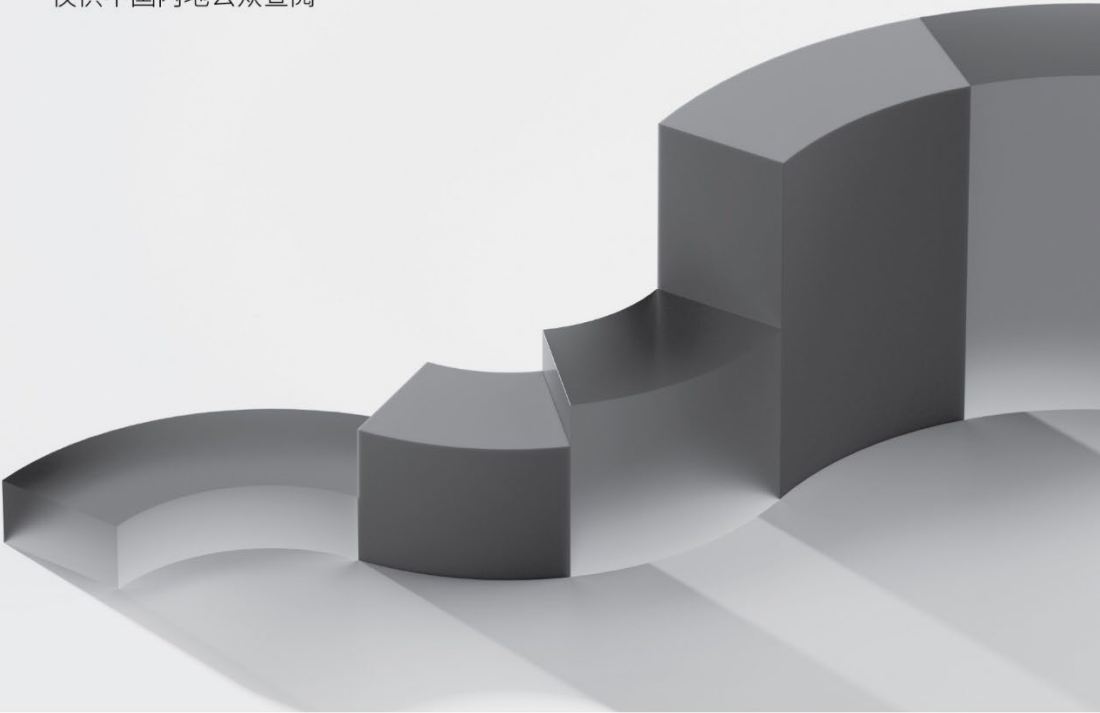


仅供中国内地公众查阅



年度报告－ 2025年9月30日（经审核）

摩根亚洲总收益 债券基金

内地与香港互认基金系列

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

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

内容	页
投资组合 - 未经审计	1 – 13
投资组合持有变动表 - 未经审计	14
金融衍生工具详情 - 未经审计	15
金融衍生工具风险敞口信息 - 未经审计	15
抵押品持有情况 - 未经审计	16
财务状况表	17
综合收益表	17
可赎回份额持有人应占净资产变动表	18
现金流量表	18
财务报表之附注	19 - 55
独立核数师报告	56 - 57
管理人及受托人的责任声明	58
受托人对份额持有人的报告	58
业绩纪录 - 未经审计	58 - 60
经营与管理	60

(续)

- 1 -

投资组合 (续)
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
澳大利亚 (续)				Chile Electricity Lux Ser Regs 6.01% 20Jan2033	美元 4,000,000	3,808,687	0.1
Santos Finance Ltd Ser EMTN (Reg S) (Br) 5.25% 13Mar2029	美元 2,850,000	2,899,251	0.1	Empresa De Los Ferro carr Ser Regs (Reg S) 3.068% 18Aug2050	美元 10,600,000	6,759,615	0.2
Scentre Group Trst 1 Ser MTN 5.35% 18Sep2035	美元 7,030,000	4,625,546	0.2	中国内地 (8.8%)			
Scentre Group Trst 1 Ser MTN 5.9% 27Nov2034	澳元 200,000	140,884	0.0	Alibaba Group Holding (Reg) 4% 06Dec2037	美元 11,000,000	10,313,983	0.4
SGSP Australia Assets Ser EMTN 3.375% 08Oct2032	欧元 3,274,000	3,821,329	0.1	Alibaba Group Holding (Reg) 4.5% 28/11/2034	美元 3,000,000	3,027,282	0.1
Treasury Corp Victoria Ser MTN (Reg) 4.75% 15Sep2036	澳元 1,000,000	647,354	0.0	Alibaba Group Holding Ser Regs (Reg) 5.625% 26Nov2054	美元 3,000,000	3,198,037	0.1
Westpac Banking Corp (Reg) Var 15Nov2035	美元 1,385,000	1,257,452	0.0	Alibaba Group Holding Ser Regs 5.25% 26May2035	美元 12,000,000	12,788,216	0.4
Westpac Banking Corp Ser MTN Var 04Jun2040	澳元 13,000,000	8,902,712	0.3	Azure Orbit IV Intl Fin Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4% 25Jan2028	美元 1,800,000	1,796,148	0.1
比利时 (0.2%)				Central Plaza Dev Ltd 6.8% 07Apr2029	美元 3,000,000	3,163,028	0.1
KBC Group Nv Var Perp 31Dec2049	欧元 4,600,000	5,677,489	0.2	Central Plaza Dev Ltd 7.15% 21Mar2028	美元 2,405,000	2,472,073	0.1
巴西 (0.9%)				CFAMC III Co Ltd (Reg) (Reg S) 3.8% 07Nov2025 (formerly known as Huarong Finance 2017 Co (Reg) (Reg S) 3.8% 07Nov2025)	新加坡元 28,000,000	22,054,455	0.8
Acu Petroleo Luxembourg Ser Regs (Reg) (Reg S) 7.5% 13Jul2035	美元 2,000,000	1,824,929	0.1	CFAMC III Co Ltd 4.75% 27Apr2027 (formerly known as Huarong Finance 2017 Co 4.75% 27Apr2027)	美元 3,700,000	3,791,862	0.1
Braskem Netherlands Ser Regs (Reg S) 8.5% 12Jan2031	美元 4,000,000	1,637,111	0.1	CFAMC IV Co Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.625% 30Sep2030 (formerly known as Huarong Finance 2019 Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.625% 30Sep2030)	美元 8,200,000	7,839,370	0.3
CSN Islands XI Corp Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.75% 28Jan2028	美元 7,000,000	6,887,653	0.2	CFAMC IV Co Ltd Ser EMTN (Regs) 4.5% 29May2029 (formerly known as Huarong Finance 2019 Ser EMTN (Regs) 4.5% 29May2029)	美元 800,000	808,856	0.0
Fed Republic of Brazil 6.625% 15Mar2035	美元 3,000,000	3,131,833	0.1	China Cinda 2020 I Mngmn Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3% 20Jan2031	美元 12,100,000	11,346,777	0.4
Fed Republic of Brazil 7.25% 12Jan2056	美元 3,000,000	3,049,883	0.1	China Cinda 2020 I Mngmn Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.75% 28May2029	美元 11,410,000	12,091,660	0.4
Petrobras Global Finance (Reg) 6.5% 03Jul2033	美元 3,000,000	3,162,642	0.1	China Greatwall Vi (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 5,700,000	6,078,613	0.2
Raizen Fuels Finance Ser Regs (Reg S) 6.45% 05Mar2034	美元 5,000,000	4,876,477	0.2				
Suzano Austria Gmbh 3.75% 15Jan2031	美元 1,000,000	955,220	0.0				
保加利亚 (0.1%)							
Bulgaria Ser 20Y 4.125% 18Jul2045	欧元 3,000,000	3,447,866	0.1				
加拿大 (0.1%)							
Royal Bank of Canada Ser EMTN (Reg) 4.5% 01Feb2028	港元 2,000,000	270,698	0.0				
Royal Bank of Canada Ser EMTN (Reg) 5.17% 09Mar2028	港元 5,000,000	686,965	0.1				
Toronto-Dominion Bank Ser EMTN 3.41% 16Jun2028	港元 5,000,000	648,496	0.0				
智利 (0.5%)							
Chile Electricity 5.58% 20Oct2035	美元 5,000,000	5,177,028	0.2				

投资组合 (续)

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
中国内地 (续)							
China Greatwall Vi 5.25% 23Apr2028	美元 4,200,000	4,372,698	0.1	Longfor Holdings Ltd (Reg) (Reg S) 3.95% 16Sep2029	美元 3,436,000	2,995,238	0.1
China Hongqiao Group Ltd 6.925% 29Nov2028	美元 5,855,000	6,220,376	0.2	Longfor Properties (Reg) (Reg S) 4.5% 16Jan2028	美元 1,900,000	1,793,237	0.1
China Mengniu Dairy 2% 30Jul2030	离岸人民币 17,500,000	2,432,501	0.1	Meituan Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.05% 28Oct2030	美元 2,800,000	2,646,399	0.1
China Mengniu Dairy 2.3% 30Jul2035	离岸人民币 8,270,000	1,140,869	0.0	Meituan Ser Regs 4.625% 02Oct2029	美元 5,259,000	5,390,848	0.2
China Modern Dairy Holdi (Reg) (Reg S) 2.125% 14Jul2026	美元 2,050,000	2,020,613	0.1	New Metro Global Ltd (Reg) (Reg S) 4.5% 02May2026	美元 1,500,000	1,459,840	0.1
China Resources Land Ltd Ser EMTN (Reg) 6.1% 28Oct2029	港元 10,000,000	1,418,952	0.0	Prosus NV Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.832% 08Feb2051	美元 2,200,000	1,499,913	0.1
ENN Clean Energy Ser Regs (Reg S) 3.375% 12May2026	美元 7,100,000	7,137,628	0.2	Talent Yield Intntnl (Reg) (Reg S) 3.125% 06May2031	美元 4,600,000	4,385,766	0.2
Expand Lead Ltd (Reg) (Reg S) 4.95% 22Jul2026	美元 2,900,000	2,893,002	0.1	Tencent Holdings Ltd Ser Regs (Reg S) 3.24% 03Jun2050	美元 8,000,000	5,952,136	0.2
Far East Horizon Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4.25% 26Oct2026	美元 7,956,000	8,048,517	0.3	Tencent Holdings Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.68% 22Apr2041	美元 6,000,000	5,257,679	0.2
Far East Horizon Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 6.625% 16Apr2027	美元 4,102,000	4,324,645	0.1	Tencent Music Ent Grp (Reg) 2% 03Sep2030	美元 1,700,000	1,529,593	0.1
Far East Horizon Ltd Ser EMTN 4.25% 14Feb2028	离岸人民币 2,000,000	288,103	0.0	Vanke Real Estate HK Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.975% 09Nov2027	美元 1,800,000	1,361,077	0.0
Far East Horizon Ltd Ser EMTN 6.0% 01Oct2028	美元 3,300,000	3,485,262	0.1	Weibo Corp (Reg) 3.375% 08Jul2030	美元 13,469,000	12,856,164	0.4
Fortune Star BVI Ltd (Reg) (Reg S) 3.95% 02Oct2026	欧元 18,000,000	21,511,925	0.7	Xiaomi Best Time Intl Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.1% 14Jul2051	美元 1,400,000	1,159,036	0.0
Fortune Star Bvi Ltd (Reg) (Reg S) 5.05% 27Jan2027	美元 1,200,000	1,197,150	0.0	Zhongsheng Group (Reg) (Reg S) 5.98% 30Jan2028	美元 4,566,000	4,672,834	0.2
Fortune Star Bvi Ltd 8.5% 19May2028	美元 1,000,000	1,081,277	0.0				
Franshion Brilliant Ltd (Reg) (Reg S) 3.2% 09Apr2026	美元 5,600,000	5,626,924	0.2	哥伦比亚 (0.2%) Colombia			
GLP China Holdings Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.95% 29Mar2026	美元 4,600,000	4,533,534	0.2	Telecomunicacio Ser Regs (Reg S) 4.95% 17Jul2030	美元 4,000,000	3,745,440	0.1
Greentown China Hldgs 8.45% 24Feb2028	美元 1,300,000	1,365,618	0.0	Republic of Colombia 5% 19Sep2032	欧元 3,000,000	3,491,448	0.1
Hongkong Intl Qingdao (Reg) (Reg S) 5.75% 12Sep2027	美元 3,000,000	3,060,014	0.1	哥斯达黎加 (0.1%) Costa Rica (Rep of) Ser Regs 7% 04Apr2044	美元 3,000,000	3,296,756	0.1
JD.com Inc 4.125% 14Jan2050	美元 9,000,000	7,499,425	0.3	丹麦 (0.1%) Danske Bank A/S (Reg S) (Br) Var Perp 31Dec2049	美元 3,200,000	3,233,535	0.1
Lenovo Group Ltd Ser Regs (Reg S) 3.421% 02Nov2030	美元 6,800,000	6,554,735	0.2	埃及 (0.1%) Egypt Taskeek Co 7.95% 07Oct2032	美元 3,339,000	3,380,738	0.1
Lenovo Group Ltd Ser Regs (Reg S) 6.536% 27Jul2032	美元 5,000,000	5,567,280	0.2				
Longfor Holdings Ltd (Reg) (Reg S) 3.375% 13Apr2027	美元 2,940,000	2,817,689	0.1				

投资组合 (续)

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
法国 (0.5%)				CAS Capital No1 Ltd			
BNP Paribas Ser EMTN				(Reg) (Reg S) Var Perp			
(Reg S) (Br) Var				31Dec2049	美元 15,800,000	15,785,476	0.5
15Nov2035	英镑 3,800,000	5,502,403	0.2	Champion MTN Ltd Ser			
Credit Agricole Sa Ser				EMTN (Reg S) (Br)			
EMTN 5.03%				3.73% 06Apr2028	港元 12,000,000	1,517,954	0.1
07Sep2026	港元 20,000,000	2,614,902	0.1	CK Property Finance			
Societe Generale Ser				Ser EMTN (Br) (Regs)			
EMTN Var Perp				2.29% 07/09/2026	港元 5,000,000	638,906	0.0
31Dec2049	欧元 1,600,000	1,892,485	0.0	CLP Power Hong Kong			
Total Se Ser EMTN (Reg				Ltd Var Perp			
S) 3.088% 14Sep2026	港元 40,000,000	5,127,817	0.2	31Dec2049	美元 2,400,000	2,548,247	0.1
德国 (0.0%)				Dah Sing Bank Ltd Ser			
Vonovia Se Ser MTN				EMTN (Reg) (Reg S)			
5.266% 03Sep2032	澳元 2,000,000	1,334,730	0.0	Var 02Nov2031	美元 2,800,000	2,777,092	0.1
危地马拉 (0.1%)				Dah Sing Bank Ltd Ser			
Republic of Guatemala				EMTN (Reg) (Reg S)			
Ser Regs 6.25%				Var 15Nov2033	美元 6,500,000	7,102,882	0.2
15Aug2036	美元 3,000,000	3,143,623	0.1	FWD Group Holdin			
香港特别行政区 (6.5%)				(Reg) (Reg S) 5.836%			
AIA Group Ltd Ser				22Sep2035	美元 2,993,000	3,047,655	0.1
EMTN 3.58%				FWD Group Holdings			
11Jun2035	新加坡元 6,250,000	5,284,630	0.2	Ltd Ser EMTN (Reg)			
AIA Group Ltd Ser GMTN				(Reg S) 7.635%			
(Reg S) Var				02Jul2031	美元 7,900,000	8,960,645	0.3
09Sep2033	欧元 1,700,000	1,881,494	0.1	FWD Group Holdings			
AIA Group Ltd Ser GMTN				Ltd Ser Regs 5.252%			
(Reg) (Reg S) Var Perp				22Sep2030	美元 7,680,000	7,721,948	0.3
2.7% 31Dec2049	美元 3,000,000	3,009,642	0.1	HKCG Finance Ltd Ser			
AIA Group Ltd Ser				EMTN 3.6%			
GMTN (Reg) (Reg S)				25Oct2029	港元 10,000,000	1,310,723	0.0
Var Perp 5.1%				Hongkong Land			
31Dec2049	新加坡元 3,750,000	3,161,600	0.1	Finance Ser EMTN			
AIA Group Ltd Ser Regs				(Reg) (Reg S) 5.25%			
(Reg S) 5.4%				14Jul2033	美元 1,510,000	1,576,105	0.1
30Sep2054	美元 16,214,000	15,960,462	0.5	Hongkong Land Notes			
AIA Group Ltd Ser Regs				Co Ser EMTN 3.75%			
(Reg) (Reg S) 3.2%				25Nov2026	港元 20,000,000	2,592,085	0.1
16Sep2040	美元 3,000,000	2,364,640	0.1	JMH Co Ltd (Reg) (Reg			
AIA Group Ltd Ser Regs				S) 2.875% 09Apr2036	美元 2,984,000	2,567,059	0.1
(Reg) (Reg S) 5.375%				Joy Trsr Assets Hld Ser			
05Apr2034	美元 3,000,000	3,195,418	0.1	EMTN (Reg) (Reg S)			
Airport Authority HK				5.75% 06Jun2029	美元 8,300,000	8,754,276	0.3
(Reg) (Reg S) Var Perp				Li & Fung Ltd 8.375%			
2.1%	美元 2,000,000	1,980,769	0.1	05Feb2029	美元 3,601,000	3,815,111	0.1
Airport Authority HK				MTR Corp Ci Ltd Ser			
(Reg) (Reg S) VAR Perp				EMTN Var Perp			
2.4%	美元 8,000,000	7,717,631	0.3	31Dec2049	美元 4,459,000	4,714,488	0.2
Airport Authority HK Ser				MTR Corp Ltd Ser EMTN			
Regs (Reg) (Reg S)				5.25% 01Apr2055	美元 3,238,000	3,370,119	0.1
3.25% 12Jan2052	美元 1,500,000	1,152,382	0.0	Nan Fung Treasury Ltd			
Airport Authority HK Ser				Ser EMTN (Reg) (Reg			
Regs 4.875%				S) 3.875% 03Oct2027	美元 3,000,000	3,006,343	0.1
15Jul2030	美元 16,657,000	17,502,620	0.6	Nanyang Commercial			
Bank of East Asia Ltd Ser				Bank (Reg S) Var Perp			
EMTN (Reg) (Reg S) Var				31Dec2049	美元 2,950,000	3,104,403	0.1
13Mar2027	美元 4,000,000	4,049,106	0.1	Nanyang Commercial			
Bank of East Asia Ltd Ser				Bank (Reg) (Reg S)			
EMTN (Reg) (Reg S) Var				Var 06Aug2034	美元 8,400,000	8,761,915	0.3
27Jun2034	美元 6,261,000	6,676,323	0.2	Prudential Funding			
Bank of East Asia Ltd Ser				(Asia) Plc (Reg) (Reg			
EMTN (Reg) (Reg S) Var				S) Var 03Nov2033	美元 11,766,000	11,369,160	0.4
Perp 31Dec2049	美元 2,700,000	2,770,400	0.1	Sun Hung Kai Prop (Cap)			
				2.28% 25Aug2026	港元 3,000,000	383,285	0.0
				Sun Hung Kai Prop (Cap)			
				2.68% 29Jun2027	港元 13,000,000	1,656,793	0.1

投资组合 (续)

于二零二五年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	占资产 公平值 美元	净值百 分比		单位数目	占资产 公平值 美元	净值百 分比
香港特别行政区 (续)				Greenko Dutch BV Ser			
Sun Hung Kai Prop (Cap)				Regs (Reg) (Reg S)			
Ser EMTN (Reg S) (Br)				3.85% 29Mar2026	美元 18,800,000	16,130,211	0.5
1.89% 06Nov2027	港元 15,000,000	1,878,267	0.1	Greenko Power II Ltd			
Sun Hung Kai Prop (Cap)				Ser Regs (Reg) (Reg			
Ser EMTN (Reg S) 2.7%	港元 5,000,000	638,636	0.0	S) 4.3% 13Dec2028	美元 21,275,000	16,480,238	0.6
24Aug2027				Greenko Wind Projects			
Swire Propert MTN				Mu Ser Regs 7.25%			
Fin Ser EMTN				27Sep2028	美元 9,463,000	9,645,419	0.3
(Reg) (Reg S) 3.1%				HDFC Bank Ltd Ser			
03Sep2027	离岸人民币 30,000,000	4,266,241	0.1	Regs (Reg S) Var Perp	美元 30,900,000	30,522,556	1.0
Wharf Reic Finance Bvi				Hindustan Petroleum			
(Reg) (Reg S) 2.455%				Corp (Reg) (Reg S)			
02Oct2026	港元 1,000,000	130,509	0.0	4% 12Jul2027	美元 3,300,000	3,303,590	0.1
Wharf Reic Finance Bvi				HPCL-Mittal Energy Ltd			
Ser EMTN (Reg) (Reg S)				(Reg) (Reg S) 5.25%			
1.7% 30Mar2026	港元 2,000,000	257,281	0.0	28Apr2027	美元 6,600,000	6,743,698	0.2
印度 (16.3%)				HPCL-Mittal Energy Ltd			
ABJA Investment Co				Ser EMTN (Reg S)			
(Reg) (Reg S) 5.45%				5.45% 22Oct2026	美元 7,800,000	7,987,752	0.3
24Jan2028	美元 3,700,000	3,811,070	0.1	India Clean Energy			
Adani Ports And Special				Hldg Ser Regs (Reg)			
Ser Regs (Reg S) 3.1%				(Reg S) 4.5%			
02Feb2031	美元 3,300,000	2,957,492	0.1	18Apr2027	美元 19,700,000	19,690,544	0.7
Adani Ports And Special				India Cleantech Energy			
Ser Regs (Reg) (Reg S)				4.7% 10Aug2026	美元 4,724,000	3,580,372	0.1
3.828% 02Feb2032	美元 3,200,000	2,927,903	0.1	India Government			
Adani Ports and Special				Bond (Reg) 7.04%	印度卢比		
Ser Regs (Reg) (Reg S)				03Jun2029	1,450,000,000	17,167,926	0.6
4.2% 04Aug2027	美元 3,000,000	2,988,291	0.1	India Government			
Adani Ports and Special				Bond 6.28%	印度卢比		
Ser Regs (Reg) 4%				14Jul2032	1,600,000,000	18,011,053	0.6
30Jul2027	美元 2,000,000	1,980,068	0.1	India Government			
Axis Bank Gift City Ser				Bond 6.33%	印度卢比		
Regs (Reg S) Var Perp				05May2035	1,000,000,000	11,360,794	0.4
31Dec2049	美元 18,900,000	18,696,744	0.6	India Government			
Azure Power Energy Ltd				Bond 6.79%	印度卢比		
Ser Regs (Reg) (Reg S)				30Dec2031	1,280,170,000	14,862,896	0.5
3.575% 19Aug2026	美元 22,052,000	15,547,982	0.5	India Green Power Hold			
Biocon Biologics Global				Ser Regs (Reg) (Reg S)			
Ser Regs 6.67%				4% 22Feb2027	美元 15,754,000	13,455,417	0.5
09Oct2029	美元 2,245,000	2,253,369	0.1	Indian Railway Finance			
Clean Renewable Power				(Reg) (Regs) 3.835%			
Ser Regs (Reg) (Reg S)				13/12/2027	美元 4,200,000	4,206,762	0.1
4.25% 25Mar2027	美元 8,600,000	6,514,693	0.2	Indian Railway Finance			
Continuum Energy Aura				Ser Regs (Reg S)			
Ser Regs (Reg S) 9.5%				3.249% 13Feb2030	美元 3,300,000	3,152,691	0.1
24Feb2027	美元 15,700,000	16,370,734	0.6	IRB Infrastructure Deve			
Continuum Grn Spv Co-				Ser Regs (Reg S)			
Iss Ser Regs (Reg) (Reg				7.11% 11Mar2032	美元 16,339,000	17,048,162	0.6
S) 7.5% 26Jun2033	美元 1,800,000	1,873,164	0.1	JSW Infrastructure Ser			
Delhi International				Regs (Reg) (Reg S)			
Airport Limited Ser				4.95% 21Jan2029	美元 11,070,000	11,230,399	0.4
Regs (Reg) 6.125%				JSW Steel Ltd Ser Regs			
31Oct2026	美元 9,500,000	9,839,587	0.3	(Reg) (Reg S) 3.95%			
Delhi Intl Airport Ser				05Apr2027	美元 7,500,000	7,511,881	0.3
Regs (Reg) (Reg S)				JSW Steel Ltd Ser Regs			
6.45% 04Jun2029	美元 3,700,000	3,935,287	0.1	(Reg) (Reg S) 5.05%			
Diamond II Ltd Ser Regs				05Apr2032	美元 6,900,000	6,885,533	0.2
(Reg S) 7.95%				Muthoot Finance Ltd			
28Jul2026	美元 11,200,000	11,434,102	0.4	Ser Regs (Reg S)			
				7.125% 14Feb2028	美元 8,371,000	8,709,988	0.3
				Muthoot Finance Ltd			
				Ser Regs 6.375%			
				02Mar2030	美元 10,150,000	10,374,233	0.3

