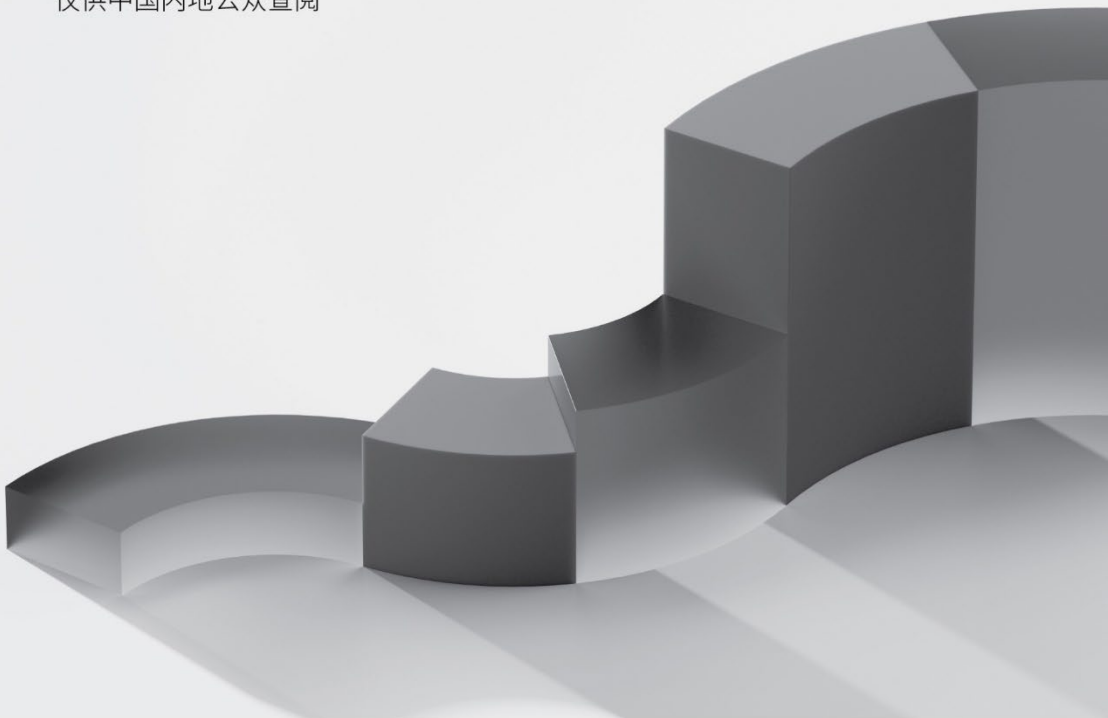


仅供中国内地公众查阅



年度报告— 2023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

---

**摩根**  
资产管理

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

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

内容	页
投资组合 - 未经审计	1 – 10
投资组合持有变动表 - 未经审计	10
金融衍生工具详情 - 未经审计	11
金融衍生工具风险敞口信息 - 未经审计	11
抵押品持有情况 - 未经审计	12
财务状况表	13
综合收益表	13
可赎回份额持有人应占净资产变动表	14
现金流量表	14
财务报表之附注	15 – 49
独立核数师报告	50 – 51
管理人及受托人的责任声明	52
受托人对份额持有人的报告	52
业绩纪录 - 未经审计	52 – 53
经营与管理	54

投资组合

(续)

于二零二三年九月三十日 (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
上市投资 (99.5%)				China Resources Land Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 5,400,000	5,248,620	0.4
(I) 债务证券 (93.3%)				CK Hutchison Intl 19 II Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.75% 06Sep2029	美元 300,000	256,726	0.0
澳大利亚 (4.3%)				CK Hutchison Intl 20 Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.5% 08May2030	美元 3,500,000	2,919,511	0.2
Ausgrid Finance Pty Ltd Ser Regs (Reg S) 4.35% 01Aug2028	美元 12,100,000	11,377,969	0.8	CN Overseas Fin KY VIII Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.375% 02Mar2025	美元 5,100,000	4,825,172	0.3
Aust & Nz Banking Group Ser Regs (Reg S) 2.57% 25Nov2035	美元 5,900,000	4,426,230	0.3	Goodman HK Finance Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3% 22Jul2030	美元 1,000,000	820,296	0.1
Commonwealth Bank Aust Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.61% 12Sep2034	美元 5,300,000	4,468,273	0.3	Melco Resorts Finance Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.625% 17Jul2027	美元 2,900,000	2,629,890	0.2
GAIF Bond Issuer P/L Ser Regs (Reg) (Regs) 3.4% 30Sep2026	美元 5,300,000	4,898,384	0.4	Sun Hung Kai Prop (Cap) Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.75% 25Feb2029	美元 4,400,000	4,001,514	0.3
Macquarie Group Ltd Ser Regs (Reg S) Var 15Jun2034	美元 11,100,000	10,650,710	0.8	Tencent Holdings Ltd Ser Regs (Reg S) 2.39% 03Jun2030	美元 7,700,000	6,242,127	0.4
National Australia Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 02Aug2034	美元 5,300,000	4,564,852	0.3	Tencent Holdings Ltd Ser Regs (Reg S) 3.84% 22Apr2051	美元 20,400,000	13,380,258	1.0
NBN Co Ltd Ser Regs (Reg S) 2.625% 05May2031	美元 9,800,000	8,017,476	0.6	Tencent Holdings Ltd Ser Regs (Reg S) (Regs) 3.925% 19Jan2038	美元 5,200,000	3,982,059	0.3
Scentre Group Trust 1/2 Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.625% 28Jan2026	美元 2,100,000	2,009,576	0.2				
Scentre Group Trust 1/2 Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.375% 28May2030	美元 5,000,000	4,615,652	0.3				
Transurban Finance Co Ser Regs (Reg S) 2.45% 16Mar2031	美元 6,000,000	4,750,355	0.3				
巴哈马 (0.7%)							
Compet Team Tech Ltd (Reg) (Reg S) 4.25% 12Mar2029	美元 10,700,000	9,925,599	0.7				
加拿大 (0.3%)							
Royal Bank Of Canada Ser EMTN (Reg S) (Br) 4.375% 02Oct2030	欧元 4,000,000	4,213,651	0.3				
开曼群岛 (4.8%)							
Alibaba Group Holding 3.15% 09Feb2051	美元 15,000,000	8,586,442	0.6				
Azure Orbit IV Intl Fin Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4% 25Jan2028	美元 1,800,000	1,695,799	0.1				
Baidu Inc (Reg) 3.425% 07Apr2030	美元 1,700,000	1,490,499	0.1				
Bank Negara Indonesia (Reg S) Var Perp 2,100,000	美元 2,100,000	1,963,975	0.2				
CCBL Cayman 1 Corp Ser EMTN (Reg) (Reg S) 1.6% 15Sep2026	美元 500,000	445,091	0.0				
Champion MTN Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.95% 15Jun2030	美元 10,000,000	8,136,471	0.6				

投资组合 (续)

(续)

于二零二三年九月三十日 (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
<b>中国 (7.7%)</b>							
Alibaba Group Holding (Reg) 4.2% 06Dec2047	美元 6,200,000	4,421,516	0.3	Shougang Group Co Ltd (Reg) (Reg S) 4% 23May2024	美元 8,000,000	8,005,018	0.6
CDB Financial Leasing (Reg) (Reg S) Var 28Sep2030	美元 7,158,000	6,646,236	0.5	Shui On Development Hldg (Reg) (Reg S) 6.15% 24Aug2024	美元 1,300,000	840,217	0.1
Central Plaza Dev Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.85% 14Jul2025	美元 1,700,000	1,323,934	0.1	Sinosing Serv P L (Reg) (Reg S) 2.625% 20Feb2030	美元 2,540,000	2,118,572	0.1
China (Govt of) Ser Inbk (Reg) 3.19% 15Apr2053 (Interbank)	人民币 50,000,000	7,206,986	0.5	Vanke Real Estate HK Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.5% 12Nov2029	美元 2,900,000	1,844,440	0.1
China Cinda 2020 I Mngm Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3% 20Jan2031	美元 5,000,000	3,931,478	0.3	Weibo Corp (Reg) 3.375% 08Jul2030	美元 2,300,000	1,815,582	0.1
China Huadian Overseas (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 2,500,000	2,411,719	0.2	West China Cement Ltd (Reg) (Reg S) 4.95% 08Jul2026	美元 900,000	651,521	0.0
China Oil & Gas Group (Reg) (Reg S) 4.7% 30Jun2026	美元 5,640,000	4,536,706	0.3	Yanlord Land HK Co Ltd (Reg) (Reg S) 5.125% 20May2026	美元 1,400,000	828,939	0.1
ENN Energy Holdings Ltd Ser Regs (Reg S) 2.625% 17Sep2030	美元 6,800,000	5,469,637	0.4	Yunda Holding Inv (Reg) (Reg S) 2.25% 19Aug2025	美元 8,400,000	7,509,659	0.5
ENN Energy Holdings Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 17May2027	美元 2,400,000	2,359,361	0.2	Zhongsheng Group (Reg) (Reg S) 3% 13Jan2026	美元 11,900,000	10,933,649	0.8
Franshion Brilliant Ltd (Reg S) 4.25% 23Jul2029	美元 2,100,000	1,329,884	0.1	<b>丹麦 (0.3%)</b> Danbrnk FRN 23Aug2028	英镑 3,600,000	4,491,665	0.3
Gemdale Ever Prosperity Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4.95% 12Aug2024	美元 1,500,000	672,273	0.0	<b>法国 (0.2%)</b> BPCE Sa Ser Regs (Reg S) 3.25% 11Jan2028	美元 2,500,000	2,248,842	0.2
Huarong Finance 2017 Co 4.75% 27Apr2027	美元 4,900,000	4,302,442	0.3				
Huarong Finance 2017 Co Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4.25% 07Nov2027	美元 1,600,000	1,361,200	0.1				
Huarong Finance 2019 Ser EMTN (Reg S) 3.25% 13Nov2024	美元 2,800,000	2,670,383	0.2				
Huarong Finance II Co Ltd (Reg) (Reg S) 4.625 03Jun2026	美元 1,000,000	893,190	0.1				
Huarong Finance II Ser EMTN (Reg) (Regs) 5.5% 16Jan2025	美元 2,600,000	2,483,542	0.2				
ICBCIL Finance Co Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 1.75% 25Aug2025	美元 2,500,000	2,315,835	0.2				
Ind & Comm Bk of China (Reg) (Reg S) VAR Perp 3.58% JD.Com Inc 4.125% 14Jan2050	美元 1,200,000	1,138,974	0.1				
SD Iron & Steel Xinheng (Reg) (Reg S) 4.8% 28Jul2024	美元 5,300,000	3,693,888	0.3				
	美元 12,800,000	12,631,296	0.9				

投资组合 (续)

(续)

于二零二三年九月三十日 (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
<b>香港 (6.6%)</b>				<b>Lenovo Group Ltd Ser</b>			
AIA Group Ltd Ser Gmtn (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 4,900,000	4,370,575	0.3	Regs (Reg S) 3.421% 02Nov2030	美元 3,700,000	3,072,138	0.2
AIA Group Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.2% 16Sep2040	美元 5,000,000	3,375,739	0.2	MCC Holding HK Corp Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 4,600,000	4,571,908	0.3
Airport Authority HK (Reg) (Reg S) VAR Perp 2.1%	美元 17,200,000	14,987,260	1.1	NWD Finance (BVI) Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 1,000,000	507,719	0.0
Airport Authority HK (Reg) (Reg S) VAR Perp 2.4%	美元 4,200,000	3,821,352	0.3	Xiaomi Best Time Intl Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.1% 14Jul2051	美元 1,500,000	855,379	0.1
Bank of Communication HK (Reg) (Reg S) Var 08Jul2031	美元 10,250,000	9,334,614	0.7	<b>印度 (7.0%)</b>			
Bank of East Asia Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 6,200,000	5,132,911	0.4	ABJA Investment Co (Reg) (Reg S) 5.45% 24Jan2028	美元 12,200,000	12,044,963	0.9
CK Hutchison Intl 23 Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.75% 21Apr2028	美元 3,600,000	3,547,827	0.2	Axis Bank Gift City Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 4,500,000	3,920,807	0.3
CK Hutchison Intl 21 Ser Regs (Reg S) 2.5% 15Apr2031	美元 4,600,000	3,740,570	0.3	Bharat Petroleum Corp Ser Mtn (Regs) 4% 08May2025	美元 1,640,000	1,617,915	0.1
CMB International Leasin Ser EMTN (Reg S) 1.875% 12Aug2025	美元 1,400,000	1,303,418	0.1	Bharti Airtel Ltd Ser Regs (Regs) 3.25% 03Jun2031	美元 2,200,000	1,840,933	0.1
CMB International Leasin Ser EMTN (Reg S) 2.75% 12Aug2030	美元 8,600,000	6,921,005	0.5	Greenko Power II Lt 4.3% 13Dec2028(Sink)	美元 2,000,000	1,616,692	0.1
CMB International Leasin Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2% 04Feb2026	美元 1,100,000	1,008,176	0.1	Greenko Solar Mauritius Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.95% 29Jul2026	美元 3,000,000	2,835,742	0.2
Dah Sing Bank Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 02Nov2031	美元 3,100,000	2,753,280	0.2	HDFC Bank Ltd Ser Regs (Reg S) Var Perp	美元 6,700,000	5,817,067	0.4
Elect Global Inv Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 1,300,000	1,070,146	0.1	Hindustan Petroleum Corp (Reg) (Reg S) 4% 12Jul2027	美元 6,000,000	5,648,675	0.4
GLP China Holdings Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.95% 29Mar2026	美元 3,800,000	2,395,865	0.2	ICICI Bank Ltd/Dubai Ser Regs (Reg) 3.8% 14Dec2027	美元 1,600,000	1,503,636	0.1
Hong Kong Mortgage Corp Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4.875% 13Sep2028	美元 9,580,000	9,512,121	0.7	India (Govt of) 7.38% 20Jun2027	印度卢比 1,300,000,000	15,967,911	1.2
Hongkong Land Finance Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.25% 14Jul2033	美元 4,510,000	4,280,906	0.3	India Clean Energy Hldg Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.5% 18Apr2027	美元 6,550,000	5,577,600	0.4
ICBCIL Finance Co Ltd Ser Regs (Reg) (Regs) 3.625% 19May2026	美元 2,000,000	1,926,669	0.1	India Green Energy Hldng Ser Regs (Reg S) 5.375% 29Apr2024	美元 5,000,000	5,033,770	0.4
Jinan URB Const Intl Inv (Reg) (Reg S) 2.4% 23Sep2026	美元 2,800,000	2,503,162	0.2	Indian Railway Finance (Reg) (Regs) 3.835% 13/12/2027	美元 4,200,000	3,944,148	0.3
				Indian Railway Finance Ser Regs (Reg S) 3.249% 13Feb2030	美元 6,900,000	5,866,021	0.4
				JSW Infrastructure Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.95% 21Jan2029	美元 6,400,000	5,682,205	0.4
				JSW Steel Ltd (Reg S) 5.95% 18Apr2024	美元 3,000,000	3,067,696	0.2
				JSW Steel Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.95% 05Apr2027	美元 11,700,000	10,480,370	0.8
				Oil India Ltd (Reg) (Reg S) 5.125% 04Feb2029	美元 3,950,000	3,840,761	0.3

投资组合 (续)

(续)

于二零二三年九月三十日 (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
<b>印度尼西亚 (6.4%)</b>				<b>日本 (2.7%)</b>			
Bank Negara Indonesia (Reg S) Var Perp	美元 6,300,000	5,193,519	0.4	Mitsubishi HC Fin Amer Ser Regs (Reg S) 5.658% 28Feb2033	美元 6,200,000	5,943,921	0.4
Freeport Indonesia Pt Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.2% 14Apr2052	美元 6,000,000	5,206,597	0.4	Mitsubishi HC Fin Amer Ser Regs (Reg S) 5.807% 12Sep2028	美元 3,800,000	3,766,350	0.3
Hutama Karya Persero PT Ser Regs (Reg S) 3.75% 11May2030	美元 12,500,000	11,139,842	0.8	Mizuho Financial Group (Reg) Var 16Jul2030	美元 4,500,000	3,871,218	0.3
Indonesia (Reg Of) Ser Regs (Reg) 5.25% 08Jan2047	美元 12,000,000	11,162,210	0.8	Mizuho Financial Group 2.564% 13Sep2031	美元 3,800,000	2,884,151	0.2
Indonesia (Rep of) (Reg) 4.3% 31Mar2052	美元 4,300,000	3,330,562	0.2	Nissan Motor Co (Reg) (Reg S) (Ser Regs) 4.81% 17Sep2030	美元 4,000,000	3,456,070	0.2
Indonesia (Rep of) 3.2% 23Sep2061	美元 4,000,000	2,386,464	0.2	Nissan Motor Co Ser Regs (Regs) 4.345% 17Sep2027	美元 1,800,000	1,646,694	0.1
Indonesia (Rep of) 3.5% 14Feb2050	美元 5,700,000	3,905,557	0.3	Nomura Holdings Inc (Reg) 1.653% 14Jul2026	美元 4,200,000	3,728,412	0.3
Indonesia (Rep of) Ser Regs (Reg S) 3.55% 09Jun2051	美元 3,000,000	2,084,383	0.1	Nomura Holdings Inc (Reg) 2.608% 14Jul2031	美元 5,000,000	3,854,946	0.3
Indonesia (Rep of) Ser Regs 7.75% 17Jan2038	美元 4,000,000	4,764,414	0.3	Shanghai Commercial Bank (Reg) (Reg S) Var 28Feb2033	美元 7,850,000	7,737,147	0.6
Minejasa Capital 5.625% 10Aug2037(Sink)	美元 1,000,000	774,470	0.1				
Pertamina Geothermal Ene Ser Regs (Reg S) 5.15% 27Apr2028	美元 2,700,000	2,689,932	0.2				
Pertamina Persero Ser (Regs) 6.45% 30May2044	美元 4,200,000	4,098,642	0.3				
PT Adaro Indonesia Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.25% 31Oct2024	美元 10,000,000	9,813,684	0.7				
PT Bank Tabungan Negara (Reg) (Reg S) 4.2% 23Jan2025	美元 4,300,000	4,111,588	0.3				
Pt Indonesia Asahan Aluminium And Pt Mineral Industri Indonesia (Persero) Ser Regs (Reg S) 5.8% 15May2050	美元 6,000,000	5,008,213	0.4				
PT Pertamina (Persero) Ser Regs (Reg S) 4.175% 21Jan2050	美元 16,000,000	11,312,241	0.8				
PT Pertamina (Persero) Ser Regs (Reg S) 4.7% 30Jul2049	美元 2,000,000	1,546,290	0.1				
<b>爱尔兰 (0.3%)</b>							
Avolon Holdings Fndg Ltd Ser Regs (Reg S) 6.375% 04May2028	美元 3,500,000	3,533,522	0.3				
<b>意大利 (0.2%)</b>							
Intesa Sanpaolo Spa Ser EMTN (Reg S) (Br) 5.125% 29Aug2031	欧元 2,491,000	2,620,240	0.2				

