	美元 0.0321	1,246,598.580	(40,016)
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 0.0160	123,176,202.170	(273,525)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	新加坡元 0.0191	694,133.317	(9,860)
美元类别（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	美元 0.0320	27,903,689.110	(892,917)
美元 C 类别（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	美元 0.0341	3,039,227.068	(103,638)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	澳元 0.0209	15,835,706.554	(215,922)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	加元 0.0262	6,080,302.122	(117,719)
欧元对冲类别（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	欧元 0.0202	1,549,270.627	(33,799)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	英镑 0.0292	4,293,007.739	(158,355)
港元类别（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	港元 0.0322	173,694,757.909	(714,624)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	纽元 0.0293	4,260,265.245	(74,664)
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 0.0344	3,070,100.730	(14,546)
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 0.0117	10,884,686.340	(17,540)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	美元 0.0321	1,256,901.760	(40,347)
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 0.0121	120,841,141.705	(201,391)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 11 日	新加坡元 0.0184	694,196.643	(9,464)
美元类别（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	美元 0.0320	27,395,549.741	(876,656)
美元 C 类别（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	美元 0.0342	3,039,414.437	(103,948)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	澳元 0.0216	16,036,473.241	(224,927)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	加元 0.0263	6,103,982.505	(116,850)
欧元对冲类别（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	欧元 0.0208	1,508,880.964	(33,558)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	英镑 0.0295	3,735,671.068	(137,989)
港元类别（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	港元 0.0323	169,592,150.850	(700,382)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	纽元 0.0292	3,992,187.759	(68,981)
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 0.0346	4,487,780.270	(21,409)
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 0.0218	11,972,500.070	(35,985)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	美元 0.0321	1,322,037.930	(42,437)
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 0.0226	118,361,721.249	(368,812)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	新加坡元 0.0185	688,102.267	(9,334)
美元类别（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	美元 0.0320	26,799,857.074	(857,594)
美元 C 类别（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	美元 0.0342	3,055,259.784	(104,490)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	澳元 0.0206	15,635,472.370	(214,206)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	加元 0.0257	5,615,516.931	(105,834)
欧元对冲类别（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	欧元 0.0195	1,316,537.942	(27,870)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	英镑 0.0294	3,678,803.598	(137,705)
港元类别（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	港元 0.0322	161,783,762.266	(665,883)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	纽元 0.0294	4,140,013.450	(74,783)
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 0.0346	9,408,434.210	(44,790)
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 0.0139	13,833,179.830	(26,456)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	美元 0.0321	1,505,184.070	(48,316)
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 0.0144	114,475,822.771	(226,811)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	新加坡元 0.0172	654,542.994	(8,329)
美元类别（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	美元 0.0320	26,964,034.120	(862,848)
美元 C 类别（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	美元 0.0342	3,023,501.380	(103,404)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	澳元 0.0211	15,362,974.656	(216,489)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	加元 0.0247	5,306,034.340	(95,779)
欧元对冲类别（每月派息）	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	欧元 0.0186	1,300,945.966	(25,934)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	英镑 0.0294	3,652,051.213	(135,727)
港元类别（每月派息）	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	港元 0.0322	161,388,085.913	(665,611)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	纽元 0.0293	4,118,316.631	(73,528)
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 0.0347	14,979,469.890	(71,196)
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 0.0075	15,402,907.010	(15,823)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	美元 0.0321	1,586,678.790	(50,932)
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 0.0077	113,621,052.656	(119,833)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
新加坡元对冲类别（每月派息）	2024年6月28日	2024年7月9日	新加坡元 0.0176	651,374.537	(8,459)
美元类别（每月派息）	2024年6月28日	2024年7月9日	美元 0.0320	26,869,398.038	(859,820)
美元 C 类别（每季派息）	2024年6月28日	2024年7月9日	美元 0.1135	5,548,301.775	(629,732)
美元 C 类别（每月派息）	2024年6月28日	2024年7月9日	美元 0.0342	2,826,052.306	(96,651)
澳元对冲类别（每月派息）	2024年7月31日	2024年8月8日	澳元 0.0214	13,775,098.677	(192,496)
加元对冲类别（每月派息）	2024年7月31日	2024年8月8日	加元 0.0234	4,359,724.385	(73,848)
欧元对冲类别（每月派息）	2024年7月31日	2024年8月8日	欧元 0.0177	1,196,123.235	(22,909)
英镑对冲类别（每月派息）	2024年7月31日	2024年8月8日	英镑 0.0291	3,374,147.089	(126,117)
港元类别（每月派息）	2024年7月31日	2024年8月8日	港元 0.0322	156,570,614.380	(645,363)
纽元对冲类别（每月派息）	2024年7月31日	2024年8月8日	纽元 0.0293	4,797,805.309	(83,495)
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 0.0348	22,772,897.630	(109,649)
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 0.0111	16,689,080.930	(25,631)
PRC 美元份额（每月派息）	2024年7月31日	2024年8月8日	美元 0.0321	1,701,077.860	(54,605)
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 0.0115	108,834,063.733	(173,168)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2024年7月31日	2024年8月8日	新加坡元 0.0170	716,726.868	(9,109)
美元类别（每月派息）	2024年7月31日	2024年8月8日	美元 0.0320	25,870,493.715	(827,855)
美元 C 类别（每月派息）	2024年7月31日	2024年8月8日	美元 0.0342	2,760,284.889	(94,402)
澳元对冲类别（每月派息）	2024年8月30日	2024年9月9日	澳元 0.0212	13,452,704.393	(193,506)
加元对冲类别（每月派息）	2024年8月30日	2024年9月9日	加元 0.0216	4,278,231.306	(68,566)
欧元对冲类别（每月派息）	2024年8月30日	2024年9月9日	欧元 0.0174	1,125,126.754	(21,670)
英镑对冲类别（每月派息）	2024年8月30日	2024年9月9日	英镑 0.0277	3,253,496.335	(118,442)
港元类别（每月派息）	2024年8月30日	2024年9月9日	港元 0.0321	150,026,312.709	(617,384)
纽元对冲类别（每月派息）	2024年8月30日	2024年9月9日	纽元 0.0285	4,757,058.151	(84,823)
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 0.0340	27,454,532.710	(131,714)
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 0.0038	17,348,978.350	(9,302)
PRC 美元份额（每月派息）	2024年8月30日	2024年9月9日	美元 0.0321	1,749,707.720	(56,166)
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 0.0039	104,493,844.385	(57,503)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2024年8月30日	2024年9月9日	新加坡元 0.0160	717,754.745	(8,810)
美元类别（每月派息）	2024年8月30日	2024年9月9日	美元 0.0320	24,298,627.426	(777,555)
美元 C 类别（每月派息）	2024年8月30日	2024年9月9日	美元 0.0343	2,825,150.442	(96,903)
澳元对冲类别（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月10日	澳元 0.0225	13,137,642.179	(205,070)
加元对冲类别（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月9日	加元 0.0217	4,249,227.936	(68,254)
欧元对冲类别（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月9日	欧元 0.0179	1,097,686.610	(21,929)
英镑对冲类别（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月9日	英镑 0.0288	3,215,382.876	(124,213)
港元类别（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月9日	港元 0.0321	142,210,169.539	(587,698)
纽元对冲类别（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月9日	纽元 0.0287	4,556,787.515	(83,208)
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 0.0338	33,903,266.120	(163,736)
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 0.0000	19,722,007.740	-
PRC 美元份额（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月9日	美元 0.0321	1,854,720.970	(59,536)
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 0.0000	101,312,561.631	-
新加坡元对冲类别（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月9日	新加坡元 0.0145	693,045.979	(7,839)
美元类别（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月9日	美元 0.0320	23,681,839.166	(757,818)
美元 C 类别（每季派息）	2024年9月30日	2024年10月9日	美元 0.1137	5,057,258.609	(575,010)
美元 C 类别（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月9日	美元 0.0343	2,914,606.505	(99,971)
可赎回份额持有人之总收益分配					(34,318,570)

7 税项

<p><u>澳大利亚税项</u></p> <p>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。</p> <p>管理人认为，于二零二五年及二零二四年九月三十日，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，于二零二五年及二零二四年九月三十日并无税项拨备。该评估为管理人的最佳估计。</p> <p><u>中国税项</u></p> <p>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。</p> <p>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”）。</p>	
---	--

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，将对该等有价值证券的买卖价差征收百分之六的增值税（“增值税”）以及适用的附加税费。

#### *A 股股息收入和资本收益*

本基金通过沪港通和深港通（统称“中华通”）对中国境内上市的 A 股进行投资，并对股票所得的股息收入缴纳百分之十的预提所得税。截至二零二五年及二零二四年九月三十日止年度，已就股票所得的股息收入缴纳预提所得税。

根据财税二零一四年第八十一号和财税二零一六年第一百二十七号，境外投资者通过中华通交易中国境内 A 股所得的资本收益暂时获豁免缴纳中国境内企业所得税。根据三十六号通知及其他现行增值税法规，通过中华通交易有价值证券（包括 A 股和其他中国境内上市证券）所得的资本收益可获豁免缴纳中国境内增值税。

#### *H 股股息收入和资本收益*

本基金对香港交所上市的中国境内公司股份（“H 股”）进行投资。根据《中华人民共和国企业所得税法》的一般税务规定，除非根据相关双重税收协定获得豁免或减免，否则严格来说，基金须就来自中国境内的资本收益缴纳百分之十的预提所得税。然而，中国境内税务机关实际上可能难以对此类资本收益征收预提所得税。地方税务局并未严格执行对中国境内非税收居民企业从 H 股交易所获得的资本收益收取百分之十的预提所得税。如果资本收益来自 H 股交易，一般不征收增值税，因为购买和出售通常均在中国境外完成。

由于管理人认为，在当前的执法环境下，对 H 股所得的资本收益征税的可能性不大，因此未对财务报表中的此等收益作出税项拨备。

#### 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

截至二零二五年及二零二四年九月三十日止年度，已就若干收到的股息收入和所得的资本收益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) 以下为受托人及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。