投资组合 (续)

于二零二五年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
印度 (续)				Freeport Indonesia PT Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.315% 14Apr2032	美元 22,700,000	23,546,703	0.8
Muthoot Finance Ltd Ser Regs 6.375% 23Apr2029	美元 9,125,000	9,512,823	0.3	Freeport Indonesia PT Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.2% 14Apr2052	美元 5,000,000	5,262,711	0.2
Network 121 Ltd Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 12,200,000	12,338,838	0.4	Hutama Karya Persero PT Ser Regs (Reg S) 3.75% 11May2030	美元 5,000,000	4,911,457	0.2
Periama Holdings LLC/De (Reg) (Reg S) 5.95% 19Apr2026	美元 14,650,000	15,099,638	0.5	Indika Inti Energi PT Ser Regs (Reg S) 8.75% 07May2029	美元 5,400,000	5,606,377	0.2
Piramal Capital & Hous Ser EMTN (Reg) (Reg S) 7.8% 29Jan2028	美元 3,385,000	3,513,560	0.1	Indonesia (Rep of) (Reg) 4.3% 31Mar2052	美元 5,000,000	4,145,445	0.1
Power Finance Corp Ltd Ser GMTN (Reg) (Reg S) 3.35% 16May2031	美元 5,400,000	5,138,883	0.2	Indonesia (Rep of) (Reg) 5.65% 11Jan2053	美元 20,000,000	20,545,371	0.7
REC Ltd Ser Regs (Reg S) 4.75% 27Sep2029	美元 3,300,000	3,340,555	0.1	Indonesia (Rep of) 7% 15Feb2033	180,000,000,000	11,375,125	0.4
Reliance Industries 6.25% 19Oct2040	美元 9,600,000	10,910,866	0.4	Indonesia (Rep of) Ser Fr91 6.375% 15Apr2032	500,000,000,000	31,458,038	1.1
Reliance Industries Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.625% 12Jan2052	美元 6,000,000	4,497,188	0.2	Indonesia (Rep of) Ser MTN 5.3% 14Aug2035	澳元 1,200,000	806,309	0.0
Shriram Finance Ltd Ser Regs (Reg S) 6.625% 22Apr2027	美元 16,900,000	17,788,491	0.6	Indonesia (Rep of) Ser Regs (Reg S) 5.2% 23Jul2035	美元 8,000,000	8,260,370	0.3
Shriram Finance Ltd Ser Regs (Reg) 6.15% 03Apr2028	美元 5,000,000	5,246,882	0.2	Indonesia (Rep of) Ser Regs 5.95% 28Jan2046	美元 6,000,000	6,476,871	0.2
Tata Capital Ltd Ser EMTN 5.389% 21Jul2028	美元 21,639,000	22,318,683	0.8	Indonesia (Rep of) Ser Regs 6.625% 17Feb2037	美元 8,000,000	9,144,626	0.3
TML Holdings Pte Ltd (Reg) (Reg S) 4.35% 09Jun2026	美元 3,950,000	3,991,543	0.1	Indonesia (Rep of) Ser Regs 7.75% 17Jan2038	美元 13,500,000	16,891,545	0.6
Ultratech Cement Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.8% 16Feb2031	美元 2,388,000	2,186,904	0.1	Indonesia (Rep of) Ser Regs 8.5Pct 12/10/2035	美元 6,300,000	8,310,833	0.3
Vedanta Resources 10.875% 17Sep2029	美元 2,300,000	2,422,899	0.1	Krakatau Posco Pt (Reg) (Reg S) 6.375% 11Jun2027	美元 2,000,000	2,078,100	0.1
Vedanta Resources Ser Regs (Reg S) 10.25% 03Jun2028	美元 2,750,000	2,937,414	0.1	LLPL Capital Pte Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.875% 04Feb2039	美元 20,400,000	15,069,003	0.5
Vedanta Resources Ser Regs 9.85% 24Apr2033	美元 1,400,000	1,519,850	0.0	Majapahit Holding BV Ser Regs 7.875Pct 29/06/2037	美元 12,200,000	15,110,978	0.5
印度尼西亚 (14.5%)				Medco Maple Tree Pte Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 8.96% 27Apr2029	美元 10,700,000	11,600,126	0.4
Bank Bukopin PT 5.658% 30Oct2027	美元 8,223,000	8,466,386	0.3	Medco Oak Tree Pte Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 7.375% 14May2026	美元 9,565,000	9,991,800	0.3
Bank Mandiri PT Ser EMTN 4.9% 24Mar2028	美元 2,676,000	2,711,577	0.1	Minejesa Capital BV Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 10Aug2030	美元 9,000,000	6,471,888	0.2
Bank Negara Indonesia (Reg S) Var Perp	美元 23,800,000	23,136,839	0.8	Minejesa Capital BV Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.625% 10Aug2037	美元 20,000,000	20,043,975	0.7
Bank Negara Indonesia Ser EMTN (Reg S) 5.28% 05Apr2029	美元 2,766,000	2,909,489	0.1	Pertamina Geothermal Ene Ser Regs (Reg S) 5.15% 27Apr2028	美元 3,700,000	3,837,592	0.1
Bank Negara Indonesia Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.75% 30Mar2026	美元 3,900,000	3,873,726	0.1				
Cikarang Listrindo PT Ser Regs 5.65% 12Mar2035	美元 4,000,000	4,047,446	0.1				

投资组合 (续)
于二零二五年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
印度尼西亚 (续)				意大利 (0.1%)			
Pertamina Persero Ser (Regs) 6.45% 30May2044	美元 16,400,000	18,019,437	0.6	Intesa Sanpaolo SpA Ser -" (Br) Var Perp 31Dec2049	欧元 1,145,000	1,417,961	0.0
Pertamina Persero Ser Regs (Reg) 6Pct 03/05/2042	美元 14,000,000	14,726,315	0.5	Unicredit SPA (Reg S) (Br) Var Perp 31Dec2049	欧元 2,300,000	2,853,408	0.1
Pertamina Persero Ser Regs 5.625% 20May2043	美元 8,600,000	8,655,580	0.3	日本 (5.0%)			
Pertamina Ser Regs 6.5Pct 27/05/2041	美元 10,900,000	11,968,079	0.4	Chugoku Electric Power 5.742% 14Jan2035	美元 11,284,000	11,945,699	0.4
Perusahaan Listrik Negar Ser Regs (Reg) (Regs) 6.25% 25Jan2049	美元 2,500,000	2,605,498	0.1	Dai-ichi Life Holdings Ser Regs Var Perp 31Dec2049	美元 2,100,000	2,211,602	0.1
Perusahaan Listrik Negar Ser Regs (Reg) 6.15% 21May2048	美元 15,000,000	15,634,325	0.5	Hikari Tsushin I 6.13% 18Sep2035	美元 2,000,000	2,054,231	0.1
Perusahaan Listrik Negara (Regs) (Reg) 5.25Pct 24/10/2042	美元 4,000,000	3,824,571	0.1	Hokkaido Electric Power 4.587% 04Sep2030	美元 6,607,000	6,652,068	0.2
Perusahaan Penerbit SBSN Ser Regs (Br) 5.25% 25Nov2034	美元 10,000,000	10,439,890	0.3	Jera Co Inc 4.544% 02Sep2030	美元 4,909,000	4,924,966	0.2
Perusahaan Penerbit SBSN Ser Regs 5.65% 25Nov2054	美元 20,000,000	20,390,620	0.7	Kansai Electric Power Co 5.037% 26Feb2030	美元 5,000,000	5,153,020	0.2
PT Indonesia Asahan Aluminium and PT Mineral Industri Indonesia (Persero) Ser Regs (Reg S) 5.45% 15May2030	美元 5,408,000	5,695,791	0.2	Kyushu Electric 5.246% 09Sep2035	美元 6,484,000	6,588,758	0.2
PT Indonesia Asahan Aluminium and PT Mineral Industri Indonesia (Persero) Ser Regs (Reg S) 5.8% 15May2050	美元 3,000,000	3,020,136	0.1	Meiji Yasuda Life Insura Ser Regs (Reg S) Var 11Sep2054	美元 7,366,000	7,553,680	0.3
PT Indonesia Asahan Aluminium and PT Mineral Industri Indonesia (Persero) Ser Regs (Reg S) 6.53% 15Nov2028	美元 2,600,000	2,854,391	0.1	Meiji Yasuda Life Insura Ser Regs (Regs) 5.2% 20/10/2045	美元 4,000,000	4,093,390	0.1
PT Pelabuhan Indo II Ser Regs (Regs) 5.375% 05/05/2045	美元 8,000,000	7,812,517	0.3	Meiji Yasuda Life Insura Ser Regs Var 11Jun2055	美元 3,500,000	3,709,678	0.1
Republic of Indonesia 4.125% 15Jan2037	欧元 5,000,000	6,100,818	0.2	Mitsubishi Estat 4.352% 02Oct2030	美元 7,734,000	7,754,035	0.3
Republic of Indonesia 5.6% 15Jan2035	美元 8,000,000	8,571,138	0.3	Mitsubishi HC Cap UK Plc Ser EMTN 4.69% 26Jun2026	港元 4,000,000	524,560	0.0
Star Energy Co Issue Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.85% 14Oct2038	美元 1,800,000	1,764,973	0.1	Mitsubishi HC Cap UK Plc Ser EMTN 5.302% 23Jan2028	美元 11,270,000	11,608,031	0.4
国际 (0.3%)				Mitsubishi UFJ Fin Var Perp 31Dec2049	美元 1,420,000	1,455,653	0.1
European				Mizuho Financial Group (Reg) Var 16Jul2030	美元 4,500,000	4,344,229	0.2
Investment Bank Ser EMTN (Reg) (Reg S) 9.25% 28Jan2027	巴西雷亚尔 28,945,000	5,595,360	0.2	Mizuho Financial Group 2.564% 13Sep2031	美元 1,500,000	1,331,842	0.0
Intl Bk Recon & Develop Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.75% 14Jan2028	巴西雷亚尔 25,000,000	4,317,436	0.1	Nippon Life Insurance Ser Regs (Reg S) Var 23Jan2050	美元 3,000,000	2,854,030	0.1
				Nippon Life Insurance Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 16Sep2051	美元 1,000,000	895,918	0.0
				Nippon Life Insurance Ser Var 02Sep2055	欧元 641,000	756,315	0.0
				Nomura Holdings Inc Var 10Jun2036	美元 7,924,000	7,915,674	0.3
				Norinchukin Bank 4.674% 09Sep2030	美元 2,454,000	2,474,613	0.1
				Norinchukin Bank Ser Regs (Reg S) 4.867% 14Sep2027	美元 3,000,000	3,039,571	0.1

投资组合 (续)

于二零二五年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
日本 (续)				KT Corp Ser Regs			
NTT Finance Corp Ser Regs 5.502% 16Jul2035	美元 9,400,000	9,835,173	0.3	4.375% 03Jan2029	美元 1,906,000	1,935,048	0.1
Rakuten Group Inc Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 9,841,000	10,020,740	0.3	Kyobo Life Insurance Co Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 5,400,000	5,594,520	0.2
Rakuten Group Inc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	欧元 6,200,000	7,278,560	0.3	LG Energy Solution Ser Regs 5.875% 02Apr2035	美元 2,500,000	2,661,532	0.1
Resona Bank Ltd 4.983% 22Jan2028	美元 5,438,000	5,582,394	0.2	Mirae Asset Securities (Reg) (Reg S) 6.875% 26Jul2026	美元 1,500,000	1,547,822	0.1
Sumitomo Mitsui Trst Var 11Sep2036	美元 3,970,000	4,027,475	0.1	NH Investment & Secs 4.625% 10Jul2028	美元 8,268,000	8,417,942	0.3
Sumitomo Mitsui Finl Grp Var Perp 31Dec2049	美元 9,050,000	9,459,588	0.3	Posco Ser Regs (Reg S) 5.875% 17Jan2033	美元 3,000,000	3,215,358	0.1
哈萨克斯坦 (0.0%)				Shinhan Bank Ser MTN (Reg) 5% 30Aug2028	澳元 2,670,000	1,755,605	0.1
Development Bank 3.35% 01Sep2028 离岸人民币	8,000,000	1,132,842	0.0	Shinhan Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.375% 13Apr2032	美元 1,400,000	1,400,436	0.0
韩国 (6.2%)				Shinhan Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.75% 15Apr2034	美元 6,800,000	7,321,189	0.2
Export-Import Bank 5.25% 14Jan2035	美元 8,000,000	8,628,161	0.3	Shinhan Card Co Ltd Ser MTN (Reg) 5.05% 22Oct2027	澳元 6,070,000	4,171,126	0.1
Export-Import Bank Korea Ser EMTN 4.6% 22Nov2026	港元 9,000,000	1,218,786	0.0	Shinhan Financial Group Ser Regs (Reg) (Reg S) 5% 24Jul2028	美元 1,600,000	1,648,283	0.1
Hana Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 9,300,000	9,312,722	0.3	Shinhan Financial Group Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 7,400,000	7,385,742	0.3
Hanwha Life Insurance Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 04Feb2032	美元 8,250,000	8,154,181	0.3	SK Battery America Inc (Reg) (Reg S) 2.125% 26Jan2026	美元 1,400,000	1,391,711	0.0
Hanwha Life Insurance Var 24Jun2055	美元 8,158,000	8,689,706	0.3	SK Hynix Inc Ser Regs (Reg S) 5.5% 16Jan2029	美元 4,400,000	4,596,833	0.2
Hyundai Assan Otomotiv 1.625% 12/07/26-RegS	美元 4,700,000	4,617,708	0.2	SK Hynix Inc Ser Regs (Reg S) 6.375% 17Jan2028	美元 1,400,000	1,481,517	0.1
Hyundai Capital Services Ser EMTN (Reg S) 4.72% 02Apr2027	港元 20,000,000	2,668,964	0.1	SK Hynix Inc Ser Regs (Reg S) 6.5% 17Jan2033	美元 13,670,000	15,271,449	0.5
KB Capital Co Ltd (Reg) (Reg S) 1.5% 28Oct2025	美元 1,360,000	1,365,683	0.0	Tongyang life insurance co Var 07May2035	美元 9,000,000	9,643,221	0.3
Kookmin Bank Ser GMTN (Reg) (Reg S) 4.5% 01Feb2029	美元 1,900,000	1,913,540	0.1	Woori Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 6.375%	美元 11,637,000	12,265,184	0.4
Korea Development Bank Ser GMTN (Reg) (Reg S) 3.5% 20Aug2027	港元 36,000,000	4,635,509	0.2	科威特 (0.1%)			
Korea Housing Finance Co Ser Regs 5.125% 21Jan2030	美元 6,816,000	7,159,494	0.2	NBK Tier 1 Fnc Ltd Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 3,300,000	3,249,704	0.1
Korea Hydro & Nuclear Po FRN 30Jul2030	美元 9,375,000	9,497,454	0.3	澳门特别行政区 (4.3%)			
Korea Ocean Business Co (Reg) (Reg S) 4.5% 03May2028	美元 3,000,000	3,082,508	0.1	Champion Path Holdings (Reg) (Reg S) 4.5% 27Jan2026	美元 11,300,000	11,344,635	0.4
Korea Ocean Business Co 4.625% 09May2030	美元 5,123,000	5,320,884	0.2	Champion Path Holdings (Reg) (Reg S) 4.85% 27Jan2028	美元 300,000	298,555	0.0
Korea Railroad Corp 4.375% 27May2028	美元 4,278,000	4,395,931	0.1				
Korearehabsresource (Reg) (Reg S) 5.125% 08May2029	美元 8,798,000	9,213,166	0.3				

投资组合 (续)				(续)			
于二零二五年九月三十日 (未经审计)							
	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百分 比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百分 比
澳门特别行政区 (续)				Comision Federal De			
MGM China Holdings Ltd				Elec Ser Regs (Reg S)			
Ser Regs (Reg S) 4.75%				3.348% 09Feb2031	美元 3,000,000	2,719,926	0.1
01Feb2027	美元 1,100,000	1,106,913	0.0	Comision Federal De			
MGM China Holdings Ltd				Elec Ser Regs 5.7%	美元 8,000,000	8,210,867	0.3
Ser Regs (Reg) (Reg S)	美元 7,070,000	7,240,263	0.2	24Jan2030			
5.875% 15May2026				Mex Bonos Desarr			
MGM China Holdings Ltd				Fix Rt Ser M			
Ser Regs (Reg) (Reg S)				8.5% 28Feb2030	墨西哥比索 3,500,000	19,419,315	0.6
7.125% 26Jun2031	美元 1,482,000	1,592,399	0.1	Mexichem Sab De CV			
Sands China Ltd (Reg)				Ser Regs (Reg)	美元 2,000,000	1,715,309	0.1
3.25% 08Aug2031	美元 1,500,000	1,390,808	0.1	5.875% 17Sep2044			
Sands China Ltd Ser Wi				Mexico (Utd States of)	美元 4,237,000	3,577,676	0.1
(Reg) 3.8% 08Jan2026	美元 8,700,000	8,758,874	0.3	(Reg) 5% 27Apr2051			
Sands China Ltd Ser Wi				Mexico (Utd States of)			
(Reg) 4.375%				(Reg) 6.338%	美元 5,000,000	5,003,151	0.2
18Jun2030	美元 4,273,000	4,257,871	0.1	04May2053			
Sands China Ltd Ser Wi				Mexico (Utd States of)			
(Reg) 5.4% 08Aug2028	美元 15,000,000	15,475,140	0.5	(Reg) 6.35%	美元 10,000,000	10,676,922	0.4
Studio City Co Ltd Ser				09Feb2035			
Regs (Reg) (Reg S) 7%	美元 19,100,000	19,424,918	0.7	Mexico (Utd States			
15Feb2027				of) 7.75%			
Studio City Finance Ltd				29May2031	墨西哥比索 3,500,000	19,104,717	0.6
Ser Regs (Reg) (Reg S)				Pemex Project			
6.5% 15Jan2028	美元 9,700,000	9,835,172	0.3	Funding Master			
Studio City Finance Ltd				Trust Ser Wi			
Ser Regs (Reg) (Regs)				6.625Pct 15/06/2035			
5% 15Jan2029	美元 20,965,000	20,437,323	0.7	(Series 13)	美元 4,000,000	3,894,736	0.1
Wynn Macau Ltd Ser				Tierra Mojada Lux II Srl			
Regs (Reg) (Reg S)				Ser Regs (Reg) (Reg			
5.5% 01Oct2027	美元 3,000,000	3,084,525	0.1	S) 5.75% 01Dec2040	美元 2,000,000	1,698,235	0.1
Wynn Macau Ltd Ser				United Mexican States			
Regs (Reg) (Reg S)				6.875% 13May2037	美元 6,200,000	6,865,596	0.2
5.625% 26Aug2028	美元 18,900,000	18,996,820	0.6	United States of			
Wynn Macau Ltd Ser				Mexico (Reg) 6%			
Regs (Reg) (RegS)				07May2036	美元 8,000,000	8,388,800	0.3
5.125% 15Dec2029	美元 4,400,000	4,386,757	0.2	United States of			
马来西亚 (1.0%)				Mexico 8.5%			
Ambank M Bhd Ser				31May2029	墨西哥比索 3,500,000	19,877,740	0.6
EMTN 5.252%				蒙古 (0.6%)			
23Jan2030	美元 12,972,000	13,465,701	0.4	Mongolia Intl Bond Ser			
Malaysia Government				Regs (Reg S) 7.875%			
Ser 122 3.582%	马来西亚林吉特			05Jun2029	美元 4,300,000	4,674,201	0.1
15Jul2032	36,000,000	8,708,525	0.3	Mongolia Intl Bond Ser			
Malaysia Government				Regs (Reg S) 8.65%			
Ser 225 3.476%	马来西亚林吉特			19Jan2028	美元 10,100,000	10,931,457	0.4
02Jul2035	36,000,000	8,652,567	0.3	Mongolian Mining			
墨西哥 (4.2%)				Corp Ser Regs 8.44%	美元 2,200,000	2,323,759	0.1
Banco Mercantil De				03Apr2030			
Norte Ser Regs (Reg S)				荷兰 (0.5%)			
Var Perp 31Dec2049	美元 2,400,000	2,552,972	0.1	Cooperatieve			
Banco Mercantil De				Rabobank UA (Reg			
Norte Ser Regs (Reg)				S) (Br) Var Perp 31			
(Reg S) Var Perp				Dec2049	欧元 2,600,000	3,112,702	0.1
31Dec2049	美元 4,400,000	4,786,985	0.2	Cooperatieve			
BBVA Bancomer SA				Rabobank UA Ser			
Texas Var 18Jan2033	美元 5,700,000	5,661,580	0.2	MTN (Reg S) Var	澳元 770,000	548,800	0.0
				26Oct2032			
				ING Groep Nv (Reg S)			
				(Br) Var Perp	美元 1,600,000	1,709,624	0.1
				31Dec2049			

投资组合 (续)