投资组合 (续)

(续)

于二零二三年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	占资产 公允价值 美元	净值百 分比		单位数目	占资产 公允价值 美元	净值百 分比
<b>韩国 (14.0%)</b>							
Busan Bank Ser GMTN (Reg) (Regs) 3.625% 25Jul2026	美元 16,200,000	14,949,293	1.1	Korea Land & Housing Cor (Reg) (Reg S) 5.75% 06Oct2025	美元 4,200,000	4,247,334	0.3
Doosan Enerbility (Reg) (Reg S) 5.5% 17Jul2026	美元 3,200,000	3,231,640	0.2	Korea Midland Power Co (Reg) (Reg S) 3.625% 21Apr2027	美元 3,700,000	3,530,022	0.3
GS Caltex Corp Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.5% 05Jan2026	美元 3,800,000	3,728,349	0.3	Kyobo Life Insurance Co Ser Regs (Reg S) Var Perp Lotte Property & Develop (Reg S) 4.5% 01Aug2025	美元 4,200,000	4,190,870	0.3
Hana Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 5,200,000	4,722,864	0.3	Nonghyup Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.875% 03Jul2028	美元 2,500,000	2,457,775	0.2
Hanwha Energy USA 4.125% 05Jul2025	美元 4,000,000	3,925,551	0.3	Posco Ser Regs (Reg S) 5.75% 17Jan2028	美元 4,350,000	4,272,817	0.3
Hanwha Life Insurance Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 04Feb2032	美元 7,650,000	6,838,125	0.5	Posco Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.375% 04Aug2025	美元 5,300,000	5,332,210	0.4
Hyundai Motor Manu Indo Ser EMTN (Reg) (Reg S) 1.75% 06May2026	美元 6,900,000	6,231,801	0.4	Posco Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.5% 04Aug2027	美元 5,200,000	5,099,048	0.4
Incheon Intl Airport (Reg) (Reg S) 1.25% 04May2026	美元 1,000,000	899,820	0.1	Shinhan Bank Ser GMTN (Reg) (Reg S) 4.5% 26Mar2028	美元 3,200,000	3,075,206	0.2
KB Capital Co Ltd (Reg) (Reg S) 1.5% 28Oct2025	美元 1,360,000	1,241,500	0.1	Shinhan Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.375% 13Apr2032	美元 7,000,000	6,528,865	0.5
KB Kookmin Card Co Ltd (Reg) (Reg S) 4% 09Jun2025	美元 5,500,000	5,384,205	0.4	Shinhan Bank Ser Regs 3.875% 24Mar2026	美元 3,700,000	3,299,970	0.2
Kodit Global 2023-1 Ltd (Reg) (Reg S) 4.954% 25May2026	美元 5,100,000	5,093,100	0.4	Shinhan Card Co Ltd (Reg S) 1.375% 23Jun2026	美元 8,600,000	8,121,375	0.6
Kookmin Bank Ser GMTN (Reg) (Reg S) 4.5% 01Feb2029	美元 6,900,000	6,414,482	0.5	Shinhan Card Co Ltd (Reg) (Reg S) 2.5% 27Jan2027	美元 2,000,000	1,780,630	0.1
Kookmin Bank Ser Regs (Reg) (Reg_S) Var Perp 31Dec2049	美元 6,300,000	6,167,247	0.4	Shinhan Financial Group Ser Regs (Reg) (Reg S) 5% 24Jul2028	美元 2,000,000	1,794,347	0.1
Korea (Rep of) Ser 2803 3.25% 10Mar2028	韩元 16,500,000,000	11,906,883	0.9	Shinhan Financial Group Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 05Feb2030	美元 3,600,000	3,511,735	0.2
Korea (Rep of) Ser 3306 3.25% 10Jun2033	韩元 10,100,000,000	7,102,022	0.5	SK Broadband Co Ltd (Reg) (Reg S) 4.875% 28Jun2028	美元 8,200,000	7,900,352	0.6
Korea East-West Power Co (Reg) (Reg S) 4.875% 12Jul2028	美元 5,620,000	5,515,156	0.4	SK Hynix Inc Ser Regs (Reg S) 6.5% 17Jan2033	美元 2,000,000	1,965,732	0.1
Korea Expressway Corp Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.625% 18May2025	美元 1,400,000	1,373,205	0.1	SK On Co Ltd (Reg) (Reg S) 5.375% 11May2026	美元 8,000,000	7,934,385	0.6
Korea Housing Finance Co Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 24Feb2028	美元 1,600,000	1,553,192	0.1		美元 1,100,000	1,114,981	0.1
Korea Housing Finance Co Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 24Feb2033	美元 7,150,000	6,633,352	0.5				
Korea Hydro & Nuclear Po Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.25% 27Jul2027	美元 5,000,000	4,830,978	0.3				
Korea Hydro & Nuclear Po Ser Regs (Reg) (Reg S) 5% 18Jul2028	美元 10,400,000	10,291,776	0.7				



投资组合 (续)

(续)

于二零二三年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	占资产		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
		公平值 美元	净值百 分比			
<b>澳门 (2.1%)</b>						
Melco Resorts Finance Ser Regs (Reg S) 5.75% 21Jul2028	美元 2,300,000	2,043,275	0.1			
MGM China Holdings Ltd Ser Regs (Reg S) 4.75% 01Feb2027	美元 1,600,000	1,450,435	0.1			
Sands China Ltd Ser Wi (Reg) 5.125% 08Aug2025	美元 2,600,000	2,540,900	0.2			
Sands China Ltd Ser Wi (Reg) 5.4% 08Aug2028Wi	美元 2,800,000	2,660,795	0.2			
Studio City Finance Ltd Ser Regs (Reg S) 6.5% 15Jan2028	美元 4,700,000	4,054,019	0.3			
Wynn Macau Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.5% 15Jan2026	美元 5,600,000	5,305,413	0.4			
Wynn Macau Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.625% 26Aug2028	美元 13,400,000	11,705,118	0.8			
<b>马来西亚 (1.3%)</b>						
Axiata Spv5 Labuan Ltd Ser EMTN (Reg S) 3.064% 19Aug2050	美元 2,000,000	1,233,233	0.1			
GOHL Capital Ltd 4.25% 24Jan2027	美元 10,500,000	9,772,232	0.7			
Petronas Capital Ltd Ser Regs (Reg S) 2.48% 28Jan2032	美元 4,600,000	3,670,796	0.3			
Petronas Capital Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.5% 21Apr2030	美元 4,000,000	3,604,658	0.2			
<b>毛里求斯 (1.7%)</b>						
Greenko Solar Mauritius Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.55% 29Jan2025	美元 3,300,000	3,225,942	0.2			
Greenko Wind Projects Mu Ser Regs (Reg S) 5.5% 06Apr2025	美元 3,100,000	3,068,092	0.2			
India Green Power Hol 4% 22Feb2027(Sink)	美元 8,370,000	7,386,695	0.6			
Network I2I Ltd Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 7,300,000	6,754,020	0.5			
Network I2I Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 3,200,000	3,211,369	0.2			
<b>墨西哥 (3.3%)</b>						
Mex Bonos Desar 5.75% 05Mar2026	墨西哥比索 700,000	3,630,812	0.3			
Mexico (Utd States of) (Reg) 5% 27Apr2051	美元 7,737,000	6,137,413	0.4			
Mexico (Utd States of) (Reg) 6.338% 04May2053	美元 5,000,000	4,697,517	0.3			
Mexico (Utd States of) 8.5% 31May2029	墨西哥比索 2,838,500	15,727,967	1.1			
Mexico (Utd States of) Ser M 7.5% 26May2033	墨西哥比索 3,200,000	16,093,050	1.2			
<b>蒙古 (0.3%)</b>						
Mongolia Intl Bond Ser Regs (Reg S) 3.5% 07Jul2027	美元 2,887,000	2,454,255	0.2			
Mongolia Intl Bond Ser Regs (Reg S) 8.65% 19Jan2028	美元 1,600,000	1,623,482	0.1			
<b>荷兰 (0.8%)</b>						
Greenko Dutch BV 3.85% 29Mar2026(Sink)	美元 6,200,000	5,179,186	0.4			
Minejesa Capi BV Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 10Aug2030 (Sink)	美元 2,500,000	2,247,005	0.2			
Prosus Nv Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.832% 08Feb2051	美元 6,500,000	3,630,150	0.2			
<b>新西兰 (1.5%)</b>						
New Zealand (Govt of) Ser 0427 (Reg) (Reg S) 4.5% 15Apr2027	纽元 13,000,000	7,738,823	0.6			
New Zealand (Govt of) Ser 433 (Reg) (Reg S) 3.5% 14Apr2033	纽元 24,286,000	12,850,530	0.9			
<b>巴基斯坦 (0.2%)</b>						
Islamic Rep of Pakistan Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.875% 05Dec2027	美元 4,400,000	2,351,821	0.2			

投资组合 (续)

(续)

于二零二三年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	占资产			单位数目	占资产	
		公平值 美元	净值百 分比			公平值 美元	净值百 分比
<b>菲律宾 (1.0%)</b>				<b>西班牙 (0.3%)</b>			
Globe Telecom Inc (Reg) (Reg S) 3% 23Jul2035	美元 1,000,000	727,584	0.1	CaixaBank Sa Ser 144A Var 13Sep2027	美元 4,300,000	4,314,308	0.3
Globe Telecom Inc (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 5,000,000	4,747,916	0.4	<b>国际 (1.3%)</b>			
Philippines (Rep of) (Reg) 2.95% 05May2045	美元 3,000,000	1,945,602	0.1	Asian Development Bank Ser GMTN (Reg) 7% 01Aug2025	智利比索 6,300,000,000	7,195,333	0.5
PLDT Inc (Reg) (Reg S) 2.5% 23Jan2031	美元 3,600,000	2,885,750	0.2	Intl Bk Recon & Develop Ser Gdf (Reg) 6.75% 04Feb2024	巴西雷亚尔 49,755,000	10,280,619	0.8
Rizal Commercial Banking (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 3,110,000	2,876,255	0.2				
<b>新加坡 (5.3%)</b>				<b>泰国 (2.9%)</b>			
BOC Aviation Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.25% 29Apr2025	美元 3,800,000	3,692,005	0.3	Bangkok Bank Pcl/Hk Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 25Sep2034	美元 2,300,000	1,923,058	0.1
BOC Aviation USA Corp Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.875% 03May2033	美元 8,000,000	7,538,521	0.6	Kasikornbank PCL HK Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 02Oct2031	美元 10,100,000	9,175,155	0.7
Continuum Energy 4.5% 09Feb2027(Sinking)	美元 5,600,000	4,708,914	0.3	Krung Thai Bank/Cayman (Reg S) Var Perp	美元 7,800,000	7,045,220	0.5
DBS Group Holdings Ltd Ser GMTN (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 10,000,000	9,531,987	0.7	Thailand (Govt of) 2.65% 泰铢 17Jun2028	260,000,000	7,142,021	0.5
GLP Pte Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.875% 04Jun2025	美元 4,700,000	3,324,351	0.2	Thailand Government Bond 2.875% 17Dec2028	130,000,000	3,604,631	0.3
Indika Energy Capital IV Ser Regs (Reg) (Reg S) 8.25% 22Oct2025	美元 7,700,000	7,913,155	0.6	Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg S) 2.5% 18Jun2030	美元 5,250,000	4,157,458	0.3
LLPPL Capital Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.875% 04Feb2039 (Sink)	美元 3,500,000	2,542,672	0.2	Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg S) 3.5% 17Oct2049	美元 6,000,000	3,563,901	0.3
Medco Bell Pte Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.375% 30Jan2027	美元 3,600,000	3,427,150	0.2	Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg S) 3.75% 18Jun2050	美元 5,700,000	3,506,778	0.2
Medco Platinum Road Pte Ser Regs (Regs) 6.75% 30/01/2025	美元 6,900,000	6,973,626	0.5				
Oversea-Chinese Banking Ser Regs (Reg S) Var 10Sep2030	美元 9,300,000	8,570,003	0.6				
Singapore Government 0.5% 01Nov2025	新加坡元 15,500,000	10,660,225	0.8				
United Overseas Bank Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 4,500,000	4,582,492	0.3				

投资组合 (续)

(续)

于二零二三年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	占资产 公允价值 美元	净值百 分比		单位数目	占资产 公允价值 美元	净值百 分比
阿联酋 (1.3%)				维京群岛 (8.3%)			
ADCB Finance Cayman Ltd Ser Emtn (Reg S) (Br) Frn 20Jun2024	美元 8,000,000	8,064,623	0.6	Amipeace Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.25% 22Oct2030	美元 2,800,000	2,298,824	0.2
Aldar Investment Propert (Reg) (Reg S) 4.875% 24May2033	美元 1,000,000	972,198	0.1	CAS Capital No1 Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 14,200,000	11,667,399	0.8
MDGH GMTN RSC Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.375% 22Nov2033	美元 10,000,000	9,294,771	0.6	Castle Peak Pwr Fin Co Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.125% 03Mar2031	美元 5,900,000	4,640,408	0.3
英国 (4.2%)				Castle Peak Pwr Fin Co Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.2% 22Jun2030	美元 6,200,000	5,045,405	0.4
HSBC Holdings Plc Var 03Nov2028	美元 7,600,000	8,095,312	0.6	Champion Path Holdings (Reg) (Reg S) 4.5% 27Jan2026	美元 3,400,000	3,034,517	0.2
Lloyds Banking Group Plc Ser EMTN (Reg S) (Br) Var 21Sep2031	欧元 4,000,000	4,188,410	0.3	Champion Path Holdings (Reg) (Reg S) 4.85% 27Jan2028	美元 3,400,000	2,780,987	0.2
Prudential Funding (Asia) Plc (Reg) (Reg S) Var 03Nov2033	美元 9,500,000	8,000,689	0.6	CLP Power HK Financing Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.125% 30Jun2030	美元 10,100,000	8,145,049	0.6
Santander UK Group Hldgs Ser EMTN (Reg S) (Br) 29Aug2029	英镑 1,800,000	2,274,140	0.2	CN Huaneng Gp HK Treasur (Reg) (Reg S) Var Perp 2.85%	美元 5,100,000	5,107,480	0.4
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg S) 6.296% 06Jul2034	美元 10,160,000	9,962,973	0.7	CN Huaneng Gp HK Treasur (Reg) (Reg S) Var Perp 3.08%	美元 4,900,000	4,647,563	0.3
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg S) Var 09Jan2029	美元 1,500,000	1,517,363	0.1	Dianjian Haiyu Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 6,400,000	6,073,636	0.4
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg S) Var 12Jan2025	美元 5,800,000	5,718,273	0.4	ENN Clean Energy Ser Regs (Reg S) 3.375% 12May2026	美元 5,700,000	5,309,235	0.4
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg S) Var 16Nov2028	美元 10,900,000	11,744,774	0.8	Haitian BVI Int Invst (Reg) (Reg S) 2.8% 04Nov2023	美元 4,400,000	4,434,467	0.3
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 4,700,000	4,526,224	0.3	Huarong Finance 2019 Ser EMTN (Reg S) Frn 24Feb2025	美元 500,000	472,849	0.0
Standard Chartered Ser Regs (Reg S) Var 29Jun2032	美元 1,134,000	877,516	0.1	Hysan MTN Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.875% 02Jun2027	美元 2,700,000	2,427,012	0.2
Yorkshire Building Soc (Reg S) (Br) Var 12Sep2027	英镑 1,538,000	1,897,518	0.1	JMH Co Ltd (Reg) (Reg S) 2.5% 09Apr2031	美元 2,900,000	2,366,111	0.2
美国 (2.0%)				Nan Fung Treasury Ltd Ser EMTN (Reg) (Regs) 3.625% 27Aug2030	美元 4,451,000	3,607,307	0.2
Freeport Indonesia PT Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.315% 14Apr2032	美元 400,000	373,021	0.0	NWD MTN Ltd (Reg) (Reg S) 4.125% 18Jul2029	美元 12,300,000	7,869,953	0.6
MetLife Global Funding I Ser Regs (Reg S) 5.4% 12Sep2028	美元 2,600,000	2,579,797	0.2	Studio City Finance Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 6% 15Jul2025	美元 2,600,000	2,510,083	0.2
TSY INFL IX N/B 2.375% 15Jan2025	美元 12,500,000	20,130,782	1.4				
US Treasury 1.375% 15Jul2033	美元 5,337,500	4,984,140	0.4				