截至二零二五年九月三十日止年度，综合收益表中的股息收入为 38,475 美元（二零二四年：22,620 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>2025</u>					
HSBC Bank Plc, 伦敦	4,726,969	0.26	2,363	0.33	0.05
J.P. Morgan Securities Australia Limited	17,536	0.00	5	0.00	0.03
J.P. Morgan India Private Limited	60,875	0.00	18	0.00	0.03
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	4,531,705	0.25	1,555	0.22	0.03
JPMorgan Chase Bank, N.A.	252,960,000	13.79	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司	3,634,521	0.20	2,176	0.31	0.06
香港上海汇丰银行有限公司, 首尔	9,224,397	0.50	5,605	0.79	0.06

2024

HSBC Securities & Capital Markets (India) Private Limited	804,811	0.06	805	0.14	0.10
J.P. Morgan India Private Limited	5,769,761	0.41	5,348	0.90	0.09
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	20,370,914	1.43	11,351	1.92	0.06
JPMorgan Chase Bank, N.A.	186,730,000	13.14	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司	15,522,761	1.09	11,336	1.91	0.07
香港上海汇丰银行有限公司, 首尔	534,201	0.04	481	0.08	0.09

(b) 与管理人及其关联人士之年末结余：

	2025 美元	2024 美元
银行现金	55,888	5,064,482
应收款项	3	169
应付款项	(1,963,910)	(1,311,482)

于二零二五年九月三十日，本基金的投资结余 70,000 美元（二零二四年：10,000 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。

- (c) 截至二零二五年九月三十日止年度，本基金与受托人之关联人士签订了远期外汇合约，实现亏损 1,312,226 美元（二零二四年：实现亏损 704,437 美元）。
- (d) 截至二零二五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 21,951 美元（二零二四年：8,921 美元）。
- (e) 支付给摩根基金（亚洲）有限公司美元 C 类别（每季派息）及美元 C 类别（每月派息）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点七五和百分之一点五计算。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人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。

此外，如果本基金的资产净值超过 500 万美元但低于 2,000 万美元，则管理人就每次评估收取估值费用 40 美元；如果本基金的资产净值超过 2,000 万美元，则管理人就每次评估收取估值费用 70 美元。

(f) 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，管理人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	总分配	总赎回	年末	交易利润 美元
2025					
摩根资产管理（亚太）有限公司					
- 美元类别（累计）	47,134.796	4,574.861	(26,154.616)	25,555.041	-
- 美元 C 类别（每月派息）	25,377.666	1,251.269	-	26,628.935	10,777
JPMorgan Asset Management (S) Limited					
- 美元类别（累计）	252.322	0.023	-	252.345	-
摩根基金（亚洲）有限公司					
- 美元类别（累计）	287.734	-	-	287.734	-

2024

摩根资产管理（亚太）有限公司					
- 美元类别（累计）	58,959.634	7,650.312	(19,475.150)	47,134.796	-
- 美元 C 类别（每月派息）	-	25,377.666	-	25,377.666	6,865
JPMorgan Asset Management (S) Limited					
- 美元类别（累计）	3,770.483	252.322	(3,770.483)	252.322	-
摩根基金（亚洲）有限公司					
- 美元类别（累计）	-	287.734	-	287.734	-

- (g) 受托人费用按本基金资产净值的首 4,000 万美元，以本基金资产净值的年率百分之零点零六计算；资产净值介乎 4,000 万美元至 7,000 万美元，按年率百分之零点零四计算；超过 7,000 万美元时，按年率百分之零点零二五计算。受托人费用于每个交易日累计，并于每月月底支付。
- (h) 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率为本基金资产净值的年率介乎百分之零点零一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。
- (i) 截至二零二五年及二零二四年九月三十日止年度，除附注 8(a)、8(e)和 8(h)披露的股息收入、管理费用、估值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：

	2025 美元	2024 美元
存款利息	12,898	29,802
交易成本	(1,578)	(16,699)
托管费用及银行费用	(40,837)	(36,146)

(j) 截至二零二五年及二零二四年九月三十日止年度，除附注 8(g)披露的受托人费用外，已收／（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：

	2025 美元	2024 美元
存款利息	20,343	49,401
交易成本	(83,709)	(50,732)
利息支出	(169,209)	(114,290)
托管费用及银行费用	(350,855)	(402,024)

9 借款

截至二零二五年及二零二四年九月三十日止年度，本基金从香港上海汇丰银行有限公司（受托人的关联人士）借入无抵押短期借款。所有银行借款的久期均在 7 天内。所有交易均为按一般商业条款下进行的正常业务流程。

10 非金钱收益／佣金共享安排

投资管理人与经纪签署了非金钱收益／佣金共享安排，从而收取若干产品和服务以协助作出投资决策。由本基金支付的部分交易佣金会由经纪保留，作为产品和服务的补偿。

该等产品和服务必须对本基金具有明显的利益，并仅限于研究和咨询服务。

截至二零二五年九月三十日止年度，投资管理人经非金钱收益／佣金共享安排而获得的服务交易金额为 1,541,687,170 美元（二零二四年：722,947,330 美元）。本基金就该等交易支付佣金 46,951 美元（二零二四年：14,608 美元）。

11 衍生性产品

以下截至九月三十日未平仓之远期外汇合约：				未实现收益／（亏损）	
交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元	
2025					
未平仓合约：					
加元 275,845	美元 199,552	2025 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	1,303	
美元 41,058	加元 57,141	2025 年 10 月 2 日	Citibank N.A., 伦敦	10	
美元 130,598	英镑 97,293	2025 年 10 月 3 日	美国道富银行	383	
美元 25,637	纽元 44,306	2025 年 10 月 3 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	90	
美元 5,604	澳元 8,519	2025 年 10 月 3 日	美林国际, 伦敦	42	
美元 39,311	加元 54,714	2025 年 10 月 3 日	美林国际, 伦敦	14	
美元 1,104	纽元 1,901	2025 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	0	
美元 1,109	澳元 1,673	2025 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	0	
美元 1,768	英镑 1,314	2025 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	0	
加元 2,097	美元 1,507	2025 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	0	
美元 1,102	加元 1,534	2025 年 10 月 6 日	美林国际, 伦敦	0	
美元 96,327	澳元 145,331	2025 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	0	
欧元 30,062	美元 35,338	2025 年 10 月 9 日	法国巴黎银行	0	
纽元 126,733	美元 73,605	2025 年 10 月 9 日	法国巴黎银行	0	
美元 116,894	离岸人民币 834,232	2025 年 10 月 9 日	法国巴黎银行	215	
美元 1,102	离岸人民币 7,855	2025 年 10 月 10 日	法国巴黎银行	1	
澳元 1,367,670	美元 912,707	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	6,021	
澳元 1,707,506	美元 1,137,675	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	5,696	
澳元 251,569	美元 167,884	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	1,107	
澳元 433,583	美元 288,415	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	974	
澳元 1,861,620	美元 1,234,676	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	529	
澳元 102,863	美元 68,715	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	522	
澳元 716,920	美元 475,481	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	204	
澳元 4,964	美元 3,316	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	25	
澳元 10,007	美元 6,657	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	22	
澳元 1,652	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	8	
澳元 1,647	美元 1,099	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	7	
澳元 1,655	美元 1,100	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3	
澳元 1,668	美元 1,106	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	0	
加元 264,750	美元 192,892	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,428	
加元 324,835	美元 235,693	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2,004	
加元 192,968	美元 140,287	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,464	
加元 319,799	美元 231,471	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,404	
加元 165,761	美元 120,467	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,217	
加元 116,922	美元 84,781	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	666	
加元 84,110	美元 60,989	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	479	
加元 76,384	美元 55,368	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	416	
加元 100,050	美元 72,362	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	385	
加元 27,318	美元 19,804	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	152	
加元 5,961	美元 4,338	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	49	
加元 7,756	美元 5,615	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	35	
加元 4,221	美元 3,055	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	18	
加元 1,932	美元 1,406	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	16	
加元 1,523	美元 1,105	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	9	
加元 1,521	美元 1,102	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	8	
加元 1,521	美元 1,102	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	8	
加元 1,521	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	8	
加元 1,519	美元 1,100	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	7	
加元 1,520	美元 1,100	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	7	
加元 1,520	美元 1,100	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	7	
离岸人民币 6,620,735	美元 932,758	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,520	
离岸人民币 9,884,699	美元 1,391,290	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,453	
离岸人民币 4,595,628	美元 647,640	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,937	
离岸人民币 2,531,439	美元 357,577	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	1,900	
离岸人民币 3,104,387	美元 437,396	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,218	
离岸人民币 4,231,465	美元 595,708	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,172	
离岸人民币 2,837,807	美元 399,691	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	969	

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 2,747,892	美元 387,027	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	938
离岸人民币 1,169,268	美元 165,164	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	878
离岸人民币 1,129,572	美元 159,557	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	848
离岸人民币 1,453,490	美元 205,032	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	811
离岸人民币 1,406,563	美元 198,412	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	785
离岸人民币 2,733,831	美元 384,870	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	757
离岸人民币 872,933	美元 123,305	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	655
离岸人民币 1,710,064	美元 240,921	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	651
离岸人民币 1,645,686	美元 231,787	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	562
离岸人民币 1,235,614	美元 174,129	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	520
离岸人民币 2,266,425	美元 318,908	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	467
离岸人民币 674,112	美元 95,091	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	376
离岸人民币 943,648	美元 132,955	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	369
离岸人民币 1,422,411	美元 200,221	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	367
离岸人民币 1,168,306	美元 164,479	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	328
离岸人民币 622,113	美元 87,653	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	244
离岸人民币 1,043,842	美元 146,879	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	215
离岸人民币 771,949	美元 108,675	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	214
离岸人民币 2,284,319	美元 321,162	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	207
离岸人民币 515,048	美元 72,562	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	196
离岸人民币 1,987,470	美元 279,427	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	180
离岸人民币 573,530	美元 80,744	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	161
离岸人民币 412,349	美元 58,078	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	142
离岸人民币 403,798	美元 56,863	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	128
离岸人民币 385,829	美元 54,333	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	122
离岸人民币 336,947	美元 47,458	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	116
离岸人民币 319,454	美元 44,994	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	110
离岸人民币 269,859	美元 38,022	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	105
离岸人民币 587,874	美元 82,699	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	101
离岸人民币 355,004	美元 49,971	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	91
离岸人民币 198,361	美元 27,948	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	78
离岸人民币 1,267,807	美元 178,175	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	43
离岸人民币 100,464	美元 14,155	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	39
离岸人民币 225,928	美元 31,783	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	39
离岸人民币 218,205	美元 30,696	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	37
离岸人民币 61,347	美元 8,639	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	20
离岸人民币 504,902	美元 70,955	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	15
离岸人民币 146,220	美元 20,557	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	13
离岸人民币 36,794	美元 5,180	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 10,139	美元 1,432	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	8
离岸人民币 17,070	美元 2,405	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	7
离岸人民币 7,817	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	6
离岸人民币 7,817	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	6
离岸人民币 15,416	美元 2,172	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	6
离岸人民币 19,001	美元 2,675	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	5
离岸人民币 7,831	美元 1,105	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4
离岸人民币 7,831	美元 1,105	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4
离岸人民币 7,831	美元 1,105	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4
离岸人民币 7,831	美元 1,105	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4
离岸人民币 12,462	美元 1,755	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4
离岸人民币 12,093	美元 1,703	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	4
离岸人民币 17,422	美元 2,451	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	4
离岸人民币 7,806	美元 1,100	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 7,833	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	3
离岸人民币 7,833	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	3
离岸人民币 7,833	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	3
离岸人民币 7,833	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	3
离岸人民币 7,833	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	3
离岸人民币 7,835	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	3
离岸人民币 7,806	美元 1,100	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 7,806	美元 1,100	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 7,806	美元 1,100	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 7,828	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 7,828	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 95,604	美元 13,435	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	3