于二零二五年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
荷兰 (续)				Philippines (Rep of)			
ING Groep NV Var				(Reg) 5.6%			
Perp 3.875%	美元 2,800,000	2,732,062	0.1	14May2049	美元 9,000,000	9,434,012	0.3
ING Groep NV Var				Philippines (Rep of)			
Perp 5.75%	美元 4,400,000	4,513,377	0.2	(Reg) 5.95%			
Rabobank Ua/Au Ser				13Oct2047	美元 11,000,000	12,149,975	0.4
MTN 4.295%				Philippines (Rep of)			
10Jul2030	澳元 2,000,000	1,329,532	0.0	6.25Pct 14/01/2036	菲律宾比索 600,000,000	10,359,377	0.4
巴基斯坦 (1.1%)				PLDT Inc (Reg) (Reg S)			
Islamic Rep of				2.5% 23Jan2031	美元 600,000	550,015	0.0
Pakistan Ser Regs				PLDT Inc (Reg) (Reg S)			
(Reg) (Reg S)				3.45% 23Jun2050	美元 4,300,000	3,131,394	0.1
6.875% 05Dec2027	美元 8,200,000	8,412,468	0.3	Republic of Philippines			
Pakistan (Rep of) Ser				5.5% 04Feb2035	美元 3,720,000	3,995,240	0.1
Regs (Reg S) 6%				Republic of Philippines			
08Apr2026	美元 15,900,000	16,331,659	0.6	5.9% 04Feb2050	美元 3,000,000	3,227,762	0.1
Pakistan (Rep of) Ser				Rizal Commercial			
Regs (Reg S) 7.375%				Banking Ser EMTN			
08Apr2031	美元 1,400,000	1,424,695	0.0	5.375% 29Jan2030	美元 2,937,000	3,055,677	0.1
Pakistan (Rep of) Ser				Royal Capital BV (Reg)			
Regs (Reg S) 7.95%				(Reg S) Var Perp			
31Jan2029	美元 3,000,000	3,092,833	0.1	31Dec2049	美元 5,350,000	5,461,739	0.2
Pakistan (Republic of)				卡塔尔 (0.0%)			
Ser Regs (Reg S)				QNB Finance Ltd Ser			
8.875% 08Apr2051	美元 2,000,000	1,931,731	0.1	EMTN 4.517%			
秘鲁 (0.6%)				21Feb2027	港元 4,000,000	537,738	0.0
Hunt Oil Co of Peru				罗马尼亚 (0.1%)			
Ser Regs 7.75%				Romania (Govt of) Ser			
05Nov2038	美元 3,000,000	3,401,972	0.1	Regs (Reg) (Reg S)			
Peru (Rep of) (Reg)				2% 14Apr2033	欧元 3,000,000	2,805,188	0.1
3.3% 11Mar2041	美元 4,600,000	3,591,833	0.2	沙特阿拉伯 (1.4%)			
Republic of Peru 5.5%				Eig Pearl Holdings Sarl			
30Mar2036	美元 3,000,000	3,102,458	0.1	Ser Regs (Reg) (Reg			
Republic of Peru				S) 4.387%			
Ser Regs (Br)				30Nov2046	美元 8,500,000	7,058,895	0.2
7.3% 12Aug2033	秘鲁新索尔 20,000,000	6,504,208	0.2	Gaci First Investment			
菲律宾 (3.5%)				5% 15Sep2035	美元 2,837,000	2,844,805	0.1
Bank of Philippine				Gaci First Investment			
Islan Ser EMTN				5.625% 29Jul2034	美元 5,188,000	5,536,719	0.2
5.0% 07Apr2030	美元 1,676,000	1,772,503	0.1	Greensaif Pipelines			
Globe Telecom Inc				Bidc Ser Regs (Reg			
(Reg) (Reg S) 3%				S) 6.51% 23Feb2042	美元 4,600,000	5,021,255	0.2
23Jul2035	美元 11,600,000	9,888,683	0.3	Greensaif Pipelines			
Globe Telecom Inc				Bidc Ser Regs (Reg)			
(Reg) (Reg S) Var Perp				(Reg S) 5.8528%			
ICTSI Treasury BV				23Feb2036	美元 6,400,000	6,766,041	0.2
(Reg) (Reg S) 3.5%				Saudi Arabian Oil Co			
16Nov2031	美元 2,600,000	2,485,045	0.1	Ser Regs (Reg S)			
Metropolitan Bank &				5.75% 17Jul2054	美元 3,500,000	3,527,631	0.1
Trus Ser EMTN (Reg				Saudi Arabian Oil Co			
S) 5.5% 06Mar2034	美元 1,942,000	2,039,510	0.1	Ser Regs 5.375%			
Metropolitan Bank &				02Jun2035	美元 4,100,000	4,316,322	0.2
Trus Ser EMTN (Reg)				Saudi Arabian Oil Co			
(Reg S) 5.375%				Ser Regs 6.375%			
06Mar2029	美元 4,000,000	4,165,347	0.1	02Jun2055	美元 5,100,000	5,547,764	0.2
Philippine National				新加坡 (1.6%)			
Bank Ser EMTN (Reg				Clifford Capital			
S) 4.85% 23Oct2029	美元 1,184,000	1,228,961	0.1	Holding 3.97%			
Philippines (Rep of)				30Sep2028	美元 23,890,000	23,873,164	0.8
(Reg) 3.95%				DBS Bank			
20Jan2040	美元 10,300,000	9,328,291	0.3	Ltd/Australia Ser			
Philippines (Rep of)				MTN FRN 21Feb2028	澳元 2,060,000	1,376,720	0.0
(Reg) 5.25%							
14May2034	美元 10,000,000	10,675,522	0.4				

投资组合 (续)

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
新加坡 (续)				台湾地区 (0.5%)			
Great Eastern Life Assur Ser EMTN Var Perp 31Dec2049	美元 13,650,000	13,941,539	0.5	Cathaylife Singapore (Reg) (Reg S) Var 05Sep2039	美元 4,833,000	4,940,089	0.2
Oversea-Chinese Banking Ser GMTN (Reg S) Var 21May2034	美元 1,400,000	1,480,578	0.1	Fubon Life Singa 5.45% 10Dec2035	美元 4,071,000	4,160,378	0.1
SP Group Treasury Pte Ser Regs (Reg S) 3.375% 27Feb2029	美元 1,250,000	1,229,068	0.0	Nanshan Life Pte Ltd (Reg) (Reg S) 5.45% 11Sep2034	美元 3,600,000	3,588,648	0.1
Spore Airport Terminal S Ser GMTN (Reg) (Reg S) 4.828% 23Jan2029	美元 3,000,000	3,089,241	0.1	Shin Kong Life Sg Pte (Reg) 6.95% 26Jun2035	美元 2,750,000	3,027,954	0.1
Temasek Financial I Ltd Ser Regs 5.375Pct 23/11/2039	美元 2,000,000	2,232,074	0.1	泰国 (2.6%)			
南非 (0.1%)				Export-Import Bk Thailand Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.354% 16May2029	美元 1,228,000	1,296,740	0.1
Republic of South Africa (Reg) 5.65% 27Sep2047	美元 4,000,000	3,224,177	0.1	Kasikornbank PCL HK Ser EMTN (Reg S) Var Perp 4%	美元 3,613,000	3,582,830	0.1
西班牙 (0.3%)				Kasikornbank PCL HK Ser EMTN (Reg S) Var Perp 5.275%	美元 16,800,000	17,271,108	0.6
Banco Bilbao Vizcaya Arg Var Perp 31Dec2049	美元 2,000,000	2,156,989	0.1	Kasikornbank PCL HK Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 02Oct2031	美元 8,100,000	8,074,689	0.3
Banco Santander SA (Reg) (Reg S) Var 17Jul2034	澳元 6,200,000	4,339,334	0.1	Krung Thai Bank/Cayman (Reg S) Var Perp	美元 21,700,000	21,603,073	0.7
Banco Santander Sa Ser 0 Var Perp 31Dec2049	美元 1,400,000	1,386,352	0.0	Muang Thai Life Assuranc (Reg) (Reg S) Var 27Jan2037	美元 5,952,000	5,907,977	0.2
Banco Santander Sa Ser Eur Var Perp 31Dec2049	欧元 1,200,000	1,411,161	0.1	Muangthai Capital PCL (Reg) 6.875% 30Sep2028	美元 8,210,000	8,608,259	0.3
斯里兰卡 (0.8%)				Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg S) 2.5% 18Jun2030	美元 3,750,000	3,417,903	0.1
Republic of Sri Lanka Ser Regs (Reg) (Reg S) STP 15Jun2035	美元 2,208,920	1,642,816	0.0	Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg S) 3.5% 17Oct2049	美元 539,000	381,557	0.0
Republic of Sri Lanka Ser Regs 4.0% 15Apr2028	美元 25,227,114	18,005,019	0.6	Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg S) 3.75% 18Jun2050	美元 1,700,000	1,245,641	0.1
Sri Lanka Govt Bond Ser A 11.4% 15Jan2027	斯里兰卡卢比 550,000,000	1,931,908	0.1	Thaioil Trsry Center Ser Regs (Regs) 4.875% 23Jan2043	美元 4,700,000	4,164,251	0.1
Sri Lanka Govt Bond Ser A 20% 15Sep2027	斯里兰卡卢比 550,000,000	2,199,070	0.1	土耳其 (0.2%)			
瑞士 (0.4%)				Republic of Turkiye 6.5% 03Jan2035	美元 3,000,000	2,998,827	0.1
UBS Group AG (Reg S) Var Perp	美元 2,400,000	2,410,889	0.1	Turkiye Varlik F 6.875% 10Feb2031	美元 1,724,000	1,740,296	0.0
UBS Group AG Ser 144A (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 2,400,000	2,738,766	0.1	Yapi Ve Kredi Bankasi Var Perp Ser Regs (Reg S) 03Sep2095	美元 2,167,000	2,209,813	0.1
UBS Group AG Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 2,600,000	2,586,302	0.1	阿联酋 (0.1%)			
UBS Group AG Ser Regs Var Perp 31Dec2049	美元 2,600,000	2,697,764	0.1	Aldar Investment Prop Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.5% 16May2034	美元 3,600,000	3,829,867	0.1
				Emirates Nbd Bank Pjsc 6.1% 21Feb2033	澳元 320,000	224,853	0.0

投资组合 (续)
于二零二五年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百分比
阿联酋 (续)				United Kingdom Gilt 4.5% 07Mar2035	英镑 4,902,802	6,518,083	0.2
Emirates Nbd Bank Pjsc Ser EMTN (Reg S) (Br) 2.1% 27Sep2028	港元 1,000,000	122,045	0.0	美国 (0.9%)			
英国 (2.2%)				Citigroup Inc Ser Y (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 3,000,000	2,956,100	0.1
Barclays Plc (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	英镑 700,000	946,665	0.0	Digital Dutch Finco Bv 3.875% 15Jul2034	欧元 3,196,000	3,774,194	0.1
Barclays Plc (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 4,200,000	4,216,788	0.1	Goldman Sachs Group Inc 4.5% 16May2028	澳元 1,000,000	673,603	0.0
Barclays Plc Ser MTN Var 28May2035	澳元 2,800,000	1,958,876	0.1	Hyundai Capital America Ser EMTN 2.875% 26Jun2028	欧元 806,000	958,113	0.0
Barclays Plc Var Perp 31Dec2049	美元 2,650,000	2,550,523	0.1	Hyundai Capital America Ser Regs FRN 27Mar2030	美元 1,800,000	1,844,275	0.1
CK Hutchison Intl 24 Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.5% 26Apr2034	美元 1,500,000	1,610,415	0.1	Resorts World/RWLW Cap Ser Regs (Reg S) 4.625% 06Apr2031	美元 8,900,000	7,835,050	0.3
HSBC Holdings Plc (Reg) Var 13Nov2034	美元 1,200,000	1,400,226	0.1	Resorts World/RWLW Cap Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625%	美元 1,800,000	1,668,956	0.1
HSBC Holdings Plc (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 2,000,000	2,134,319	0.1	Resorts World/Rwlv Cap Ser Regs (Reg) (Reg S) 8.45%	美元 2,800,000	2,891,902	0.1
HSBC Holdings Plc FRN 13May2031	美元 2,600,000	2,673,600	0.1	Wells Fargo Bank Na Ser EMTN 3.9% 29Apr2028	港元 5,000,000	659,939	0.0
HSBC Holdings Plc Ser EMTN (Reg S) (Br) 7% 07Apr2038	英镑 2,000,000	2,953,844	0.1	WPC 3.75% 19Nov2034	欧元 1,443,000	1,726,279	0.1
HSBC Holdings Plc Ser EMTN Var Perp 31Dec2049	新加坡元 4,250,000	3,486,229	0.1			2,693,259,092	91.3
HSBC Holdings Plc Ser MTN (Reg) (Reg S) Var 21Mar2034	澳元 2,100,000	1,442,297	0.1	(III) 集体投资计划 (3.5%)			
HSBC Holdings Plc Ser MTN FRN 11Mar2035	澳元 5,830,000	3,904,703	0.1	卢森堡 (3.5%)			
HSBC Holdings Plc Ser MTN Var 11Mar2035	澳元 5,830,000	3,933,618	0.1	JPMLIQ-JPM USD Liquidity LVNAV 'X' (dist)**	102,404,794	102,404,794	3.5
HSBC Holdings Plc Var Perp 31Dec2049	美元 3,600,000	3,833,804	0.1	(IV) 衍生性产品 (-0.1%)			
Lloyds Banking Group Plc Ser * (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 2,800,000	2,920,207	0.1	信贷违约掉期 (-0.0%)			
Lloyds Banking Group Plc Ser MTN (Reg S) Var 06Mar2030	澳元 2,000,000	1,370,232	0.0	(D) Credit Default Swap Index~604~ 122 30,000,000.00 USD 01/05/2025 20/06/2030		446,991	0.0
Nationwide Bldg Ser (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	英镑 659,000	941,814	0.0	(D) Credit Default Swap Index~604~ 125 30,000,000.00 USD 16/05/2025 20/06/2030		446,991	0.0
Natwest Group Pl (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 2,900,000	2,691,600	0.1	(D) Credit Default Swap Index~604~ 127 20,000,000.00 USD 20/05/2025 20/06/2030		(1,594,570)	(0.0)
Royal BK ScotInd Grp PLC (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 2,900,000	2,958,637	0.1				
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg S) Var 09Jan2029	美元 1,500,000	1,582,429	0.1				
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg S) Var 16Nov2028	美元 6,600,000	7,261,589	0.2				
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 1,575,000	1,651,230	0.1				

投资组合 (续)

于二零二五年九月三十日 (未经审计)

单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
远期外汇合约 (-0.1%)	(1,871,691)	(0.1)
期货 (-0.0%)		
Aust 10yr Bond Fut 15/12/2025	199 (103,499)	(0.0)
Aust 3yr Bond Fut 15/12/2025	1,474 (295,595)	(0.0)
Long Gilt Future 29/12/2025	376 189,431	0.0
US 10Yr Note (CBT) 19/12/2025	740 57,000	0.0
US 10Yr Ultra Fut 19/12/2025	308 115,125	0.0
US 5Yr Note (CBT) 31/12/2025	853 (258,859)	(0.0)
US Ultra Bond (CBT) 19/12/2025	4 1,750	0.0
利率掉期 (-0.0%)		
(D) Interest Rate Swap~619~ 165 235,000,000.00 HKD 17/12/2025		
17/12/2030	(91,462)	(0.0)
(D) Interest Rate Swap~619~ 163 200,000,000.00 CNY 17/12/2025		
17/12/2030	(22,707)	(0.0)
(D) Interest Rate Swap~619~ 166 300,000,000.00 CNY 17/12/2025		
17/12/2026	5,301	0.0
(D) Interest Rate Swap~619~ 167 88,800,000,000.00 KRW 17/12/2025		
17/12/2030	(12,115)	(0.0)
	(2,987,909)	(0.1)
总上市投资	2,884,136,502	97.8
其他净资产	66,162,138	2.2
于二零二五年九月三十日 可赎回份额持有人应占 净资产	2,950,298,640	100.0
总投资, 按成本	2,779,005,614	

* 由管理人的关联人士发行和管理 (关联人士的定义, 参见附注 8)

在香港未获认可及并非供香港公众投资

投资组合持有变动表		(续)	
截至二零二五年九月三十日止年度 (未经审计)			
		持有占资产净值百分比	持有占资产净值百分比
		2025	2024
上市投资			
可转换证券			
中国内地	1.4	3.1	
香港特别行政区	0.7	-	
台湾地区	0.4	-	
美国	0.3	0.6	
马来西亚	0.2	-	
韩国	0.1	0.8	
维京群岛	-	0.3	
债券证券			
印度	16.3	13.4	
印度尼西亚	14.5	18.3	
中国内地	8.8	10.0	
香港特别行政区	6.5	5.6	
韩国	6.2	7.2	
日本	5.0	4.3	
澳门特别行政区	4.3	5.4	
墨西哥	4.2	1.4	
澳大利亚	3.5	3.7	
菲律宾	3.5	3.2	
泰国	2.6	3.2	
英国	2.2	2.5	
新加坡	1.6	1.7	
沙特阿拉伯	1.4	0.4	
巴基斯坦	1.1	0.8	
马来西亚	1.0	2.6	
美国	0.9	1.3	
巴西	0.9	0.5	
斯里兰卡	0.8	0.6	
秘鲁	0.6	0.4	
蒙古	0.6	-	
台湾地区	0.5	0.9	
智利	0.5	0.3	
法国	0.5	0.3	
荷兰	0.5	0.3	
瑞士	0.4	-	
国际	0.3	0.6	
西班牙	0.3	-	
哥伦比亚	0.2	1.4	
比利时	0.2	-	
土耳其	0.2	-	
阿联酋	0.1	0.4	
罗马尼亚	0.1	0.4	
科威特	0.1	0.3	
哥斯达黎加	0.1	0.2	
意大利	0.1	-	
埃及	0.1	-	
保加利亚	0.1	-	
南非	0.1	-	
丹麦	0.1	-	
危地马拉	0.1	-	
安哥拉	0.1	-	
加拿大	0.1	-	
卡塔尔	0.0	0.4	
德国	0.0	-	
哈萨克斯坦	0.0	-	
巴拿马	-	0.4	
爱尔兰	-	0.2	
巴拉圭	-	0.1	
集体投资计划			
卢森堡		3.5	1.5
衍生性产品			
远期外汇合约		(0.1)	0.6
利率掉期		(0.0)	(0.1)
期货		(0.0)	(0.0)
信贷违约掉期		(0.0)	(0.4)
总上市投资		97.8	99.1
其他净资产		2.2	0.9
于九月三十日可赎回份额持有人应占净资产		100.0	100.0

金融衍生工具详情 于二零二五年九月三十日 (未经审计)		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)	
(a) 可转换证券	于二零二五年九月三十日，本基金持有之可转换证券，其标的资产和交易对手均为发行机构，详情请参阅投资组合。	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
(b) 信贷违约掉期	于二零二五年九月三十日，本基金持有之信贷违约掉期合约，详情请参阅附注 11。	最低总敞口	59.7
		最高总敞口	266.5
(c) 远期外汇合约	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。	平均总敞口	110.6
		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。	
(d) 期货	于二零二五年九月三十日，本基金持有之期货合约，详情请参阅附注 11。		2025 占资产净值百分比
		最低净敞口	14.3
(e) 利率掉期	于二零二五年九月三十日，本基金持有之利率掉期合约，详情请参阅附注 11。	最高净敞口	44.5
		平均净敞口	29.3
* 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。			

抵押品持有情况
于二零二五年九月三十日 (未经审计)

抵押品提供方	抵押品的性质	到期期限	计价货币	抵押品所涵盖资产净值 百分比	抵押品价值 美元
Citibank N.A., 伦敦	现金	不适用	美元	0.3	7,305,573
美林国际, 伦敦	现金	不适用	美元	0.0	802,511
美国道富银行	现金	不适用	美元	0.0	1,059,977
				0.3	9,168,061

现金抵押品再投资详情

截至二零二五年九月三十日止年度，未进行现金抵押品再投资。

托管／保管安排

	收到／持有的抵押品 金额 2025 美元	计划下提供的抵押品 所占比例 2025 百分比
现金抵押品的托管机构		
隔离账户		
香港上海汇丰银行有限公司	9,168,061	100.0

财务状况表

于二零二五年九月三十日

	2025 美元	2024 美元
资产		
流动资产		
银行现金	50,441,938	24,866,024
现金抵押品	9,168,061	616,762
应收经纪款项	60,447,848	9,580,637
分配应收款项	40,580,837	6,434,887
保证金	21,376,765	24,406,721
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 11]	24,372,548	13,989,777
投资 [附注 4(l)(a)]	2,887,124,411	1,643,786,624
股息及其他应收款项	149,022	3,500
总资产	3,093,661,430	1,723,684,932
负债		
流动负债		
应付经纪款项	95,413,753	33,229,268
赎回应付款项	11,798,241	10,439,786
应付收益分配 [附注 6]	5,704,569	4,437,588
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 11]	27,360,457	12,594,213
其他应付款项	3,085,770	1,925,480
总负债（不含可赎回份额持有人应占净资产）	143,362,790	62,626,335
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	2,950,298,640	1,661,058,597

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
收入		
投资及衍生性产品净收益 [附注 5]	125,982,049	205,441,723
股息收入 [附注 8(a)]	4,003,656	3,112,503
存款利息 [附注 8(i), 8(j)]	1,084,789	601,991
汇兑净亏损	(6,869,011)	(1,855,126)
其他收入	179,379	24,274
	124,380,862	207,325,365
支出		
管理费用 [附注 8(e)]	23,745,406	14,397,424
托管费用及银行费用 [附注 8(i), 8(j)]	854,865	441,918
受托人费用 [附注 8(g)]	659,067	378,445
基金注册登记机构费用 [附注 8(h)]	399,974	219,408
交易成本 [附注 8(j)]	254,363	120,484
核数师酬金	57,805	80,472
法律及专业服务费	28,196	18,229
估值费用 [附注 8(e)]	17,290	17,150
印刷及出版支出	6,541	8,600
其他经营费用	24,001	9,117
	26,047,508	15,691,247
净经营利润	98,333,354	191,634,118
财务成本		
收益分配 [附注 6]	(58,976,884)	(59,870,402)
利息支出 [附注 8(j)]	(85,445)	-
	(59,062,329)	(59,870,402)
除税前利润	39,271,025	131,763,716
税项 [附注 7]	(713,362)	(279,186)
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加	38,557,663	131,484,530

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	1,661,058,597	1,384,301,568
分配可赎回份额 [附注 3]	3,067,656,684	831,119,386
赎回可赎回份额 [附注 3]	(1,816,974,304)	(685,846,887)
净分配	1,250,682,380	145,272,499
	2,911,740,977	1,529,574,067
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加	38,557,663	131,484,530
年末可赎回份额持有人应占净资产	2,950,298,640	1,661,058,597