投资组合 (续)

于二零二三年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
<b>维京群岛 (续)</b>			
Studio City Finance Ltd Ser Regs (Reg) (Regs) 5% 15Jan2029	美元 8,500,000	6,492,092	0.5
Sunny Express (Reg) (Reg S) 3.125% 23Apr2030	美元 12,000,000	10,599,735	0.8
Talent Yield Intntnl (Reg) (Reg S) 3.125% 06May2031	美元 5,400,000	4,569,150	0.3
TSMC Global Ltd Ser Regs (Reg S) 2.25% 23Apr2031	美元 9,800,000	7,943,091	0.6
Wharf REIC Finance Bvl Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.875% 07May2030	美元 3,060,000	2,566,416	0.2
		1,291,111,873	93.3
		-----	-----

投资组合 (续)

于二零二三年九月三十日 (未经审计)

投资组合持有变动表

截至二零二三年九月三十日止年度 (未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比	持有占资产净值百分比		
				2023	2022	
<b>(II) 集体投资计划 (6.1%)</b>				<b>上市投资</b>		
卢森堡 (6.1%)				<b>债务证券</b>		
JPMLIQ-JPM - USD Liquidity LVNAV X (dist)**	84,856,520	84,856,520	6.1	韩国	14.0	8.4
		84,856,520	6.1	维京群岛	8.3	16.7
		-----	-----	中国	7.7	5.7
				印度	7.0	5.9
				香港	6.6	12.9
<b>(III) 衍生性产品 (0.1%)</b>				印度尼西亚	6.4	11.9
远期外汇合约 (0.2%)		3,104,867	0.2	新加坡	5.3	7.0
				开曼群岛	4.8	7.7
期货 (-0.1%)				澳大利亚	4.3	-
Aust 10yr Bond Fut 15/12/2023	253	27,906	0.0	英国	4.2	-
US 5yr Note (CBT) 29/12/2023	174	(199,828)	0.0	墨西哥	3.3	1.2
US 10yr Note (CBT) 19/12/2023	683	(929,524)	(0.1)	泰国	2.9	4.1
US Ultra Bond (CBT) 19/12/2023	33	(302,414)	0.0	日本	2.7	-
				澳门	2.1	-
				美国	2.0	1.1
				毛里求斯	1.7	1.8
				新西兰	1.5	-
				马来西亚	1.3	1.7
				国际	1.3	1.0
				阿联酋	1.3	-
		1,701,007	0.1	菲律宾	1.0	4.0
		-----	-----	荷兰	0.8	1.4
				巴哈马	0.7	-
<b>总上市投资</b>		1,377,669,400	99.5	加拿大	0.3	-
<b>其他净资产</b>		6,632,168	0.5	丹麦	0.3	-
				爱尔兰	0.3	-
				蒙古	0.3	-
				西班牙	0.3	-
				法国	0.2	-
				意大利	0.2	-
<b>于二零二三年九月三十日 可赎回份额持有人应 占净资产</b>		1,384,301,568	100.0	巴基斯坦	0.2	-
				百慕大	-	0.5
				泽西市	-	0.3
<b>总投资, 按成本</b>		1,457,390,249		<b>集体投资计划</b>		
				卢森堡	6.1	-
				<b>衍生性产品</b>		
				远期外汇合约	0.2	(1.4)
				期货	(0.1)	(0.1)
				<b>总上市投资</b>	99.5	91.8
				<b>其他净资产</b>	0.5	8.2
				<b>于九月三十日可赎回份额持有人应占净资 产</b>	100.0	100.0

\* 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

金融衍生工具详情

于二零二三年九月三十日 (未经审计)

(a) 远期外汇合约

于二零二三年九月三十日, 本基金持有之未平仓远期外汇合约, 详情请参阅附注 11。

(b) 期货

于二零二三年九月三十日, 本基金持有之未平仓期货合约, 详情请参阅附注 11。

金融衍生工具风险敞口信息

截至二零二三年九月三十日止年度 (未经审计)

截至二零二三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。

	2023 占资产净值百分比
最低总敞口	39.4
最高总敞口	230.3
平均总敞口	95.7

截至二零二三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。

	2023 占资产净值百分比
最低净敞口	4.9
最高净敞口	23.1
平均净敞口	11.6

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

抵押品持有情况

于二零二三年九月三十日（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
高盛国际，伦敦	现金	不适用	美元	0.0	485,000

现金抵押品再投资详情

截至二零二三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

现金抵押品的托管机构	计划下提供的抵押品所 收到／持有的抵押品金额		占比例
	2023 美元	2023 百分比	2023 百分比
隔离账户 香港上海汇丰银行有限公司	485,000		100.0

财务状况表

于二零二三年九月三十日

	2023 美元	2022 美元
<b>资产</b>		
<b>流动资产</b>		
银行现金	24,735,540	110,369,125
现金抵押品	485,000	4,447,035
应收经纪款项	2,685,949	15,458,563
分配应收款项	2,507,017	963,053
保证金	3,604,964	6,532,965
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 11]	6,774,766	7,031,407
投资 [附注 4(l)(a)]	1,375,968,393	1,270,376,289
股息及其他应收款项	442,009	57
<b>总资产</b>	<u>1,417,203,638</u>	<u>1,415,178,494</u>
<b>负债</b>		
<b>流动负债</b>		
应付经纪款项	12,505,661	4,447,035
赎回应付款项	7,943,307	14,152,564
应付收益分配 [附注 6]	5,768,606	6,315,937
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 11]	5,073,759	27,070,687
其他应付款项	1,610,737	1,657,842
<b>总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)</b>	<u>32,902,070</u>	<u>53,644,065</u>
<b>可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]</b>	<u><u>1,384,301,568</u></u>	<u><u>1,361,534,429</u></u>

由受托人及管理人于二零二四年一月二十四日批准

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

截至二零二三年九月三十日止年度

	2023 美元	2022 美元
<b>收入</b>		
投资及衍生性产品净收益 / (亏损) [附注 5]	9,836,020	(435,632,110)
存款利息 [附注 8(i), 8(j)]	1,601,828	195,619
股息收入	306,520	-
汇兑净亏损	(4,235,916)	(2,634,293)
其他收入	84,434	42,676
	<u>7,592,886</u>	<u>(438,028,108)</u>
<b>支出</b>		
管理费用 [附注 8(e)]	14,865,866	19,650,579
托管费用及银行费用 [附注 8(i), 8(j)]	396,752	475,309
受托人费用 [附注 8(g)]	389,009	510,976
基金注册登记机构费用 [附注 8(h)]	220,899	270,491
交易成本 [附注 8(j)]	117,484	122,875
法律及专业服务费	22,054	24,137
核数师酬金	18,826	48,005
估值费用 [附注 8(e)]	17,080	17,220
印刷及出版支出	5,966	7,656
其他经营费用	8,717	23,715
	<u>16,062,653</u>	<u>21,150,963</u>
<b>净经营亏损</b>	<u>(8,469,767)</u>	<u>(459,179,071)</u>
<b>财务成本</b>		
收益分配 [附注 6]	(67,789,728)	(105,332,073)
利息支出 [附注 8(j)]	(454)	(119)
	<u>(67,790,182)</u>	<u>(105,332,192)</u>
<b>除税前亏损</b>	<u>(76,259,949)</u>	<u>(564,511,263)</u>
税项 [附注 7]	(727,494)	(297,847)
<b>可赎回份额持有人应占净资产及总综合亏损之减少</b>	<u><u>(76,987,443)</u></u>	<u><u>(564,809,110)</u></u>



可赎回份额持有人应占净资产变动表

截至二零二三年九月三十日止年度

	2023 美元	2022 美元
年初可赎回份额持有人应占净资产	1,361,534,429	2,735,503,623
分配可赎回份额 [附注 3]	652,450,452	224,574,022
赎回可赎回份额 [附注 3]	(552,695,870)	(1,033,734,106)
净分配 / (赎回)	99,754,582	(809,160,084)
	1,461,289,011	1,926,343,539
可赎回份额持有人应占净资产及总综合亏损之减少	(76,987,443)	(564,809,110)
年末可赎回份额持有人应占净资产	1,384,301,568	1,361,534,429

现金流量表

截至二零二三年九月三十日止年度

	2023 美元	2022 美元
<b>经营业务</b>		
购入投资及衍生性产品	(2,953,063,802)	(818,730,870)
出售投资及衍生性产品		
所得款项	2,855,990,574	1,786,081,988
现金抵押品之减少 / (增加)	3,962,035	(4,447,035)
保证金之减少 / (增加)	2,928,001	(5,203,356)
已收利息	1,601,828	199,135
已收股息	306,520	-
已付交易成本	(116,670)	(121,706)
已付基金注册登记机构费用	(222,257)	(323,262)
已付受托人费用	(390,818)	(540,321)
已付税项	(727,494)	(297,847)
已付管理费用	(14,915,393)	(20,847,282)
其他	(5,725,097)	(1,784,024)
<b>经营业务所 (运用) / 产生之现金净额</b>	<b>(110,372,573)</b>	<b>933,985,420</b>
<b>融资活动</b>		
已付利息	(454)	(119)
分配可赎回份额所得款项	650,906,488	234,115,234
赎回可赎回份额付款	(558,905,127)	(1,046,985,615)
已付收益分配	(68,337,059)	(110,560,346)
<b>融资活动所产生 / (运用) 之现金净额</b>	<b>23,663,848</b>	<b>(923,430,846)</b>
<b>现金及现金等价物之 (减少) / 增加</b>	<b>(86,708,725)</b>	<b>10,554,574</b>
年初现金及现金等价物	110,369,125	101,180,556
现金及现金等价物之汇兑收益 / (亏损)	1,075,140	(1,366,005)
<b>年末现金及现金等价物</b>	<b>24,735,540</b>	<b>110,369,125</b>
<b>现金及现金等价物余额分析:</b>		
银行现金	24,735,540	110,369,125

第十五至四十九页之附注乃属本财务报表之一部分。

财务报表之附注

1 本基金

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

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

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

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

2 主要会计政策

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

(a) 财务报表之编制基础

本基金之财务报表乃按照香港会计师公会颁布的香港财务报告准则编制。财务报表乃按历史成本准则编制，并就按公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。

于二零二二年十月一日生效的新准则及对现有准则的修订

没有于二零二二年十月一日开始的财政年度首次生效的新准则或对现有准则的修订对本基金产生重大影响。

于二零二二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二零二二年十月一日开始的年度期间生效，但在编制此等财务报表时并未提前采纳。此等新准则、对准则的修订和解释预期不会对本基金的财务报表产生重大影响。

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公允价值为负数的衍生性产品合约列示为按公允价值透过损益列账的负债。

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。

确认、取消确认及计量

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

公允价值估计

公允价值指在计量日期，于一项有序交易中由市场参与者出售一项资产而应收取或转让一项负债而应支付的价格。在活跃市场中买卖的金融资产和负债的公允价值，按最后交易价计算。当被投资公司的证券交易暂停，该投资的价值按基金管理人估计的公允价值计算。在非活跃市场中进行金融工具交易时，以市场报价、交易商／经纪报价或其他获可观察输入值支持的报价来源作为估值。

债务证券的公允价值按包括应计利息的报价计算。

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

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

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

公允价值级次分层间的转拨

在公允价值级次分层之间的转拨视为于报告期间开始时已发生。

(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)

2023

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	16,616,653.699	12,215,191.070	830,208.683	293,204,611.211	7,329,451.810
总分配	9,865,280.959	6,293,962.378	1,028,039.891	126,240,948.162	4,025,472.803
总赎回	(7,383,768.938)	(4,551,338.246)	(101,921.638)	(121,331,614.886)	(2,673,671.583)
年末	19,098,165.720	13,957,815.202	1,756,326.936	298,113,944.487	8,681,253.030
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净资产	116,529,684	86,315,208	11,342,201	1,980,906,422	52,716,264
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	6.10	6.18	6.46	6.64	6.07
	人民币	人民币	美元	美元	人民币
已发行份额数目:					
年初	38,776,163.540	49,195,372.500	12,999,636.350	2,370,246.030	949,029.054
总分配	158,484,543.970	1,439,233.690	447,161.200	28,155.460	3,793,158.686
总赎回	(73,858,986.450)	(8,793,153.660)	(3,215,929.760)	(379,313.780)	(273,032.181)
年末	123,401,721.060	41,841,452.530	10,230,867.790	2,019,087.710	4,469,155.559
	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	1,389,825,131	285,946,232	103,363,951	13,922,104	52,730,828
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	11.26	6.83	10.10	6.90	11.80

2023

	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	344,611,366.002	950,698.459	44,993,626.466
总分配	42,369,645.705	601,966.717	13,081,033.132
总赎回	(92,434,310.760)	(461,714.538)	(15,249,386.848)
年末	<u>294,546,700.947</u>	<u>1,090,950.638</u>	<u>42,825,272.750</u>
	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应占净资产	<u>1,863,716,717</u>	<u>12,341,257</u>	<u>324,128,294</u>
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	<u>6.33</u>	<u>11.31</u>	<u>7.57</u>

2022

	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	22,995,059.343	14,901,951.254	602,138.264	454,579,708.028	9,207,083.277
总分配	2,396,565.142	1,445,107.597	469,208.699	41,225,517.981	862,966.483
总赎回	(8,774,970.786)	(4,131,867.781)	(241,138.280)	(202,600,614.798)	(2,740,597.950)
年末	<u>16,616,653.699</u>	<u>12,215,191.070</u>	<u>830,208.683</u>	<u>293,204,611.211</u>	<u>7,329,451.810</u>
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净资产	<u>106,130,688</u>	<u>78,934,141</u>	<u>5,603,013</u>	<u>2,038,454,890</u>	<u>46,587,636</u>
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	<u>6.39</u>	<u>6.46</u>	<u>6.75</u>	<u>6.95</u>	<u>6.36</u>

2022

	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	58,099,327.490	61,388,435.190	30,905,933.500	3,245,234.020	1,082,326.570
总分配 总赎回	8,478,940.780 (27,802,104.730)	2,157,303.280 (14,350,365.970)	426,859.490 (18,333,156.640)	91,361.750 (966,349.740)	18,294.357 (151,591.873)
年末	<u>38,776,163.540</u>	<u>49,195,372.500</u>	<u>12,999,636.350</u>	<u>2,370,246.030</u>	<u>949,029.054</u>

	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	<u>437,407,794</u>	<u>351,740,162</u>	<u>128,311,762</u>	<u>17,065,170</u>	<u>11,271,909</u>
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	<u>11.28</u>	<u>7.15</u>	<u>9.87</u>	<u>7.20</u>	<u>11.88</u>

	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:			
年初	471,890,960.288	954,442.901	63,438,929.394
总分配 总赎回	42,611,029.087 (169,890,623.373)	209,060.232 (212,804.674)	7,143,439.371 (25,588,742.299)
年末	<u>344,611,366.002</u>	<u>950,698.459</u>	<u>44,993,626.466</u>
可赎回份额持有人应占净资产	<u>2,280,668,217</u>	<u>10,505,581</u>	<u>355,501,134</u>
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	<u>6.62</u>	<u>11.05</u>	<u>7.90</u>

#### 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价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允价值总额。截至二零二三年九月三十日止年度，对集体投资计划的购买总额为313,000,000 美元（二零二二年：无）。截至二零二三年九月三十日止年度，无投资集体投资计划所产生的净收益／（损失）（二零二二年：无）。

##### (a) 市场风险

##### (i) 市场价格风险

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

##### (ii) 利率风险

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

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

	1 年以内 美元	1 至 5 年 美元	5 年以上 美元	无确定到期日 美元	总额 美元
<b>2023</b>					
银行现金	24,735,540	-	-	-	24,735,540
保证金	3,604,964	-	-	-	3,604,964
衍生性产品	(1,403,860)	-	-	-	(1,403,860)
投资（注*）	53,029,979	503,293,091	734,788,803	84,856,520	1,375,968,393
总利率敏感性缺口	79,966,623	503,293,091	734,788,803	84,856,520	1,402,905,037
<b>2022</b>					
银行现金	110,369,125	-	-	-	110,369,125
保证金	6,532,965	-	-	-	6,532,965
衍生性产品	2,581,725	-	-	-	2,581,725
投资（注*）	47,615,626	450,480,355	772,280,308	-	1,270,376,289
总利率敏感性缺口	167,099,441	450,480,355	772,280,308	-	1,389,860,104