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 7,837	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 7,837	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 7,828	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 7,828	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 7,828	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 7,838	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 7,838	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	3
离岸人民币 7,829	美元 1,102	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 7,824	美元 1,101	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 7,839	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	2
离岸人民币 8,903	美元 1,253	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2
离岸人民币 7,829	美元 1,102	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2
离岸人民币 7,829	美元 1,102	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 7,829	美元 1,102	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 7,829	美元 1,102	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 7,835	美元 1,102	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1
离岸人民币 7,835	美元 1,102	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1
离岸人民币 7,835	美元 1,102	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1
离岸人民币 7,848	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	1
离岸人民币 7,848	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	1
离岸人民币 7,848	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	1
离岸人民币 7,852	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	0
欧元 965,319	美元 1,138,785	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3,153
欧元 157,356	美元 186,829	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	1,711
欧元 48,829	美元 57,989	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	544
欧元 928	美元 1,095	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
英镑 848,680	美元 1,150,368	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	7,704
英镑 430,924	美元 582,429	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2,233
英镑 147,342	美元 199,815	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,435
英镑 153,929	美元 208,462	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,212
英镑 60,004	美元 81,552	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	763
英镑 98,933	美元 133,935	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	731
英镑 61,811	美元 83,824	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	602
英镑 16,663	美元 22,764	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	329
英镑 28,954	美元 39,197	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	214
英镑 20,049	美元 27,177	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	183
英镑 51,358	美元 69,321	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	173
英镑 810	美元 1,106	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	16
英镑 810	美元 1,106	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	16
英镑 811	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	10
英镑 1,138	美元 1,542	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	10
英镑 811	美元 1,100	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	8
英镑 805	美元 1,092	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	7
英镑 813	美元 1,101	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	6
英镑 815	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	5
纽元 1,886,486	美元 1,110,767	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	14,524
纽元 243,442	美元 145,119	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,654
纽元 273,564	美元 161,502	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2,533
纽元 444,920	美元 260,992	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2,448
纽元 277,043	美元 163,045	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,055
纽元 91,007	美元 54,487	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,603
纽元 205,998	美元 120,394	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	688
纽元 45,387	美元 26,973	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	598
纽元 3,551	美元 2,110	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	47
纽元 2,796	美元 1,668	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	44
纽元 1,839	美元 1,100	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	31
纽元 1,854	美元 1,106	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	29
纽元 1,877	美元 1,101	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	10
新加坡元 177,285	美元 138,764	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	1,027
新加坡元 1,409	美元 1,107	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	12
新加坡元 1,413	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	6
新加坡元 1,413	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	6
新加坡元 1,995	美元 1,555	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	5
美元 78,652,613	澳元 120,146,066	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	997,381

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 15,619,388	欧元 13,336,763	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	70,407
美元 955,092	澳元 1,455,319	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	9,701
美元 973,816	澳元 1,475,443	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	4,319
美元 1,735,817	澳元 2,624,687	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	4,201
美元 723,755	英镑 538,880	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,793
美元 94,237	澳元 144,354	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,461
美元 110,275	澳元 168,351	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,332
美元 607,902	离岸人民币 4,335,371	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	1,234
美元 85,097	澳元 129,913	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,028
美元 217,901	欧元 185,993	2025 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	907
美元 422,457	离岸人民币 3,013,151	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	902
美元 475,793	离岸人民币 3,392,427	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	856
美元 66,016	澳元 100,591	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	670
美元 54,346	澳元 82,966	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	656
美元 830,561	欧元 706,513	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	603
美元 205,110	欧元 174,828	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	563
美元 129,633	澳元 196,391	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	563
美元 514,577	离岸人民币 3,666,127	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	527
美元 80,100	澳元 121,408	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	387
美元 964,283	离岸人民币 6,865,388	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	330
美元 628,235	离岸人民币 4,473,330	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	284
美元 138,118	离岸人民币 984,793	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	249
美元 66,372	澳元 100,438	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	213
美元 195,086	离岸人民币 1,389,900	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	200
美元 28,150	纽约 48,761	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	185
美元 523,366	离岸人民币 3,726,198	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	179
美元 157,051	离岸人民币 1,118,915	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	161
美元 46,358	澳元 70,152	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	149
美元 69,414	澳元 104,912	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	137
美元 23,191	欧元 19,826	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	133
美元 73,072	离岸人民币 521,010	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	131
美元 24,469	纽约 42,317	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	122
美元 54,620	欧元 46,520	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	107
美元 6,502	澳元 9,960	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	101
美元 9,621	澳元 14,663	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	100
美元 43,735	离岸人民币 311,941	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	93
美元 158,178	欧元 134,528	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	85
美元 13,222	澳元 20,067	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	82
美元 232,785	欧元 197,936	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	74
美元 68,535	离岸人民币 488,281	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	70
美元 59,263	欧元 50,427	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	61
美元 26,337	离岸人民币 187,787	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	47
美元 7,772	澳元 11,788	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	43
美元 20,090	加元 27,983	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	41
美元 11,110	英镑 8,276	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	33
美元 7,229	英镑 5,393	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	33
美元 92,502	加元 128,620	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	29
美元 4,553	欧元 3,892	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	26
美元 50,260	离岸人民币 357,872	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	23
美元 6,551	新加坡元 8,460	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	22
美元 1,745	澳元 2,660	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	18
美元 13,777	欧元 11,721	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	12
美元 26,169	离岸人民币 186,326	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	11
美元 3,991	英镑 2,970	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	8
美元 1,176	欧元 1,005	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	6
美元 1,862	离岸人民币 13,274	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3
美元 5,321	离岸人民币 37,890	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	2
美元 2,066	欧元 1,757	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	0
英镑 1,314	美元 1,769	2025 年 11 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	0
美元 1,437,805	离岸人民币 10,217,375	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	916
美元 612,274	离岸人民币 4,350,966	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	390
美元 562,929	离岸人民币 4,000,247	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	350
美元 494,219	离岸人民币 3,512,036	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	315
美元 79,248	离岸人民币 563,158	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	51
美元 77,498	离岸人民币 550,717	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	49