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	(7,561,685,859)	(3,752,541,907)
出售投资及衍生性产品		
所得款项	6,459,885,743	3,704,704,359
已收股息	4,003,656	3,112,503
保证金之减少 / (增加)	3,029,956	(20,801,757)
已收利息	1,084,789	601,991
已付基金注册登记机构费用	(254,679)	(209,460)
已付交易成本	(255,023)	(118,745)
已付受托人费用	(630,689)	(371,917)
已付税项	(713,362)	(279,186)
现金抵押品之增加	(8,551,299)	(131,762)
已付管理费用	(22,827,590)	(14,114,835)
其他	(7,648,316)	(2,327,475)
经营业务所运用之现金净额	(1,134,562,673)	(82,478,191)
融资活动		
已付利息	(85,445)	-
分配可赎回份额所得款项	3,033,510,734	827,191,516
赎回可赎回份额付款	(1,815,615,849)	(683,350,408)
已付收益分配	(57,709,903)	(61,201,420)
融资活动所产生之现金净额	1,160,099,537	82,639,688
现金及现金等价物之增加	25,536,864	161,497
年初现金及现金等价物	24,866,024	24,735,540
现金及现金等价物之汇兑收益 / (亏损)	39,050	(31,013)
年末现金及现金等价物	50,441,938	24,866,024
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	50,441,938	24,866,024

财务报表之附注

1 本基金

摩根亚洲总收益债券基金（“本基金”）根据二零零四年十一月三十日的信托契约（经修订）（“信托契约”）成立，受香港法律监管。本基金已获香港证券及期货事务监察委员会（“证监会”）认可。

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

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

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

2 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，并按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算、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。

债务证券的公允价值按包括应计利息的报价计算。

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

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

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

公允价值级次分层间的转拨

在公允价值级次分层之间的转拨视为于报告期间开始时已发生。

结构化主体

本基金将其他基金（“被投资基金”）中的所有投资视为对非合并结构化主体的投资。本基金所投资的被投资基金的目标是达成中长期资本增值。

(c) 金融工具抵销

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

(d) 收入及支出

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

投资利息收入乃作为投资及衍生性产品净收益／亏损的一部分，在综合收益表确认。

银行现金及短期存款利息收入乃按实际利息法在综合收益表确认。

支出乃按应计基准在综合收益表确认。

(e) 交易成本

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

(f) 外币交易

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

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

(g) 现金及现金等价物

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

(h) 现金抵押品及保证金

本基金收到的现金抵押品在财务状况表中确认为现金抵押品，不计入现金及现金等价物。

本基金提供的现金抵押品在财务状况表中确认为保证金，不计入现金及现金等价物。

(i) 应收／应付经纪款项

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

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

(j) 分配份额所得款项及赎回份额支付款项

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

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

(k) 应付可赎回份额持有人的收益分配

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

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

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	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (资息月派) 份额	港元类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目：					
年初	13,441,867.382	11,017,832.492	1,294,601.382	-	224,284,339.491
总分配	5,853,730.230	1,712,709.949	1,359,969.672	852,296.164	122,303,347.666
总赎回	(5,238,125.741)	(1,490,803.209)	(576,377.523)	(4,046.208)	(87,241,818.626)
年末	14,057,471.871	11,239,739.232	2,078,193.531	848,249.956	259,345,868.531
	澳元	加元	英镑	港元	港元
可赎回份额持有人应占 净资产	88,391,554.542	71,834,144.742	13,855,426.488	8,544,838.460	1,770,065,346.038
可赎回份额持有人应占 净资产（每份额）	6.29	6.39	6.67	10.07	6.83
	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	PRC 人民币对冲 份额（每月派息） 份额
已发行份额数目：					
年初	6,898,060.544	-	-	281,981,370.720	130,298,367.030
总分配	2,925,258.365	1,287,560,378.470	103,198,245.830	211,100,159.950	46,474,532.830
总赎回	(2,779,781.220)	(682,832,637.660)	(5,670,590.960)	(233,001,011.330)	(60,265,707.790)
年末	7,043,537.689	604,727,740.810	97,527,654.870	260,080,519.340	116,507,192.070
	纽元	人民币	人民币	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	44,064,574.426	6,418,166,975.016	975,618,545.271	3,309,774,435.041	824,105,348.598
可赎回份额持有人应占 净资产（每份额）	6.26	10.61	10.00	12.73	7.07
	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	美元类别 (累计) 份额
已发行份额数目：					
年初	8,855,711.320	5,990,036.480	2,386,652.658	243,997,365.988	976,461.685
总分配	4,604,189.090	8,125,185.050	1,259,415.764	28,777,663.793	3,739,772.051
总赎回	(3,160,528.270)	(1,910,284.320)	(2,233,052.216)	(64,552,000.870)	(1,667,570.906)
年末	10,299,372.140	12,204,937.210	1,413,016.206	208,223,028.911	3,048,662.830

2025

	PRC 美元份额 (累计) 美元	PRC 美元份额 (每月派息) 美元	人民币对冲类别 (累计) 人民币	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	美元类别 (累计) 美元
可赎回份额持有人应占 净资产	123,131,391.430	86,947,116.150	18,772,637.340	1,363,050,841.186	40,830,051.590
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	11.96	7.12	13.29	6.55	13.39
	美元类别 (资息月派) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 X 类别 (累计) 份额		
已发行份额数目：					
年初	-	35,278,106.631	-		
总分配	87,051.805	15,678,824.644	22,828,246.203		
总赎回	-	(17,877,859.453)	-		
年末	87,051.805	33,079,071.822	22,828,246.203		
	美元	美元	美元		
可赎回份额持有人应占 净资产	877,617.300	258,791,108.730	245,424,295.830		
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	10.08	7.82	10.75		

2024

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目：					
年初	19,098,165.720	13,957,815.202	1,756,326.936	298,113,944.487	8,681,253.030
总分配	1,593,662.057	1,361,844.527	408,254.742	32,754,693.567	1,934,613.853
总赎回	(7,249,960.395)	(4,301,827.237)	(869,980.296)	(106,584,298.563)	(3,717,806.339)
年末	13,441,867.382	11,017,832.492	1,294,601.382	224,284,339.491	6,898,060.544
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占 净资产	86,189,330	71,667,903	8,786,380	1,555,927,665	43,974,919
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	6.41	6.50	6.79	6.94	6.37

2024					
	PRC 人民币对冲 份额（累计） 份额	PRC 人民币对冲 份额 （每月派息） 份额	PRC 美元份额 （累计） 份额	PRC 美元份额 （每月派息） 份额	人民币对冲类别 （累计） 份额
已发行份额数目：					
年初	123,401,721.060	41,841,452.530	10,230,867.790	2,019,087.710	4,469,155.559
总分配 总赎回	337,789,992.370 (179,210,342.710)	110,517,480.440 (22,060,565.940)	1,132,420.210 (2,507,576.680)	4,623,158.870 (652,210.100)	1,791,990.361 (3,874,493.262)
年末	281,981,370.720	130,298,367.030	8,855,711.320	5,990,036.480	2,386,652.658
	人民币	人民币	美元	美元	人民币
可赎回份额持有人应 占净资产	3,497,384,846	938,136,758	100,749,385	43,463,162	30,928,198
可赎回份额持有人应占 净资产（每份额）	12.40	7.20	11.38	7.26	12.96
	人民币对冲类别 （每月派息） 份额	美元类别 （累计） 份额	美元类别 （每月派息） 份额		
已发行份额数目：					
年初	294,546,700.947	1,090,950.638	42,825,272.750		
总分配 总赎回	21,191,492.881 (71,740,827.840)	400,454.483 (514,943.436)	4,939,586.475 (12,486,752.594)		
年末	243,997,365.988	976,461.685	35,278,106.631		
	人民币	美元	美元		
可赎回份额持有人应 占净资产	1,625,504,501	12,440,724	281,037,222		
可赎回份额持有人应占 净资产（每份额）	6.66	12.74	7.97		

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1,956,667,627 美元（二零二四年：928,560,165 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

本基金主要投资可转换证券和债务证券，此等债券须承担利率风险。利率风险请参阅附注 4(l)(a)(ii)。

(ii) 利率风险

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

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

	1 年以内 美元	1 至 5 年 美元	5 年以上 美元	无确定到期日 美元	总额 美元
2025					
银行现金	50,441,938	-	-	-	50,441,938
保证金	21,376,765	-	-	-	21,376,765
衍生性产品	(294,647)	5,301	(126,284)	-	(415,630)
投资（注*）	189,464,939	1,002,660,956	1,592,593,722	102,404,794	2,887,124,411
总利率敏感性缺口	260,988,995	1,002,666,257	1,592,467,438	102,404,794	2,958,527,484

2024

银行现金	24,866,024	-	-	-	24,866,024
保证金	24,406,721	-	-	-	24,406,721
衍生性产品	(178,831)	(1,688,949)	(146,577)	-	(2,014,357)
投资（注*）	140,706,155	569,020,456	909,968,447	24,091,566	1,643,786,624
总利率敏感性缺口	189,800,069	567,331,507	909,821,870	24,091,566	1,691,045,012

注：

* 投资的票面息率范围介乎年率 0.00% - 20.00%（二零二四年：年率 0.00% - 22.50%）。

于九月三十日，本基金投资及衍生性产品之公允价值如下：

	2025		2024	
	投资之公允价值 美元	占资产净值 百分比	投资之公允价值 美元	占资产净值 百分比
上市投资				
资产				
可转换证券				
- 其他	91,460,525	3.1	79,534,631	4.8
债务证券				
- 印度	481,957,618	16.3	222,478,256	13.4
- 印度尼西亚	428,174,785	14.5	303,837,140	18.3
- 中国内地	258,328,857	8.8	164,975,125	10.0
- 香港特别行政区	190,960,721	6.5	93,286,122	5.6
- 韩国	181,578,915	6.2	120,151,547	7.2
- 日本	146,045,493	5.0	71,339,949	4.3
- 澳门特别行政区	127,630,973	4.3	90,137,169	5.4
- 其他	878,581,730	29.7	473,955,119	28.5
	2,693,259,092	91.3	1,540,160,427	92.7

	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				
集体投资计划				
- 其他	102,404,794	3.5	24,091,566	1.5
衍生性产品				
- 远期外汇合约	23,109,959	0.8	13,858,804	0.8
- 信贷违约掉期	893,982	0.0	-	-
- 期货	363,306	0.0	81,047	0.0
- 利率掉期	5,301	0.0	49,926	0.0
	24,372,548	0.8	13,989,777	0.8
	2,911,496,959	98.7	1,657,776,401	99.8
负债				
衍生性产品				
- 期货	(657,953)	(0.0)	(259,878)	(0.0)
- 利率掉期	(126,284)	(0.0)	(1,885,452)	(0.1)
- 信贷违约掉期	(1,594,570)	(0.0)	(6,931,538)	(0.4)
- 远期外汇合约	(24,981,650)	(0.9)	(3,517,345)	(0.2)
	(27,360,457)	(0.9)	(12,594,213)	(0.7)
总上市投资	2,884,136,502	97.8	1,645,182,188	99.1

有关衍生性产品的风险亦请参阅附注 11。

投资管理主要通过本基金的修正久期定期监控本基金的利率风险敏感度。修正久期计量某项债券的价格相对于利率变动的敏感度。于二零二五年九月三十日，投资管理人估计本基金的修正久期为 5.24（二零二四年：5.29）。为了披露相关敏感度，采用的利率合理变动百分比为二十五个基点，不包括不大可能出现或“最恶劣”情况或“压力测试”下之变动，也不代表投资管理人对本基金未来回报的预测。若利率上升二十五个基点，其他变量保持稳定，则将致使本基金的资产净值减少约 38,648,912 美元（二零二四年：21,967,500 美元）。若利率下降二十五个基点，则将致使本基金的资产净值增加相同金额。

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

(iii) 汇兑风险

本基金持有以若干币种计价的资产及负债。香港财务报告会计准则第 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(b)。

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

汇兑风险承担净值（注*）	美元等值	与美元比较之合理变动百分比（注**）	估计对资产净值的影响 美元
2025			
澳元	70,301,917	-4.5	(3,163,586)
巴西雷亚尔	7,350,593	+2.3	169,064
加元	51,564,138	-2.9	(1,495,360)
人民币（离岸）	766,589,773	-1.8	(13,798,616)
人民币（在岸）	(314,094)	-1.4	4,397
欧元	332,255	+5.3	17,610
港元	(5,239,015)	-0.2	10,478
印尼盾	(11,385,146)	-9.2	1,047,433
印度卢比	12,707,251	-5.6	(711,606)
日元	(577,357)	-3.1	17,898
韩元	(12,115)	-6.8	824
马来西亚林吉特	17,361,092	-2.0	(347,222)
墨西哥比索	20,037,859	+6.9	1,382,612
纽元	25,058,151	-8.7	(2,180,059)
秘鲁新索尔	26,676,287	+1.9	506,849
菲律宾比索	64,792	-3.7	(2,397)
新加坡元	87,911,557	-0.6	(527,469)
斯里兰卡卢比	4,130,978	-2.1	(86,751)
英镑	17,573,080	+0.4	70,292
台币	(7,573,413)	+3.8	(287,790)
泰铢	(4,801,276)	-0.7	33,609
	1,077,757,307		(19,339,790)
2024			
澳元	66,989,835	+7.5	5,024,238
巴西雷亚尔	(1,698,774)	-8.1	137,601
加元	53,301,172	+0.1	53,301
人民币（离岸）	873,359,479	+4.1	35,807,739
人民币（在岸）	(467,372)	+4.1	(19,162)
欧元	(3,657,870)	+5.4	(197,525)
港元	(24,138,831)	+0.8	(193,111)
印尼盾	41,430,209	+2.1	870,034
印度卢比	24,057,314	-0.9	(216,516)
韩元	4,114,116	+3.2	131,652
马来西亚林吉特	8,578,003	+13.9	1,192,342
墨西哥比索	(2,550,797)	-11.3	288,240
纽元	28,220,128	+5.9	1,664,988
秘鲁新索尔	12,082,080	+1.9	229,560
菲律宾比索	2,305,329	+1.0	23,053
新加坡元	33,259,873	+6.5	2,161,892
斯里兰卡卢比	3,308,768	+9.4	311,024
英镑	11,891,794	+9.9	1,177,288
台币	191,394	+2.0	3,828
泰铢	4,546,847	+13.2	600,184
	1,135,122,697		49,050,650

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方向变动。

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。

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

下表概述于九月三十日按照信贷评级的债务证券及可转换证券。

	2025 占资产净值百分比	2024 占资产净值百分比
标准普尔(AAA)/穆迪(Aaa)/惠誉(AAA)	1.2	1.2
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	4.6	1.2
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	15.6	17.5
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	38.6	39.4
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	20.3	20.5
标准普尔(B)/穆迪(B)/惠誉(B)	3.8	3.1
标准普尔(CCC)/穆迪(Caa)/惠誉(CCC)	0.8	0.8
未评级	6.4	9.0
	91.3	92.7

于九月三十日，按照发行机构的信贷评级，下表概述上述未评级债务证券及可转换证券。

	2025 占资产净值百分比	2024 占资产净值百分比
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	0.6	1.0
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	4.2	5.3
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	-	0.2
标准普尔(CCC)/穆迪(Caa)/惠誉(CCC)	0.2	-
未评级	1.4	2.5
	6.4	9.0

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

下表概述本基金于九月三十日存放金融资产的银行／经纪／托管机构的信贷评级。

	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)	2,016	3,705,562
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	50,439,922	21,160,462
托管机构的现金抵押品		
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	9,168,061	616,762
存放经纪之保证金及经纪持有/发行的衍生性产品		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	10,077,066	9,582,845
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	35,672,247	28,813,653
托管机构的投资余额		
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	2,887,124,411	1,643,786,624

(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。

在投资限制和指引的规限下，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	12 个月以上 美元	1 个月以内 美元	1 至 12 个月 美元
应付经纪款项	95,413,753	-	-	33,229,268	-
赎回应付款项	11,798,241	-	-	10,439,786	-
应付收益分配	5,704,569	-	-	4,437,588	-
其他应付款项	3,085,770	-	-	1,925,480	-
衍生性产品	1,342,900	24,296,703	1,720,854	339,907	12,254,306
可赎回份额持有人应占净资产	2,950,298,640	-	-	1,661,058,597	-
总金融负债	3,067,643,873	24,296,703	1,720,854	1,711,430,626	12,254,306

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				
现金抵押品	9,168,061	(9,168,061)	-	-
保证金	21,376,765	(13,120,840)	-	8,255,925
衍生性产品	23,589,516	(10,991,388)	-	12,598,128
	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				
应付经纪款项	9,666,563	-	(9,666,563)	-
衍生性产品	27,337,362	(10,492,886)	(13,120,840)	3,723,636
	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				
应收经纪款项	6,838,083	(6,838,083)	-	-
现金抵押品	616,762	(616,762)	-	-
保证金	24,406,721	(1,805,210)	-	22,601,511
衍生性产品	12,202,097	(1,427,767)	-	10,774,330
	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				
应付经纪款项	7,951,754	(6,838,083)	(1,113,671)	-
衍生性产品	5,130,155	(1,427,767)	(1,308,301)	2,394,087

(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，监测基金的投资指引及限制条件，以透过分散投资维持足够的资金流通性。

(III) 公平值估计

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				
可转换证券	-	91,460,525	-	91,460,525
债务证券	-	2,693,259,092	-	2,693,259,092
集体投资计划	102,404,794	-	-	102,404,794
衍生性产品	363,306	24,009,242	-	24,372,548
按公平值透过损益列账的总金融资产	102,768,100	2,808,728,859	-	2,911,496,959
负债				
衍生性产品	657,953	26,702,504	-	27,360,457
按公平值透过损益列账的总金融负债	657,953	26,702,504	-	27,360,457

	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总额 美元
上市投资				
2024				
资产				
可转换证券	-	79,534,631	-	79,534,631
债务证券	-	1,540,160,427	-	1,540,160,427
集体投资计划	24,091,566	-	-	24,091,566
衍生性产品	81,047	13,908,730	-	13,989,777
按公允价值透过损益列账的总金融资产	24,172,613	1,633,603,788	-	1,657,776,401
负债				
衍生性产品	259,878	12,334,335	-	12,594,213
按公允价值透过损益列账的总金融负债	259,878	12,334,335	-	12,594,213

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，并包括集体投资计划及交易所交易衍生性产品。本基金没有调整这些工具的报价。

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

被分类为第三层次的投资，由于其交易次数疏落，故此有显著的不可观察输入值。

截至二零二五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	26,799,973	158,051,764
投资及衍生性产品销售之实现收益	99,182,076	47,389,959
	125,982,049	205,441,723