注：

\* 投资的票面利率范围介乎年率 0.03% - 8.65%（二零二二年：年率 0.00% - 8.50%）。



于九月三十日，本基金投资及衍生性产品之公平值如下：

	2023		2022	
	投资之公平值 美元	占资产净值 百分比	投资之公平值 美元	占资产净值 百分比
上市投资				
资产				
债务证券				
- 韩国	194,192,195	14.0	114,350,984	8.4
- 维京群岛	114,608,769	8.3	228,002,349	16.7
- 中国	106,348,077	7.7	77,760,987	5.7
- 印度	96,306,912	7.0	80,267,600	5.9
- 香港	90,992,740	6.6	175,631,937	12.9
- 印度尼西亚	88,528,608	6.4	161,719,102	11.9
- 新加坡	73,465,101	5.3	95,182,132	7.0
- 开曼群岛	66,624,450	4.8	104,856,261	7.7
- 其他	460,045,021	33.2	232,604,937	17.1
	1,291,111,873	93.3	1,270,376,289	93.3
集体投资计划				
卢森堡	84,856,520	6.1	-	-
衍生性产品				
- 远期外汇合约	6,746,860	0.5	4,449,682	0.3
- 期货	27,906	0.0	2,581,725	0.1
	1,382,743,159	99.9	1,277,407,696	93.7
负债				
衍生性产品				
- 远期外汇合约	(3,641,993)	(0.3)	(23,730,703)	(1.7)
- 期货	(1,431,766)	(0.1)	(3,339,984)	(0.2)
	(5,073,759)	(0.4)	(27,070,687)	(1.9)
总上市投资	1,377,669,400	99.5	1,250,337,009	91.8

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。于二零二三年九月三十日，投资管理人估计本基金的修正久期为 4.83（二零二二年：4.41）。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 16,715,441 美元（二零二二年：15,010,917 美元）。若利率下降二十五个基点，则将致使本基金的资产净值增加相同金额。

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

(iii) 汇兑风险

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

本基金订立了若干远期外汇合约，以对冲若干外汇承担以维持有限的非美元风险承担。年末未平仓远期外汇合约请参阅附注11(a)。

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

汇兑风险承担净值 (注*)	美元等值	与美元比较之合理变动百分比 (注**)	估计对资产净值的影响 美元
<b>2023</b>			
澳元	95,917,274	+0.4	383,669
巴西雷亚尔	1,099,071	+8.1	89,025
加元	63,207,235	+1.6	1,011,316
智利比索	7,195,333	+7.2	518,064
人民币 (离岸)	455,464,670	-2.1	(9,564,758)
人民币 (在岸)	6,917,839	-2.9	(200,617)
欧元	(301,768)	+8.1	(24,443)
港元	(1,825,390)	+0.2	(3,651)
印尼盾	(7,755,390)	-1.5	116,331
印度卢比	4,045,671	-2.0	(80,913)
日元	20,727,726	-3.0	(621,832)
韩元	20,985,802	+6.0	1,259,148
墨西哥比索	21,044,844	+15.7	3,304,041
纽元	38,372,248	+6.2	2,379,079
新加坡元	(55,684,423)	+5.1	(2,839,906)
英镑	13,924,728	+9.3	1,295,000
台币	(10,519,738)	-1.6	168,316
泰铢	7,133,419	+3.6	256,803
	<u>679,949,151</u>		<u>(2,555,328)</u>

汇兑风险承担净值 (注*)	美元等值	与美元比较之合理变动百分比 (注**)	估计对资产净值的影响 美元
<u>2022</u>			
澳元	111,930,488	-11.0	(12,312,354)
巴西雷亚尔	1,208,844	+0.7	8,462
加元	58,060,229	-7.8	(4,528,698)
人民币 (离岸)	392,460,747	-9.5	(37,283,771)
人民币 (在岸)	(297,827)	-8.9	26,507
哥伦比亚比索	4,060,558	-17.0	(690,295)
欧元	3,490	-15.5	(541)
港元	(2,682,092)	-0.8	21,457
印度卢比	14,649,299	-8.8	(1,289,138)
印尼盾	12,041,362	-6.0	(722,482)
日元	608,813	-22.9	(139,418)
墨西哥比索	16,683,250	+2.2	367,032
纽元	33,331,764	-18.0	(5,999,718)
新加坡元	56,354,160	-5.4	(3,043,125)
英镑	6,384,180	-17.2	(1,098,079)
台币	(43,252,134)	-12.2	5,276,760
泰铢	4,930,879	-10.3	(507,881)
	<u>666,476,010</u>		<u>(61,915,282)</u>

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。

于二零二三年及二零二二年九月三十日，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始交付有关投资及衍生性产品，所以违约风险甚低。就购买而言，本基金的托管银行会在收到投资及衍生性产品后即时付款。若任何一方不能履行其责任，交易将告失效。

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

下表概述于九月三十日按照信贷评级的债务证券。

	2023 占资产净值百分比	2022 占资产净值百分比
标准普尔(AAA)/穆迪(Aaa)/惠誉(AAA)	5.4	1.5
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	9.4	3.4
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	26.7	17.4
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	28.1	48.2
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	8.4	12.7
标准普尔(B)/穆迪(B)/惠誉(B)	8.7	2.7
标准普尔(CCC)/穆迪(Caa)/惠誉(CCC)	0.2	-
未评级	6.2	7.4
	<u>93.1</u>	<u>93.3</u>

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。

	2023 占资产净值百分比	2022 占资产净值百分比
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	1.4	-
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	0.5	0.6
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	2.0	1.0
未评级	2.3	5.8
	<u>6.2</u>	<u>7.4</u>

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

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。

	2023 交易对手风险承担 美元	2022 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)	2,408,109	2,678,977
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	22,327,431	107,690,148
托管机构的现金抵押品		
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	485,000	4,447,035
存放经纪之保证金及经纪持有/发行的衍生性产品		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	5,156,271	1,325,706
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	5,223,459	12,238,666
托管机构的投资余额		
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	1,375,968,393	1,270,376,289

(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。

	2023		2022	
	1个月以内 美元	1至12个月 美元	1个月以内 美元	1至12个月 美元
应付经纪款项	12,505,661	-	4,447,035	-
赎回应付款项	7,943,307	-	14,152,564	-
应付收益分配	5,768,606	-	6,315,937	-
其他应付款项	1,610,737	-	1,657,842	-
衍生性产品	1,215,371	3,858,388	18,220,849	8,849,838
可赎回份额持有人应占净资产	1,384,301,568	-	1,361,534,429	-
总金融负债	1,413,345,250	3,858,388	1,406,328,656	8,849,838

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

于二零二三年及二零二二年九月三十日，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	受总净额结算协议及类似协议规限		净额
	的经确认金融资产	金融工具	的相关金额	
	总额	抵押品及保证金	美元	美元
	美元	美元	美元	美元
<u>2023</u>				
<u>资产</u>				
现金抵押品	485,000	-	(485,000)	-
保证金	3,604,964	-	(2,187,962)	1,417,002
衍生性产品	6,774,437	(1,320,161)	-	5,454,276
按公允价值透过损益列账的金融资产	10,864,401	(1,320,161)	(2,672,962)	6,871,278

	财务状况表中列示	受总净额结算协议及类似协议规限		净额
	的经确认金融负债	金融工具	的相关金额	
	总额	抵押品及保证金	美元	美元
	美元	美元	美元	美元
<u>负债</u>				
应付经纪款项	485,000	-	(485,000)	-
衍生性产品	5,073,253	(1,320,161)	(2,187,962)	1,565,130
按公允价值透过损益列账的金融负债	5,558,253	(1,320,161)	(2,672,962)	1,565,130

	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		净额 美元
		金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	
<b>2022</b>				
<b>资产</b>				
保证金	6,532,965	-	(6,362,145)	170,820
衍生性产品	7,029,897	(5,373,880)	-	1,656,017
按公允价值透过损益列账的金融资产	<u>13,562,862</u>	<u>(5,373,880)</u>	<u>(6,362,145)</u>	<u>1,826,837</u>
<b>负债</b>				
应付经纪款项	4,447,035	-	(3,038,986)	1,408,049
衍生性产品	27,070,687	(5,373,880)	(3,323,159)	18,373,648
按公允价值透过损益列账的金融负债	<u>31,517,722</u>	<u>(5,373,880)</u>	<u>(6,362,145)</u>	<u>19,781,697</u>

(II) 资本风险管理

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

为了维持资本结构，本基金的政策执行如下：

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

(III) 公允价值估计

于二零二三年及二零二二年九月三十日，管理层认为资产及负债的账面价值与公允价值相若。

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

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

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

上市投资	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总额 美元
<b>2023</b>				
<b>资产</b>				
债务证券	-	1,291,111,873	-	1,291,111,873
集体投资计划	84,856,520	-	-	84,856,520
衍生性产品	27,906	6,746,860	-	6,774,766
按公允价值透过损益列账的总金融资产	<u>84,884,426</u>	<u>1,297,858,733</u>	-	<u>1,382,743,159</u>
<b>负债</b>				
衍生性产品	1,431,766	3,641,993	-	5,073,759
按公允价值透过损益列账的总金融负债	<u>1,431,766</u>	<u>3,641,993</u>	-	<u>5,073,759</u>
<b>2022</b>				
<b>资产</b>				
债务证券	-	1,270,376,289	-	1,270,376,289
衍生性产品	2,581,725	4,449,682	-	7,031,407
按公允价值透过损益列账的总金融资产	<u>2,581,725</u>	<u>1,274,825,971</u>	-	<u>1,277,407,696</u>
<b>负债</b>				
衍生性产品	3,339,984	23,730,703	-	27,070,687
按公允价值透过损益列账的总金融负债	<u>3,339,984</u>	<u>23,730,703</u>	-	<u>27,070,687</u>



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

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

被分类为第三层次的投资，由于其交易次数疏落，故此有显著的不可观察输入值。

截至二零二三年及二零二二年九月三十日止年度，公平值层次之间并无转拨。

于二零二三年及二零二二年九月三十日，以摊余成本计量的资产和负债，其账面价值为其公平值的合理约数。

5 投资及衍生性产品净收益/（亏损）

	2023 美元	2022 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益/亏损之变动	132,652,958	(214,799,717)
投资及衍生性产品销售之实现亏损	(122,816,938)	(220,832,393)
	9,836,020	(435,632,110)

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。

本年年末结转未分配收入（二零二二年：无）。

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
<u>2023</u>					
澳元对冲类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	澳元0.0321	16,031,733.123	(329,073)
加元对冲类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	加元0.0363	11,903,583.157	(316,777)
英镑对冲类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	英镑0.0332	830,522.264	(31,746)
港元类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	港元0.0387	283,939,159.316	(1,399,829)
纽元对冲类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	纽元0.0345	7,267,755.380	(145,666)
PRC人民币对冲份额（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	人民币0.0332	48,415,211.570	(219,285)
PRC美元份额（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	美元0.0401	2,308,869.180	(92,586)
人民币对冲类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	人民币0.0307	335,786,294.188	(1,406,344)
美元类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	美元0.0440	43,810,078.239	(1,927,641)
澳元对冲类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	澳元0.0300	15,584,433.207	(313,107)
加元对冲类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	加元0.0352	11,638,931.096	(302,198)
英镑对冲类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	英镑0.0323	882,671.807	(33,953)
港元类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	港元0.0385	278,467,611.869	(1,373,519)
纽元对冲类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	纽元0.0329	7,310,581.009	(149,386)
PRC人民币对冲份额（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	人民币0.0263	48,156,378.010	(178,796)
PRC美元份额（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	美元0.0401	2,273,174.780	(91,154)
人民币对冲类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	人民币0.0243	329,560,391.315	(1,130,551)
美元类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	美元0.0440	43,019,753.278	(1,892,867)
澳元对冲类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	澳元0.0273	15,402,499.612	(285,154)
加元对冲类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	加元0.0333	11,670,257.016	(286,815)
英镑对冲类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	英镑0.0299	888,834.189	(31,968)
港元类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	港元0.0384	276,172,844.005	(1,358,758)
纽元对冲类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	纽元0.0322	7,165,360.778	(145,922)
PRC人民币对冲份额（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	人民币0.0213	47,272,058.670	(145,529)
PRC美元份额（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	美元0.0401	2,258,190.020	(90,553)
人民币对冲类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	人民币0.0198	325,821,398.984	(932,419)
美元类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	美元0.0440	42,704,805.293	(1,879,009)
澳元对冲类别（每月派息）	2023年1月31日	2023年2月8日	澳元0.0271	15,955,192.209	(304,680)
加元对冲类别（每月派息）	2023年1月31日	2023年2月8日	加元0.0348	12,173,358.592	(317,483)

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)	2023年1月31日	2023年2月8日	英镑0.0316	885,490.606	(34,448)
港元类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	港元0.0386	281,455,890.539	(1,385,996)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月9日	纽元0.0321	7,573,923.563	(157,118)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	人民币0.0228	46,808,434.330	(157,949)
PRC美元份额 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	美元0.0401	2,257,858.620	(90,540)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	人民币0.0212	323,651,947.748	(1,015,484)
美元类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	美元0.0440	43,365,864.969	(1,908,096)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	澳元0.0281	15,886,572.230	(301,038)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	加元0.0349	12,357,114.812	(316,767)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	英镑0.0333	1,333,064.712	(53,742)
港元类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	港元0.0387	300,024,726.090	(1,479,197)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	纽元0.0334	7,797,424.230	(161,352)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	人民币0.0268	46,582,102.230	(179,582)
PRC美元份额 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	美元0.0401	2,268,951.820	(90,985)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	人民币0.0249	322,707,269.252	(1,155,891)
美元类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	美元0.0440	44,996,252.332	(1,979,833)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	澳元0.0281	16,570,095.275	(311,849)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	加元0.0339	12,354,174.329	(309,459)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	英镑0.0330	1,380,872.387	(56,343)
港元类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	港元0.0387	306,626,589.787	(1,511,659)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	纽元0.0353	8,310,502.953	(183,541)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	人民币0.0240	45,441,635.210	(158,810)
PRC美元份额 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	美元0.0401	2,206,148.280	(88,467)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	人民币0.0222	320,156,885.788	(1,034,975)
美元类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	美元0.0440	46,499,464.329	(2,045,974)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	澳元0.0280	18,133,504.367	(335,539)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	加元0.0330	13,251,925.262	(322,431)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	英镑0.0330	1,476,724.334	(61,251)
港元类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	港元0.0387	314,427,331.449	(1,550,126)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	纽元0.0356	8,544,864.077	(187,887)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	人民币0.0213	44,976,061.760	(138,373)
PRC美元份额 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	美元0.0401	2,199,370.530	(88,195)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	人民币0.0197	320,773,243.891	(912,755)
美元类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	美元0.0440	48,123,632.535	(2,117,438)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	澳元0.0276	19,638,654.606	(350,773)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	加元0.0319	14,187,104.985	(332,942)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	英镑0.0328	1,516,754.845	(61,659)
港元类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	港元0.0385	332,241,446.633	(1,633,992)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	纽元0.0360	8,991,534.073	(194,007)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	人民币0.0218	44,295,097.820	(135,512)
PRC美元份额 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	美元0.0401	2,174,853.600	(87,212)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	人民币0.0202	323,676,203.064	(917,547)
美元类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	美元0.0440	48,089,066.159	(2,115,917)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	澳元0.0289	20,750,244.037	(399,178)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	加元0.0319	14,845,458.152	(357,884)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	英镑0.0336	1,708,975.828	(73,003)
港元类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	港元0.0386	329,575,507.354	(1,623,359)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	纽元0.0363	9,051,970.925	(201,309)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	人民币0.0222	43,673,504.540	(133,275)
PRC美元份额 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	美元0.0401	2,066,065.650	(82,849)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	人民币0.0206	321,623,569.050	(910,739)
美元类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	美元0.0440	47,895,576.397	(2,107,403)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	澳元0.0293	19,937,898.207	(393,650)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	加元0.0332	14,312,060.613	(360,996)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	英镑0.0361	1,704,388.843	(79,165)
港元类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	港元0.0385	324,606,874.817	(1,602,493)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	纽元0.0361	8,955,126.049	(201,193)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	人民币0.0211	42,942,971.190	(126,841)
PRC美元份额 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	美元0.0401	2,056,480.580	(82,465)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	人民币0.0196	311,920,555.788	(855,277)
美元类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	美元0.0440	47,141,500.055	(2,074,224)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	澳元0.0286	19,562,792.833	(362,357)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	加元0.0333	14,194,871.441	(349,377)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	英镑0.0363	1,724,525.811	(79,324)
港元类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	港元0.0386	310,194,462.360	(1,526,892)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	纽元0.0352	8,691,110.300	(182,164)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	人民币0.0225	42,376,295.310	(130,998)
PRC美元份额 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	美元0.0401	2,030,444.430	(81,421)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	人民币0.0208	302,502,244.108	(864,470)
美元类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	美元0.0440	44,382,948.014	(1,952,847)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	澳元0.0287	19,241,480.717	(356,409)

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9月29日	2023年10月11日	加元 0.0333	13,958,936.933	(343,811)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	英镑 0.0369	1,756,326.936	(79,102)
港元类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	港币 0.0386	298,357,446.880	(1,470,482)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	纽元 0.0351	8,681,253.030	(183,086)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年9月28日	2023年10月11日	人民币 0.0316	41,841,437.880	(181,476)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年9月28日	2023年10月11日	美元 0.0401	2,019,087.710	(80,965)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月11日	人民币 0.0293	295,363,671.353	(1,187,820)
美元类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月11日	美元 0.0440	42,851,284.607	(1,885,455)

可赎回份额持有人之总收益分配

(67,789,728)