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 44,594	离岸人民币 316,892	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	28
美元 73,727	纽元 126,733	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	6
美元 35,426	欧元 30,062	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	3
美元 74,820	澳元 112,820	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	1
美元 1,511	加元 2,097	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	0
			未实现总收益	1,207,810
澳元 129,913	美元 85,073	2025 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,028)
加元 128,620	美元 92,422	2025 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	(22)
纽元 42,317	美元 24,452	2025 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	(120)
新加坡元 8,460	美元 6,542	2025 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	(21)
加元 27,983	美元 20,076	2025 年 10 月 6 日	巴克莱银行, 伦敦	(40)
欧元 1,005	美元 1,175	2025 年 10 月 6 日	巴克莱银行, 伦敦	(6)
纽元 48,761	美元 28,133	2025 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	(184)
美元 23,536	纽元 40,528	2025 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	(0)
美元 61,574	欧元 52,390	2025 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	(0)
英镑 8,276	美元 11,109	2025 年 10 月 8 日	Citibank N.A., 伦敦	(33)
澳元 112,820	美元 74,779	2025 年 10 月 9 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 187,787	美元 26,313	2025 年 10 月 9 日	法国巴黎银行	(48)
离岸人民币 488,281	美元 68,467	2025 年 10 月 9 日	Citibank N.A., 伦敦	(77)
离岸人民币 311,941	美元 43,695	2025 年 10 月 9 日	Citibank N.A., 伦敦	(95)
离岸人民币 521,010	美元 73,005	2025 年 10 月 9 日	法国巴黎银行	(134)
离岸人民币 1,389,900	美元 194,893	2025 年 10 月 9 日	Citibank N.A., 伦敦	(222)
离岸人民币 3,666,127	美元 514,068	2025 年 10 月 9 日	Citibank N.A., 伦敦	(582)
离岸人民币 3,392,427	美元 475,353	2025 年 10 月 9 日	法国巴黎银行	(875)
离岸人民币 3,013,151	美元 422,066	2025 年 10 月 9 日	Citibank N.A., 伦敦	(919)
离岸人民币 4,335,371	美元 607,274	2025 年 10 月 9 日	巴克莱银行, 伦敦	(1,324)
离岸人民币 357,872	美元 50,232	2025 年 10 月 14 日	法国巴黎银行	(25)
离岸人民币 550,717	美元 77,292	2025 年 10 月 14 日	法国巴黎银行	(46)
离岸人民币 3,512,036	美元 492,904	2025 年 10 月 14 日	法国巴黎银行	(296)
离岸人民币 4,473,330	美元 627,889	2025 年 10 月 14 日	法国巴黎银行	(307)
离岸人民币 563,158	美元 79,043	2025 年 10 月 15 日	法国巴黎银行	(47)
离岸人民币 10,217,375	美元 1,434,086	2025 年 10 月 15 日	法国巴黎银行	(859)
澳元 1,649	美元 1,091	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
澳元 1,671	美元 1,102	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(5)
澳元 1,665	美元 1,098	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
澳元 1,678	美元 1,105	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(7)
澳元 1,681	美元 1,095	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(20)
澳元 30,724	美元 20,328	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(40)
澳元 8,519	美元 5,606	2025 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(42)
澳元 16,959	美元 11,130	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(113)
澳元 19,951	美元 13,090	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(136)
澳元 139,360	美元 92,091	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(297)
澳元 104,949	美元 69,274	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(301)
澳元 129,283	美元 85,295	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(412)
澳元 120,000	美元 79,117	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(436)
澳元 149,288	美元 98,361	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(608)
澳元 120,010	美元 78,345	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,216)
澳元 162,421	美元 106,369	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,307)
澳元 239,457	美元 156,852	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,895)
澳元 2,041,182	美元 1,347,329	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(5,858)
澳元 651,695	美元 424,351	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(7,686)
加元 1,534	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(0)
加元 57,141	美元 41,095	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
加元 54,714	美元 39,345	2025 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(17)
离岸人民币 7,855	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(0)
离岸人民币 7,854	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
离岸人民币 7,855	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 7,825	美元 1,098	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 7,825	美元 1,098	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 7,825	美元 1,098	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 7,853	美元 1,101	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 7,853	美元 1,101	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 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 72,435	美元 10,173	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 81,913	美元 11,505	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
离岸人民币 141,078	美元 19,815	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
离岸人民币 324,698	美元 45,573	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(48)
离岸人民币 1,173,741	美元 164,854	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(61)
离岸人民币 541,325	美元 75,978	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(81)
离岸人民币 1,663,095	美元 233,586	2025 年 10 月 21 日	美国道富银行	(85)
离岸人民币 405,778	美元 56,890	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(123)
离岸人民币 834,232	美元 116,998	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(214)
离岸人民币 1,964,735	美元 275,549	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(503)
离岸人民币 2,277,170	美元 319,261	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(690)
离岸人民币 2,483,281	美元 348,126	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(784)
欧元 933	美元 1,097	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
欧元 933	美元 1,097	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
欧元 938	美元 1,102	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
欧元 938	美元 1,102	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1)
欧元 940	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2)
欧元 1,926	美元 2,263	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3)
欧元 939	美元 1,099	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
欧元 3,342	美元 3,924	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
欧元 9,049	美元 10,636	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(9)
欧元 3,285	美元 3,832	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(32)
欧元 10,623	美元 12,426	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(71)
欧元 164,991	美元 193,390	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(711)
欧元 714,027	美元 835,240	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4,764)
英镑 4,770	美元 6,394	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(29)
英镑 10,936	美元 14,658	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(66)
英镑 97,293	美元 130,614	2025 年 10 月 21 日	美国道富银行	(382)
英镑 169,841	美元 228,228	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(448)
纽元 44,306	美元 25,655	2025 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(91)
美元 1,475	离岸人民币 10,497	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(0)
美元 1,753	离岸人民币 12,474	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
美元 1,550	离岸人民币 11,007	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
美元 1,401	离岸人民币 9,946	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
美元 1,674	离岸人民币 11,879	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(5)
美元 1,296	英镑 958	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
美元 3,178	离岸人民币 22,575	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
美元 7,805	欧元 6,627	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(9)
美元 1,937	加元 2,676	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(12)
美元 9,601	离岸人民币 68,245	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(12)
美元 2,915	欧元 2,467	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(12)
美元 2,930	新加坡元 3,752	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
美元 5,613	离岸人民币 39,838	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(16)
美元 4,162	英镑 3,079	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
美元 1,704	加元 2,343	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(18)
美元 2,091	英镑 1,539	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(20)
美元 13,822	离岸人民币 98,232	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(20)
美元 2,120	加元 2,917	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(21)
美元 11,627	离岸人民币 82,599	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(22)
美元 1,589	英镑 1,163	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(23)
美元 11,912	离岸人民币 84,573	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(29)
美元 14,035	离岸人民币 99,641	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(35)
美元 6,742	英镑 4,980	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(37)
美元 5,135	加元 7,084	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(39)
美元 4,925	欧元 4,148	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(45)
美元 6,913	英镑 5,098	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(50)
美元 20,547	离岸人民币 145,883	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(50)
美元 193,999	离岸人民币 1,380,365	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(53)
美元 35,039	欧元 29,738	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(54)
美元 31,525	离岸人民币 223,922	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(63)
美元 31,625	离岸人民币 224,635	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(63)
美元 11,766	英镑 8,688	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(68)
美元 3,111	纽元 5,235	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(69)
美元 31,489	离岸人民币 223,607	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(72)
美元 104,406	离岸人民币 742,574	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(72)

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 5,770	纽元 9,804	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(73)
美元 36,888	离岸人民币 262,018	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(74)
美元 9,898	加元 13,653	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(76)
美元 33,628	离岸人民币 238,796	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(77)
美元 8,265	纽元 14,087	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(79)
美元 44,415	离岸人民币 315,482	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(89)
美元 48,839	离岸人民币 346,947	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(91)
美元 6,579	加元 9,012	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(96)
美元 65,603	离岸人民币 466,221	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(97)
美元 51,253	离岸人民币 364,051	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(102)
美元 32,865	澳元 49,407	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(111)
美元 42,717	澳元 64,267	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(112)
美元 58,598	离岸人民币 416,221	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(117)
美元 30,197	离岸人民币 214,066	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(120)
美元 61,030	离岸人民币 433,500	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(122)
美元 29,084	欧元 24,616	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(125)
美元 54,901	离岸人民币 389,855	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(125)
美元 160,119	欧元 135,985	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(142)
美元 48,354	离岸人民币 343,137	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(142)
美元 326,613	澳元 492,456	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(143)
美元 53,071	离岸人民币 376,694	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(144)
美元 218,473	欧元 185,583	2025 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(147)
美元 48,854	离岸人民币 346,653	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(148)
美元 5,862	纽元 9,823	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(154)
美元 84,084	离岸人民币 597,324	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(157)
美元 23,932	英镑 17,647	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(172)
美元 116,324	离岸人民币 826,683	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(172)
美元 59,877	离岸人民币 424,904	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(176)
美元 274,910	离岸人民币 1,955,275	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(187)
美元 68,758	离岸人民币 487,999	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(193)
美元 112,731	离岸人民币 800,961	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(193)
美元 33,030	加元 45,635	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(199)
美元 7,982	纽元 13,370	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(212)
美元 78,687	离岸人民币 558,511	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(214)
美元 17,799	加元 24,430	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(224)
美元 97,278	离岸人民币 690,655	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(238)
美元 85,780	离岸人民币 608,761	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(247)
美元 49,830	离岸人民币 352,759	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(266)
美元 1,039,589	离岸人民币 7,397,005	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(283)
美元 199,411	离岸人民币 1,417,153	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(296)
美元 39,524	加元 54,487	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(326)
美元 12,537	纽元 21,010	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(328)
美元 175,287	离岸人民币 1,245,024	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(356)
美元 137,514	离岸人民币 975,979	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(385)
美元 128,728	离岸人民币 913,419	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(389)
美元 139,135	离岸人民币 987,463	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(392)
美元 101,677	离岸人民币 720,792	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(403)
美元 35,823	纽元 60,940	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(411)
美元 146,425	离岸人民币 1,039,208	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(413)
美元 97,071	离岸人民币 687,891	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(420)
美元 25,242	纽元 42,706	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(426)
美元 108,400	英镑 80,135	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(506)
美元 430,132	离岸人民币 3,057,429	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(552)
美元 123,618	澳元 185,534	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(620)
美元 70,189	欧元 59,116	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(643)
美元 231,959	离岸人民币 1,646,281	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(650)
美元 294,593	离岸人民币 2,091,910	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(671)
美元 260,985	离岸人民币 1,852,421	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(713)
美元 293,799	离岸人民币 2,085,854	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(728)
美元 374,096	离岸人民币 2,657,223	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(747)
美元 468,283	离岸人民币 3,327,176	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(802)
美元 1,182,406	离岸人民币 8,409,706	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(811)
美元 426,656	离岸人民币 3,030,459	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(866)
美元 145,104	英镑 107,058	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(961)
美元 103,191	英镑 75,925	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(966)