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 0.0325	14,615,901.841	(311,136)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	加元 0.0306	11,121,926.884	(244,148)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	英镑 0.0377	1,497,359.694	(72,575)
港元类别（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	港元 0.0384	226,728,205.111	(1,119,876)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	纽元 0.0343	7,297,048.975	(148,959)
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 0.0218	126,467,775.330	(386,792)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	美元 0.0401	5,893,982.280	(236,349)
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 0.0201	243,705,600.797	(687,231)
美元类别（每月派息）	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	美元 0.0440	31,421,477.695	(1,382,543)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	澳元 0.0336	14,494,683.137	(317,270)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	加元 0.0300	11,023,559.983	(236,194)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	英镑 0.0378	1,551,423.062	(74,539)
港元类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	港元 0.0384	224,018,096.383	(1,105,473)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	纽元 0.0338	7,340,121.519	(146,761)
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 0.0573	712.460	(6)
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 0.0283	122,300,568.330	(477,354)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	美元 0.0401	5,699,065.720	(228,533)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
人民币对冲类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	人民币 0.0261	238,721,418.784	(859,326)
美元类别（每月派息）	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	美元 0.0440	30,940,410.823	(1,361,376)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	澳元 0.0340	14,451,278.779	(304,215)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	加元 0.0282	10,835,353.688	(212,458)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	英镑 0.0380	1,511,723.972	(71,945)
港元类别（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	港元 0.0383	218,058,565.877	(1,075,141)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	纽元 0.0329	7,062,494.209	(130,177)
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 0.0575	284,231.730	(2,226)
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 0.0298	117,002,087.400	(474,925)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	美元 0.0401	5,506,446.590	(220,809)
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 0.0275	234,376,880.198	(877,936)
美元类别（每月派息）	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	美元 0.0440	30,147,817.132	(1,326,502)
PRC 人民币份额（每月派息）	2025 年 1 月 27 日	2025 年 2 月 10 日	人民币 0.0578	1,365,462.650	(10,889)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2025 年 1 月 27 日	2025 年 2 月 10 日	人民币 0.0340	117,021,612.120	(548,954)
PRC 美元份额（每月派息）	2025 年 1 月 27 日	2025 年 2 月 10 日	美元 0.0401	5,806,663.680	(232,847)
澳元对冲类别（每月派息）	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	澳元 0.0353	13,839,408.236	(305,063)
加元对冲类别（每月派息）	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	加元 0.0286	10,743,330.167	(213,478)
英镑对冲类别（每月派息）	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	英镑 0.0392	1,492,257.171	(72,729)
港元类别（每月派息）	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	港元 0.0384	211,515,262.222	(1,042,549)
纽元对冲类别（每月派息）	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 11 日	纽元 0.0341	7,014,797.346	(135,354)
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 0.0315	225,171,810.554	(974,455)
美元类别（每月派息）	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	美元 0.0440	29,158,479.942	(1,282,971)
澳元对冲类别（每月派息）	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	澳元 0.0347	13,653,221.075	(294,612)
加元对冲类别（每月派息）	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	加元 0.0285	10,721,353.750	(212,112)
英镑对冲类别（每月派息）	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	英镑 0.0382	1,453,902.628	(69,932)
港元类别（派息月派）	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	港元 0.0706	775.663	(7)
港元类别（每月派息）	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	港元 0.0383	207,129,538.861	(1,020,132)
纽元对冲类别（每月派息）	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	纽元 0.0331	7,156,723.544	(132,740)
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 0.0575	9,551,871.710	(75,314)
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 0.0292	116,214,708.500	(465,334)
PRC 美元份额（每月派息）	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	美元 0.0400	6,639,783.900	(265,591)
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 0.0270	220,852,441.390	(817,686)
美元类别（派息月派）	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	美元 0.0707	99.701	(7)
美元类别（每月派息）	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	美元 0.0440	28,731,892.413	(1,264,201)
澳元对冲类别（每月派息）	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	澳元 0.0339	13,618,006.571	(287,677)
加元对冲类别（每月派息）	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	加元 0.0271	10,722,844.471	(201,903)
英镑对冲类别（每月派息）	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	英镑 0.0380	1,518,947.147	(74,502)
港元类别（派息月派）	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	港元 0.0706	294,339.690	(2,671)
港元类别（每月派息）	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	港元 0.0383	207,666,514.460	(1,022,278)
纽元对冲类别（每月派息）	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	纽元 0.0317	7,222,540.548	(129,668)
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 0.0574	28,060,836.570	(221,678)
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 0.0245	114,281,731.770	(385,348)
PRC 美元份额（每月派息）	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	美元 0.0401	7,960,786.420	(319,228)
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 0.0227	216,895,418.959	(677,621)
美元类别（派息月派）	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	美元 0.0708	100.398	(7)
美元类别（每月派息）	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	美元 0.0440	28,751,102.829	(1,265,047)
澳元对冲类别（每月派息）	2025 年 4 月 30 日	2025 年 5 月 12 日	澳元 0.0340	13,699,515.601	(298,031)
加元对冲类别（每月派息）	2025 年 4 月 30 日	2025 年 5 月 12 日	加元 0.0263	10,582,911.028	(201,499)
英镑对冲类别（每月派息）	2025 年 4 月 30 日	2025 年 5 月 12 日	英镑 0.0377	1,582,903.721	(79,708)
港元类别（派息月派）	2025 年 4 月 30 日	2025 年 5 月 12 日	港元 0.0692	788,802.389	(7,039)
港元类别（每月派息）	2025 年 4 月 30 日	2025 年 5 月 12 日	港元 0.0383	207,695,813.397	(1,025,797)
纽元对冲类别（每月派息）	2025 年 4 月 30 日	2025 年 5 月 12 日	纽元 0.0304	7,334,136.637	(132,314)
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 0.0576	41,728,495.240	(330,468)
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 0.0240	114,104,505.820	(376,520)
PRC 美元份额（每月派息）	2025 年 4 月 30 日	2025 年 5 月 12 日	美元 0.0400	8,502,250.080	(340,090)
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 0.0222	215,536,005.122	(657,881)
美元类别（派息月派）	2025 年 4 月 30 日	2025 年 5 月 12 日	美元 0.0694	107.599	(7)
美元类别（每月派息）	2025 年 4 月 30 日	2025 年 5 月 12 日	美元 0.0440	28,791,325.959	(1,266,816)
澳元对冲类别（每月派息）	2025 年 5 月 30 日	2025 年 6 月 10 日	澳元 0.0332	13,972,268.790	(298,529)
加元对冲类别（每月派息）	2025 年 5 月 30 日	2025 年 6 月 9 日	加元 0.0261	10,547,829.211	(200,224)
英镑对冲类别（每月派息）	2025 年 5 月 30 日	2025 年 6 月 9 日	英镑 0.0367	1,708,340.626	(84,549)
港元类别（派息月派）	2025 年 5 月 30 日	2025 年 6 月 9 日	港元 0.0701	798,640.536	(7,139)
港元类别（每月派息）	2025 年 5 月 30 日	2025 年 6 月 9 日	港元 0.0387	207,689,741.896	(1,025,000)
纽元对冲类别（每月派息）	2025 年 5 月 30 日	2025 年 6 月 9 日	纽元 0.0295	7,167,499.240	(126,241)
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 0.0569	51,772,014.520	(409,049)
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 0.0218	113,777,340.300	(344,414)
PRC 美元份额（每月派息）	2025 年 5 月 30 日	2025 年 6 月 9 日	美元 0.0401	9,120,577.770	(365,735)
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 0.0202	211,997,467.052	(594,634)
美元类别（派息月派）	2025 年 5 月 30 日	2025 年 6 月 9 日	美元 0.0697	19,968.897	(1,392)
美元类别（每月派息）	2025 年 5 月 30 日	2025 年 6 月 9 日	美元 0.0440	28,789,467.609	(1,266,735)
澳元对冲类别（每月派息）	2025 年 6 月 30 日	2025 年 7 月 9 日	澳元 0.0327	13,986,867.588	(299,738)
加元对冲类别（每月派息）	2025 年 6 月 30 日	2025 年 7 月 9 日	加元 0.0263	10,503,721.483	(202,453)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
英镑对冲类别（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	英镑 0.0365	1,887,671.446	(94,417)
港元类别（资息月派）	2025年6月30日	2025年7月9日	港元 0.0707	798,714.645	(7,195)
港元类别（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	港元 0.0388	221,448,397.107	(1,094,547)
纽元对冲类别（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	纽元 0.0289	7,094,792.814	(124,469)
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 0.0568	58,482,345.300	(463,734)
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 0.0224	110,528,211.820	(345,636)
PRC 美元份额（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	美元 0.0401	9,536,351.220	(382,408)
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 0.0208	213,812,963.140	(620,859)
美元类别（资息月派）	2025年6月30日	2025年7月9日	美元 0.0701	19,976.930	(1,400)
美元类别（每月派息）	2025年6月30日	2025年7月9日	美元 0.0440	29,842,254.754	(1,313,057)
澳元对冲类别（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	澳元 0.0322	13,659,876.386	(283,196)
加元对冲类别（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	加元 0.0260	10,638,792.385	(200,071)
英镑对冲类别（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	英镑 0.0364	1,840,558.164	(88,659)
港元类别（资息月派）	2025年7月31日	2025年8月8日	港元 0.0711	798,789.463	(7,235)
港元类别（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	港元 0.0387	236,062,949.083	(1,163,775)
纽元对冲类别（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	纽元 0.0289	7,300,551.821	(124,555)
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 0.0566	68,981,115.740	(541,501)
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 0.0226	111,778,220.730	(350,363)
PRC 美元份额（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	美元 0.0401	10,267,344.710	(411,722)
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 0.0209	211,940,365.541	(614,345)
美元类别（资息月派）	2025年7月31日	2025年8月8日	美元 0.0705	19,984.996	(1,409)
美元类别（每月派息）	2025年7月31日	2025年8月8日	美元 0.0440	32,569,451.894	(1,433,054)
澳元对冲类别（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	澳元 0.0317	13,995,231.975	(290,368)
加元对冲类别（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	加元 0.0262	10,915,881.608	(208,308)
英镑对冲类别（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	英镑 0.0354	2,007,187.995	(95,998)
港元类别（资息月派）	2025年8月29日	2025年9月8日	港元 0.0710	799,062.152	(7,277)
港元类别（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	港元 0.0385	256,703,101.522	(1,267,735)
纽元对冲类别（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	纽元 0.0283	6,966,728.897	(116,333)
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 0.0567	82,759,173.740	(658,792)
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 0.0223	115,327,198.240	(361,065)
PRC 美元份额（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	美元 0.0401	11,141,462.770	(446,773)
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 0.0206	212,839,131.780	(615,558)
美元类别（资息月派）	2025年8月29日	2025年9月8日	美元 0.0708	22,668.859	(1,605)
美元类别（每月派息）	2025年8月29日	2025年9月8日	美元 0.0440	33,534,897.501	(1,475,534)
澳元对冲类别（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	澳元 0.0322	14,051,135.804	(299,859)
加元对冲类别（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	加元 0.0265	11,190,535.157	(213,130)
英镑对冲类别（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	英镑 0.0359	2,076,401.240	(100,353)
港元类别（资息月派）	2025年9月30日	2025年10月10日	港元 0.0710	848,249.956	(7,742)
港元类别（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	港元 0.0384	259,779,417.486	(1,282,137)
纽元对冲类别（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	纽元 0.0284	7,014,988.536	(115,680)
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 0.0562	97,348,870.700	(767,602)
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 0.0225	115,885,334.310	(365,830)
PRC 美元份额（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	美元 0.0401	12,168,515.680	(487,957)
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 0.0208	208,383,366.017	(608,128)
美元类别（资息月派）	2025年9月30日	2025年10月10日	美元 0.0711	87,051.805	(6,189)
美元类别（每月派息）	2025年9月30日	2025年10月10日	美元 0.0440	32,953,680.850	(1,449,962)
可赎回份额持有人之总收益分配					(58,976,884)

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 0.0285	19,079,707.027	(344,289)
加元对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	加元 0.0332	13,421,046.121	(320,964)
英镑对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	英镑 0.0364	1,775,966.701	(78,444)
港元类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	港元 0.0386	286,193,667.797	(1,411,839)
纽元对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	纽元 0.0351	8,375,319.424	(170,990)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	人民币 0.0331	41,395,671.400	(186,623)
PRC 美元份额（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	美元 0.0400	1,963,240.390	(78,530)
人民币对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	人民币 0.0306	289,613,993.950	(1,207,043)
美元类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	美元 0.0440	42,054,795.563	(1,850,409)
澳元对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	澳元 0.0294	17,983,177.047	(350,558)
加元对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	加元 0.0334	12,924,380.802	(318,379)
英镑对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	英镑 0.0364	1,831,560.472	(84,399)
港元类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	港元 0.0384	274,078,481.908	(1,347,530)
纽元对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	纽元 0.0348	8,012,008.442	(172,212)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	人民币 0.0265	41,103,943.090	(152,535)
PRC 美元份额（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	美元 0.0401	1,940,841.620	(77,828)
人民币对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	人民币 0.0244	286,400,645.833	(978,599)
美元类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	美元 0.0440	41,153,915.390	(1,810,770)
澳元对冲类别（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	澳元 0.0288	17,664,887.867	(347,144)

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）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	加元 0.0330	12,137,795.820	(303,767)
英镑对冲类别（每月派息）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	英镑 0.0357	1,813,188.634	(82,519)
港元类别（每月派息）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	港元 0.0385	266,288,877.038	(1,312,935)
纽元对冲类别（每月派息）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	纽元 0.0345	7,774,798.117	(169,830)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	人民币 0.0239	40,726,636.420	(136,697)
PRC 美元份额（每月派息）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	美元 0.0401	1,895,299.460	(76,001)
人民币对冲类别（每月派息）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	人民币 0.0221	283,260,423.084	(879,147)
美元类别（每月派息）	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	美元 0.0440	40,500,343.991	(1,782,013)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	澳元 0.0289	16,688,076.003	(318,815)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	加元 0.0330	11,927,494.959	(294,605)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	英镑 0.0362	1,875,260.999	(86,447)
港元类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	港元 0.0386	253,089,752.210	(1,249,706)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 9 日	纽元 0.0345	7,443,473.484	(158,073)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	人民币 0.0236	45,103,173.600	(148,380)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	美元 0.0401	2,261,777.670	(90,697)
人民币对冲类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	人民币 0.0218	271,154,596.012	(824,006)
美元类别（每月派息）	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	美元 0.0440	37,817,695.784	(1,663,977)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	澳元 0.0296	15,614,009.806	(300,945)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	加元 0.0335	11,542,188.267	(285,076)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	英镑 0.0363	1,858,345.060	(85,331)
港元类别（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	港元 0.0386	250,369,586.969	(1,234,450)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	纽元 0.0352	7,341,003.261	(157,432)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	人民币 0.0272	58,133,166.730	(219,454)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	美元 0.0401	3,053,355.800	(122,440)
人民币对冲类别（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	人民币 0.0251	267,202,836.845	(930,820)
美元类别（每月派息）	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	美元 0.0440	37,268,781.105	(1,639,824)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	澳元 0.0294	15,457,539.787	(296,484)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	加元 0.0331	11,296,932.163	(276,319)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	英镑 0.0363	1,842,768.836	(84,502)
港元类别（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	港元 0.0385	246,548,795.624	(1,212,827)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	纽元 0.0351	7,239,051.923	(151,984)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	人民币 0.0242	87,157,514.740	(290,509)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	美元 0.0401	4,255,249.760	(170,636)
人民币对冲类别（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	人民币 0.0225	260,758,441.817	(808,091)
美元类别（每月派息）	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	美元 0.0440	36,727,873.433	(1,616,024)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	澳元 0.0299	14,979,946.726	(290,844)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	加元 0.0331	11,127,003.343	(268,081)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	英镑 0.0364	1,456,110.121	(66,367)
港元类别（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	港元 0.0386	237,213,386.856	(1,170,720)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	纽元 0.0352	7,262,595.123	(151,277)
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 0.0320	122,801,942.260	(541,802)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	美元 0.0401	5,742,162.700	(230,261)
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 0.0296	259,220,748.337	(1,057,905)
美元类别（每月派息）	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	美元 0.0440	36,121,642.252	(1,589,350)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	澳元 0.0295	14,563,909.818	(285,729)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	加元 0.0329	11,120,608.065	(268,399)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	英镑 0.0364	1,450,543.802	(67,224)
港元类别（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	港元 0.0385	233,312,230.501	(1,148,168)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	纽元 0.0352	7,023,195.931	(151,890)
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 0.0266	133,792,834.230	(489,669)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	美元 0.0401	6,156,803.150	(246,888)
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 0.0247	255,485,887.499	(868,264)
美元类别（每月派息）	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	美元 0.0440	36,265,996.500	(1,595,702)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	澳元 0.0298	14,572,940.227	(290,029)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	加元 0.0320	11,039,364.784	(258,165)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	英镑 0.0364	1,428,509.997	(65,730)
港元类别（每月派息）	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	港元 0.0385	231,190,753.424	(1,140,052)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	纽元 0.0352	7,080,845.443	(151,878)
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 0.0216	131,282,297.340	(388,406)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	美元 0.0401	6,090,072.090	(244,212)
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 0.0200	251,336,412.242	(688,513)
美元类别（每月派息）	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	美元 0.0440	36,046,499.611	(1,586,044)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 7 月 31 日	2024 年 8 月 8 日	澳元 0.0301	14,327,002.089	(281,601)
加元对冲类别（每月派息）	2024 年 7 月 31 日	2024 年 8 月 8 日	加元 0.0313	11,035,580.403	(250,037)
英镑对冲类别（每月派息）	2024 年 7 月 31 日	2024 年 8 月 8 日	英镑 0.0362	1,340,035.967	(62,308)
港元类别（每月派息）	2024 年 7 月 31 日	2024 年 8 月 8 日	港元 0.0385	225,307,803.905	(1,110,388)
纽元对冲类别（每月派息）	2024 年 7 月 31 日	2024 年 8 月 8 日	纽元 0.0353	6,978,594.525	(146,316)
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 0.0245	127,402,924.610	(431,868)
PRC 美元份额（每月派息）	2024 年 7 月 31 日	2024 年 8 月 8 日	美元 0.0401	6,035,755.170	(242,034)
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 0.0227	245,043,170.604	(769,616)
美元类别（每月派息）	2024 年 7 月 31 日	2024 年 8 月 8 日	美元 0.0440	35,099,568.768	(1,544,379)
澳元对冲类别（每月派息）	2024 年 8 月 30 日	2024 年 9 月 9 日	澳元 0.0300	13,772,586.354	(280,341)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
加元对冲类别（每月派息）	2024年8月30日	2024年9月9日	加元 0.0299	10,795,349.803	(239,496)
英镑对冲类别（每月派息）	2024年8月30日	2024年9月9日	英镑 0.0352	1,320,041.294	(61,067)
港元类别（每月派息）	2024年8月30日	2024年9月9日	港元 0.0384	221,146,563.564	(1,088,666)
纽元对冲类别（每月派息）	2024年8月30日	2024年9月9日	纽元 0.0346	7,040,776.451	(152,415)
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 0.0190	133,212,080.080	(357,137)
PRC 美元份额（每月派息）	2024年8月30日	2024年9月9日	美元 0.0401	6,133,550.560	(245,955)
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 0.0175	242,389,182.555	(598,534)
美元类别（每月派息）	2024年8月30日	2024年9月9日	美元 0.0440	34,528,214.527	(1,519,239)
澳元对冲类别（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月10日	澳元 0.0310	13,441,867.382	(289,084)
加元对冲类别（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月9日	加元 0.0301	11,017,832.492	(245,484)
英镑对冲类别（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月9日	英镑 0.0360	1,316,323.242	(63,563)
港元类别（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月9日	港元 0.0385	222,308,142.472	(1,101,881)
纽元对冲类别（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月9日	纽元 0.0348	6,898,060.544	(152,733)
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 0.0154	131,167,276.780	(288,624)
PRC 美元份额（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月9日	美元 0.0401	5,990,036.480	(240,201)
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 0.0142	243,863,746.506	(494,791)
美元类别（每月派息）	2024年9月30日	2024年10月9日	美元 0.0440	35,482,480.953	(1,561,227)
可赎回份额持有人之总收益分配					(59,870,402)

7 税项

中国税项

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

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

此外，中国境内非居民企业须就债务证券所得的利息收入缴纳百分之十的预提所得税。根据中国企业所得税法，中国境内的债务证券发行人有义务就该等境外债务证券持有人的利息收入预扣百分之十的中国境内预提所得税。然而，根据中国企业所得税法，由国务院财政部门发行的政府债券和/或经国务院批准的地方政府债券所产生的利息收入可获豁免缴纳中国境内预提所得税。此外，银行存款利息收入也免征增值税（“增值税”）。根据《二零二五年第四号公告》的规定，自二零二五年八月八日起，国债、地方政府债券及金融债券利息收入由原免征增值税改为需缴纳增值税（二零二五年八月八日前发行或此后重新发行的相关债券利息除外）；但依据《二零二一年第三十四号公告》，合格境外投资者取得的该类利息收入暂免征收增值税的政策，此规定将至少延续至二零二五年十二月三十一日。目前，财政部及国家税务总局尚未发布关于进一步延长免征预提所得税和增值税的公告/通知。

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以及适用的附加税费。

截至二零二五年及二零二四年九月三十日止年度，本基金通过债券通投资中国境内的债务证券。管理人认为，对中国境内债务证券所得的收益征收中国境内税项的情况于本财务报表批准之日尚不明确，并已运用判断评估本基金是否可能就其收益缴纳中国所得税、其潜在负债金额及截至报告日征收该等税项的可能性。然而，因存在重大不确定性，管理人的估计可能与实际情况大相径庭。

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

香港税项

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

其他司法管辖区

截至二零二五年及二零二四年九月三十日止年度，已就若干收到的利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) 以下为与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 4,003,656 美元（二零二四年：3,112,503 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
2025					
汇丰银行（中国）有限公司	65,074,593	0.23	-	-	-
HSBC Bank Plc, 伦敦	159,639,336	0.56	-	-	-
HSBC Securities & Capital Markets (India) Private Limited	90,763,474	0.32	-	-	-
HSBC Securities (USA) Inc, 纽约	21,835,500	0.08	-	-	-
JPMorgan Chase Bank, N.A.	3,839,025,682	13.58	-	-	-
J.P. Morgan Securities Plc	5,005,158	0.02	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司	1,008,187,770	3.57	-	-	-

2024					
汇丰银行（中国）有限公司	58,661,005	0.43	-	-	-
HSBC Bank Plc, 伦敦	55,607,881	0.41	-	-	-
HSBC Securities & Capital Markets (India) Private Limited	65,141,042	0.48	-	-	-
HSBC Securities (USA) Inc, 纽约	2,835,128	0.02	-	-	-
JPMorgan Chase Bank, N.A.	1,915,409,747	14.14	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司	523,507,310	3.86	-	-	-

(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	2,016	3,705,562
应付款项	(2,555,828)	(1,479,495)

于二零二五年九月三十日，本基金的投资结余 102,404,794 美元（二零二四年：24,091,566 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 3,700,209 美元（二零二四年：实现亏损 10,364,339 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 35,143 美元（二零二四年：36 美元）。

- (e) 支付给摩根基金（亚洲）有限公司美元 X 类别（累计）之管理费和其他基金份额类别之管理费分别按本基金资产净值的年率百分之零和百分之一计算。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，若干管理人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）	20,808.120	11,696.267	(7,908.982)	24,595.405	-
- PRC 人民币份额（累计）	-	712.460	(712.460)	-	-
- PRC 人民币份额（每月派息）	-	716.460	(716.460)	-	17
- 港元类别（派息月派）	-	814.636	-	814.636	57
- 美元类别（派息月派）	-	104.706	-	104.706	57
JPMorgan Asset Management (S) Limited					
- 美元类别（累计）	-	1,344.718	-	1,344.718	-
2024					
摩根资产管理（亚太）有限公司					
- 美元类别（累计）	19,288.704	9,274.771	(7,755.355)	20,808.120	-

- (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	32,964	33,183
托管费用及银行费用	(39,872)	(29,785)

- (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	404,703	313,670
交易成本	(49,982)	(34,597)
利息支出	(85,445)	-
托管费用及银行费用	(550,900)	(279,174)

9 借款

截至二零二五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。截至二零二四年九月三十日止年度，本基金无银行借款。

10 非金钱收益／佣金共享安排

截至二零二五年及二零二四年九月三十日止年度，投资管理人及其关联人士未有就本基金通过经纪或交易商指示交易而签订任何非金钱收益／佣金共享安排。

11 衍生性产品

(a) 以下为于九月三十日未平仓之信贷违约掉期合约：

	标的资产	交易对手	公平值 美元
<u>2025</u>			
(D) Credit Default Swap Index~604~ 122 30,000,000.00 USD 01/05/2025 20/06/2030	CDX.EM.43	Citigroup Global Markets Ltd	446,991
(D) Credit Default Swap Index~604~ 125 30,000,000.00 USD 16/05/2025 20/06/2030	CDX.EM.43	Citigroup Global Markets Ltd	446,991
		金融资产总额	893,982

(D) Credit Default Swap Index~604~ 127 20,000,000.00 USD 20/05/2025 20/06/2030	CDX.NA.HY.44	Citigroup Global Markets Ltd	(1,594,570)
		金融负债总额	(1,594,570)

		金融负债净额	(700,588)

<u>2024</u>			
(D) Credit Default Swap Index~604~ 64 93,000,000.00 USD 01/10/2024 20/12/2029	CDX.NA.HY.43	Citigroup Global Markets Ltd	(6,931,538)
		金融负债总额	(6,931,538)

		金融负债净额	(6,931,538)

(b) 以下为于九月三十日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 (亏损) 美元
2025				
未平仓合约：				
美元 1,093	澳元 1,669	2025 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	13
美元 1,103	纽元 1,907	2025 年 10 月 2 日	巴克莱银行, 伦敦	4
美元 362,299	纽元 628,000	2025 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	2,362
美元 17,102	港元 133,056	2025 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	0
美元 180,436	美元 104,785	2025 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	0
美元 824,898	港元 6,419,136	2025 年 10 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	220
美元 63,901	加元 88,948	2025 年 10 月 6 日	巴克莱银行, 伦敦	38
美元 1,648	港元 12,823	2025 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	0
美元 45,509	澳元 69,192	2025 年 10 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	352
加元 346,535	美元 249,151	2025 年 10 月 9 日	法国巴黎银行	13
英镑 11,955	美元 16,095	2025 年 10 月 9 日	法国巴黎银行	0
美元 49,998	离岸人民币 356,815	2025 年 10 月 9 日	法国巴黎银行	92
美元 1,102	离岸人民币 7,855	2025 年 10 月 10 日	法国巴黎银行	1
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 465,293	美元 310,822	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	2,360
澳元 690,395	美元 459,989	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	2,296
澳元 54,699	美元 36,503	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	241
澳元 28,608	美元 19,030	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	64
澳元 83,696	美元 55,509	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	24
澳元 1,652	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	8
澳元 1,655	美元 1,100	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3
加元 285,996	美元 207,848	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,100
加元 34,095	美元 24,841	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	313
加元 32,872	美元 23,831	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	182
加元 27,763	美元 20,095	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	122
加元 20,920	美元 15,169	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	119
加元 1,512	美元 1,100	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	12
离岸人民币 10,266,437	美元 1,450,177	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	7,705
离岸人民币 7,381,314	美元 1,039,824	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	2,722
离岸人民币 5,103,565	美元 718,485	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	1,415
离岸人民币 2,180,838	美元 307,632	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,217
离岸人民币 5,478,210	美元 770,650	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	941
离岸人民币 2,827,739	美元 398,203	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	895
离岸人民币 2,191,612	美元 308,764	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	834
离岸人民币 1,508,073	美元 212,525	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	635
离岸人民币 1,455,305	美元 204,977	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	501
离岸人民币 1,433,932	美元 201,957	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	485
离岸人民币 1,366,656	美元 192,491	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	470
离岸人民币 2,465,830	美元 346,882	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	423
离岸人民币 11,381,361	美元 1,599,510	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	387
离岸人民币 1,490,321	美元 209,780	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	384
离岸人民币 1,100,205	美元 154,962	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	379
离岸人民币 789,786	美元 111,277	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	309
离岸人民币 1,305,550	美元 183,704	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	269
离岸人民币 797,725	美元 112,337	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	254
离岸人民币 849,875	美元 119,646	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	236
离岸人民币 1,782,834	美元 250,656	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	161
离岸人民币 4,375,540	美元 614,928	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	149
离岸人民币 345,355	美元 48,619	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	96
离岸人民币 307,442	美元 43,282	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	85
离岸人民币 2,569,126	美元 361,047	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	75
离岸人民币 252,155	美元 35,481	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	52
离岸人民币 104,266	美元 14,685	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	35
离岸人民币 98,648	美元 13,894	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	34
离岸人民币 91,858	美元 12,930	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	24
离岸人民币 72,136	美元 10,156	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	20
离岸人民币 575,044	美元 80,813	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	17
离岸人民币 12,388	美元 1,750	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	9
离岸人民币 103,810	美元 14,595	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	9
离岸人民币 31,835	美元 4,482	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	9
离岸人民币 19,710	美元 2,776	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	Citibank N.A., 伦敦	6
离岸人民币 10,486	美元 1,479	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	6
离岸人民币 7,831	美元 1,105	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	4