2022

澳元对冲类别 (每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	澳元 0.0345	22,444,233.000	(584,577)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	加元 0.0363	14,577,681.865	(429,016)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	英镑 0.0373	563,583.628	(29,008)
港元类别 (每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	港币 0.0383	431,457,900.786	(2,124,753)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	纽元 0.0374	8,622,302.810	(232,584)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	人民币 0.0642	60,692,996.160	(609,880)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	美元 0.0401	3,173,472.370	(127,256)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	人民币 0.0594	453,675,880.473	(4,217,962)
美元类别 (每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	美元 0.0440	60,714,753.551	(2,671,449)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	澳元 0.0346	21,596,951.029	(531,746)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	加元 0.0363	14,553,196.984	(412,962)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	英镑 0.0374	548,980.277	(27,299)
港元类别 (每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	港币 0.0384	415,732,782.275	(2,046,789)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	纽元 0.0387	8,522,899.413	(224,074)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	人民币 0.0598	59,654,964.700	(558,134)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	美元 0.0401	3,106,208.720	(124,559)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	人民币 0.0553	441,457,240.707	(3,819,480)
美元类别 (每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	美元 0.0440	59,544,962.022	(2,619,978)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	澳元 0.0329	21,364,966.590	(509,854)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	加元 0.0341	14,455,308.039	(387,875)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	英镑 0.0341	553,190.646	(25,460)
港元类别 (每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	港币 0.0385	404,177,462.896	(1,994,876)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	纽元 0.0385	8,452,210.383	(222,499)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	人民币 0.0603	58,768,476.490	(555,824)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	美元 0.0401	3,018,473.070	(121,041)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	人民币 0.0558	436,923,881.073	(3,823,979)
美元类别 (每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	美元 0.0440	59,668,848.464	(2,625,429)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	澳元 0.0349	19,416,614.220	(473,975)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	加元 0.0362	13,809,138.185	(391,381)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	英镑 0.0379	566,562.649	(28,803)
港元类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	港币 0.0384	390,843,133.008	(1,925,718)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	纽元 0.0387	8,280,191.144	(210,115)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年1月28日	2022年2月11日	人民币 0.0557	57,048,155.580	(498,851)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年1月28日	2022年2月11日	美元 0.0401	2,860,901.890	(114,722)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	人民币 0.0516	420,787,408.000	(3,410,852)
美元类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	美元 0.0440	57,714,699.365	(2,539,447)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	澳元 0.0348	19,002,025.971	(477,867)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	加元 0.0365	13,677,995.973	(391,889)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	英镑 0.0392	557,442.670	(29,320)
港元类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	港币 0.0385	384,008,454.766	(1,893,254)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	纽元 0.0391	8,220,852.861	(216,599)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	人民币 0.0577	55,898,919.670	(511,152)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	美元 0.0401	2,823,707.350	(113,231)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	人民币 0.0533	412,963,391.796	(3,485,723)
美元类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	美元 0.0440	57,148,612.792	(2,514,539)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	澳元 0.0329	18,831,553.726	(465,257)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	加元 0.0358	13,590,815.434	(389,537)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	英镑 0.0383	528,722.225	(26,662)
港元类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	港币 0.0386	366,323,033.178	(1,805,561)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	纽元 0.0386	8,107,797.479	(217,680)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	人民币 0.0592	54,861,225.740	(511,615)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	美元 0.0401	2,700,172.480	(108,277)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	人民币 0.0547	405,861,577.120	(3,497,208)
美元类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	美元 0.0440	55,757,399.395	(2,453,326)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	澳元 0.0328	18,334,322.338	(427,360)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	加元 0.0372	13,218,768.629	(384,757)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	英镑 0.0388	812,453.733	(39,577)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
港元类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	港元0.0387	357,362,061.111	(1,762,637)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	纽元0.0388	7,960,047.297	(200,459)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	人民币0.0571	54,026,201.600	(464,474)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	美元0.0401	2,649,589.850	(106,249)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	人民币0.0528	398,023,552.292	(3,164,196)
美元类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	美元0.0440	54,643,675.083	(2,404,319)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	澳元0.0321	17,581,193.061	(404,841)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	加元0.0369	12,786,462.715	(373,025)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	英镑0.0378	827,616.446	(39,427)
港元类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	港元0.0387	338,952,473.101	(1,671,962)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	纽元0.0380	7,831,414.769	(193,719)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	人民币0.0548	53,388,083.990	(438,013)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	美元0.0401	2,600,777.540	(104,291)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	人民币0.0506	385,619,458.471	(2,921,272)
美元类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	美元0.0440	51,986,428.740	(2,287,400)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	澳元0.0330	16,916,498.784	(383,877)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	加元0.0366	12,743,518.081	(361,574)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	英镑0.0361	855,866.144	(37,522)
港元类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	港元0.0387	326,338,556.287	(1,609,454)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	纽元0.0385	7,601,609.403	(181,962)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	人民币0.0471	53,083,592.580	(372,936)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	美元0.0401	2,513,957.880	(100,810)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	人民币0.0436	378,046,381.658	(2,458,581)
美元类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	美元0.0440	49,886,905.061	(2,195,022)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	澳元0.0335	17,216,504.087	(402,458)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	加元0.0364	12,633,967.177	(358,900)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	英镑0.0336	852,043.388	(34,838)
港元类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	港元0.0387	311,276,231.545	(1,534,591)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	纽元0.0370	7,552,209.784	(175,218)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	人民币0.0406	51,524,394.810	(309,781)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	美元0.0401	2,438,450.950	(97,782)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	人民币0.0377	361,105,430.174	(2,016,005)
美元类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	美元0.0440	47,422,641.186	(2,086,594)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	澳元0.0323	16,790,754.660	(371,802)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	加元0.0367	12,391,598.674	(347,260)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	英镑0.0330	844,017.328	(32,409)
港元类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	港元0.0387	304,620,200.914	(1,501,978)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	纽元0.0367	7,474,795.268	(168,189)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	人民币0.0360	49,979,460.650	(261,006)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	美元0.0401	2,421,805.320	(97,114)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	人民币0.0333	356,394,024.534	(1,721,598)
美元类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	美元0.0440	46,545,345.467	(2,047,993)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	澳元0.0325	16,616,653.699	(347,219)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	加元0.0376	12,215,191.070	(334,261)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	英镑0.0334	830,208.683	(30,954)
港元类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	港元0.0387	293,632,252.167	(1,447,607)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	纽元0.0356	7,329,451.810	(147,594)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	人民币0.0373	49,226,694.710	(257,556)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	美元0.0401	2,370,246.030	(95,047)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	人民币0.0346	344,878,912.715	(1,673,805)
美元类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	美元0.0440	45,043,039.744	(1,981,894)

可赎回份额持有人之总收益分配

(105,332,073)

## 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，银行存款利息收入以及从政府债券和地方政府债券所获得的利息亦可免征增值税（“增值税”）。

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

截至二零二三年及二零二二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项拨备。

### 香港税项

由于本基金根据香港证券及期货条例第 104 条获认可为集体投资计划，根据香港税务条例第 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

截至二零二三年及二零二二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（“证监会守则”）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。

截至二零二三年九月三十日止年度，综合收益表中的股息收入为 306,520 美元（二零二二年：无），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	占本基金本年		占本基金本年		平均佣金率 百分比
	投资买卖总价值 美元	度之总交易价 值百分比	支付佣金 美元	度支付之总佣 金百分比	
<u>2023</u>					
HSBC Securities & Capital Markets (India)					
Private Limited	40,965,162	0.42	-	-	-
JPMorgan Chase Bank, N.A.	541,450,000	5.50	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司	514,317,344	5.23	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司，首尔分行	74,454,529	0.76	-	-	-
<u>2022</u>					
汇丰银行（中国）有限公司	63,768,122	0.82	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司	192,935,610	2.47	-	-	-

(b) 与管理人及其关联人士之年末结余：

	2023 美元	2022 美元
银行现金	2,408,109	2,678,977
应付款项	(1,186,914)	(1,244,130)

于二零二三年九月三十日，本基金的投资结余 84,856,520 美元（二零二二年：无），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) 截至二零二三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 34,231,710 美元（二零二二年：实现亏损 7,404,412 美元）。

(d) 截至二零二三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 251 美元（二零二二年：862 美元）。

- (e) 支付给摩根基金（亚洲）有限公司之管理费按本基金资产净值的年率百分之一计算。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或其关联人士管理的集体投资计划，在考虑针对该集体投资计划中归属于本基金的利益已征收的管理费以后，相应减少支付给管理人的管理费用。

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

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

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

	年初	总分配	总赎回	年末	交易利润 美元
<b>2023</b>					
<u>摩根资产管理（亚太）有限公司</u>					
- 美元类别（累计）	24,737.714	7,248.733	(12,697.743)	19,288.704	-
<u>JPMorgan Asset Management (S) Limited</u>					
- 美元类别（累计）	111.846	-	(111.846)	-	-
<b>2022</b>					
<u>摩根资产管理（亚太）有限公司</u>					
- 美元类别（累计）	34,940.962	8,569.255	(18,772.503)	24,737.714	6,851
<u>JPMorgan Asset Management (S) Limited</u>					
- 美元类别（累计）	223.693	-	(111.847)	111.846	-

- (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，按年率百分之零点点零四计算；超过 7,000 万美元时，按年率百分之零点点零二五计算。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比率为本基金资产净值的年率介乎百分之零点点零一至百分之零点点零五不等。基金注册登记机构费用于每季季末支付。

- (i) 截至二零二三年及二零二二年九月三十日止年度，除附注 8(e)和 8(h)披露的管理费用、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：

	2023 美元	2022 美元
存款利息	45,839	14,134
托管费用及银行费用	(31,284)	(41,701)

- (j) 截至二零二三年及二零二二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：

	2023 美元	2022 美元
存款利息	178,305	13,016
利息支出	(454)	(119)
交易成本	(24,126)	(15,181)
托管费用及银行费用	(279,155)	(343,254)

## 9 借款

截至二零二三年及二零二二年九月三十日止年度，本基金从香港上海汇丰银行有限公司（受托人的关联人士）借入无抵押短期借款。所有银行借款的久期均在 7 天内。所有交易均为按一般商业条款下进行的正常业务流程。

## 10 非金钱收益／佣金共享安排

截至二零二三年及二零二二年九月三十日止年度，投资管理及其关联人士未有就本基金通过经纪或交易商指示交易而签订任何非金钱收益／佣金共享安排。

## 11 衍生性产品

- (a) 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
<b>2023</b>				
未平仓合约：				
美元 11,421	澳元 17,796	2023 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	65
美元 3,402	英镑 2,795	2023 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	10
美元 1,580	英镑 1,302	2023 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	9
加元 17,672	美元 13,101	2023 年 10 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	29
美元 23,365	澳元 36,632	2023 年 10 月 4 日	法国巴黎银行	279
加元 398,343	美元 294,717	2023 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	72
美元 14,626	澳元 22,810	2023 年 10 月 5 日	Citibank N.A., 伦敦	97
美元 1,103	澳元 1,852	2023 年 10 月 5 日	Citibank N.A., 伦敦	10
美元 566,112	澳元 877,088	2023 年 10 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	40
美元 5,153	加元 6,966	2023 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	0
美元 1,101	离岸人民币 8,048	2023 年 10 月 10 日	法国巴黎银行	4
美元 1,100	离岸人民币 8,042	2023 年 10 月 11 日	Citibank N.A., 伦敦	4
美元 1,124	离岸人民币 8,206	2023 年 10 月 12 日	Citibank N.A., 伦敦	2
澳元 745,404	美元 484,784	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3,372
澳元 355,741	美元 230,772	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	1,020
澳元 395,217	美元 255,862	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	615
澳元 235,071	美元 152,148	2023 年 10 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	329



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 137,397	美元 88,951	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	215
澳元 46,368	美元 29,981	2023年10月20日	法国巴黎银行	34
加元 371,948	美元 276,384	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	1,204
加元 235,521	美元 175,191	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	945
加元 142,061	美元 105,976	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	875
加元 100,218	美元 74,490	2023年10月20日	法国巴黎银行	346
加元 164,500	美元 122,029	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	326
加元 166,720	美元 123,557	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	212
加元 319,598	美元 236,548	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	98
加元 56,819	美元 42,131	2023年10月20日	法国巴黎银行	94
加元 364,065	美元 269,413	2023年10月20日	法国巴黎银行	65
加元 7,355	美元 5,486	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	44
加元 13,474	美元 9,994	2023年10月20日	法国巴黎银行	26
加元 8,261	美元 6,123	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	12
加元 4,616	美元 3,423	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	8
加元 1,480	美元 1,099	2023年10月20日	法国巴黎银行	3
离岸人民币 14,572,380	美元 2,004,978	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	3,697
离岸人民币 3,640,586	美元 502,083	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,108
离岸人民币 3,727,867	美元 513,640	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	1,678
离岸人民币 2,642,984	美元 364,161	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	1,189
离岸人民币 3,218,063	美元 442,766	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	816
离岸人民币 517,479	美元 71,300	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	233
离岸人民币 600,646	美元 82,699	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	209
离岸人民币 465,286	美元 64,062	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	162
离岸人民币 2,204,531	美元 302,817	2023年10月20日	法国巴黎银行	60
离岸人民币 103,691	美元 14,276	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	36
离岸人民币 133,132	美元 18,317	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	34
离岸人民币 1,423,749	美元 195,556	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	27
离岸人民币 7,996	美元 1,102	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	4
离岸人民币 8,027	美元 1,105	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 8,027	美元 1,105	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	3
英镑 87,956	美元 109,881	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	2,515
英镑 46,729	美元 59,035	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	1,993
英镑 57,074	美元 71,659	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	1,989
英镑 17,153	美元 21,419	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	480
英镑 26,028	美元 32,158	2023年10月20日	美林国际, 伦敦	386
英镑 49,177	美元 60,259	2023年10月20日	加拿大皇家银行	230
英镑 3,574	美元 4,425	2023年10月20日	法国巴黎银行	62
英镑 881	美元 1,099	2023年10月20日	法国巴黎银行	24
英镑 878	美元 1,095	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	23
英镑 1,056	美元 1,310	2023年10月20日	法国巴黎银行	20
英镑 881	美元 1,093	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	19
英镑 889	美元 1,102	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	17
美元 267,210,346	离岸人民币 1,955,763,291	2023年10月20日	法国巴黎银行	1,382,304
美元 198,521,142	离岸人民币 1,453,013,960	2023年10月20日	法国巴黎银行	1,026,969
美元 77,954,482	澳元 121,988,863	2023年10月20日	法国巴黎银行	830,805
美元 31,803,134	纽元 54,077,029	2023年10月20日	加拿大皇家银行	689,320
美元 65,926,174	加元 89,885,005	2023年10月20日	法国巴黎银行	573,836
美元 40,432,678	离岸人民币 295,934,451	2023年10月20日	法国巴黎银行	209,162
美元 7,317,662	离岸人民币 53,559,357	2023年10月20日	法国巴黎银行	37,855
美元 390,744	纽元 661,474	2023年10月20日	法国巴黎银行	6,705
美元 368,789	澳元 577,637	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	4,272
美元 220,137	加元 300,628	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	2,278
美元 357,448	澳元 555,313	2023年10月20日	法国巴黎银行	1,196
美元 48,289	纽元 81,816	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	871
美元 75,119	纽元 126,325	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	784
美元 22,952	纽元 39,053	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	513
美元 154,986	加元 209,825	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	250
美元 26,897	离岸人民币 196,711	2023年10月20日	法国巴黎银行	118
美元 630,929	离岸人民币 4,594,955	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	114
美元 7,130	纽元 12,041	2023年10月20日	法国巴黎银行	105
美元 53,259	离岸人民币 388,407	2023年10月20日	法国巴黎银行	82
美元 16,641	离岸人民币 121,696	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	72
美元 2,935	纽元 5,000	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	69
美元 7,295	纽元 12,249	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	66
美元 9,545	离岸人民币 69,938	2023年10月20日	法国巴黎银行	59
美元 13,783	离岸人民币 100,781	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	57
美元 13,506	离岸人民币 98,710	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	51
美元 11,821	离岸人民币 86,397	2023年10月20日	法国巴黎银行	45