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 351,101	欧元 297,619	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(973)
美元 658,256	离岸人民币 4,678,038	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(975)
美元 349,106	离岸人民币 2,477,510	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(1,006)
美元 416,307	离岸人民币 2,955,715	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,018)
美元 810,662	离岸人民币 5,762,273	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,041)
美元 218,277	澳元 327,605	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,094)
美元 405,594	离岸人民币 2,877,943	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(1,232)
美元 199,732	加元 275,845	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,287)
美元 649,899	离岸人民币 4,616,111	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(1,318)
美元 777,484	离岸人民币 5,524,067	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(1,332)
美元 255,684	离岸人民币 1,810,052	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(1,365)
美元 264,851	离岸人民币 1,874,946	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,414)
美元 721,929	离岸人民币 5,127,714	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,466)
美元 736,449	离岸人民币 5,230,948	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,482)
美元 556,942	离岸人民币 3,952,472	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(1,607)
美元 188,241	欧元 158,608	2025 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,649)
美元 424,142	离岸人民币 3,006,750	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,683)
美元 405,180	离岸人民币 2,871,280	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(1,754)
美元 663,969	离岸人民币 4,712,724	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,814)
美元 764,180	离岸人民币 5,425,376	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,895)
美元 706,047	离岸人民币 5,011,032	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,979)
美元 306,994	澳元 460,016	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(2,030)
美元 705,357	加元 977,315	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(2,267)
美元 787,218	离岸人民币 5,586,330	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,318)
美元 1,242,419	离岸人民币 8,826,063	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,325)
美元 1,180,785	离岸人民币 8,387,032	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,376)
美元 1,186,804	离岸人民币 8,429,621	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(2,411)
美元 1,002,677	离岸人民币 7,118,580	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(2,490)
美元 873,825	离岸人民币 6,200,920	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,573)
美元 854,395	离岸人民币 6,062,464	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(2,596)
美元 1,187,156	离岸人民币 8,430,089	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,697)
美元 363,464	加元 501,373	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(2,771)
美元 679,149	离岸人民币 4,812,747	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(2,941)
美元 1,739,023	离岸人民币 12,355,856	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(2,979)
美元 453,342	加元 626,008	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(2,985)
美元 1,097,368	离岸人民币 7,788,353	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3,075)
美元 773,252	新加坡元 991,032	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3,297)
美元 842,343	英镑 623,150	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(3,333)
美元 498,033	英镑 367,389	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(3,381)
美元 7,940,275	离岸人民币 56,486,960	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3,648)
美元 2,054,147	离岸人民币 14,590,684	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4,102)
美元 596,694	加元 823,560	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4,216)
美元 378,793	加元 520,308	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(4,478)
美元 1,151,455	离岸人民币 8,162,683	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,568)
美元 1,596,297	离岸人民币 11,328,495	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(4,602)
美元 489,822	加元 673,759	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(5,113)
美元 538,150	英镑 395,863	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(5,160)
美元 1,113,041	澳元 1,671,107	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(5,192)
美元 2,705,757	离岸人民币 19,218,432	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(5,496)
美元 251,539	纽元 422,892	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(5,795)
美元 451,877	英镑 331,248	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(5,885)
美元 922,225	澳元 1,381,941	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(6,076)
美元 1,448,383	离岸人民币 10,263,866	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(6,271)
美元 251,180	纽元 420,197	2025 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(7,002)
美元 305,633	纽元 512,305	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(7,933)
美元 1,624,558	离岸人民币 11,500,648	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(8,674)
美元 464,495	纽元 782,414	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(9,832)
美元 30,824,044	离岸人民币 219,281,633	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(14,162)
美元 47,508,440	离岸人民币 337,974,089	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(21,828)
美元 39,788,520	英镑 29,534,363	2025 年 10 月 21 日	美国道富银行	(23,424)
美元 126,097,713	离岸人民币 897,056,607	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(57,935)
美元 21,582,959	纽元 36,669,854	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(273,997)
美元 31,974,894	加元 44,048,263	2025 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(286,135)
美元 33,926	新加坡元 43,358	2025 年 10 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(237)
美元 46,763	新加坡元 59,764	2025 年 10 月 22 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(327)

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 72,164	新加坡元 92,419	2025 年 10 月 22 日	美林国际，伦敦	(356)
美元 39,038	新加坡元 49,721	2025 年 10 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(405)
美元 3,308,557	新加坡元 4,243,019	2025 年 10 月 22 日	高盛国际，伦敦	(11,782)
澳元 1,673	美元 1,109	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(0)
澳元 145,331	美元 96,381	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(1)
加元 1,532	美元 1,103	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 1,209,892	美元 170,250	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(116)
离岸人民币 2,118,532	美元 298,110	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(203)
离岸人民币 6,535,687	美元 919,672	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(627)
欧元 52,390	美元 61,739	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(5)
纽元 1,901	美元 1,106	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(0)
纽元 40,528	美元 23,577	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(2)
未实现总亏损				(932,433)
未实现净收益				275,377

2024

未平仓合约：

加元 242,742	美元 179,889	2024 年 10 月 2 日	Citibank N.A.，伦敦	206
加元 97,821	美元 72,600	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	192
美元 155,714	纽元 246,520	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	1,135
美元 177,303	新加坡元 227,645	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	267
美元 12,013	英镑 8,967	2024 年 10 月 2 日	巴克莱银行，伦敦	14
美元 1,101	英镑 821	2024 年 10 月 2 日	Citibank N.A.，伦敦	1
加元 19,688	美元 14,632	2024 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	58
美元 248,393	澳元 358,392	2024 年 10 月 3 日	Citibank N.A.，伦敦	246
美元 35,019	英镑 26,119	2024 年 10 月 3 日	Citibank N.A.，伦敦	16
美元 1,101	英镑 820	2024 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	0
美元 1,099	纽元 1,728	2024 年 10 月 3 日	巴克莱银行，伦敦	0
欧元 12,005	美元 13,422	2024 年 10 月 4 日	Citibank N.A.，伦敦	23
美元 43,266	纽元 68,003	2024 年 10 月 4 日	巴克莱银行，伦敦	0
加元 289,000	美元 213,950	2024 年 10 月 7 日	巴克莱银行，伦敦	4
欧元 24,016	美元 26,808	2024 年 10 月 7 日	巴克莱银行，伦敦	0
英镑 27,719	美元 37,180	2024 年 10 月 7 日	法国巴黎银行	0
美元 12,142	离岸人民币 85,265	2024 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	46
美元 4,411	离岸人民币 30,973	2024 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	17
离岸人民币 3,278,574	美元 469,956	2024 年 10 月 10 日	巴克莱银行，伦敦	1,216
离岸人民币 1,590,510	美元 227,986	2024 年 10 月 10 日	法国巴黎银行	590
离岸人民币 10,404,998	美元 1,490,446	2024 年 10 月 15 日	美林国际，伦敦	2,117
离岸人民币 4,365,346	美元 625,258	2024 年 10 月 15 日	美林国际，伦敦	840
加元 719,904	美元 533,431	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	302
加元 336,052	美元 249,036	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	171
加元 22,151	美元 16,434	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	30
加元 9,487	美元 7,044	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	18
加元 1,482	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4
加元 1,485	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3
加元 1,480	美元 1,100	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	3
加元 2,404	美元 1,782	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	2
离岸人民币 8,379,430	美元 1,202,158	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	2,869
离岸人民币 1,476,535	美元 211,850	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	524
离岸人民币 986,995	美元 141,524	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	262
离岸人民币 674,937	美元 96,839	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	240
离岸人民币 603,274	美元 86,456	2024 年 10 月 21 日	美国道富银行	114
离岸人民币 321,829	美元 46,175	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	114
离岸人民币 532,407	美元 76,293	2024 年 10 月 21 日	美国道富银行	93
离岸人民币 156,462	美元 22,449	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	55
离岸人民币 91,971	美元 13,188	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	24
离岸人民币 69,032	美元 9,904	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	24
离岸人民币 47,606	美元 6,830	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	17
离岸人民币 64,235	美元 9,206	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	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 37,166	美元 5,326	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	7
离岸人民币 7,733	美元 1,109	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3
离岸人民币 7,733	美元 1,109	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3
欧元 109,161	美元 122,126	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	194
纽元 191,986	美元 122,211	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	54
纽元 4,831	美元 3,075	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1
新加坡元 4,499	美元 3,518	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	5
美元 79,027,261	澳元 117,304,177	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	2,378,671
美元 146,825,788	离岸人民币 1,035,707,638	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,407,780
美元 40,350,631	英镑 30,622,237	2024 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	723,925
美元 26,445,572	纽元 42,484,621	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	586,415
美元 23,536,486	离岸人民币 166,026,134	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	225,670
美元 13,990,067	离岸人民币 98,685,794	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	134,138
美元 6,536,561	离岸人民币 46,108,836	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	62,673
美元 5,159,138	新加坡元 6,685,268	2024 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	60,938
美元 11,997,312	欧元 10,775,498	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	38,854
美元 784,394	澳元 1,168,705	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	26,656
美元 1,235,320	澳元 1,806,905	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	18,623
美元 1,468,721	离岸人民币 10,389,339	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	18,232
美元 2,240,086	离岸人民币 15,770,813	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	17,079
美元 1,350,784	澳元 1,966,431	2024 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	13,865
美元 412,704	澳元 612,177	2024 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	12,130
美元 1,907,498	澳元 2,765,443	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	11,645
美元 474,103	澳元 696,489	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	9,242
美元 747,413	离岸人民币 5,286,221	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	9,167
美元 2,468,851	离岸人民币 17,310,395	2024 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	8,664
美元 401,538	英镑 305,757	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	8,583
美元 868,657	离岸人民币 6,128,145	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	8,422
美元 613,455	离岸人民币 4,344,537	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	8,348
美元 261,833	纽元 423,761	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	7,796
美元 402,489	纽元 642,887	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	6,565
美元 147,609	澳元 221,690	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	6,238
美元 393,445	离岸人民币 2,788,281	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	5,623
美元 392,757	离岸人民币 2,783,411	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	5,613
美元 626,351	英镑 470,353	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	4,548
美元 305,583	离岸人民币 2,165,400	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	4,336
美元 278,822	离岸人民币 1,978,193	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4,303
美元 309,507	离岸人民币 2,191,954	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4,212
美元 549,465	离岸人民币 3,868,383	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4,189
美元 627,152	纽元 992,155	2024 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	4,133
美元 439,493	纽元 697,020	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4,004
美元 130,178	英镑 100,000	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,955
美元 133,700	纽元 216,015	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3,745
美元 209,334	英镑 158,717	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	3,558
美元 275,057	离岸人民币 1,946,200	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3,489
美元 211,495	离岸人民币 1,500,520	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,264
美元 261,374	离岸人民币 1,848,886	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,245
美元 154,784	纽元 248,280	2024 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	3,191
美元 244,856	英镑 184,753	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,959
美元 329,027	离岸人民币 2,316,441	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,509
美元 259,312	离岸人民币 1,828,983	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,458
美元 212,597	离岸人民币 1,501,173	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2,255
美元 49,903	澳元 75,000	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,145
美元 305,279	离岸人民币 2,146,899	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,992
美元 77,473	澳元 114,482	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,975
美元 153,348	离岸人民币 1,084,745	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,904
美元 974,126	英镑 727,612	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,843
美元 259,097	离岸人民币 1,822,927	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,806
美元 106,533	离岸人民币 756,725	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,772
美元 134,430	离岸人民币 950,782	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	1,649
美元 430,004	离岸人民币 3,015,808	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,627
美元 114,131	离岸人民币 808,744	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,619
美元 438,089	离岸人民币 3,071,668	2024 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	1,537
美元 119,724	离岸人民币 847,122	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,519
美元 156,282	离岸人民币 1,102,290	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,481
美元 204,616	离岸人民币 1,439,618	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,426