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 7,831	美元 1,105	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 8,213	美元 1,157	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 7,835	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 7,835	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 8,067	美元 1,136	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 7,837	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	巴克莱银行, 伦敦	3
离岸人民币 7,838	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	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	2
离岸人民币 7,838	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	2
离岸人民币 8,933	美元 1,257	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 11,074	美元 1,558	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 7,839	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 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 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 7,824	美元 1,101	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 7,857	美元 1,106	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 7,857	美元 1,106	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 7,857	美元 1,106	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	法国巴黎银行	2
离岸人民币 7,852	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	0
英镑 97,238	美元 131,808	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	887
英镑 17,840	美元 24,193	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	174
英镑 47,048	美元 63,446	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	100
英镑 811	美元 1,100	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	8
纽元 987,792	美元 590,686	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	16,677
纽元 902,792	美元 533,612	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	8,997
纽元 491,465	美元 287,234	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,642
纽元 101,794	美元 60,748	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	1,595
纽元 196,975	美元 115,923	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,461
纽元 77,173	美元 45,645	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	800
纽元 114,602	美元 67,367	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	771
纽元 39,927	美元 23,426	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	225
纽元 97,538	美元 56,793	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	114
纽元 5,758	美元 3,422	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	76
纽元 1,854	美元 1,102	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	24
纽元 1,871	美元 1,106	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	19
纽元 1,885	美元 1,113	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	17
美元 57,730,754	澳元 88,186,809	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	732,074
美元 3,205,958	澳元 4,851,485	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	10,300
美元 816,505	纽元 1,414,336	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	5,370
美元 218,365	澳元 334,494	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3,386
美元 135,496	澳元 206,897	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,665
美元 687,688	离岸人民币 4,903,248	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,237
美元 215,796	澳元 327,359	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1,224
美元 185,616	纽元 321,521	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,221
美元 1,014,767	离岸人民币 7,229,641	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,024
美元 198,063	英镑 147,769	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	894
美元 431,205	加元 600,609	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	879
美元 1,859,650	离岸人民币 13,241,659	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	852
美元 325,907	离岸人民币 2,324,271	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	661
美元 56,663	澳元 86,340	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	575
美元 112,818	澳元 170,916	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	490
美元 29,185	澳元 44,554	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	352
美元 74,357	澳元 112,649	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	323
美元 49,691	澳元 75,318	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	240
美元 14,364	澳元 21,887	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	146
美元 71,573	澳元 108,177	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	142
美元 23,542	澳元 35,706	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	130
美元 19,585	澳元 29,726	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	121
美元 50,478	离岸人民币 360,023	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	106
美元 245,778	离岸人民币 1,749,858	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	84
美元 171,622	离岸人民币 1,221,894	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	59

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 107,567	离岸人民币 765,841	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	37
美元 77,077	离岸人民币 548,825	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	35
美元 34,089	离岸人民币 242,862	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	34
美元 86,284	离岸人民币 614,256	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	21
美元 1,131	澳元 1,710	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2
美元 32,480,715	巴西雷亚尔 200,000,000	2025 年 11 月 10 日	Citibank N.A., 伦敦	4,708,972
台币 150,000,000	美元 5,348,375	2025 年 11 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	410,559
澳元 11,600,000	美元 7,751,487	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	58,819
离岸人民币 120,000,000	美元 16,897,910	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	5,217
离岸人民币 95,000,000	美元 13,377,050	2025 年 11 月 17 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3,668
欧元 44,144,964	美元 52,318,329	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	303,157
欧元 5,800,000	美元 6,900,344	2025 年 11 月 17 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	66,314
英镑 14,402,000	美元 19,655,507	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	263,603
港元 60,000,000	美元 7,768,887	2025 年 11 月 17 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	48,536
印尼盾 375,000,000,000	美元 23,037,228	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	544,291
印尼盾 350,000,000,000	美元 21,516,839	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	523,431
印尼盾 200,000,000,000	美元 12,385,488	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	389,255
印尼盾 320,000,000,000	美元 19,499,021	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	305,048
印尼盾 200,000,000,000	美元 12,292,865	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	296,632
印尼盾 150,000,000,000	美元 9,229,009	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	231,834
印尼盾 250,000,000,000	美元 15,206,535	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	211,244
印尼盾 150,000,000,000	美元 9,206,436	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	209,261
印尼盾 150,000,000,000	美元 9,205,560	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	208,385
印尼盾 145,000,000,000	美元 8,898,435	2025 年 11 月 17 日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	201,166
印尼盾 73,000,000,000	美元 4,472,601	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	93,976
印度卢比 1,010,000,000	美元 11,701,598	2025 年 11 月 17 日	高盛国际, 伦敦	356,183
印度卢比 1,300,000,000	美元 14,751,321	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	148,312
印度卢比 1,200,000,000	美元 13,620,762	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	141,061
印度卢比 635,000,000	美元 7,247,055	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	114,047
日元 1,880,000,000	美元 13,264,938	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	472,693
日元 2,600,000,000	美元 18,080,030	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	388,628
日元 1,970,000,000	美元 13,488,740	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	84,100
日元 1,000,000,000	美元 6,839,234	2025 年 11 月 17 日	高盛国际, 伦敦	34,849
韩元 7,200,000,000	美元 5,294,433	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	151,062
韩元 9,500,000,000	美元 6,916,001	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	129,608
韩元 9,000,000,000	美元 6,558,028	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	128,814
韩元 7,500,000,000	美元 5,462,690	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	105,011
韩元 10,000,000,000	美元 7,235,040	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	91,468
韩元 9,600,000,000	美元 6,936,324	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	78,495
韩元 9,500,000,000	美元 6,859,312	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	72,919
韩元 9,600,000,000	美元 6,918,901	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	61,073
韩元 20,215,000,000	美元 14,473,505	2025 年 11 月 17 日	美林国际, 伦敦	32,775
纽元 27,200,000	美元 16,438,315	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	615,558
纽元 39,500,000	美元 23,105,091	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	127,190
纽元 10,800,000	美元 6,405,588	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	123,023
纽元 11,800,000	美元 6,915,932	2025 年 11 月 17 日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	51,647
菲律宾比索 590,000,000	美元 10,434,629	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	311,620
菲律宾比索 360,000,000	美元 6,339,352	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	162,601
菲律宾比索 410,000,000	美元 7,186,930	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	152,297
新加坡元 50,000,000	美元 39,362,132	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	436,662
新加坡元 35,000,000	美元 27,533,733	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	285,904
新加坡元 23,500,000	美元 18,458,401	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	163,430
新加坡元 36,000,000	美元 28,165,069	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	138,731
新加坡元 15,700,000	美元 12,309,975	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	87,377
新加坡元 17,500,000	美元 13,700,056	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	76,142
新加坡元 7,315,650	美元 5,750,000	2025 年 11 月 17 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	54,698
新加坡元 10,000,000	美元 7,824,855	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	39,761
新加坡元 10,000,000	美元 7,820,400	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	35,306
新加坡元 40,700,000	美元 31,709,673	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	24,341
泰铢 155,000,000	美元 4,874,367	2025 年 11 月 17 日	高盛国际, 伦敦	73,091
泰铢 250,000,000	美元 7,751,601	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	7,608
台币 420,000,000	美元 14,070,493	2025 年 11 月 17 日	美林国际, 伦敦	240,783
台币 450,000,000	美元 14,995,701	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	178,155
台币 75,000,000	美元 2,619,072	2025 年 11 月 17 日	美林国际, 伦敦	149,481
台币 235,000,000	美元 7,887,109	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	149,057
台币 80,000,000	美元 2,769,112	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	134,882
台币 220,000,000	美元 7,246,878	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	2,744
美元 8,788,296	巴西雷亚尔 50,358,923	2025 年 11 月 17 日	美林国际, 伦敦	561,688
美元 9,780,908	秘鲁新索尔 35,000,000	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	305,132
美元 9,791,579	秘鲁新索尔 35,000,000	2025 年 11 月 17 日	高盛国际, 伦敦	294,460

				未实现收益／ (亏损) 美元
交付合约	折算额	交割日期	交易对手	
美元 12,725,525	秘鲁新索尔 45,000,000	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	242,241
美元 6,992,225	秘鲁新索尔 25,000,000	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	212,089
美元 6,302,521	秘鲁新索尔 22,500,000	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	181,362
美元 7,053,579	秘鲁新索尔 25,000,000	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	150,735
美元 9,161,901	澳元 14,000,000	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	122,353
美元 30,150,049	离岸人民币 215,000,000	2025 年 11 月 17 日	美林国际, 伦敦	116,026
美元 26,093,557	马来西亚林吉特 110,000,000	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	90,703
美元 5,883,381	澳元 9,000,000	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	85,068
美元 7,079,777	澳元 10,800,000	2025 年 11 月 17 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	82,362
美元 13,033,484	马来西亚林吉特 55,000,000	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	58,646
美元 14,104,062	欧元 12,000,000	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	35,310
美元 3,811,290	澳元 5,800,000	2025 年 11 月 17 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	35,044
美元 13,061,341	马来西亚林吉特 55,000,000	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	30,789
美元 6,884,907	台币 210,000,000	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	29,948
美元 12,459,915	日元 1,835,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	26,132
美元 7,550,515	台币 230,000,000	2025 年 11 月 17 日	美林国际, 伦敦	22,898
美元 6,782,406	日元 1,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	高盛国际, 伦敦	21,979
美元 1,706,143	澳元 2,600,000	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	18,075
美元 17,110,489	新加坡元 22,000,000	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	16,717
美元 4,295,197	澳元 6,500,000	2025 年 11 月 17 日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	15,350
美元 3,190,026	纽元 5,500,000	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	9,429
美元 13,131,321	墨西哥比索 250,000,000	2025 年 11 月 18 日	美国道富银行	434,805
美元 13,183,769	墨西哥比索 250,000,000	2025 年 11 月 18 日	美国道富银行	382,357
美元 13,675,237	墨西哥比索 258,000,000	2025 年 11 月 18 日	美国道富银行	325,004
美元 7,255,129	澳元 11,000,000	2025 年 11 月 18 日	法国巴黎银行	39,708
美元 726,412	离岸人民币 5,162,054	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	463
美元 705,562	离岸人民币 5,013,889	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	450
美元 104,969	纽元 180,436	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	9
美元 249,651	加元 346,535	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	8
美元 1,104	离岸人民币 7,844	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	1
美元 25,996	澳元 39,199	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	0
台币 700,000,000	美元 24,808,883	2026 年 4 月 30 日	Citibank N.A., 伦敦	1,507,653
台币 200,000,000	美元 7,099,499	2026 年 4 月 30 日	高盛国际, 伦敦	442,005
台币 115,000,000	美元 4,060,319	2026 年 4 月 30 日	Citibank N.A., 伦敦	232,260
台币 60,000,000	美元 2,107,001	2026 年 4 月 30 日	渣打银行, 伦敦	109,752
港元 200,000,000	美元 25,884,671	2026 年 5 月 15 日	美国道富银行	70,492
港元 100,000,000	美元 12,954,408	2026 年 5 月 15 日	法国巴黎银行	47,319
港元 47,000,000	美元 6,076,252	2026 年 5 月 15 日	高盛国际, 伦敦	9,919
美元 155,000,000	美元 5,574,597	2026 年 5 月 20 日	渣打银行, 伦敦	408,543
印尼盾 100,000,000,000	美元 5,972,039	2026 年 8 月 31 日	Citibank N.A., 伦敦	8,583
未实现总收益				23,109,959

加元 600,609	美元 430,812	2025 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	(846)
港元 266,141	美元 34,195	2025 年 10 月 2 日	高盛国际, 伦敦	(12)
港元 2,836,795	美元 364,434	2025 年 10 月 2 日	高盛国际, 伦敦	(174)
纽元 1,414,336	美元 815,915	2025 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	(5,319)
美元 5,691	港元 44,273	2025 年 10 月 2 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
港元 2,935,567	美元 377,205	2025 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	(107)
港元 10,778,893	美元 1,385,190	2025 年 10 月 3 日	高盛国际, 伦敦	(233)
纽元 321,521	美元 185,506	2025 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	(1,211)
美元 1,101	加元 1,532	2025 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	(0)
澳元 39,199	美元 25,982	2025 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	(0)
美元 22,201	加元 30,880	2025 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	(1)
美元 381,248	港元 2,965,822	2025 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 127	美元 18	2025 年 10 月 9 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(0)
离岸人民币 360,023	美元 50,430	2025 年 10 月 9 日	法国巴黎银行	(110)
离岸人民币 2,324,271	美元 325,570	2025 年 10 月 9 日	巴克莱银行, 伦敦	(710)
离岸人民币 4,903,248	美元 687,052	2025 年 10 月 9 日	法国巴黎银行	(1,264)
离岸人民币 16,112,226	美元 2,256,599	2025 年 10 月 9 日	高盛国际, 伦敦	(5,229)
离岸人民币 22,375,398	美元 3,135,145	2025 年 10 月 9 日	高盛国际, 伦敦	(5,905)
离岸人民币 548,825	美元 77,035	2025 年 10 月 14 日	法国巴黎银行	(38)
离岸人民币 5,013,889	美元 703,684	2025 年 10 月 14 日	法国巴黎银行	(423)
离岸人民币 5,162,054	美元 724,479	2025 年 10 月 14 日	法国巴黎银行	(435)
离岸人民币 13,241,659	美元 1,858,635	2025 年 10 月 14 日	法国巴黎银行	(909)
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 1,669	美元 1,093	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(13)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／ (亏损) 美元
澳元 1,686	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
澳元 1,681	美元 1,095	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(20)
澳元 20,353	美元 13,450	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(43)
澳元 25,514	美元 16,811	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(104)
澳元 15,583	美元 10,225	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(106)
澳元 36,630	美元 24,039	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(244)
澳元 69,192	美元 45,517	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(353)
澳元 357,312	美元 235,737	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,140)
澳元 344,388	美元 227,059	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,250)
澳元 293,759	美元 191,940	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,805)
澳元 443,649	美元 290,543	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3,571)
澳元 506,338	美元 331,598	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,076)
澳元 3,451,141	美元 2,260,601	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(27,309)
加元 1,534	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
加元 88,948	美元 63,947	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(43)
加元 228,877	美元 164,303	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(354)
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 7,854	美元 1,103	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 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 7,855	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	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 7,825	美元 1,098	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 7,825	美元 1,098	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 60,864	美元 8,550	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 301,656	美元 42,373	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(11)
离岸人民币 271,933	美元 38,191	2025 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(17)
离岸人民币 608,288	美元 85,435	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(32)
离岸人民币 141,770	美元 19,883	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(36)
离岸人民币 1,472,867	美元 206,866	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(77)
离岸人民币 2,516,720	美元 353,523	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(85)
离岸人民币 356,815	美元 50,042	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(92)
离岸人民币 788,684	美元 110,697	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(116)
离岸人民币 4,138,732	美元 581,367	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(140)
离岸人民币 4,489,791	美元 630,569	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(263)
离岸人民币 1,042,189	美元 146,118	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(314)
离岸人民币 5,368,760	美元 754,004	2025 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(327)
离岸人民币 10,213,560	美元 1,434,698	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(345)
英镑 5,447	美元 7,301	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(33)
英镑 71,046	美元 95,471	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(186)
英镑 44,179	美元 59,030	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(452)
纽元 1,907	美元 1,104	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(4)
纽元 143,040	美元 82,498	2025 年 10 月 21 日	美国道富银行	(623)
纽元 628,000	美元 362,546	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,386)
美元 2,436	离岸人民币 17,335	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1)
美元 1,343	离岸人民币 9,550	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
美元 1,204	离岸人民币 8,558	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2)
美元 7,828	离岸人民币 55,699	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2)
美元 1,151	离岸人民币 8,173	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
美元 1,151	离岸人民币 8,171	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
美元 1,400	离岸人民币 9,933	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
美元 1,419	离岸人民币 10,066	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(4)
美元 1,106	离岸人民币 7,837	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
美元 2,131	澳元 3,203	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
美元 1,434	加元 1,983	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(8)
美元 1,301	澳元 1,950	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(9)
美元 6,654	离岸人民币 47,285	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(10)
美元 1,727	加元 2,387	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(10)
美元 2,030	英镑 1,500	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(11)
美元 58,188	英镑 43,208	2025 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(13)
美元 7,798	离岸人民币 55,406	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(14)
美元 1,935	加元 2,670	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(15)
美元 2,642	加元 3,645	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(20)
美元 9,888	离岸人民币 70,234	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(20)
美元 78,978	离岸人民币 561,965	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(20)
美元 8,508	离岸人民币 60,379	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(25)
美元 13,196	离岸人民币 93,729	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(26)
美元 14,213	离岸人民币 100,954	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(29)
美元 14,333	离岸人民币 101,805	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(29)
美元 8,536	离岸人民币 60,535	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(30)

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 121,200	离岸人民币 862,376	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(33)
美元 60,309	离岸人民币 428,938	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(41)
美元 2,560	纽元 4,328	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(45)
美元 1,923	纽元 3,226	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(48)
美元 19,677	离岸人民币 139,701	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(49)
美元 6,193	加元 8,535	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(53)
美元 37,295	离岸人民币 264,939	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(70)
美元 37,484	离岸人民币 266,252	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(75)
美元 35,614	离岸人民币 252,843	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(88)
美元 10,401	纽元 17,734	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(96)
美元 66,557	离岸人民币 473,000	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(99)
美元 227,817	澳元 343,492	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(101)
美元 15,397	澳元 23,071	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(102)
美元 21,577	澳元 32,385	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(108)
美元 43,913	离岸人民币 311,685	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(120)
美元 23,616	离岸人民币 167,184	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(126)
美元 5,801	纽元 9,761	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(129)
美元 20,141	英镑 14,851	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(145)
美元 53,409	离岸人民币 379,063	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(150)
美元 61,387	离岸人民币 435,836	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(151)
美元 10,084	纽元 17,080	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(159)
美元 112,369	英镑 83,327	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(178)
美元 74,393	离岸人民币 528,163	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(184)
美元 69,371	离岸人民币 492,274	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(204)
美元 35,841	加元 49,505	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(226)
美元 108,961	离岸人民币 773,737	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(248)
美元 39,584	英镑 29,205	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(262)
美元 139,401	离岸人民币 990,168	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(278)
美元 41,104	澳元 61,531	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(313)
美元 78,927	离岸人民币 559,505	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(314)
美元 107,509	离岸人民币 762,841	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(327)
美元 110,192	离岸人民币 781,879	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(335)
美元 130,297	离岸人民币 924,761	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(365)
美元 68,924	英镑 50,903	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(389)
美元 67,969	英镑 50,190	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(393)
美元 221,334	离岸人民币 1,572,341	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(414)
美元 221,430	离岸人民币 1,573,022	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(414)
美元 212,337	离岸人民币 1,508,218	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(427)
美元 67,765	英镑 49,997	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(449)
美元 236,574	离岸人民币 1,680,370	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(476)
美元 707,700	离岸人民币 5,033,424	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(486)
美元 176,319	离岸人民币 1,251,370	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(497)
美元 193,406	离岸人民币 1,372,663	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(542)
美元 150,317	离岸人民币 1,065,581	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(599)
美元 279,002	离岸人民币 1,981,198	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(636)
美元 263,497	离岸人民币 1,870,790	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(645)
美元 372,203	离岸人民币 2,644,391	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(656)
美元 98,019	英镑 72,313	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(657)
美元 126,221	离岸人民币 893,549	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(674)
美元 230,353	离岸人民币 1,634,655	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(678)
美元 118,561	纽元 202,859	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(679)
美元 52,670	英镑 38,610	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(686)
美元 558,017	离岸人民币 3,966,444	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(717)
美元 40,924	纽元 69,191	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(717)
美元 123,619	英镑 91,280	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(720)
美元 206,342	澳元 310,104	2025 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(760)
美元 67,319	加元 92,514	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(763)
美元 29,521	纽元 49,465	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(777)
美元 72,266	加元 99,128	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(953)
美元 493,405	离岸人民币 3,504,564	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(1,001)
美元 168,204	加元 232,386	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(1,024)
美元 34,788	纽元 58,104	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,024)
美元 158,958	澳元 238,196	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,047)
美元 196,376	离岸人民币 1,390,199	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,048)
美元 150,438	加元 207,632	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(1,065)
美元 387,832	离岸人民币 2,752,337	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(1,118)
美元 189,064	加元 261,243	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,123)
美元 654,437	离岸人民币 4,649,577	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,154)
美元 2,598,012	离岸人民币 18,482,206	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,194)
美元 104,808	纽元 178,087	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,321)