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 15,076	离岸人民币 110,098	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	44
美元 3,354	纽元 5,652	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	42
美元 17,035	澳元 26,436	2023年10月20日	法国巴黎银行	38
美元 12,804	离岸人民币 93,499	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	37
美元 9,495	离岸人民币 69,386	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	34
美元 23,090	离岸人民币 168,340	2023年10月20日	法国巴黎银行	29
美元 5,420	加元 7,362	2023年10月20日	法国巴黎银行	27
美元 35,690	澳元 55,300	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	25
美元 17,698	离岸人民币 129,045	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	24
美元 14,360	离岸人民币 104,725	2023年10月20日	法国巴黎银行	22
美元 7,636	离岸人民币 55,765	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	22
美元 9,839	离岸人民币 71,796	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	21
美元 10,058	离岸人民币 73,373	2023年10月20日	美林国际, 伦敦	18
美元 9,384	离岸人民币 68,457	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	18
美元 1,715	离岸人民币 12,567	2023年10月20日	法国巴黎银行	11
美元 7,229	离岸人民币 52,707	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	10
美元 6,878	离岸人民币 50,154	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	9
美元 14,513	离岸人民币 105,737	2023年10月20日	法国巴黎银行	8
美元 16,878	加元 22,822	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	7
美元 17,271	离岸人民币 125,779	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	3
美元 8,835	离岸人民币 64,353	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 106,556,970	美元 14,663,736	2023年10月26日	法国巴黎银行	26,528
泰铢 390,000,000	美元 10,795,370	2023年10月31日	Citibank N.A., 伦敦	57,696
巴西雷亚尔 46,557,675	美元 9,276,932	2024年1月16日	高盛国际, 伦敦	95,384
欧元 2,730,000	美元 2,947,488	2024年1月16日	Citibank N.A., 伦敦	41,690
欧元 3,980,000	美元 4,264,984	2024年1月16日	美国道富银行	28,691
英镑 7,100,000	美元 8,882,297	2024年1月16日	法国巴黎银行	209,356
印尼盾 120,000,000,000	美元 7,789,477	2024年1月16日	美国道富银行	27,227
印度卢比 2,330,000,000	美元 27,939,995	2024年1月16日	高盛国际, 伦敦	21,584
日元 1,100,000,000	美元 7,654,533	2024年1月16日	高盛国际, 伦敦	148,294
韩元 9,000,000,000	美元 6,841,297	2024年1月16日	Citibank N.A., 伦敦	127,306
韩元 11,600,000,000	美元 8,762,587	2024年1月16日	Citibank N.A., 伦敦	108,999
韩元 4,700,000,000	美元 3,562,063	2024年1月16日	Citibank N.A., 伦敦	55,868
韩元 5,000,000,000	美元 3,771,080	2024年1月16日	高盛国际, 伦敦	41,086
新索尔 38,000,000	美元 10,183,572	2024年1月16日	高盛国际, 伦敦	215,815
新加坡元 24,000,000	美元 17,716,492	2024年1月16日	美林国际, 伦敦	44,003
新加坡元 19,300,000	美元 14,251,199	2024年1月16日	美林国际, 伦敦	39,573
台币 225,000,000	美元 7,101,824	2024年1月16日	高盛国际, 伦敦	36,329
美元 10,697,329	澳元 16,600,000	2024年1月16日	HSBC Bank Plc, 伦敦	56,965
美元 6,901,692	离岸人民币 50,300,000	2024年1月16日	Citibank N.A., 伦敦	38,649
美元 17,209,415	离岸人民币 125,000,000	2024年1月16日	HSBC Bank Plc, 伦敦	37,952
美元 3,540,785	澳元 5,500,000	2024年1月16日	Citibank N.A., 伦敦	22,385
美元 14,132,181	离岸人民币 102,500,000	2024年1月16日	法国巴黎银行	10,660
美元 3,154,174	墨西哥比索 56,000,000	2024年1月16日	高盛国际, 伦敦	10,160
美元 3,475,089	纽元 5,800,000	2024年1月16日	美国道富银行	9,795
美元 3,460,130	韩元 4,650,000,000	2024年1月16日	Citibank N.A., 伦敦	8,765
美元 4,867,312	澳元 7,520,000	2024年1月16日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,512
美元 3,543,964	台币 113,000,000	2024年1月16日	渣打银行, 伦敦	4,485
美元 3,729,701	韩元 5,000,000,000	2024年1月16日	渣打银行, 伦敦	294
离岸人民币 104,213,790	美元 15,000,000	2024年7月26日	高盛国际, 伦敦	419,918
			未实现总收益	6,746,860
美元 3,422	加元 4,616	2023年10月3日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
美元 269,359	加元 364,065	2023年10月4日	法国巴黎银行	(73)
美元 123,531	加元 166,720	2023年10月5日	Citibank N.A., 伦敦	(213)
离岸人民币 73,373	美元 10,055	2023年10月10日	美林国际, 伦敦	(17)
离岸人民币 98,710	美元 13,501	2023年10月10日	Citibank N.A., 伦敦	(50)
离岸人民币 121,696	美元 16,635	2023年10月10日	Citibank N.A., 伦敦	(72)
离岸人民币 196,711	美元 26,889	2023年10月10日	法国巴黎银行	(116)
离岸人民币 86,397	美元 11,817	2023年10月11日	法国巴黎银行	(44)
离岸人民币 100,781	美元 13,782	2023年10月12日	Citibank N.A., 伦敦	(54)
离岸人民币 71,796	美元 9,838	2023年10月13日	Citibank N.A., 伦敦	(20)
澳元 1,713	美元 1,106	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
澳元 1,721	美元 1,109	2023年10月20日	法国巴黎银行	(3)
澳元 1,693	美元 1,088	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
澳元 1,703	美元 1,092	2023年10月20日	法国巴黎银行	(8)
澳元 89,892	美元 58,015	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(41)
澳元 17,796	美元 11,428	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(65)
澳元 27,638	美元 17,757	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(93)
澳元 19,837	美元 12,717	2023年10月20日	法国巴黎银行	(95)
澳元 22,810	美元 14,633	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(98)
澳元 91,705	美元 59,092	2023年10月20日	法国巴黎银行	(135)
澳元 82,861	美元 53,335	2023年10月20日	法国巴黎银行	(180)
澳元 73,809	美元 47,422	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(247)
澳元 36,632	美元 23,377	2023年10月20日	法国巴黎银行	(281)
澳元 221,422	美元 142,719	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(285)
澳元 45,090	美元 28,792	2023年10月20日	法国巴黎银行	(329)
澳元 172,353	美元 110,814	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(499)
澳元 337,493	美元 217,222	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(745)
澳元 508,919	美元 327,913	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(767)
澳元 228,542	美元 146,621	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(980)
澳元 616,784	美元 394,755	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(3,589)
澳元 1,009,901	美元 644,839	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(7,395)
加元 1,488	美元 1,101	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
加元 1,500	美元 1,104	2023年10月20日	法国巴黎银行	(5)
加元 2,034	美元 1,497	2023年10月20日	法国巴黎银行	(7)
加元 160,855	美元 118,981	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(25)
加元 203,424	美元 150,459	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(42)
加元 20,391	美元 15,004	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(82)
加元 474,251	美元 350,720	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(147)
加元 62,262	美元 45,580	2023年10月20日	法国巴黎银行	(484)
加元 132,398	美元 97,153	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(799)
加元 133,390	美元 97,834	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(853)
加元 352,421	美元 259,492	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(1,241)
加元 445,282	美元 326,252	2023年10月20日	加拿大皇家银行	(3,183)
离岸人民币 8,206	美元 1,125	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 8,097	美元 1,110	2023年10月20日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 8,097	美元 1,110	2023年10月20日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 8,023	美元 1,100	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 8,023	美元 1,100	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 8,005	美元 1,098	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 8,048	美元 1,101	2023年10月20日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 8,022	美元 1,098	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
离岸人民币 8,042	美元 1,100	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
离岸人民币 387,038	美元 53,124	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(30)
离岸人民币 95,855	美元 13,129	2023年10月20日	美国道富银行	(35)
离岸人民币 86,960	美元 11,907	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(35)
离岸人民币 135,435	美元 18,563	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(37)
离岸人民币 195,118	美元 26,757	2023年10月20日	法国巴黎银行	(39)
离岸人民币 97,022	美元 13,283	2023年10月20日	法国巴黎银行	(41)
离岸人民币 100,371	美元 13,733	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(51)
离岸人民币 624,417	美元 85,700	2023年10月20日	法国巴黎银行	(54)
离岸人民币 268,418	美元 36,809	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(54)
离岸人民币 309,458	美元 42,437	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(63)
离岸人民币 86,731	美元 11,845	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(66)
离岸人民币 281,553	美元 38,600	2023年10月20日	加拿大皇家银行	(67)
离岸人民币 226,004	美元 30,969	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(68)
离岸人民币 893,144	美元 122,590	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(69)
离岸人民币 132,146	美元 18,079	2023年10月20日	法国巴黎银行	(70)
离岸人民币 188,008	美元 25,742	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(78)
离岸人民币 147,663	美元 20,191	2023年10月20日	法国巴黎银行	(88)
离岸人民币 619,103	美元 84,932	2023年10月20日	法国巴黎银行	(91)
离岸人民币 524,081	美元 71,880	2023年10月20日	法国巴黎银行	(94)
离岸人民币 431,056	美元 59,101	2023年10月20日	法国巴黎银行	(97)
离岸人民币 130,623	美元 17,825	2023年10月20日	法国巴黎银行	(114)
离岸人民币 1,398,816	美元 191,984	2023年10月20日	法国巴黎银行	(121)
离岸人民币 741,683	美元 101,731	2023年10月20日	法国巴黎银行	(128)
离岸人民币 669,900	美元 91,865	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(136)
离岸人民币 295,421	美元 40,401	2023年10月20日	法国巴黎银行	(170)
离岸人民币 643,435	美元 88,172	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(194)
离岸人民币 337,691	美元 46,175	2023年10月20日	法国巴黎银行	(201)
离岸人民币 551,808	美元 75,570	2023年10月20日	美国道富银行	(212)
离岸人民币 1,267,105	美元 173,790	2023年10月20日	法国巴黎银行	(227)

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 833,564	美元 114,226	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(251)
离岸人民币 1,026,470	美元 140,689	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(280)
离岸人民币 1,573,191	美元 215,771	2023年10月20日	法国巴黎银行	(281)
离岸人民币 567,996	美元 77,720	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(285)
离岸人民币 1,072,288	美元 146,969	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(293)
离岸人民币 488,888	美元 66,845	2023年10月20日	法国巴黎银行	(296)
离岸人民币 545,342	美元 74,594	2023年10月20日	法国巴黎银行	(300)
离岸人民币 1,742,779	美元 238,974	2023年10月20日	法国巴黎银行	(369)
离岸人民币 1,782,191	美元 244,353	2023年10月20日	法国巴黎银行	(402)
离岸人民币 1,033,784	美元 141,554	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(420)
离岸人民币 3,047,908	美元 418,131	2023年10月20日	法国巴黎银行	(450)
离岸人民币 1,302,273	美元 178,388	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(458)
离岸人民币 1,948,364	美元 267,113	2023年10月20日	加拿大皇家银行	(463)
离岸人民币 2,138,122	美元 293,154	2023年10月20日	法国巴黎银行	(483)
离岸人民币 979,650	美元 134,048	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(491)
离岸人民币 1,051,255	美元 143,846	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(527)
离岸人民币 1,592,935	美元 218,211	2023年10月20日	法国巴黎银行	(553)
离岸人民币 787,232	美元 107,426	2023年10月20日	法国巴黎银行	(688)
离岸人民币 786,982	美元 107,391	2023年10月20日	法国巴黎银行	(688)
离岸人民币 1,267,779	美元 173,340	2023年10月20日	法国巴黎银行	(769)
离岸人民币 1,653,457	美元 226,281	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(794)
离岸人民币 4,060,261	美元 556,715	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(896)
离岸人民币 2,700,044	美元 369,773	2023年10月20日	美国道富银行	(1,035)
离岸人民币 3,011,907	美元 412,387	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,250)
离岸人民币 2,678,946	美元 366,435	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1,475)
离岸人民币 3,626,338	美元 496,432	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(1,587)
离岸人民币 3,273,606	美元 447,855	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1,722)
离岸人民币 3,331,723	美元 455,806	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1,753)
离岸人民币 3,565,863	美元 487,902	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,813)
离岸人民币 5,352,747	美元 733,231	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,882)
离岸人民币 9,730,398	美元 1,334,355	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1,959)
离岸人民币 7,826,841	美元 1,072,176	2023年10月20日	法国巴黎银行	(2,715)
离岸人民币 10,400,121	美元 1,425,138	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(3,152)
离岸人民币 8,090,373	美元 1,107,798	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(3,285)
离岸人民币 20,757,014	美元 2,837,879	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(12,763)
英镑 1,302	美元 1,580	2023年10月20日	法国巴黎银行	(9)
英镑 2,795	美元 3,402	2023年10月20日	法国巴黎银行	(10)
英镑 20,297	美元 24,744	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(33)
欧元 1,852	美元 1,103	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(10)
欧元 1,840	美元 1,096	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(10)
欧元 1,862	美元 1,106	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
欧元 1,847	美元 1,096	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
欧元 1,854	美元 1,089	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(24)
欧元 13,776	美元 8,157	2023年10月20日	法国巴黎银行	(120)
欧元 42,757	美元 25,540	2023年10月20日	法国巴黎银行	(151)
欧元 25,052	美元 14,798	2023年10月20日	法国巴黎银行	(254)
欧元 106,776	美元 63,650	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(506)
欧元 103,643	美元 61,533	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(742)
欧元 97,146	美元 57,408	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(963)
欧元 140,681	美元 83,429	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,100)
欧元 86,323	美元 50,668	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,199)
欧元 225,907	美元 134,533	2023年10月20日	美林国际, 伦敦	(1,205)
欧元 225,654	美元 134,154	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,431)
欧元 150,267	美元 88,689	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,600)
欧元 409,958	美元 243,410	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2,915)
欧元 276,513	美元 162,819	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(3,325)
美元 4,121	离岸人民币 30,000	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1)
美元 96,154	离岸人民币 700,114	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
美元 12,161	离岸人民币 88,526	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
美元 468,640	离岸人民币 3,412,261	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(21)
美元 11,119	加元 15,000	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(21)
美元 11,031	离岸人民币 80,163	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(22)
美元 7,163	离岸人民币 51,984	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(24)
美元 10,216	离岸人民币 74,184	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(28)
美元 13,104	加元 17,672	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(29)
美元 294,786	加元 398,343	2023年10月20日	法国巴黎银行	(78)
美元 38,653	离岸人民币 280,501	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(131)
美元 8,998	英镑 7,182	2023年10月20日	法国巴黎银行	(232)

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 12,902	英镑 10,329	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(294)
美元 295,127	离岸人民币 2,144,625	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(597)
美元 253,186	澳元 390,779	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(805)
美元 75,164	英镑 60,713	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1,053)
美元 33,306	英镑 26,254	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,258)
美元 59,573	英镑 47,686	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,363)
美元 226,755	英镑 182,923	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(3,463)
美元 14,230,674	英镑 11,405,796	2023年10月20日	法国巴黎银行	(307,767)
美元 15,000,000	离岸人民币 106,556,970	2023年10月26日	高盛国际, 伦敦	(362,792)
美元 11,184,463	泰铢 390,000,000	2023年10月31日	Citibank N.A., 伦敦	(446,790)
澳元 877,088	美元 567,006	2023年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(68)
澳元 637,079	美元 410,552	2023年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,347)
加元 6,966	美元 5,156	2023年11月21日	法国巴黎银行	(0)
加元 561,210	美元 414,125	2023年11月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,265)
离岸人民币 8,028	美元 1,104	2023年11月21日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 415,903	美元 57,082	2023年11月21日	美林国际, 伦敦	(113)
离岸人民币 5,192,028	美元 713,641	2023年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(356)
离岸人民币 10,445,187	美元 1,433,575	2023年11月21日	美林国际, 伦敦	(2,826)
英镑 57,038	美元 69,596	2023年11月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(41)
纽元 261,702	美元 156,947	2023年11月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(300)
离岸人民币 51,000,000	美元 7,011,919	2024年1月16日	法国巴黎银行	(25,007)
离岸人民币 70,000,000	美元 9,631,794	2024年1月16日	高盛国际, 伦敦	(26,731)
离岸人民币 105,000,000	美元 14,411,892	2024年1月16日	渣打银行, 伦敦	(75,897)
离岸人民币 438,304,343	美元 60,148,011	2024年1月16日	美国道富银行	(328,756)
欧元 3,950,000	美元 4,172,389	2024年1月16日	高盛国际, 伦敦	(31,971)
日元 1,050,000,000	美元 7,156,674	2024年1月16日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(8,372)
墨西哥比索 357,000,000	美元 19,949,157	2024年1月16日	Citibank N.A., 伦敦	(223,470)
纽元 6,750,000	美元 4,016,824	2024年1月16日	Citibank N.A., 伦敦	(38,860)
纽元 31,850,000	美元 18,827,236	2024年1月16日	美国道富银行	(309,582)
新加坡元 7,500,000	美元 5,521,827	2024年1月16日	Citibank N.A., 伦敦	(825)
新加坡元 9,000,000	美元 6,612,790	2024年1月16日	美林国际, 伦敦	(14,394)
新加坡元 21,000,000	美元 15,436,100	2024年1月16日	美国道富银行	(27,328)
新加坡元 9,300,000	美元 6,818,757	2024年1月16日	法国巴黎银行	(29,333)
台币 115,000,000	美元 3,603,886	2024年1月16日	高盛国际, 伦敦	(7,367)
台币 220,000,000	美元 6,862,776	2024年1月16日	高盛国际, 伦敦	(45,709)
美元 3,529,760	台币 112,000,000	2024年1月16日	渣打银行, 伦敦	(12,714)
美元 3,269,017	日元 476,000,000	2024年1月16日	渣打银行, 伦敦	(20,863)
美元 3,268,446	日元 475,000,000	2024年1月16日	渣打银行, 伦敦	(27,116)
美元 3,385,495	韩元 4,500,000,000	2024年1月16日	高盛国际, 伦敦	(28,500)
美元 16,029,047	印度卢比 1,335,000,000	2024年1月16日	渣打银行, 伦敦	(32,876)
美元 6,763,510	韩元 9,000,000,000	2024年1月16日	美林国际, 伦敦	(49,519)
美元 17,297,808	离岸人民币 125,000,000	2024年1月16日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(50,441)
美元 7,403,267	韩元 9,800,000,000	2024年1月16日	渣打银行, 伦敦	(92,477)
美元 7,382,541	日元 1,060,000,000	2024年1月16日	渣打银行, 伦敦	(149,257)
美元 10,187,941	新索尔 38,000,000	2024年1月16日	高盛国际, 伦敦	(220,184)
美元 21,544,797	日元 3,090,000,000	2024年1月16日	美国道富银行	(459,091)
美元 14,663,748	离岸人民币 104,213,790	2024年7月26日	渣打银行, 伦敦	(83,666)

未实现总亏损 (3,641,993)

未实现净收益 3,104,867

2022

未平仓合约:

纽元 20,416	美元 11,766	2022年10月3日	法国巴黎银行	217
美元 23,664	英镑 21,960	2022年10月3日	法国巴黎银行	850
澳元 2,408	美元 1,564	2022年10月5日	法国巴黎银行	15
纽元 21,294	美元 12,059	2022年10月5日	法国巴黎银行	13
美元 50,214	英镑 46,724	2022年10月5日	法国巴黎银行	1,946
美元 39,537	离岸人民币 284,004	2022年10月11日	法国巴黎银行	306

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 1,096	离岸人民币 7,903	2022年10月11日	法国巴黎银行	13
离岸人民币 134,699	美元 18,914	2022年10月13日	法国巴黎银行	16
离岸人民币 8,032	美元 1,128	2022年10月13日	法国巴黎银行	1
美元 1,105	离岸人民币 7,878	2022年10月13日	法国巴黎银行	0
美元 1,099	离岸人民币 7,835	2022年10月13日	法国巴黎银行	0
澳元 687,427	美元 466,106	2022年10月21日	美国道富银行	24,027
澳元 464,062	美元 316,018	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	17,583
澳元 419,357	美元 282,413	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	12,728
澳元 644,211	美元 424,208	2022年10月21日	法国巴黎银行	9,921
澳元 282,138	美元 190,513	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	9,073
澳元 309,072	美元 205,771	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	7,010
澳元 175,584	美元 119,390	2022年10月21日	法国巴黎银行	6,473
澳元 148,195	美元 101,420	2022年10月21日	法国巴黎银行	6,116
澳元 189,751	美元 128,123	2022年10月21日	法国巴黎银行	6,096
澳元 196,952	美元 131,890	2022年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	5,232
澳元 968,564	美元 627,681	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	4,805
澳元 463,337	美元 301,194	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	3,226
澳元 86,262	美元 58,025	2022年10月21日	法国巴黎银行	2,551
澳元 282,113	美元 183,199	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,774
澳元 47,816	美元 32,040	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,290
澳元 208,657	美元 135,166	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	980
澳元 19,553	美元 13,400	2022年10月21日	法国巴黎银行	825
澳元 134,655	美元 87,210	2022年10月21日	法国巴黎银行	614
澳元 26,069	美元 17,291	2022年10月21日	法国巴黎银行	526
澳元 12,953	美元 8,629	2022年10月21日	法国巴黎银行	299
澳元 10,218	美元 6,858	2022年10月21日	加拿大皇家银行	286
澳元 37,928	美元 24,567	2022年10月21日	法国巴黎银行	176
澳元 53,455	美元 34,545	2022年10月21日	法国巴黎银行	169
澳元 1,602	美元 1,099	2022年10月21日	法国巴黎银行	69
澳元 1,602	美元 1,099	2022年10月21日	法国巴黎银行	69
澳元 1,597	美元 1,083	2022年10月21日	法国巴黎银行	56
澳元 1,636	美元 1,103	2022年10月21日	法国巴黎银行	51
加元 1,147,170	美元 870,279	2022年10月21日	法国巴黎银行	35,443
加元 517,705	美元 393,049	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	16,298
加元 338,149	美元 257,277	2022年10月21日	加拿大皇家银行	11,194
加元 310,522	美元 235,838	2022年10月21日	加拿大皇家银行	9,861
加元 480,530	美元 355,190	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	5,492
加元 149,674	美元 113,717	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,794
加元 237,269	美元 176,625	2022年10月21日	加拿大皇家银行	3,956
加元 137,836	美元 103,307	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	2,998
加元 339,818	美元 248,693	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	1,396
加元 721,654	美元 526,251	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	1,078
加元 35,414	美元 26,666	2022年10月21日	法国巴黎银行	894
加元 25,998	美元 19,709	2022年10月21日	法国巴黎银行	790
加元 17,213	美元 13,154	2022年10月21日	法国巴黎银行	627
加元 28,118	美元 20,839	2022年10月21日	法国巴黎银行	376
加元 147,914	美元 107,854	2022年10月21日	加拿大皇家银行	212
加元 65,117	美元 47,578	2022年10月21日	法国巴黎银行	190
加元 4,890	美元 3,723	2022年10月21日	法国巴黎银行	165
加元 2,573	美元 1,948	2022年10月21日	法国巴黎银行	76
加元 2,956	美元 2,207	2022年10月21日	法国巴黎银行	56
加元 1,441	美元 1,100	2022年10月21日	法国巴黎银行	51
加元 1,441	美元 1,100	2022年10月21日	法国巴黎银行	51
加元 1,450	美元 1,104	2022年10月21日	法国巴黎银行	49
加元 62,866	美元 45,798	2022年10月21日	法国巴黎银行	48
加元 1,439	美元 1,095	2022年10月21日	法国巴黎银行	48
离岸人民币 15,848,199	美元 2,296,512	2022年10月21日	法国巴黎银行	72,876
离岸人民币 11,408,853	美元 1,651,697	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	50,938
离岸人民币 9,919,190	美元 1,434,397	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	42,651
离岸人民币 9,255,215	美元 1,324,380	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	25,795
离岸人民币 5,222,174	美元 753,306	2022年10月21日	法国巴黎银行	20,591
离岸人民币 4,179,376	美元 604,759	2022年10月21日	法国巴黎银行	18,358
离岸人民币 5,637,187	美元 809,271	2022年10月21日	法国巴黎银行	18,326
离岸人民币 6,111,444	美元 874,622	2022年10月21日	美国道富银行	17,134
离岸人民币 10,994,311	美元 1,557,194	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	14,599
离岸人民币 3,475,150	美元 500,664	2022年10月21日	法国巴黎银行	13,071
离岸人民币 2,227,614	美元 322,509	2022年10月21日	法国巴黎银行	9,956

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 1,729,247	美元 250,968	2022年10月21日	法国巴黎银行	8,340
离岸人民币 1,794,938	美元 260,108	2022年10月21日	美国道富银行	8,263
离岸人民币 2,973,107	美元 424,069	2022年10月21日	法国巴黎银行	6,917
离岸人民币 2,085,320	美元 299,496	2022年10月21日	法国巴黎银行	6,908
离岸人民币 1,506,893	美元 218,165	2022年10月21日	法国巴黎银行	6,735
离岸人民币 1,964,552	美元 282,079	2022年10月21日	法国巴黎银行	6,435
离岸人民币 2,891,703	美元 412,104	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	6,374
离岸人民币 2,285,720	美元 326,149	2022年10月21日	法国巴黎银行	5,444
离岸人民币 1,828,629	美元 261,952	2022年10月21日	美国道富银行	5,380
离岸人民币 1,594,458	美元 228,725	2022年10月21日	法国巴黎银行	5,009
离岸人民币 1,007,255	美元 145,751	2022年10月21日	法国巴黎银行	4,424
离岸人民币 1,407,600	美元 201,639	2022年10月21日	美国道富银行	4,141
离岸人民币 4,736,552	美元 618,072	2022年10月21日	法国巴黎银行	4,005
离岸人民币 782,267	美元 113,532	2022年10月21日	法国巴黎银行	3,773
离岸人民币 1,221,740	美元 175,122	2022年10月21日	美国道富银行	3,701
离岸人民币 966,917	美元 139,304	2022年10月21日	法国巴黎银行	3,637
离岸人民币 1,121,435	美元 160,771	2022年10月21日	法国巴黎银行	3,424
离岸人民币 1,408,679	美元 200,482	2022年10月21日	法国巴黎银行	2,832
离岸人民币 934,238	美元 133,912	2022年10月21日	美国道富银行	2,830
离岸人民币 4,494,623	美元 633,345	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	2,711
离岸人民币 1,051,751	美元 150,074	2022年10月21日	法国巴黎银行	2,505
离岸人民币 24,423,386	美元 3,429,224	2022年10月21日	法国巴黎银行	2,416
离岸人民币 1,082,934	美元 154,332	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	2,387
离岸人民币 514,764	美元 74,487	2022年10月21日	法国巴黎银行	2,261
离岸人民币 730,251	美元 104,690	2022年10月21日	法国巴黎银行	2,230
离岸人民币 461,888	美元 66,942	2022年10月21日	加拿大皇家银行	2,135
离岸人民币 2,192,795	美元 309,748	2022年10月21日	法国巴黎银行	2,080
离岸人民币 648,064	美元 92,965	2022年10月21日	法国巴黎银行	2,036
离岸人民币 584,185	美元 83,750	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,784
离岸人民币 1,344,320	美元 190,384	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,765
离岸人民币 1,672,275	美元 236,221	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,586
离岸人民币 730,381	美元 103,947	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,469
离岸人民币 433,725	美元 62,292	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,437
离岸人民币 320,088	美元 46,173	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,262
离岸人民币 326,595	美元 47,052	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,228
离岸人民币 369,723	美元 53,086	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,211
离岸人民币 13,926,130	美元 1,955,137	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,183
离岸人民币 9,022,115	美元 1,266,799	2022年10月21日	法国巴黎银行	920
离岸人民币 372,844	美元 53,201	2022年10月21日	法国巴黎银行	888
离岸人民币 2,783,311	美元 391,392	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	870
离岸人民币 261,550	美元 37,548	2022年10月21日	法国巴黎银行	850
离岸人民币 226,207	美元 32,480	2022年10月21日	法国巴黎银行	741
离岸人民币 2,130,603	美元 299,607	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	666
离岸人民币 193,570	美元 27,789	2022年10月21日	法国巴黎银行	629
离岸人民币 370,099	美元 52,414	2022年10月21日	法国巴黎银行	486
离岸人民币 506,377	美元 71,512	2022年10月21日	法国巴黎银行	463
离岸人民币 343,759	美元 48,683	2022年10月21日	法国巴黎银行	451
离岸人民币 74,927	美元 10,874	2022年10月21日	法国巴黎银行	361
离岸人民币 136,258	美元 19,435	2022年10月21日	法国巴黎银行	317
离岸人民币 56,258	美元 8,135	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	242
离岸人民币 48,208	美元 6,987	2022年10月21日	加拿大皇家银行	223
离岸人民币 41,558	美元 5,947	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	116
离岸人民币 28,708	美元 4,141	2022年10月21日	法国巴黎银行	113
离岸人民币 29,506	美元 4,223	2022年10月21日	美国道富银行	83
离岸人民币 23,035	美元 3,279	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	47
离岸人民币 33,649	美元 4,766	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	45
离岸人民币 21,959	美元 3,125	2022年10月21日	法国巴黎银行	44
离岸人民币 14,005	美元 2,009	2022年10月21日	法国巴黎银行	44
离岸人民币 7,620	美元 1,106	2022年10月21日	法国巴黎银行	37
离岸人民币 7,663	美元 1,105	2022年10月21日	法国巴黎银行	30
离岸人民币 7,594	美元 1,094	2022年10月21日	法国巴黎银行	29
离岸人民币 7,594	美元 1,094	2022年10月21日	法国巴黎银行	29
离岸人民币 7,672	美元 1,102	2022年10月21日	法国巴黎银行	25
离岸人民币 7,672	美元 1,102	2022年10月21日	法国巴黎银行	25
离岸人民币 7,672	美元 1,102	2022年10月21日	法国巴黎银行	25
离岸人民币 7,637	美元 1,097	2022年10月21日	法国巴黎银行	25
离岸人民币 7,602	美元 1,090	2022年10月21日	法国巴黎银行	23
离岸人民币 7,713	美元 1,101	2022年10月21日	法国巴黎银行	18

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 141,685	美元 19,894	2022年10月21日	法国巴黎银行	15
离岸人民币 21,937	美元 3,091	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	13
离岸人民币 67,523	美元 9,480	2022年10月21日	法国巴黎银行	6
离岸人民币 7,932	美元 1,114	2022年10月21日	法国巴黎银行	1
离岸人民币 7,932	美元 1,114	2022年10月21日	法国巴黎银行	1
英镑 37,309	美元 43,237	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,572
英镑 35,398	美元 40,869	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,337
英镑 24,604	美元 28,352	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	874
英镑 15,798	美元 18,399	2022年10月21日	美国道富银行	757
英镑 21,410	美元 24,611	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	700
英镑 17,431	美元 20,067	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	601
英镑 18,331	美元 21,036	2022年10月21日	法国巴黎银行	564
英镑 23,698	美元 26,868	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	403
英镑 34,116	美元 38,245	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	145
英镑 2,500	美元 2,853	2022年10月21日	加拿大皇家银行	61
英镑 959	美元 1,103	2022年10月21日	法国巴黎银行	32
纽元 398,874	美元 244,680	2022年10月21日	法国巴黎银行	19,043
纽元 327,087	美元 198,370	2022年10月21日	美国道富银行	13,341
纽元 205,642	美元 125,455	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	9,126
纽元 183,222	美元 110,506	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	6,860
纽元 284,531	美元 165,054	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	4,098
纽元 87,997	美元 52,861	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3,082
纽元 115,181	美元 67,943	2022年10月21日	美国道富银行	2,787
纽元 110,694	美元 65,395	2022年10月21日	法国巴黎银行	2,776
纽元 60,009	美元 36,428	2022年10月21日	法国巴黎银行	2,482
纽元 52,272	美元 32,043	2022年10月21日	法国巴黎银行	2,474
纽元 110,559	美元 64,938	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	2,396
纽元 60,891	美元 36,034	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	1,589
纽元 301,163	美元 171,889	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,526
纽元 422,288	美元 240,392	2022年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,510
纽元 46,350	美元 27,716	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,496
纽元 204,272	美元 116,815	2022年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,261
纽元 68,389	美元 39,920	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,233
纽元 29,712	美元 17,553	2022年10月21日	法国巴黎银行	745
纽元 90,441	美元 51,518	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	357
纽元 5,658	美元 3,412	2022年10月21日	法国巴黎银行	211
纽元 3,586	美元 2,184	2022年10月21日	法国巴黎银行	156
纽元 1,795	美元 1,100	2022年10月21日	法国巴黎银行	85
纽元 1,824	美元 1,103	2022年10月21日	法国巴黎银行	71
纽元 1,806	美元 1,092	2022年10月21日	法国巴黎银行	71
纽元 1,788	美元 1,078	2022年10月21日	法国巴黎银行	66
纽元 1,909	美元 1,090	2022年10月21日	法国巴黎银行	10
纽元 1,943	美元 1,100	2022年10月21日	法国巴黎银行	1
美元 29,638	英镑 27,457	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,025
美元 22,204	离岸人民币 160,051	2022年10月21日	法国巴黎银行	253
美元 21,110	离岸人民币 151,596	2022年10月21日	法国巴黎银行	160
美元 39,701	离岸人民币 284,004	2022年10月21日	法国巴黎银行	147
美元 28,453	离岸人民币 203,542	2022年10月21日	法国巴黎银行	105
美元 15,696	离岸人民币 112,116	2022年10月21日	法国巴黎银行	35
美元 1,735	离岸人民币 12,504	2022年10月21日	法国巴黎银行	20
美元 5,788	离岸人民币 41,344	2022年10月21日	法国巴黎银行	13
美元 4,451	离岸人民币 31,794	2022年10月21日	法国巴黎银行	10
美元 1,295	离岸人民币 9,252	2022年10月21日	法国巴黎银行	3
印尼盾				
460,000,000,000	美元 31,115,350	2022年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	928,652
离岸人民币 1,401,608	美元 197,631	2022年11月21日	美国道富银行	856
离岸人民币 1,088,142	美元 153,432	2022年11月21日	美国道富银行	664
美元 15,740	离岸人民币 112,141	2022年11月21日	法国巴黎银行	4
巴西雷亚尔				
43,748,333	美元 8,072,214	2023年1月13日	高盛国际, 伦敦	172,590
286,700,000	美元 40,980,519	2023年1月13日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	663,581
印尼盾				
175,000,000,000	美元 11,582,730	2023年1月13日	Citibank N.A., 伦敦	129,913
印尼盾				
54,000,000,000	美元 3,548,896	2023年1月13日	渣打银行, 伦敦	14,884
印度卢比 575,000,000	美元 7,124,069	2023年1月13日	Citibank N.A., 伦敦	122,118
林吉特 22,000,000	美元 4,864,028	2023年1月13日	渣打银行, 伦敦	92,047
新加坡元 17,000,000	美元 12,004,548	2023年1月13日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	136,106