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 290,096	加元 393,530	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,335
美元 692,348	英镑 517,101	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,255
美元 567,843	离岸人民币 3,975,970	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,210
美元 78,861	离岸人民币 558,820	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,119
美元 110,274	欧元 99,724	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,117
美元 293,098	离岸人民币 2,055,622	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,109
美元 79,111	离岸人民币 559,840	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,015
美元 78,024	离岸人民币 551,842	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	957
美元 66,680	离岸人民币 472,550	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	953
美元 98,272	离岸人民币 693,257	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	949
美元 264,986	离岸人民币 1,857,956	2024 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	930
美元 71,306	离岸人民币 504,533	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	905
美元 66,563	离岸人民币 470,851	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	826
美元 172,483	加元 234,010	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	815
美元 102,199	离岸人民币 719,512	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	779
美元 70,681	离岸人民币 499,088	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	750
美元 150,898	加元 204,736	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	720
美元 178,002	离岸人民币 1,248,406	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	674
美元 39,378	离岸人民币 279,820	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	671
美元 51,469	离岸人民币 364,224	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	660
美元 68,034	离岸人民币 479,943	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	657
美元 119,317	欧元 107,389	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	636
美元 52,043	新加坡元 67,454	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	627
美元 445,555	加元 602,475	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	612
美元 182,844	欧元 164,233	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	603
美元 80,894	新加坡元 104,349	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	585
美元 18,812	纽元 30,381	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	518
美元 73,093	离岸人民币 514,033	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	477
美元 216,172	离岸人民币 1,513,567	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	454
美元 26,595	离岸人民币 188,942	2024 年 10 月 21 日	美国道富银行	447
美元 34,061	离岸人民币 240,905	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	418
美元 112,677	离岸人民币 790,036	2024 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	395
美元 17,220	纽元 27,683	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	395
美元 30,788	欧元 27,914	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	392
美元 82,667	英镑 61,922	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	391
美元 40,079	离岸人民币 282,749	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	389
美元 20,603	离岸人民币 146,407	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	351
美元 16,635	英镑 12,640	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	319
美元 27,184	新加坡元 35,155	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	267
美元 31,335	新加坡元 40,466	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	262
美元 89,087	新加坡元 114,391	2024 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	233
美元 39,350	加元 53,444	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	228
美元 6,108	纽元 9,941	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	217
美元 7,917	英镑 6,052	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	201
美元 73,932	欧元 66,355	2024 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	186
美元 62,280	欧元 55,912	2024 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	173
美元 147,374	英镑 110,000	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	172
美元 19,123	加元 26,000	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	132
美元 7,470	英镑 5,664	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	128
美元 14,835	离岸人民币 104,372	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	103
美元 7,141	离岸人民币 50,572	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	97
美元 45,177	离岸人民币 316,315	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	95
美元 2,691	澳元 4,000	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	85
美元 3,967	英镑 3,018	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	80
美元 2,726	英镑 2,088	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	74
美元 7,375	离岸人民币 52,030	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	71
美元 6,664	离岸人民币 47,056	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	71
美元 1,385	澳元 2,082	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	60
美元 8,007	离岸人民币 56,334	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	56
美元 1,182	澳元 1,759	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	39
美元 1,189	澳元 1,767	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	37
美元 3,503	离岸人民币 24,722	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	36
美元 1,248	纽元 2,018	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	36
美元 1,532	新加坡元 2,000	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	30
美元 1,625	离岸人民币 11,540	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	27
美元 2,686	欧元 2,428	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	26
美元 1,743	离岸人民币 12,350	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	25
美元 4,315	加元 5,846	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	14

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 1,404	离岸人民币 9,902	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	13
美元 6,959	欧元 6,238	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	9
美元 252	离岸人民币 1,785	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
澳元 579,406	美元 402,221	2024 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	2
澳元 2,731	美元 1,896	2024 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	0
英镑 157,820	美元 211,677	2024 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	2
英镑 820	美元 1,100	2024 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	0
美元 2,015,595	离岸人民币 14,056,902	2024 年 11 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,423
美元 292,809	英镑 218,809	2024 年 11 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	667
美元 569,264	澳元 820,658	2024 年 11 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	430
美元 1,039,903	离岸人民币 7,249,610	2024 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	340
美元 434,346	离岸人民币 3,029,157	2024 年 11 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	306
美元 185,120	纽元 291,298	2024 年 11 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	230
美元 193,227	离岸人民币 1,347,068	2024 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	63
美元 122,454	离岸人民币 853,678	2024 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	40
美元 49,332	离岸人民币 343,915	2024 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	16
美元 26,858	欧元 24,016	2024 年 11 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	1
			未实现总收益	5,956,560
美元 3,075	纽元 4,831	2024 年 10 月 2 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
美元 3,515	新加坡元 4,499	2024 年 10 月 2 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
英镑 110,000	美元 147,377	2024 年 10 月 3 日	巴克莱银行, 伦敦	(171)
美元 1,895	澳元 2,731	2024 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	(0)
美元 1,098	欧元 984	2024 年 10 月 3 日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
美元 1,098	加元 1,483	2024 年 10 月 3 日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
美元 1,099	加元 1,480	2024 年 10 月 3 日	巴克莱银行, 伦敦	(3)
美元 16,428	加元 22,151	2024 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	(31)
美元 122,208	纽元 191,986	2024 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	(57)
美元 122,040	欧元 109,161	2024 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	(207)
美元 211,691	英镑 157,820	2024 年 10 月 4 日	法国巴黎银行	(0)
美元 127,379	欧元 114,125	2024 年 10 月 4 日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
美元 401,977	澳元 579,406	2024 年 10 月 4 日	法国巴黎银行	(1)
美元 260,614	加元 352,055	2024 年 10 月 4 日	巴克莱银行, 伦敦	(5)
纽元 154,650	美元 98,394	2024 年 10 月 7 日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
澳元 115,413	美元 80,075	2024 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 316,315	美元 45,117	2024 年 10 月 8 日	Citibank N.A., 伦敦	(99)
离岸人民币 1,513,567	美元 215,883	2024 年 10 月 8 日	Citibank N.A., 伦敦	(476)
离岸人民币 1,248,406	美元 177,777	2024 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	(678)
离岸人民币 3,975,970	美元 567,100	2024 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	(1,250)
美元 1,108	离岸人民币 7,733	2024 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	(3)
美元 46,124	离岸人民币 321,829	2024 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	(120)
离岸人民币 2,055,622	美元 292,755	2024 年 10 月 9 日	法国巴黎银行	(1,110)
离岸人民币 3,015,808	美元 429,502	2024 年 10 月 9 日	法国巴黎银行	(1,628)
美元 6,823	离岸人民币 47,606	2024 年 10 月 9 日	法国巴黎银行	(18)
美元 9,894	离岸人民币 69,032	2024 年 10 月 9 日	巴克莱银行, 伦敦	(26)
美元 5,321	离岸人民币 37,166	2024 年 10 月 10 日	法国巴黎银行	(8)
美元 9,198	离岸人民币 64,235	2024 年 10 月 10 日	法国巴黎银行	(14)
离岸人民币 3,029,157	美元 433,006	2024 年 10 月 15 日	巴克莱银行, 伦敦	(284)
离岸人民币 14,056,902	美元 2,009,376	2024 年 10 月 15 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,321)
澳元 1,603	美元 1,104	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(8)
澳元 1,606	美元 1,103	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(11)
澳元 1,602	美元 1,100	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(12)
澳元 1,619	美元 1,110	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
澳元 1,633	美元 1,105	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(28)
澳元 1,633	美元 1,099	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(35)
澳元 1,644	美元 1,105	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(36)
澳元 3,039	美元 2,066	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(44)
澳元 1,655	美元 1,098	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(50)
澳元 1,929	美元 1,285	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(54)
澳元 2,040	美元 1,357	2024 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(58)
澳元 5,773	美元 3,923	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(83)
澳元 3,706	美元 2,481	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(90)
澳元 7,223	美元 4,870	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(143)
澳元 358,392	美元 248,461	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(253)
澳元 51,486	美元 35,374	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(356)
澳元 96,348	美元 66,028	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(835)

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 437,095	美元 300,070	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3,262)
澳元 108,936	美元 72,326	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3,273)
澳元 143,033	美元 95,178	2024 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(4,082)
澳元 257,471	美元 173,083	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(5,595)
澳元 459,365	美元 312,740	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(6,046)
澳元 255,543	美元 170,149	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(7,191)
澳元 437,368	美元 294,716	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(8,805)
澳元 550,536	美元 370,407	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(11,650)
澳元 638,567	美元 426,079	2024 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(17,069)
澳元 2,176,126	美元 1,466,914	2024 年 10 月 21 日	美国道富银行	(43,259)
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 1,495	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(6)
加元 2,487	美元 1,834	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(9)
加元 5,983	美元 4,409	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(22)
加元 144,225	美元 106,191	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(616)
加元 222,219	美元 163,893	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(673)
加元 170,297	美元 125,386	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(728)
离岸人民币 7,760	美元 1,108	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 7,760	美元 1,108	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 7,760	美元 1,108	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 7,760	美元 1,108	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
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 22,951	美元 3,278	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(7)
离岸人民币 13,232	美元 1,887	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(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 7,780	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 7,780	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	Citibank N.A., 伦敦	(8)
离岸人民币 7,757	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
离岸人民币 7,757	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
离岸人民币 7,757	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
离岸人民币 7,981	美元 1,132	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(11)
离岸人民币 7,792	美元 1,104	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(11)
离岸人民币 11,947	美元 1,698	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 43,930	美元 6,274	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
离岸人民币 14,257	美元 2,026	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,843	美元 1,108	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,843	美元 1,108	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,843	美元 1,108	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 7,834	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 7,808	美元 1,103	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(14)
离岸人民币 16,294	美元 2,317	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(15)
离岸人民币 9,864	美元 1,397	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(15)
离岸人民币 7,796	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(15)
离岸人民币 7,796	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(15)
离岸人民币 7,796	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(15)
离岸人民币 7,796	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(15)
离岸人民币 8,058	美元 1,137	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 7,796	美元 1,100	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 30,973	美元 4,416	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(17)
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 7,848	美元 1,106	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(17)
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 7,921	美元 1,115	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(19)