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 380,164	离岸人民币 2,696,138	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,347)
美元 189,267	英镑 139,563	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,359)
美元 127,049	纽元 216,127	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,457)
美元 187,358	加元 258,111	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,671)
美元 144,609	加元 198,634	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,710)
美元 650,284	离岸人民币 4,614,892	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(1,875)
美元 360,699	离岸人民币 2,553,480	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,925)
美元 72,524	纽元 121,325	2025 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(2,022)
美元 99,761	纽元 167,839	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(2,229)
美元 649,606	离岸人民币 4,607,030	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(2,301)
美元 92,021	纽元 154,374	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(2,314)
美元 588,799	离岸人民币 4,173,939	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,345)
美元 880,472	离岸人民币 6,248,976	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,467)
美元 1,713,884	离岸人民币 12,180,042	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,543)
美元 273,432	加元 376,238	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,763)
美元 208,796	加元 285,999	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(3,045)
美元 765,764	离岸人民币 5,428,422	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3,050)
美元 1,532,048	离岸人民币 10,882,024	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3,083)
美元 1,130,582	离岸人民币 8,022,932	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3,330)
美元 1,530,052	离岸人民币 10,864,943	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(3,487)
美元 1,294,822	离岸人民币 9,190,549	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3,516)
美元 755,801	离岸人民币 5,350,511	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4,035)
美元 2,040,090	离岸人民币 14,490,836	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4,073)
美元 1,728,381	离岸人民币 12,265,856	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(4,982)
美元 1,484,228	离岸人民币 10,526,202	2025 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(5,257)
美元 2,361,130	离岸人民币 16,753,695	2025 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(7,173)
美元 18,014,827	英镑 13,372,110	2025 年 10 月 21 日	美国道富银行	(10,605)
美元 2,006,412	离岸人民币 14,203,892	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(10,712)
美元 714,359	纽元 1,196,604	2025 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(19,009)
美元 114,204,255	离岸人民币 812,446,788	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(52,471)
美元 195,030,954	离岸人民币 1,387,446,305	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(89,606)
美元 442,019,688	离岸人民币 3,144,519,223	2025 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(203,085)
美元 25,664,000	纽元 43,603,618	2025 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(325,806)
美元 50,605,857	加元 69,714,072	2025 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(452,859)
巴西雷亚尔 200,000,000	美元 30,998,140	2025 年 11 月 10 日	高盛国际, 伦敦	(6,191,547)
美元 5,311,013	台币 150,000,000	2025 年 11 月 13 日	渣打银行, 伦敦	(373,197)
澳元 9,200,000	美元 6,092,206	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(8,875)
澳元 4,500,000	美元 2,944,237	2025 年 11 月 17 日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	(39,988)
澳元 12,500,000	美元 8,247,394	2025 年 11 月 17 日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	(42,119)
澳元 10,000,000	美元 6,559,004	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(72,606)
澳元 25,000,000	美元 16,473,905	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	(105,120)
澳元 14,000,000	美元 9,000,880	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	(283,374)
澳元 77,643,029	美元 50,862,900	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	(626,929)
巴西雷亚尔 50,358,923	美元 8,937,603	2025 年 11 月 17 日	高盛国际, 伦敦	(412,382)
巴西雷亚尔 50,800,000	美元 9,016,524	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	(415,354)
离岸人民币 93,471,024	美元 13,131,844	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	(26,300)
欧元 10,200,000	美元 12,006,930	2025 年 11 月 17 日	高盛国际, 伦敦	(11,536)
欧元 8,800,000	美元 10,346,640	2025 年 11 月 17 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(22,232)
欧元 10,500,000	美元 12,057,870	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(314,080)
港元 105,000,000	美元 13,469,990	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(40,625)
港元 156,861,000	美元 66,406,972	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	(98,837)
印度卢比 1,300,000,000	美元 14,601,377	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	(1,632)
马来西亚林吉特 109,881,475	美元 26,075,914	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	(80,133)
马来西亚林吉特 100,000,000	美元 23,721,416	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	(82,458)
马来西亚林吉特 55,000,000	美元 13,006,669	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	(85,461)
马来西亚林吉特 45,000,000	美元 10,619,970	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	(91,773)
秘鲁新索尔 50,000,000	美元 14,005,995	2025 年 11 月 17 日	高盛国际, 伦敦	(402,634)
秘鲁新索尔 67,500,000	美元 18,910,212	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(541,436)
泰铢 250,000,000	美元 7,700,150	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	(43,844)
台币 450,000,000	美元 14,816,815	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	(732)
美元 6,852,624	印度卢比 610,000,000	2025 年 11 月 17 日	高盛国际, 伦敦	(443)
美元 13,625,633	新加坡元 17,500,000	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	(1,718)
美元 84,805	韩元 115,000,000	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	(2,654)
美元 6,873,701	巴西雷亚尔 37,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(4,026)
美元 4,513,434	日元 660,000,000	2025 年 11 月 17 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(22,539)
美元 28,335,968	港元 220,000,000	2025 年 11 月 17 日	高盛国际, 伦敦	(28,013)
美元 7,176,830	韩元 10,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(33,259)
美元 6,465,340	韩元 9,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(36,125)
美元 6,164,758	欧元 5,200,000	2025 年 11 月 17 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(37,696)
美元 15,612,717	新加坡元 20,000,000	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	(42,529)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／ (亏损) 美元
美元 7,189,416	韩元 10,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(45,844)
美元 14,637,632	澳元 22,000,000	2025 年 11 月 17 日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	(48,090)
美元 7,193,158	韩元 10,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	(49,586)
美元 6,838,345	韩元 9,500,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(51,952)
美元 4,338,106	韩元 6,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(51,963)
美元 5,672,179	印度卢比 500,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(55,638)
美元 7,631,511	台币 230,000,000	2025 年 11 月 17 日	美林国际, 伦敦	(58,098)
美元 6,058,733	印尼盾 100,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	(60,617)
美元 7,208,558	韩元 10,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	(64,987)
美元 5,450,606	日元 790,000,000	2025 年 11 月 17 日	高盛国际, 伦敦	(75,142)
美元 7,875,619	印尼盾 130,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(78,067)
美元 15,570,164	泰铢 500,000,000	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	(82,176)
美元 21,479,621	马来西亚林吉特 89,881,475	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	(84,349)
美元 3,695,131	纽元 6,200,000	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	(88,473)
美元 6,089,392	印尼盾 100,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	高盛国际, 伦敦	(91,276)
美元 9,091,460	印尼盾 150,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	高盛国际, 伦敦	(94,285)
美元 7,011,780	台币 210,000,000	2025 年 11 月 17 日	美林国际, 伦敦	(96,925)
美元 6,889,782	韩元 9,500,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(103,389)
美元 9,115,161	印尼盾 150,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	(117,986)
美元 14,277,413	台币 430,000,000	2025 年 11 月 17 日	美林国际, 伦敦	(118,424)
美元 13,353,862	新加坡元 17,000,000	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	(119,202)
美元 8,847,494	纽元 15,000,000	2025 年 11 月 17 日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	(121,709)
美元 6,556,619	韩元 9,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(127,404)
美元 9,126,030	印尼盾 150,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	(128,856)
美元 15,859,040	新加坡元 20,200,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(133,150)
美元 16,289,685	新加坡元 20,752,554	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	(133,627)
美元 28,161,214	新加坡元 36,000,000	2025 年 11 月 17 日	渣打银行, 伦敦	(134,875)
美元 6,744,683	菲律宾比索 385,000,000	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	(138,991)
美元 8,538,876	印尼盾 140,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	(141,513)
美元 7,632,886	日元 1,100,000,000	2025 年 11 月 17 日	法国巴黎银行	(148,062)
美元 6,602,424	菲律宾比索 375,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(168,308)
美元 6,598,534	韩元 9,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(169,320)
美元 14,000,514	纽元 23,700,000	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	(213,774)
美元 29,022,476	新加坡元 37,000,000	2025 年 11 月 17 日	高盛国际, 伦敦	(217,628)
美元 13,452,929	新加坡元 17,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(218,270)
美元 13,325,962	新加坡元 16,800,000	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	(247,004)
美元 6,537,780	纽元 10,800,000	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	(255,215)
美元 12,252,567	印尼盾 200,000,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(256,330)
美元 13,755,427	日元 1,980,000,000	2025 年 11 月 17 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(282,743)
美元 19,770,326	新加坡元 25,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(307,591)
美元 16,161,669	纽元 27,200,000	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	(338,912)
美元 24,567,844	新加坡元 31,000,000	2025 年 11 月 17 日	Citibank N.A., 伦敦	(434,052)
美元 13,313,809	台币 390,000,000	2025 年 11 月 17 日	美国道富银行	(471,935)
美元 41,645,540	新加坡元 52,824,994	2025 年 11 月 17 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(520,786)
墨西哥比索 135,000,000	美元 7,288,492	2025 年 11 月 18 日	高盛国际, 伦敦	(37,216)
墨西哥比索 150,000,000	美元 7,968,279	2025 年 11 月 18 日	美国道富银行	(171,397)
墨西哥比索 100,000,000	美元 5,254,288	2025 年 11 月 18 日	高盛国际, 伦敦	(172,162)
墨西哥比索 130,000,000	美元 6,853,438	2025 年 11 月 18 日	高盛国际, 伦敦	(200,948)
墨西哥比索 150,000,000	美元 7,929,360	2025 年 11 月 18 日	美国道富银行	(210,316)
墨西哥比索 170,000,000	美元 8,979,176	2025 年 11 月 18 日	高盛国际, 伦敦	(245,790)
墨西哥比索 150,000,000	美元 7,888,661	2025 年 11 月 18 日	高盛国际, 伦敦	(251,014)
墨西哥比索 355,000,000	美元 18,641,363	2025 年 11 月 18 日	美国道富银行	(622,536)
墨西哥比索 400,000,000	美元 20,861,148	2025 年 11 月 18 日	法国巴黎银行	(844,653)
美元 14,974,123	墨西哥比索 275,000,000	2025 年 11 月 18 日	渣打银行, 伦敦	(51,384)
加元 1,532	美元 1,103	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(0)
加元 30,880	美元 22,246	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 628,632	美元 88,458	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(60)
离岸人民币 1,055,504	美元 148,526	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(101)
离岸人民币 3,590,323	美元 505,214	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(344)
美元 16,097	英镑 11,955	2025 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(0)
新加坡元 14,200,000	美元 10,824,939	2026 年 3 月 10 日	美国道富银行	(316,886)
新加坡元 4,500,000	美元 3,420,199	2026 年 3 月 24 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(114,042)
美元 8,014,217	台币 230,000,000	2026 年 4 月 30 日	高盛国际, 伦敦	(358,098)
美元 7,066,414	台币 200,000,000	2026 年 4 月 30 日	渣打银行, 伦敦	(408,920)
美元 7,109,999	台币 200,000,000	2026 年 4 月 30 日	渣打银行, 伦敦	(452,505)
美元 7,992,640	台币 225,000,000	2026 年 4 月 30 日	渣打银行, 伦敦	(502,959)
美元 7,862,928	台币 220,000,000	2026 年 4 月 30 日	Citibank N.A., 伦敦	(539,684)
美元 6,070,757	港元 47,000,000	2026 年 5 月 15 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(4,425)
美元 12,919,838	港元 100,000,000	2026 年 5 月 15 日	法国巴黎银行	(12,749)
美元 25,834,987	港元 200,000,000	2026 年 5 月 15 日	高盛国际, 伦敦	(20,808)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／ (亏损) 美元
美元 2,738,046	台币 75,000,000	2026 年 5 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(238,342)
美元 2,910,319	台币 80,000,000	2026 年 5 月 20 日	渣打银行, 伦敦	(243,968)
美元 3,001,200	印尼盾 50,000,000,000	2026 年 8 月 31 日	高盛国际, 伦敦	(19,473)
美元 3,008,967	印尼盾 50,000,000,000	2026 年 8 月 31 日	高盛国际, 伦敦	(27,239)
			未实现总亏损	(24,981,650)
			未实现净收益	(1,871,691)

				未实现收益／ (亏损) 美元
交付合约	折算额	交割日期	交易对手	
2024				
未平仓合约：				
美元 145,552	澳元 212,079	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	1,577
美元 39,632	纽元 62,894	2024 年 10 月 2 日	巴克莱银行，伦敦	384
美元 1,103	纽元 1,746	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	8
美元 1,102	英镑 823	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	1
美元 641,476	澳元 931,308	2024 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	4,630
美元 7,468	纽元 11,823	2024 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	54
加元 200,295	美元 148,725	2024 年 10 月 4 日	法国巴黎银行	457
美元 2,084	澳元 3,007	2024 年 10 月 4 日	Citibank N.A.，伦敦	2
美元 1,101	澳元 1,587	2024 年 10 月 4 日	巴克莱银行，伦敦	0
美元 1,099	纽元 1,728	2024 年 10 月 4 日	Citibank N.A.，伦敦	0
加元 275,697	美元 204,480	2024 年 10 月 7 日	Citibank N.A.，伦敦	383
美元 194,292	英镑 144,848	2024 年 10 月 7 日	Citibank N.A.，伦敦	0
离岸人民币 2,408,865	美元 345,233	2024 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	895
离岸人民币 57,632	美元 8,260	2024 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	21
加元 436,388	美元 323,910	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	740
加元 142,359	美元 105,498	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	72
加元 14,012	美元 10,412	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	35
加元 3,400	美元 2,523	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	5
加元 9,858	美元 7,302	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	1
加元 1,493	美元 1,107	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1
加元 1,486	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	0
离岸人民币 2,858,200	美元 410,089	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,015
离岸人民币 4,227,279	美元 605,762	2024 年 10 月 21 日	美国道富银行	742
离岸人民币 1,280,082	美元 183,434	2024 年 10 月 21 日	美国道富银行	225
离岸人民币 255,548	美元 36,644	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	69
离岸人民币 125,733	美元 18,040	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	45
纽元 319,247	美元 203,220	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	90
纽元 1,741	美元 1,109	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	0
美元 505,523,200	离岸人民币 3,565,955,597	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4,847,004
美元 227,392,776	离岸人民币 1,604,026,366	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,180,264
美元 59,299,862	澳元 88,021,797	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	1,784,888
美元 135,067,396	离岸人民币 952,764,064	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,295,039
美元 27,890,209	纽元 44,805,419	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	618,449
美元 11,778,865	英镑 8,939,022	2024 年 10 月 21 日	渣打银行，伦敦	211,323
美元 4,254,317	离岸人民币 30,009,911	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	40,791
美元 1,612,250	离岸人民币 11,402,947	2024 年 10 月 21 日	美林国际，伦敦	19,773
美元 2,410,778	离岸人民币 16,972,526	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	18,381
美元 404,092	纽元 655,254	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	12,831
美元 726,617	离岸人民币 5,139,138	2024 年 10 月 21 日	美林国际，伦敦	8,912
美元 606,581	离岸人民币 4,296,280	2024 年 10 月 21 日	美林国际，伦敦	8,315
美元 356,920	澳元 525,188	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	7,546
美元 156,151	澳元 234,024	2024 年 10 月 21 日	高盛国际，伦敦	6,255
美元 186,677	澳元 276,904	2024 年 10 月 21 日	高盛国际，伦敦	5,487
美元 431,091	离岸人民币 3,048,973	2024 年 10 月 21 日	美林国际，伦敦	5,287
美元 643,207	离岸人民币 4,528,353	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4,904
美元 343,937	离岸人民币 2,435,852	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	4,690
美元 319,863	离岸人民币 2,266,315	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4,498
美元 346,270	离岸人民币 2,450,083	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	4,393
美元 156,787	澳元 231,687	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	3,997
美元 485,393	离岸人民币 3,417,300	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,701
美元 86,727	纽元 140,855	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc，伦敦	2,896
美元 86,297	澳元 128,000	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	2,531
美元 656,529	离岸人民币 4,604,524	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,485
美元 86,153	纽元 139,194	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc，伦敦	2,413
美元 71,800	澳元 106,716	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	2,258
美元 73,597	纽元 118,833	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,014
美元 158,741	离岸人民币 1,123,069	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	1,996
美元 126,354	澳元 184,819	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,905
美元 70,796	英镑 54,192	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,893
美元 61,121	纽元 98,707	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,684
美元 353,153	加元 479,115	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A.，伦敦	1,659
美元 98,974	离岸人民币 703,067	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行，伦敦	1,651

				未实现收益／ (亏损)
交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
美元 104,833	离岸人民币 740,238	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,112
美元 109,929	澳元 160,000	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,106
美元 149,990	离岸人民币 1,055,289	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,046
美元 58,207	纽元 92,972	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	949
美元 74,396	澳元 108,558	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	940
美元 443,020	离岸人民币 3,101,889	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	931
美元 35,646	英镑 27,220	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	864
美元 65,676	离岸人民币 464,764	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	843
美元 18,646	澳元 28,004	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	788
美元 164,164	加元 222,734	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	783
美元 139,732	加元 189,712	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	761
美元 119,307	澳元 172,968	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	728
美元 48,995	离岸人民币 347,208	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	699
美元 111,445	加元 151,362	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	647
美元 37,311	英镑 28,289	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	634
美元 109,505	加元 148,600	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	542
美元 17,760	澳元 26,356	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	530
美元 127,622	加元 173,041	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	524
美元 31,278	英镑 23,701	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	514
美元 53,413	纽元 84,499	2024 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	352
美元 50,986	加元 69,229	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	282
美元 7,496	纽元 12,201	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	267
美元 24,912	离岸人民币 175,742	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	241
美元 15,150	离岸人民币 107,487	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	234
美元 15,129	离岸人民币 107,216	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	216
美元 35,369	加元 48,036	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	205
美元 27,728	离岸人民币 195,000	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	181
美元 24,629	英镑 18,495	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	179
美元 11,578	离岸人民币 82,006	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	159
美元 111,590	加元 150,891	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	153
美元 6,398	纽元 10,286	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	147
美元 33,731	离岸人民币 236,536	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	123
美元 43,065	离岸人民币 301,527	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	92
美元 6,790	离岸人民币 48,024	2024 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	83
美元 4,222	离岸人民币 30,000	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	72
美元 9,011	离岸人民币 63,442	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	69
美元 6,649	离岸人民币 46,926	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	67
美元 2,329	英镑 1,780	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	59
美元 1,353	纽元 2,200	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	47
美元 23,828	英镑 17,798	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	45
美元 1,407	离岸人民币 10,000	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	24
美元 5,195	英镑 3,885	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	16
美元 1,102	离岸人民币 7,804	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	15
美元 1,109	离岸人民币 7,843	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	14
美元 4,047	加元 5,482	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	13
美元 1,418	离岸人民币 10,000	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	13
美元 1,582	加元 2,146	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	7
美元 2,101	离岸人民币 14,710	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4
台币 420,000,000	美元 13,807,705	2024 年 11 月 15 日	Citibank N.A., 伦敦	483,071
加元 4,062	美元 3,010	2024 年 11 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	0
英镑 144,848	美元 194,278	2024 年 11 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1
美元 773,644	离岸人民币 5,393,407	2024 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	253
美元 357,800	离岸人民币 2,494,380	2024 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	117
美元 129,002	离岸人民币 899,632	2024 年 11 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	86
美元 208,569	离岸人民币 1,454,022	2024 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	68
美元 42,934	纽元 67,560	2024 年 11 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	53
美元 18,436	英镑 13,776	2024 年 11 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	42
美元 7,259	离岸人民币 50,609	2024 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	2
印尼盾 152,547,058,290	美元 10,046,566	2025 年 1 月 22 日	高盛国际, 伦敦	20,982
菲律宾比索 236,000,000	美元 4,219,787	2025 年 1 月 22 日	高盛国际, 伦敦	10,547
台币 254,000,000	美元 8,115,612	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	13,255
美元 8,141,239	马来西亚林吉特 35,000,000	2025 年 1 月 22 日	法国巴黎银行	388,585
美元 11,815,929	纽元 19,000,000	2025 年 1 月 22 日	法国巴黎银行	273,315
美元 24,043,775	新加坡元 31,000,000	2025 年 1 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	270,198
美元 16,232,976	新加坡元 21,000,000	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	237,782
美元 11,473,950	韩元 15,200,000,000	2025 年 1 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	223,737
美元 3,419,351	澳元 5,100,000	2025 年 1 月 22 日	高盛国际, 伦敦	121,161
美元 8,751,888	新加坡元 11,300,000	2025 年 1 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	110,948
美元 7,954,184	新索尔 30,000,000	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	100,537

				未实现收益／ (亏损) 美元
交付合约	折算额	交割日期	交易对手	
美元 4,719,216	韩元 6,250,000,000	2025 年 1 月 22 日	美国美国道富银行	90,688
美元 4,079,074	澳元 6,000,000	2025 年 1 月 22 日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	86,234
美元 8,157,678	新加坡元 10,500,000	2025 年 1 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	77,700
美元 24,714,359	离岸人民币 172,000,000	2025 年 1 月 22 日	高盛国际, 伦敦	76,451
美元 3,545,989	澳元 5,200,000	2025 年 1 月 22 日	美国美国道富银行	63,945
美元 1,468,269	澳元 2,184,970	2025 年 1 月 22 日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	48,577
美元 16,566,666	离岸人民币 115,000,000	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	8,584
未实现总收益				13,858,804
澳元 160,000	美元 109,899	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	(1,101)
英镑 3,885	美元 5,195	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	(16)
美元 1,109	纽元 1,741	2024 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
美元 203,214	纽元 319,247	2024 年 10 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	(94)
美元 3,007	加元 4,062	2024 年 10 月 7 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
离岸人民币 301,527	美元 43,007	2024 年 10 月 8 日	Citibank N.A., 伦敦	(95)
离岸人民币 236,536	美元 33,683	2024 年 10 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	(129)
离岸人民币 3,101,889	美元 442,429	2024 年 10 月 8 日	Citibank N.A., 伦敦	(975)
离岸人民币 4,604,524	美元 655,700	2024 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	(2,500)
澳元 3,007	美元 2,085	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
澳元 1,602	美元 1,100	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(12)
澳元 1,625	美元 1,106	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(21)
澳元 1,633	美元 1,105	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(28)
澳元 1,638	美元 1,104	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(33)
澳元 1,633	美元 1,099	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(35)
澳元 1,638	美元 1,091	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(46)
澳元 1,655	美元 1,098	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(50)
澳元 16,865	美元 11,228	2024 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(476)
澳元 44,607	美元 30,329	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(626)
澳元 30,101	美元 20,252	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(637)
澳元 49,207	美元 33,079	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,069)
澳元 141,326	美元 96,852	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,224)
澳元 212,079	美元 145,594	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,583)
澳元 263,366	美元 180,947	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,822)
澳元 111,979	美元 75,779	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,931)
澳元 102,339	美元 68,996	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,024)
澳元 163,951	美元 111,364	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,413)
澳元 85,836	美元 57,152	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,415)
澳元 157,475	美元 105,821	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3,463)
澳元 160,750	美元 107,645	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3,912)
澳元 305,118	美元 207,727	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4,016)
澳元 931,308	美元 641,650	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,653)
澳元 554,309	美元 376,255	2024 年 10 月 21 日	美国道富银行	(8,421)
澳元 410,723	美元 272,691	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(12,340)
加元 1,489	美元 1,099	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
加元 1,496	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
加元 1,496	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
加元 1,494	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
加元 1,495	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(6)
加元 3,232	美元 2,380	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
加元 15,456	美元 11,421	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(25)
加元 39,375	美元 28,975	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(185)
加元 43,486	美元 31,984	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(220)
离岸人民币 7,722	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 7,780	美元 1,106	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
离岸人民币 7,757	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(8)
离岸人民币 7,757	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(8)
离岸人民币 7,757	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
离岸人民币 7,804	美元 1,106	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(11)
离岸人民币 7,804	美元 1,106	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(11)
离岸人民币 7,821	美元 1,108	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(12)
离岸人民币 7,821	美元 1,108	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(12)
离岸人民币 7,843	美元 1,108	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 7,796	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(15)