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 7,837	美元 1,103	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	美国道富银行	(19)
离岸人民币 7,829	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	美国道富银行	(19)
离岸人民币 42,045	美元 5,995	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(23)
离岸人民币 15,134	美元 2,139	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(27)
离岸人民币 16,049	美元 2,269	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(28)
离岸人民币 22,193	美元 3,146	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(30)
离岸人民币 21,966	美元 3,114	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(30)
离岸人民币 15,035	美元 2,122	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(30)
离岸人民币 14,695	美元 2,071	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(32)
离岸人民币 22,315	美元 3,160	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(34)
离岸人民币 19,585	美元 2,765	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(38)
离岸人民币 22,772	美元 3,218	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(41)
离岸人民币 139,190	美元 19,879	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(43)
离岸人民币 85,265	美元 12,157	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(46)
离岸人民币 198,729	美元 28,382	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(61)
离岸人民币 68,531	美元 9,744	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(64)
离岸人民币 119,943	美元 17,102	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(65)
离岸人民币 32,567	美元 4,595	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(66)
离岸人民币 28,848	美元 4,059	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(69)
离岸人民币 47,354	美元 6,706	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(71)
离岸人民币 53,287	美元 7,553	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(73)
离岸人民币 42,424	美元 5,990	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(82)
离岸人民币 47,823	美元 6,759	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(86)
离岸人民币 46,524	美元 6,547	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(112)
离岸人民币 52,175	美元 7,345	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(122)
离岸人民币 101,408	美元 14,377	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(137)
离岸人民币 93,929	美元 13,274	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(169)
离岸人民币 88,162	美元 12,441	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(177)
离岸人民币 111,543	美元 15,765	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(199)
离岸人民币 147,105	美元 20,852	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(202)
离岸人民币 117,888	美元 16,601	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(272)
离岸人民币 948,272	美元 135,428	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(291)
离岸人民币 329,874	美元 46,883	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(329)
离岸人民币 197,484	美元 27,868	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(397)
离岸人民币 310,704	美元 44,042	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(427)
离岸人民币 243,850	美元 34,408	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(493)
离岸人民币 538,198	美元 76,525	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(503)
离岸人民币 240,025	美元 33,776	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(577)
离岸人民币 357,931	美元 50,582	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(646)
离岸人民币 454,212	美元 64,323	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(685)
离岸人民币 372,415	美元 52,467	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(834)
离岸人民币 463,238	美元 65,292	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,008)
离岸人民币 744,141	美元 105,440	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,064)
离岸人民币 532,637	美元 75,074	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,159)
离岸人民币 1,191,698	美元 169,371	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,189)
离岸人民币 1,219,342	美元 172,874	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,642)
离岸人民币 826,942	美元 116,503	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(1,852)
离岸人民币 3,626,315	美元 517,043	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,966)
离岸人民币 980,248	美元 138,321	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,975)
离岸人民币 1,706,668	美元 241,824	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,439)
离岸人民币 1,253,827	美元 176,932	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,519)
离岸人民币 1,404,353	美元 197,851	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(3,144)
离岸人民币 2,929,159	美元 415,043	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,187)
离岸人民币 1,890,867	美元 266,188	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(4,439)
离岸人民币 3,036,205	美元 429,071	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(5,480)
离岸人民币 3,524,703	美元 497,344	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(7,122)
离岸人民币 4,896,476	美元 693,409	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(7,389)
离岸人民币 3,266,432	美元 459,979	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(7,523)
离岸人民币 4,647,653	美元 656,215	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(8,971)
离岸人民币 5,056,171	美元 714,549	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(9,105)
离岸人民币 8,228,258	美元 1,159,230	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(18,423)
离岸人民币 16,799,198	美元 2,380,339	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(24,012)
欧元 989	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3)
欧元 987	美元 1,100	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
欧元 996	美元 1,107	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
欧元 994	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(8)
欧元 2,560	美元 2,843	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(16)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／（亏损） 美元
欧元 15,302	美元 16,975	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(118)
欧元 96,244	美元 107,216	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(288)
欧元 45,880	美元 50,734	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(514)
欧元 68,390	美元 75,595	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(796)
欧元 189,931	美元 211,134	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,018)
欧元 140,015	美元 154,429	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,967)
英镑 823	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
英镑 821	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
英镑 824	美元 1,103	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2)
英镑 824	美元 1,103	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2)
英镑 828	美元 1,106	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
英镑 830	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(11)
英镑 8,967	美元 12,013	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(14)
英镑 26,119	美元 35,018	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
英镑 833	美元 1,099	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(19)
英镑 837	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(21)
英镑 835	美元 1,092	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(28)
英镑 990	美元 1,295	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(33)
英镑 15,560	美元 20,773	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(98)
英镑 4,999	美元 6,572	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(133)
英镑 48,519	美元 64,885	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(195)
英镑 18,259	美元 24,196	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(296)
英镑 110,524	美元 146,777	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,473)
英镑 170,556	美元 224,472	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4,300)
英镑 153,812	美元 201,429	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(4,884)
英镑 241,617	美元 316,085	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(8,003)
英镑 578,334	美元 761,667	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(14,070)
纽元 1,755	美元 1,109	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(7)
纽元 1,740	美元 1,097	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(11)
纽元 1,768	美元 1,109	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(17)
纽元 1,768	美元 1,109	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(17)
纽元 1,772	美元 1,105	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(23)
纽元 1,758	美元 1,088	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(31)
纽元 1,784	美元 1,103	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(32)
纽元 1,791	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(38)
纽元 1,770	美元 1,088	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(39)
纽元 36,697	美元 23,197	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(152)
纽元 11,813	美元 7,285	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(231)
纽元 33,850	美元 21,220	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(318)
纽元 16,075	美元 9,832	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(396)
纽元 25,531	美元 15,842	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(403)
纽元 33,257	美元 20,726	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(434)
纽元 29,146	美元 18,036	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(509)
纽元 33,134	美元 20,517	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(565)
纽元 67,685	美元 42,101	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(965)
纽元 246,520	美元 155,714	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,142)
纽元 84,017	美元 51,678	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,780)
纽元 182,813	美元 114,392	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,928)
纽元 208,478	美元 128,364	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(4,286)
纽元 819,937	美元 510,000	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(11,707)
纽元 854,429	美元 525,487	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(18,167)
新加坡元 1,440	美元 1,107	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(17)
新加坡元 10,513	美元 8,070	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(140)
新加坡元 227,645	美元 177,469	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(284)
新加坡元 44,878	美元 34,463	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(579)
新加坡元 117,672	美元 90,700	2024 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(1,182)
美元 3,824	加元 5,162	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
美元 125,236	新加坡元 160,365	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(18)
美元 13,431	欧元 12,005	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(21)
美元 285,595	欧元 255,648	2024 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(38)
美元 14,637	加元 19,688	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(58)
美元 72,630	加元 97,821	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(188)
美元 179,961	加元 242,742	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(196)
美元 158,665	离岸人民币 1,106,961	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(234)
美元 205,431	欧元 183,532	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(427)
美元 228,209	离岸人民币 1,590,510	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(570)
美元 399,823	离岸人民币 2,789,450	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(589)
美元 625,546	离岸人民币 4,365,346	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(765)

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 632,814	离岸人民币 4,414,961	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(932)
美元 470,429	离岸人民币 3,278,574	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	(1,190)
美元 698,480	加元 940,912	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc，伦敦	(1,681)
美元 1,491,124	离岸人民币 10,404,998	2024 年 10 月 21 日	美林国际，伦敦	(1,929)
美元 492,487	加元 662,022	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	(2,221)
美元 3,467,260	离岸人民币 24,190,068	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(5,105)
美元 29,011,764	加元 39,129,147	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(34,402)
加元 1,483	美元 1,099	2024 年 11 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	(0)
加元 352,055	美元 260,916	2024 年 11 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	(4)
离岸人民币 7,678	美元 1,101	2024 年 11 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	(1)
离岸人民币 40,347	美元 5,785	2024 年 11 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	(5)
离岸人民币 2,325,588	美元 333,419	2024 年 11 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	(278)
离岸人民币 3,487,472	美元 500,030	2024 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(386)
离岸人民币 5,233,851	美元 750,392	2024 年 11 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	(611)
欧元 984	美元 1,100	2024 年 11 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	(0)
欧元 114,125	美元 127,627	2024 年 11 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	(7)
纽元 1,728	美元 1,100	2024 年 11 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	(0)
纽元 68,003	美元 43,268	2024 年 11 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	(1)
美元 37,178	英镑 27,719	2024 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(0)
美元 80,120	澳元 115,413	2024 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(1)
美元 98,405	纽元 154,650	2024 年 11 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	(2)
美元 214,193	加元 289,000	2024 年 11 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	(5)
美元 36,302	新加坡元 46,398	2024 年 11 月 21 日	高盛国际，伦敦	(16)
美元 207,634	加元 280,061	2024 年 11 月 21 日	高盛国际，伦敦	(71)
美元 84,598	欧元 75,492	2024 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(170)
			未实现总亏损	(382,648)
			未实现净收益	5,573,912

独立核数师报告

致摩根亚洲股息基金（“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

摩根亚洲股息基金列载于第四页至第四十三页的财务报表，包括：

- 于二零二五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会计准则真实而中肯地反映了贵基金于二零二五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会计准则拟备真实而中肯的财务报表，并对其认为为使财务报表的拟备不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述所需的内部控制负责。

在拟备财务报表时，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二零一一年五月六日订立的信托契约（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上或承担任何责任。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）

致摩根亚洲股息基金（“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。

本独立核数师报告所涉审计项目合伙人为莫舜华（执业证书编号：P07047）。

罗兵咸永道会计师事务所  
执业会计师

香港，二零二六年一月二十七日



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；
- （在合理可行的情况下）保护本基金的财产及附带权利；及
- 就每一个会计年度，若管理人未按照信托契约管理本基金，则须向份额持有人报告。

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二零二五年九月三十日止财政年度在各个重要方面均依照二零一一年五月六日所订立之信托契约（经修订）之条款管理本基金。