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 7,829	美元 1,105	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 7,806	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 7,806	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 7,792	美元 1,100	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 7,792	美元 1,100	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
离岸人民币 7,792	美元 1,100	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
离岸人民币 7,792	美元 1,100	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
离岸人民币 7,829	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(19)
离岸人民币 26,467	美元 3,763	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(25)
离岸人民币 19,018	美元 2,696	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(26)
离岸人民币 17,928	美元 2,534	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(32)
离岸人民币 42,667	美元 6,049	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(57)
离岸人民币 48,783	美元 6,891	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(91)
离岸人民币 454,457	美元 64,904	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(139)
离岸人民币 307,996	美元 43,793	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(288)
离岸人民币 136,067	美元 19,147	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(327)
离岸人民币 253,442	美元 35,821	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(452)
离岸人民币 462,180	美元 65,689	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(460)
离岸人民币 497,547	美元 70,715	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(495)
离岸人民币 555,860	美元 79,037	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(520)
离岸人民币 1,011,536	美元 144,226	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(548)
离岸人民币 509,855	美元 72,267	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(705)
离岸人民币 401,546	美元 56,740	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(731)
离岸人民币 2,643,497	美元 377,535	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(810)
离岸人民币 445,262	美元 62,828	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(900)
离岸人民币 738,140	美元 104,651	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(994)
离岸人民币 513,186	美元 72,418	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,031)
离岸人民币 531,432	美元 74,904	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,156)
离岸人民币 601,847	美元 84,926	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,212)
离岸人民币 687,873	美元 97,223	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,228)
离岸人民币 1,005,634	美元 142,412	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,518)
离岸人民币 700,120	美元 98,546	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,657)
离岸人民币 1,160,204	美元 163,963	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,089)
离岸人民币 1,225,103	美元 173,112	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,229)
离岸人民币 7,773,252	美元 1,110,149	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,382)
离岸人民币 1,649,509	美元 233,593	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,489)
离岸人民币 1,243,898	美元 175,517	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,513)
离岸人民币 5,472,257	美元 780,239	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,967)
离岸人民币 2,014,717	美元 285,312	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3,040)
离岸人民币 3,327,718	美元 473,162	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3,110)
离岸人民币 1,507,168	美元 212,431	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3,280)
离岸人民币 1,453,664	美元 204,558	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3,495)
离岸人民币 1,847,274	美元 260,819	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3,569)
离岸人民币 1,982,076	美元 279,851	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3,829)
离岸人民币 2,080,364	美元 293,221	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,527)
离岸人民币 2,308,269	美元 325,729	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4,638)
离岸人民币 2,819,714	美元 398,118	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(5,448)
离岸人民币 2,546,312	美元 358,415	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(6,020)
离岸人民币 3,560,982	美元 502,463	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(7,195)
离岸人民币 4,071,241	美元 574,969	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(7,719)
离岸人民币 4,698,997	美元 664,073	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(8,462)
离岸人民币 5,684,879	美元 802,859	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(10,778)
离岸人民币 6,199,456	美元 876,006	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(11,279)
离岸人民币 8,891,470	美元 1,260,600	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(11,973)
离岸人民币 6,141,198	美元 866,640	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(12,307)
离岸人民币 6,831,832	美元 964,839	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(12,953)
离岸人民币 10,877,899	美元 1,541,914	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(14,963)
离岸人民币 18,208,929	美元 2,587,953	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(18,163)
英镑 823	美元 1,102	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1)
英镑 841	美元 1,106	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(22)
英镑 843	美元 1,097	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(33)
英镑 61,545	美元 80,913	2024 年 10 月 21 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,640)
英镑 82,409	美元 107,663	2024 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(2,875)
纽元 1,746	美元 1,103	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(8)
纽元 1,740	美元 1,097	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(11)
纽元 1,772	美元 1,105	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(23)
纽元 1,778	美元 1,104	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(27)
纽元 1,789	美元 1,103	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(35)
纽元 11,823	美元 7,468	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(55)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／
				(亏损) 美元
纽元 12,971	美元 8,024	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(229)
纽元 20,609	美元 12,844	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(269)
纽元 62,894	美元 39,632	2024 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(386)
纽元 128,490	美元 81,224	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(531)
纽元 337,196	美元 211,388	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3,163)
纽元 327,702	美元 204,101	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(4,409)
纽元 780,908	美元 483,233	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(13,641)
美元 1,109	加元 1,493	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3)
美元 7,979	离岸人民币 55,670	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(12)
美元 8,269	离岸人民币 57,632	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(21)
美元 102,277	加元 137,776	2024 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(246)
美元 204,540	加元 275,697	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(371)
美元 261,971	离岸人民币 1,827,699	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(386)
美元 148,779	加元 200,295	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(449)
美元 440,717	离岸人民币 3,074,751	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(649)
美元 345,628	离岸人民币 2,408,865	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(864)
美元 260,064	加元 350,000	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(869)
美元 978,958	离岸人民币 6,829,906	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,440)
美元 51,881,655	加元 69,974,542	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(61,520)
美元 13,816,244	台币 420,000,000	2024 年 11 月 15 日	高盛国际, 伦敦	(491,611)
澳元 1,587	美元 1,102	2024 年 11 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
离岸人民币 6,275,304	美元 899,704	2024 年 11 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(736)
离岸人民币 15,986,410	美元 2,291,970	2024 年 11 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,912)
纽元 1,728	美元 1,100	2024 年 11 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
美元 81,583	加元 110,041	2024 年 11 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(28)
澳元 10,000,000	美元 6,889,810	2025 年 1 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(52,370)
巴西雷亚尔 53,658,923	美元 9,514,373	2025 年 1 月 22 日	美国道富银行	(196,071)
离岸人民币 115,000,000	美元 16,408,202	2025 年 1 月 22 日	法国巴黎银行	(167,049)
离岸人民币 263,317,076	美元 37,515,594	2025 年 1 月 22 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(436,985)
欧元 14,814,964	美元 16,530,641	2025 年 1 月 22 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(78,238)
港元 110,000,000	美元 14,167,801	2025 年 1 月 22 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(14,218)
港元 277,261,000	美元 35,700,044	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	(46,510)
印尼盾 261,000,000,000	美元 17,013,787	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	(139,460)
韩元 5,360,000,000	美元 4,110,083	2025 年 1 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(14,891)
韩元 10,770,000,000	美元 8,215,291	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	(73,136)
马来西亚林吉特 33,500,000	美元 8,139,959	2025 年 1 月 22 日	法国巴黎银行	(24,301)
马来西亚林吉特 35,000,000	美元 8,055,236	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	(474,588)
纽元 19,000,000	美元 11,662,838	2025 年 1 月 22 日	美国道富银行	(426,406)
新加坡元 21,000,000	美元 16,455,604	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	(15,152)
新加坡元 10,400,000	美元 8,122,709	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	(34,237)
泰铢 137,000,000	美元 4,108,417	2025 年 1 月 22 日	美国道富银行	(180,055)
美元 4,031,066	新索尔 15,000,000	2025 年 1 月 22 日	高盛国际, 伦敦	(3,706)
美元 8,058,770	印度卢比 678,188,785	2025 年 1 月 22 日	美国道富银行	(14,401)
美元 15,729,828	离岸人民币 109,000,000	2025 年 1 月 22 日	法国巴黎银行	(19,373)
美元 8,323,196	台币 260,000,000	2025 年 1 月 22 日	高盛国际, 伦敦	(29,444)
美元 16,058,677	印度卢比 1,350,000,000	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	(45,587)
离岸人民币 70,000,000	美元 9,903,932	2025 年 2 月 10 日	渣打银行, 伦敦	(196,973)
未实现总亏损				(3,517,345)
未实现净收益				10,341,459

(c) 以下为于九月三十日之未平仓期货合约：

	长仓／ (短仓) 的 合约数目	合约金额 美元	交割日期	标的资产	交易对手	未实现收益／ (亏损) 美元
<u>2025</u>						
Long Gilt Future 29/12/2025	376	45,982,300	2025 年 12 月	10 年期英国 国债	Citigroup Global Markets Ltd	189,431
US 10Yr Ultra Fut 19/12/2025	308	35,444,063	2025 年 12 月	10 年期美国 国债	Citigroup Global Markets Ltd	115,125
US 10Yr Note (CBT) 19/12/2025	740	83,250,000	2025 年 12 月	10 年期美国 国债	Citigroup Global Markets Ltd	57,000
US Ultra Bond (CBT) 19/12/2025	4	480,250	2025 年 12 月	30 年期美国 国债	Citigroup Global Markets Ltd	1,750
					未实现总收益	363,306
<hr/>						
Aust 10yr Bond Fut 15/12/2025	199	14,949,637	2025 年 12 月	10 年期 澳大利亚国债	Citigroup Global Markets Ltd	(103,499)
Aust 3yr Bond Fut 15/12/2025	1,474	104,371,995	2025 年 12 月	3 年期 澳大利亚国债	Citigroup Global Markets Ltd	(295,595)
US 5Yr Note (CBT) 31/12/2025	853	93,143,602	2025 年 12 月	5 年期美国 国债	Citigroup Global Markets Ltd	(258,859)
					未实现总亏损	(657,953)
					未实现净亏损	(294,647)
<hr/>						
<u>2024</u>						
US 10yr Note (CBT) 19/12/2024	(247)	(28,227,469)	2024 年 12 月	10 年期美国 国债	Citigroup Global Markets Ltd	81,047
					未实现总收益	81,047
<hr/>						
Aust 10yr Bond Fut 16/12/2024	268	21,640,977	2024 年 12 月	10 年期 澳大利亚国债	Citigroup Global Markets Ltd	(16,683)
US 2yr Note (CBT) 31/12/2024	399	83,088,633	2024 年 12 月	2 年期美国 国债	Citigroup Global Markets Ltd	(65,461)
US 5yr Note (CBT) 31/12/2024	182	19,998,672	2024 年 12 月	5 年期美国 国债	Citigroup Global Markets Ltd	(177,734)
					未实现总亏损	(259,878)
					未实现净亏损	(178,831)
<hr/>						

(d) 以下为于九月三十日之未平仓利率掉期合约：

	标的资产	交易对手	公平值 美元
<u>2025</u>			
(D) Interest Rate Swap~619~ 166 300,000,000.00 CNY 17/12/2025 17/12/2026	CNY/REPO7/1W/Reuters	Citigroup Global Markets Ltd	5,301
		金融资产总额	5,301
(D) Interest Rate Swap~619~ 163 200,000,000.00 CNY 17/12/2025 17/12/2030	CNY/REPO7/1W/Reuters	Citigroup Global Markets Ltd	(22,707)
(D) Interest Rate Swap~619~ 165 235,000,000.00 HKD 17/12/2025 17/12/2030	HKD/HIBOR/3M/HKAB	Citigroup Global Markets Ltd	(91,462)
(D) Interest Rate Swap~619~ 167 88,800,000,000.00 KRW 17/12/2025 17/12/2030	KRW/CD/91D/Reuters	Citigroup Global Markets Ltd	(12,115)
		金融负债总额	(126,284)
		金融负债净额	(120,983)
<u>2024</u>			
(D) Interest Rate Swap~619~ 58 25,000,000,000.00 KRW 05/09/2024 18/12/2029	KRW/CD/91D/Reuters	Citigroup Global Markets Ltd	49,926
		金融资产总额	49,926
(D) Interest Rate Swap~619~ 42 200,000,000.00 BRL 21/06/2024 04/01/2027	BRL/CDI/1D/BCB	Citigroup Global Markets Ltd	(531,270)
(D) Interest Rate Swap~619~ 43 165,000,000.00 BRL 12/06/2024 02/01/2026	BRL/CDI/1D/BCB	Citigroup Global Markets Ltd	(282,228)
(D) Interest Rate Swap~619~ 49 240,000,000.00 BRL 15/08/2024 04/01/2027	BRL/CDI/1D/BCB	Citigroup Global Markets Ltd	(875,451)
(D) Interest Rate Swap~619~ 54 1,500,000,000.00 INR 28/08/2024 18/12/2029	INR/MIBOR/1D/NSEIL	Citigroup Global Markets Ltd	(145)
(D) Interest Rate Swap~619~ 57 120,000,000.00 CNY 04/09/2024 18/12/2029	CNY/REPO7/1W/Reuters	Citigroup Global Markets Ltd	(63,180)
(D) Interest Rate Swap~619~ 59 130,000,000.00 CNY 09/09/2024 18/12/2029	CNY/REPO7/1W/Reuters	Citigroup Global Markets Ltd	(103,178)
(D) Interest Rate Swap~619~ 61 22,300,000,000.00 KRW 12/09/2024 18/12/2029	KRW/CD/91D/Reuters	Citigroup Global Markets Ltd	(30,000)
		金融负债总额	(1,885,452)
		金融负债净额	(1,835,526)

独立核数师报告

致摩根亚洲总收益债券基金（“贵基金”）份额持有人

就财务报表审计作出的报告

意见

我们已审计的内容

摩根亚洲总收益债券基金刊载于第十七页至第五十五页的财务报表，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二零零四年十一月三十日订立的信托契约（经修订）（“信托契约”）以及香港证券及期货事务监察委员会颁布的单位信托及互惠基金守则（“证监会守则”）附录 E 的相关披露条文适当地拟备。

核数师就审计财务报表承担的责任

我们的目标，是对财务报表整体是否不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述取得合理保证，并出具包括我们意见的核数师报告。我们仅向阁下（作为整体）报告我们的意见，除此之外本报告别无其他目的。我们不会就本报告的内容向任何其他人士负上或承担任何责任。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。
- 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。

独立核数师报告（续）

致摩根亚洲总收益债券基金（“贵基金”）份额持有人

核数师就审计财务报表承担的责任（续）

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，管理人務必：

- 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二零零四年十一月三十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） - 加元对冲类别（每月派息） - 英镑对冲类别（每月派息） - 港元类别（派息月派） - 港元类别（每月派息） - 纽元对冲类别（每月派息） - PRC 人民币份额（累计） - PRC 人民币份额（每月派息） - PRC 人民币对冲份额（累计） - PRC 人民币对冲份额（每月派息） - PRC 美元份额（累计） - PRC 美元份额（每月派息） - 人民币对冲类别（累计） - 人民币对冲类别（每月派息） - 美元类别（累计） - 美元类别（派息月派） - 美元类别（每月派息） - 美元 X 类别（累计）	澳元 88,391,555 加元 71,834,145 英镑 13,855,426 港元 8,544,838 港元 1,770,065,346 纽元 44,064,574 人民币 6,418,166,975 人民币 975,618,545 人民币 3,309,774,435 人民币 824,105,349 美元 123,131,391 美元 86,947,116 人民币 18,772,637 人民币 1,363,050,841 美元 40,830,052 美元 877,617 美元 258,791,109 美元 245,424,296	澳元 6.29 加元 6.39 英镑 6.67 港元 10.07 港元 6.83 纽元 6.26 人民币 10.61 人民币 10.00 人民币 12.73 人民币 7.07 美元 11.96 美元 7.12 人民币 13.29 人民币 6.55 美元 13.39 美元 10.08 美元 7.82 美元 10.75
30/9/24 - 澳元对冲类别（每月派息） - 加元对冲类别（每月派息） - 英镑对冲类别（每月派息） - 港元类别（每月派息） - 纽元对冲类别（每月派息） - PRC 人民币对冲份额（累计） - PRC 人民币对冲份额（每月派息） - PRC 美元份额（累计） - PRC 美元份额（每月派息） - 人民币对冲类别（累计） - 人民币对冲类别（每月派息） - 美元类别（累计） - 美元类别（派息月派） - 美元类别（每月派息） - 美元类别（每月派息）	澳元 86,189,330 加元 71,667,903 英镑 8,786,380 港元 1,555,927,665 纽元 43,974,919 人民币 3,497,384,846 人民币 938,136,758 美元 100,749,385 美元 43,463,162 人民币 30,928,198 人民币 1,625,504,501 美元 12,440,724 美元 281,037,222	澳元 6.41 加元 6.50 英镑 6.79 港元 6.94 纽元 6.37 人民币 12.40 人民币 7.20 美元 11.38 美元 7.26 人民币 12.96 人民币 6.66 美元 12.74 美元 7.97
30/9/23 - 澳元对冲类别（每月派息） - 加元对冲类别（每月派息） - 英镑对冲类别（每月派息） - 港元类别（每月派息） - 纽元对冲类别（每月派息） - PRC 人民币对冲份额（累计） - PRC 人民币对冲份额（每月派息） - PRC 美元份额（累计） - PRC 美元份额（每月派息） - 人民币对冲类别（累计） - 人民币对冲类别（每月派息） - 美元类别（累计） - 美元类别（每月派息）	澳元 116,529,684 加元 86,315,208 英镑 11,342,201 港元 1,980,906,422 纽元 52,716,264 人民币 1,389,825,131 人民币 285,946,232 美元 103,363,951 美元 13,922,104 人民币 52,730,828 人民币 1,863,716,717 美元 12,341,257 美元 324,128,294	澳元 6.10 加元 6.18 英镑 6.46 港元 6.64 纽元 6.07 人民币 11.26 人民币 6.83 美元 10.10 美元 6.90 人民币 11.80 人民币 6.33 美元 11.31 美元 7.57

业绩记录 (未经审计) (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 6.42	澳元 6.03
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 6.51	加元 6.13
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 6.79	英镑 6.39
- 港元类别 (资金月派)	港元 10.19	港元 9.70
- 港元类别 (每月派息)	港元 6.94	港元 6.52
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 6.38	纽元 6.00
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 10.63	人民币 9.97
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.24	人民币 9.84
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 12.77	人民币 11.95
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 7.21	人民币 6.78
- PRC 美元份额 (累计)	美元 11.98	美元 11.08
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 7.27	美元 6.83
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.33	人民币 12.48
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 6.67	人民币 6.27
- 美元类别 (累计)	美元 13.42	美元 12.41
- 美元类别 (资金月派)	美元 10.18	美元 9.75
- 美元类别 (每月派息)	美元 7.98	美元 7.50
- 美元 X 类别 (累计)	美元 10.77	美元 9.92
30/9/24		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 6.44	澳元 6.00
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 6.54	加元 6.08
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 6.82	英镑 6.35
- 港元类别 (每月派息)	港元 6.98	港元 6.53
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 6.41	纽元 5.97
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 12.40	人民币 11.08
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 7.22	人民币 6.72
- PRC 美元份额 (累计)	美元 11.38	美元 9.95
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 7.30	美元 6.78
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.96	人民币 11.61
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 6.68	人民币 6.23
- 美元类别 (累计)	美元 12.74	美元 11.14
- 美元类别 (每月派息)	美元 8.01	美元 7.44
30/9/23		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 6.73	澳元 6.02
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 6.81	加元 6.09
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 7.13	英镑 6.36
- 港元类别 (每月派息)	港元 7.33	港元 6.55
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 6.70	纽元 5.99
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 12.07	人民币 10.69
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 7.54	人民币 6.74
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.64	美元 9.36
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 7.59	美元 6.79
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.71	人民币 11.26
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 6.98	人民币 6.24
- 美元类别 (累计)	美元 11.92	美元 10.48
- 美元类别 (每月派息)	美元 8.33	美元 7.45
30/9/22		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.32	澳元 6.39
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 8.42	加元 6.46
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 8.80	英镑 6.75
- 港元类别 (每月派息)	港元 8.97	港元 6.95
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.28	纽元 6.36
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 13.61	人民币 11.28
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.31	人民币 7.15
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12.11	美元 9.87
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 9.37	美元 7.20
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 14.34	人民币 11.88
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 8.62	人民币 6.62
- 美元类别 (累计)	美元 13.56	美元 11.05
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.28	美元 7.90

(续)

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
30/9/21		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.85	澳元 8.32
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 8.95	加元 8.42
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.34	英镑 8.80
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.50	港元 8.97
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.81	纽元 8.29
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 13.84	人民币 13.19
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.94	人民币 9.32
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12.39	美元 12.03
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 9.97	美元 9.37
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 14.57	人民币 13.84
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.19	人民币 8.62
- 美元类别 (累计)	美元 13.86	美元 13.41
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.93	美元 10.29
30/9/20		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.01	澳元 7.92
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.06	加元 8.00
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.47	英镑 8.36
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.61	港元 8.51
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.94	纽元 7.88
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 13.17	人民币 11.57
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.98	人民币 8.89
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12.05	美元 10.66
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.02	美元 8.92
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.89	人民币 12.16
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.24	人民币 8.23
- 美元类别 (累计)	美元 13.49	美元 11.93
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.99	美元 9.79
30/9/19		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.98	澳元 8.48
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.02	加元 8.53
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.43	英镑 8.92
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.64	港元 9.07
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.91	纽元 8.42
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 12.55	人民币 11.41
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.96	人民币 9.40
- PRC 美元份额 (累计)	美元 11.60	美元 10.58
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 9.99	美元 9.43
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.21	人民币 12.01
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.22	人民币 8.71
- 美元类别 (累计)	美元 12.98	美元 11.84
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.96	美元 10.35
30/9/18		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.14	澳元 8.54
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.18	加元 8.58
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.59	英镑 8.97
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.76	港元 9.17
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.07	纽元 8.47
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.72	人民币 11.30
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.14	人民币 9.48
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.99	美元 10.49
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.15	美元 9.49
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.32	人民币 11.88
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.38	人民币 8.78
- 美元类别 (累计)	美元 12.30	美元 11.75
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.13	美元 10.42
30/9/17		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.56	澳元 8.99
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.60	加元 9.03
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.04	英镑 9.43
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.12	港元 9.51
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.50	纽元 8.93
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.51	人民币 10.63
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.42	人民币 9.92
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.88	美元 10.36
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.38	美元 9.98
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.11	人民币 11.20
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.86	人民币 9.20
- 美元类别 (累计)	美元 12.24	美元 11.60
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.63	美元 10.95

业绩记录（未经审计）（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
30/9/16		
- 澳元对冲类别（每月派息）	澳元 9.65	澳元 9.01
- 加元对冲类别（每月派息）	加元 9.68	加元 9.03
- 英镑对冲类别（每月派息）	英镑 10.11	英镑 9.41
- 港元类别（每月派息）	港元 10.20	港元 9.53
- 纽元对冲类别（每月派息）	纽元 9.58	纽元 8.94
- PRC 人民币对冲份额（累计）	人民币 11.00	人民币 10.02
- PRC 人民币对冲份额（每月派息）	人民币 10.53	人民币 10.00
- PRC 美元份额（累计）	美元 10.77	美元 9.96
- PRC 美元份额（每月派息）	美元 10.49	美元 9.96
- 人民币对冲类别（累计）	人民币 11.82	人民币 10.36
- 人民币对冲类别（每月派息）	人民币 9.95	人民币 9.26
- 美元类别（累计）	美元 12.29	美元 11.09
- 美元类别（每月派息）	美元 11.73	美元 10.93

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

投资管理人

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