汇丰机构信托服务（亚洲）有限公司，受托人

二零二六年一月二十七日

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
30/9/25		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 120,608,148	澳元 10.38
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 46,819,170	加元 11.01
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 13,639,132	欧元 11.58
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 29,754,828	英镑 11.27
- 港元类别 (累计)	港元 33,385,519	港元 20.41
- 港元类别 (每月派息)	港元 1,520,295,280	港元 11.77
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 35,495,563	纽元 10.64
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 1,117,252,108	人民币 16.50
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 1,072,850,049	人民币 12.49
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 504,826,083	人民币 15.05
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 268,520,378	人民币 11.56
- PRC 美元份额 (累计)	美元 55,413,002	美元 15.54
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 46,561,728	美元 11.78
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 67,191,500	人民币 22.68
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 919,856,562	人民币 11.97
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 5,316,400	新加坡元 11.25
- 美元类别 (累计)	美元 9,101,226	美元 20.43
- 美元类别 (每月派息)	美元 294,816,523	美元 11.75
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 60,777,891	美元 13.96
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 33,982,986	美元 12.69
30/9/24		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 120,369,763	澳元 9.20
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 40,955,854	加元 9.65
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11,017,196	欧元 10.12
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 31,775,385	英镑 9.92
- 港元类别 (累计)	港元 18,142,343	港元 17.16
- 港元类别 (每月派息)	港元 1,461,539,883	港元 10.28
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 42,961,423	纽元 9.41
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 182,312,726	人民币 13.66
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 361,177,704	人民币 10.73
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 145,006,167	人民币 13.00
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 200,486,668	人民币 10.13
- PRC 美元份额 (累计)	美元 14,683,349	美元 13.10
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 19,294,877	美元 10.31
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 40,402,462	人民币 19.59
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 1,059,588,613	人民币 10.49
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 6,820,316	新加坡元 9.84
- 美元类别 (累计)	美元 7,008,760	美元 17.21
- 美元类别 (每月派息)	美元 241,599,859	美元 10.28
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 61,267,181	美元 12.11
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 32,110,026	美元 11.02
30/9/23		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 145,075,558	澳元 7.77
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 57,931,310	加元 8.13
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 15,973,298	欧元 8.51
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 45,072,406	英镑 8.38
- 港元类别 (累计)	港元 22,192,592	港元 13.93
- 港元类别 (每月派息)	港元 1,829,727,869	港元 8.71
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 42,604,365	纽元 7.95
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 13,504,313	人民币 11.45
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 19,301,686	人民币 9.39
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 52,732,738	人民币 10.74
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 83,344,001	人民币 8.51
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12,650,318	美元 10.56
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10,784,066	美元 8.66
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 25,214,077	人民币 16.19
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 1,228,111,258	人民币 8.81
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 6,357,122	新加坡元 8.28
- 美元类别 (累计)	美元 7,274,089	美元 13.86
- 美元类别 (每月派息)	美元 280,663,732	美元 8.63
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 75,937,626	美元 10.08
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 27,387,343	美元 9.18

(续)

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
30/9/25		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.46	澳元 7.62
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 11.09	加元 8.05
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.66	欧元 8.45
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 11.36	英镑 8.25
- 港元类别 (累计)	港元 20.51	港元 14.60
- 港元类别 (每月派息)	港元 11.86	港元 8.58
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.72	纽元 7.80
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 16.52	人民币 12.27
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 12.54	人民币 9.45
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 15.14	人民币 10.95
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 11.64	人民币 8.44
- PRC 美元份额 (累计)	美元 15.63	美元 11.16
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 11.88	美元 8.61
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 22.83	人民币 16.51
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 12.05	人民币 8.74
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 11.31	新加坡元 8.20
- 美元类别 (累计)	美元 20.55	美元 14.66
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.85	美元 8.59
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 14.15	美元 10.16
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 12.79	美元 9.24
30/9/24		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.26	澳元 7.51
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.71	加元 7.85
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.18	欧元 8.22
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.99	英镑 8.08
- 港元类别 (累计)	港元 17.24	港元 13.48
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.36	港元 8.40
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.47	纽元 7.68
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 13.68	人民币 11.15
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.78	人民币 9.14
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 13.05	人民币 10.40
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.17	人民币 8.23
- PRC 美元份额 (累计)	美元 13.15	美元 10.23
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.38	美元 8.37
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 19.67	人民币 15.68
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.53	人民币 8.52
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.90	新加坡元 8.00
- 美元类别 (累计)	美元 17.27	美元 13.43
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.35	美元 8.34
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 12.27	美元 9.78
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 11.09	美元 8.88
30/9/23		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.66	澳元 6.88
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.05	加元 7.15
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 9.46	欧元 7.50
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.30	英镑 7.37
- 港元类别 (累计)	港元 15.00	港元 11.77
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.68	港元 7.65
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.88	纽元 7.04
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 12.12	人民币 9.63
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.05	人民币 8.28
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.81	人民币 9.33
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.47	人民币 7.51
- PRC 美元份额 (累计)	美元 11.39	美元 8.90
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 9.63	美元 7.60
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 17.80	人民币 14.06
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.80	人民币 7.77
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.21	新加坡元 7.28
- 美元类别 (累计)	美元 14.95	美元 11.68
- 美元类别 (每月派息)	美元 9.60	美元 7.57
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 11.16	美元 8.82
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 10.16	美元 7.99

业绩记录 (未经审计)

(续)

(续)

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
30/9/22		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.08	澳元 7.25
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.45	加元 7.53
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.95	欧元 7.91
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.75	英镑 7.77
- 港元类别 (累计)	港元 16.42	港元 12.35
- 港元类别 (每月派息)	港元 11.04	港元 8.06
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.28	纽元 7.41
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 11.86	人民币 9.91
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.47	人民币 8.51
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 13.06	人民币 9.80
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.95	人民币 7.90
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12.52	美元 9.34
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 11.05	美元 8.00
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 19.68	人民币 14.77
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 11.33	人民币 8.18
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.64	新加坡元 7.68
- 美元类别 (累计)	美元 16.42	美元 12.26
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.00	美元 7.97
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 12.76	美元 9.24
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 11.56	美元 8.42
30/9/21		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.26	澳元 7.77
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.62	加元 8.04
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.12	欧元 8.41
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.92	英镑 8.26
- 港元类别 (累计)	港元 16.14	港元 11.93
- 港元类别 (每月派息)	港元 11.14	港元 8.41
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.46	纽元 7.92
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 11.81	人民币 9.14
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.69	人民币 8.45
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 12.70	人民币 9.26
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 11.13	人民币 8.41
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12.37	美元 9.15
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 11.21	美元 8.47
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 19.10	人民币 13.93
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 11.51	人民币 8.69
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.80	新加坡元 8.16
- 美元类别 (累计)	美元 16.21	美元 11.99
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.15	美元 8.42
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 12.90	美元 9.66
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 11.64	美元 8.75
30/9/20		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.50	澳元 5.86
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.68	加元 6.09
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 9.96	欧元 6.39
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.90	英镑 6.22
- 港元类别 (累计)	港元 13.63	港元 8.83
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.99	港元 6.42
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.61	纽元 5.99
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 10.69	人民币 7.20
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.28	人民币 6.87
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 10.43	人民币 6.77
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.00	人民币 6.42
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.45	美元 6.78
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.05	美元 6.47
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 15.72	人民币 10.19
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.34	人民币 6.63
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.72	新加坡元 6.19
- 美元类别 (累计)	美元 13.68	美元 8.88
- 美元类别 (每月派息)	美元 9.99	美元 6.43
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 10.15	美元 9.62
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 10.32	美元 6.65
30/9/19		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.77	澳元 8.53
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.95	加元 8.69
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.20	欧元 8.88
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.17	英镑 8.88
- 港元类别 (累计)	港元 13.61	港元 11.60
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.33	港元 9.00
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.88	纽元 8.63
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 10.55	人民币 9.75
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.39	人民币 9.57
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 10.32	人民币 9.21
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.28	人民币 9.04
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.33	美元 9.26
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.29	美元 9.08
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 15.53	人民币 13.24
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.62	人民币 9.29
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.98	新加坡元 8.72
- 美元类别 (累计)	美元 13.52	美元 11.53
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.22	美元 8.92
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 10.00	美元 9.29
30/9/18		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.73	澳元 9.08
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.90	加元 9.23
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.15	欧元 9.46
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 11.11	英镑 9.44
- 港元类别 (累计)	港元 13.96	港元 12.27
- 港元类别 (每月派息)	港元 11.22	港元 9.57
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.84	纽元 9.18
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 15.82	人民币 13.95
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 11.62	人民币 9.86
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.94	新加坡元 9.26
- 美元类别 (累计)	美元 13.87	美元 12.19
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.15	美元 9.47
30/9/17		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.86	澳元 8.64
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.99	加元 8.76
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.23	欧元 8.96
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.20	英镑 8.93
- 港元类别 (累计)	港元 12.53	港元 10.56
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.28	港元 8.93
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.97	纽元 8.74
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 14.09	人民币 11.61
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.68	人民币 9.32
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.04	新加坡元 8.78
- 美元类别 (累计)	美元 12.46	美元 10.57
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.23	美元 8.94
30/9/16		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.79	澳元 7.71
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.93	加元 7.77
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.15	欧元 7.91
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.14	英镑 7.85
- 港元类别 (累计)	港元 11.81	港元 9.01
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.10	港元 7.94
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.90	纽元 7.75
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.94	人民币 9.65
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.62	人民币 8.32
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.96	新加坡元 7.79
- 美元类别 (累计)	美元 11.82	美元 8.94
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.12	美元 7.88

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

于二零二六年一月二十七日  
Christopher David SPELMAN  
Daniel James WATKINS  
Kit Yee Elka LEUNG  
Stiofan Seamus DEBURCA  
Tsun Kay Edwin CHAN

受托人

汇丰机构信托服务  
（亚洲）有限公司  
香港  
中环皇后大道中 1 号

基金注册登记机构

HSBC Trustee (Cayman)  
Limited  
P.O. Box 309  
Ugland House  
Grand Cayman KY1-1104  
Cayman Islands

核数师

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