交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
新加坡元 10,000,000	美元 6,987,476	2023 年 1 月 13 日	澳大利亚和新西兰银行集团有限 公司	6,039
台币 1,142,000,000	美元 36,538,271	2023 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	245,886
美元 7,494,276	台币 236,000,000	2023 年 1 月 13 日	渣打银行, 伦敦	5,726
美元 6,937,007	印度卢比 570,000,000	2023 年 1 月 13 日	高盛国际, 伦敦	4,057
林吉特 68,000,000	美元 15,389,838	2023 年 2 月 13 日	渣打银行, 伦敦	611,371
印尼盾 500,000,000,000	美元 33,138,918	2023 年 5 月 31 日	渣打银行, 伦敦	560,519
			未实现总收益	4,449,682
英镑 27,457	美元 29,631	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	(1,020)
美元 1,090	纽元 1,909	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	(10)
美元 1,100	纽元 1,943	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(1)
美元 45,800	加元 62,866	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(47)
美元 34,540	澳元 53,455	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(170)
美元 24,563	澳元 37,928	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(177)
美元 47,581	加元 65,117	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(191)
美元 87,199	澳元 134,655	2022 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	(619)
离岸人民币 203,542	美元 28,448	2022 年 10 月 11 日	法国巴黎银行	(107)
离岸人民币 284,004	美元 39,694	2022 年 10 月 11 日	法国巴黎银行	(149)
离岸人民币 151,596	美元 21,104	2022 年 10 月 11 日	法国巴黎银行	(163)
离岸人民币 12,504	美元 1,734	2022 年 10 月 12 日	法国巴黎银行	(20)
离岸人民币 160,051	美元 22,200	2022 年 10 月 12 日	法国巴黎银行	(254)
美元 1,114	离岸人民币 7,932	2022 年 10 月 12 日	法国巴黎银行	(1)
美元 1,114	离岸人民币 7,932	2022 年 10 月 12 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 112,141	美元 15,371	2022 年 10 月 14 日	法国巴黎银行	(2)
澳元 727,247	美元 463,081	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(4,606)
加元 537,820	美元 388,903	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(2,487)
离岸人民币 7,791	美元 1,091	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 7,903	美元 1,096	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(13)
离岸人民币 41,533	美元 5,804	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(23)
离岸人民币 101,031	美元 14,093	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(83)
离岸人民币 467,459	美元 65,443	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(145)
离岸人民币 501,792	美元 70,250	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(156)
离岸人民币 308,114	美元 43,071	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(160)
离岸人民币 76,618	美元 10,545	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(205)
离岸人民币 146,973	美元 20,389	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(232)
离岸人民币 169,923	美元 23,573	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(269)
离岸人民币 284,004	美元 39,547	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(301)
离岸人民币 316,871	美元 44,124	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(336)
离岸人民币 649,891	美元 90,848	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(337)
离岸人民币 881,994	美元 123,294	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(458)
离岸人民币 520,094	美元 72,423	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(551)
离岸人民币 688,257	美元 95,605	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	(964)
离岸人民币 1,523,337	美元 212,550	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,187)
离岸人民币 889,322	美元 123,534	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1,245)
离岸人民币 1,982,448	美元 276,610	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,545)
离岸人民币 3,175,687	美元 443,935	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,641)
离岸人民币 4,149,280	美元 580,035	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,144)
离岸人民币 2,401,171	美元 331,543	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	(5,362)
离岸人民币 9,952,898	美元 1,390,891	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(5,585)
离岸人民币 3,133,491	美元 432,658	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	(6,997)
离岸人民币 7,251,688	美元 1,009,789	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(7,684)
离岸人民币 8,412,002	美元 1,166,974	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(13,301)
离岸人民币 20,793,213	美元 2,900,435	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(17,028)
离岸人民币 15,760,863	美元 2,169,269	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(42,113)
英镑 11,022	美元 12,193	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(116)
英镑 24,890	美元 27,074	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(722)
英镑 21,960	美元 23,671	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(853)
英镑 38,361	美元 41,044	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,797)
英镑 51,913	美元 56,053	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,922)
英镑 46,724	美元 50,218	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,962)
纽元 322,387	美元 179,761	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(2,609)
美元 1,404	离岸人民币 10,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1)
美元 1,128	离岸人民币 8,032	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1)
美元 1,567	纽元 2,767	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 1,666	澳元 2,578	2022年10月21日	法国巴黎银行	(8)
美元 417	离岸人民币 2,910	2022年10月21日	法国巴黎银行	(9)
美元 539	离岸人民币 3,753	2022年10月21日	法国巴黎银行	(12)
美元 12,060	纽元 21,294	2022年10月21日	法国巴黎银行	(14)
美元 1,564	澳元 2,408	2022年10月21日	法国巴黎银行	(15)
美元 18,916	离岸人民币 134,699	2022年10月21日	法国巴黎银行	(17)
美元 1,190	离岸人民币 8,365	2022年10月21日	法国巴黎银行	(17)
美元 1,262	离岸人民币 8,847	2022年10月21日	法国巴黎银行	(21)
美元 1,490	离岸人民币 10,445	2022年10月21日	法国巴黎银行	(24)
美元 1,223	离岸人民币 8,525	2022年10月21日	法国巴黎银行	(27)
美元 1,434	离岸人民币 10,000	2022年10月21日	法国巴黎银行	(31)
美元 2,369	离岸人民币 16,623	2022年10月21日	法国巴黎银行	(37)
美元 3,195	离岸人民币 22,415	2022年10月21日	法国巴黎银行	(49)
美元 1,792	离岸人民币 12,381	2022年10月21日	法国巴黎银行	(55)
美元 1,740	离岸人民币 12,008	2022年10月21日	法国巴黎银行	(55)
美元 2,769	离岸人民币 19,287	2022年10月21日	法国巴黎银行	(63)
美元 3,019	离岸人民币 21,060	2022年10月21日	法国巴黎银行	(64)
美元 2,478	英镑 2,156	2022年10月21日	法国巴黎银行	(71)
美元 5,896	离岸人民币 41,427	2022年10月21日	法国巴黎银行	(83)
美元 3,178	离岸人民币 22,034	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	(87)
美元 2,888	英镑 2,500	2022年10月21日	法国巴黎银行	(97)
美元 1,807	纽元 2,986	2022年10月21日	法国巴黎银行	(117)
美元 4,348	离岸人民币 30,000	2022年10月21日	法国巴黎银行	(138)
美元 1,839	纽元 3,000	2022年10月21日	法国巴黎银行	(142)
美元 4,644	离岸人民币 32,000	2022年10月21日	法国巴黎银行	(155)
美元 18,711	离岸人民币 132,120	2022年10月21日	法国巴黎银行	(174)
美元 3,870	加元 5,065	2022年10月21日	法国巴黎银行	(185)
美元 30,497	离岸人民币 215,949	2022年10月21日	法国巴黎银行	(198)
美元 11,766	纽元 20,416	2022年10月21日	法国巴黎银行	(216)
美元 15,440	离岸人民币 108,488	2022年10月21日	法国巴黎银行	(218)
美元 23,763	离岸人民币 167,793	2022年10月21日	法国巴黎银行	(221)
美元 14,270	离岸人民币 100,000	2022年10月21日	法国巴黎银行	(239)
美元 15,060	离岸人民币 105,537	2022年10月21日	法国巴黎银行	(252)
美元 6,994	澳元 10,436	2022年10月21日	法国巴黎银行	(282)
美元 14,722	离岸人民币 102,547	2022年10月21日	法国巴黎银行	(334)
美元 16,255	离岸人民币 113,312	2022年10月21日	法国巴黎银行	(356)
美元 6,800	澳元 10,000	2022年10月21日	法国巴黎银行	(369)
美元 14,765	离岸人民币 102,030	2022年10月21日	法国巴黎银行	(449)
美元 29,357	离岸人民币 205,993	2022年10月21日	法国巴黎银行	(455)
美元 14,292	离岸人民币 98,474	2022年10月21日	法国巴黎银行	(476)
美元 21,154	离岸人民币 147,329	2022年10月21日	法国巴黎银行	(483)
美元 15,529	离岸人民币 107,153	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	(494)
美元 10,785	英镑 9,202	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(508)
美元 9,090	纽元 15,033	2022年10月21日	法国巴黎银行	(586)
美元 25,800	离岸人民币 179,635	2022年10月21日	法国巴黎银行	(595)
美元 17,580	纽元 29,712	2022年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(773)
美元 39,829	离岸人民币 277,813	2022年10月21日	法国巴黎银行	(849)
美元 19,847	澳元 29,437	2022年10月21日	法国巴黎银行	(916)
美元 17,936	澳元 26,431	2022年10月21日	法国巴黎银行	(939)
美元 39,335	离岸人民币 273,022	2022年10月21日	法国巴黎银行	(1,028)
美元 34,821	离岸人民币 240,626	2022年10月21日	法国巴黎银行	(1,060)
美元 67,661	离岸人民币 469,042	2022年10月21日	法国巴黎银行	(1,851)
美元 89,316	离岸人民币 621,874	2022年10月21日	法国巴黎银行	(2,061)
美元 129,624	离岸人民币 908,700	2022年10月21日	法国巴黎银行	(2,125)
美元 87,831	离岸人民币 608,858	2022年10月21日	法国巴黎银行	(2,403)
美元 121,074	离岸人民币 844,000	2022年10月21日	法国巴黎银行	(2,654)
美元 97,784	离岸人民币 677,411	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	(2,738)
美元 44,711	纽元 73,946	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	(2,881)
美元 143,298	离岸人民币 998,000	2022年10月21日	法国巴黎银行	(3,270)
美元 128,294	离岸人民币 888,770	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	(3,592)
美元 125,407	离岸人民币 866,602	2022年10月21日	法国巴黎银行	(3,816)
美元 149,919	加元 200,000	2022年10月21日	法国巴黎银行	(4,372)
美元 56,462	纽元 92,037	2022年10月21日	法国巴黎银行	(4,398)
美元 98,681	加元 129,475	2022年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(4,457)
美元 128,148	澳元 185,475	2022年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(8,870)
美元 660,135	离岸人民币 4,576,692	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	(17,986)
美元 1,690,150	离岸人民币 11,799,211	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(34,621)
美元 6,957,983	英镑 6,041,190	2022年10月21日	加拿大皇家银行	(211,369)
美元 54,116,509	离岸人民币 377,796,006	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,108,533)
美元 70,200,387	离岸人民币 490,080,133	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,437,998)

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 30,326,430	纽元 50,343,113	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,848,035)
美元 64,290,685	加元 84,815,885	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	(2,567,216)
美元 76,383,210	澳元 113,572,251	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	(3,345,804)
美元 357,072,929	离岸人民币 2,492,783,250	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(7,314,351)
美元 15,159,504	印尼盾 230,000,000,000	2022年10月25日	渣打银行, 伦敦	(66,155)
美元 15,168,502	印尼盾 230,000,000,000	2022年10月25日	渣打银行, 伦敦	(75,153)
澳元 333,287	美元 214,430	2022年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(10)
加元 249,274	美元 180,972	2022年11月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(441)
离岸人民币 7,878	美元 1,106	2022年11月21日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 7,835	美元 1,100	2022年11月21日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 34,459	美元 4,837	2022年11月21日	美林国际, 伦敦	(1)
离岸人民币 218,947	美元 30,730	2022年11月21日	法国巴黎银行	(9)
离岸人民币 372,756	美元 52,317	2022年11月21日	法国巴黎银行	(15)
离岸人民币 1,757,626	美元 246,686	2022年11月21日	法国巴黎银行	(71)
离岸人民币 6,920,208	美元 971,397	2022年11月21日	美林国际, 伦敦	(149)
英镑 16,724	美元 18,612	2022年11月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(71)
纽元 145,479	美元 82,039	2022年11月21日	加拿大皇家银行	(272)
离岸人民币				
63,500,000	美元 8,771,263	2023年1月13日	Citibank N.A., 伦敦	(158,369)
韩元 20,250,000,000	美元 14,216,113	2023年1月13日	Citibank N.A., 伦敦	(7,644)
墨西哥比索				
75,000,000	美元 3,659,200	2023年1月13日	香港上海汇丰银行有限公司	(1,197)
泰铢 160,000,000	美元 4,262,484	2023年1月13日	渣打银行, 伦敦	(16,144)
泰铢 260,000,000	美元 6,877,779	2023年1月13日	渣打银行, 伦敦	(74,991)
台币 225,000,000	美元 7,097,210	2023年1月13日	Citibank N.A., 伦敦	(53,216)
台币 230,000,000	美元 7,244,072	2023年1月13日	Citibank N.A., 伦敦	(65,253)
美元 332,217	印尼盾 5,000,000,000	2023年1月13日	Citibank N.A., 伦敦	(4,994)
美元 13,972,715	新加坡元 20,000,000	2023年1月13日	渣打银行, 伦敦	(9,843)
美元 3,683,327	墨西哥比索 75,000,000	2023年1月13日	Citibank N.A., 伦敦	(22,930)
美元 7,220,323	离岸人民币 50,800,000	2023年1月13日	Citibank N.A., 伦敦	(76,617)
美元 4,855,440	林吉特 22,000,000	2023年1月13日	渣打银行, 伦敦	(83,459)
美元 7,203,045	澳元 11,000,000	2023年1月13日	香港上海汇丰银行有限公司	(115,965)
美元 14,097,631	澳元 21,700,000	2023年1月13日	香港上海汇丰银行有限公司	(116,755)
美元 15,023,698	印度卢比 1,208,000,000	2023年1月13日	Citibank N.A., 伦敦	(313,513)
美元 6,869,831	纽元 11,500,000	2023年1月13日	香港上海汇丰银行有限公司	(360,566)
美元 14,603,752	韩元 20,250,000,000	2023年1月13日	Citibank N.A., 伦敦	(379,994)
美元 21,464,334	澳元 31,934,429	2023年1月13日	美国道雷银行	(889,620)
美元 62,437,319	新加坡元 87,720,000	2023年1月13日	高盛国际, 伦敦	(1,196,159)
美元 5,912,625	林吉特 27,000,000	2023年2月13日	渣打银行, 伦敦	(44,704)
美元 9,043,785	林吉特 41,000,000	2023年2月13日	渣打银行, 伦敦	(133,239)
美元 14,570,578	印尼盾 216,800,000,000	2023年5月31日	Citibank N.A., 伦敦	(444,584)
印尼盾				
230,000,000,000	美元 14,923,436	2023年6月26日	渣打银行, 伦敦	(53,231)
印尼盾				
230,000,000,000	美元 14,920,532	2023年6月26日	渣打银行, 伦敦	(56,135)
美元 30,783,027	印尼盾 460,000,000,000	2023年6月26日	Citibank N.A., 伦敦	(829,693)
			未实现总亏损	(23,730,703)
				-----
			未实现净亏损	(19,281,021)
				-----

(b) 以下为于九月三十日之未平仓期货合约：

	长仓／ (短仓) 的 合约数目	合约金额 美元	交割日期	标的资产	交易对手	未实现收益／ (亏损) 美元
<u>2023</u>						
Aust 10yr Bond Fut 125/12/2023	253	18,283,610	2023 年 12 月	10 年期澳大利亚 国债	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	27,906
					未实现总收益	27,906
US 10yr Note (CBT) 1219/12/202323	683	73,806,688	2023 年 12 月	10 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	(929,524)
US 5yr Note (CBT) 12/2329/12/2023	174	18,332,531	2023 年 12 月	5 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	(199,828)
US Ultra Bond (CBT) 19/12/202312/23	33	3,916,688	2023 年 12 月	30 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	(302,414)
					未实现总亏损	(1,431,766)
					未实现净亏损	(1,403,860)
<u>2022</u>						
Aust 10yr Bond Fut 15/12/2022	363	27,333,917	2022 年 12 月	10 年期澳大利亚 国债	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	37,444
US 10yr Note (CBT) 20/12/2022	(255)	(28,575,938)	2022 年 12 月	10 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	606,750
US 5yr Note (CBT) 30/12/2022	(498)	(53,538,891)	2022 年 12 月	5 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	1,937,531
					未实现总收益	2,581,725
US Ultra Bond (CBT) 20/12/2022	261	35,757,000	2022 年 12 月	30 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd, 伦敦	(3,339,984)
					未实现总亏损	(3,339,984)
					未实现净亏损	(758,259)

## 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列载于第十三页至第四十九页的财务报表，包括：

- 于二零二三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，包括主要会计政策及其他解释信息。

我们的意见

我们认为，该等财务报表已根据香港会计师公会颁布的《香港财务报告准则》真实而中肯地反映了贵基金于二零二三年九月三十日的财务状况及其截至该日止年度的财务交易及现金流量。

#### 意见的基础

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

我们相信，我们所获得的审计凭证能充足及适当地为我们的审计意见提供基础。

#### 独立性

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

#### 其他信息

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

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

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

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

## 管理层就财务报表需承担的责任

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

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

此外，贵基金管理层负责确保财务报表已遵照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。

## 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）

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

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

### 根据信托契约与证监会守则附录 E 的相关披露条文就相关事项作出的报告

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

罗兵咸永道会计师事务所  
执业会计师

香港，二零二四年一月二十四日

管理人及受托人的责任声明

管理人的责任

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

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

管理人亦务必遵照信托契约，采取合理措施预防和监测欺诈及其他不法行为。

受托人的责任

基金受托人务必：

- 确保管理人遵照信托契约管理本基金且确保投资及借款能力符合要求；
- 确保已保留充分的会计记录及其他记录；
- (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二零二三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

二零二四年一月二十四日

业绩记录（未经审计）

资产净值

财务期结算日	本基金资产净值	每份资产净值
30/9/23		
- 澳元对冲类别（每月派息）	澳元 116,529,684	澳元 6.10
- 加元对冲类别（每月派息）	加元 86,315,208	加元 6.18
- 英镑对冲类别（每月派息）	英镑 11,342,201	英镑 6.46
- 港元类别（每月派息）	港元 1,980,906,422	港元 6.64
- 纽元对冲类别（每月派息）	纽元 52,716,264	纽元 6.07
- PRC人民币对冲份额（累计）	人民币 1,389,825,131	人民币 11.26
- PRC人民币对冲份额（每月派息）	人民币 285,946,232	人民币 6.83
- PRC美元份额（累计）	美元 103,363,951	美元 10.10
- PRC美元份额（每月派息）	美元 13,922,104	美元 6.90
- 人民币对冲类别（累计）	人民币 52,730,828	人民币 11.80
- 人民币对冲类别（每月派息）	人民币 1,863,716,717	人民币 6.33
- 美元类别（累计）	美元 12,341,257	美元 11.31
- 美元类别（每月派息）	美元 324,128,294	美元 7.57
30/9/22		
- 澳元对冲类别（每月派息）	澳元 106,130,688	澳元 6.39
- 加元对冲类别（每月派息）	加元 78,934,141	加元 6.46
- 英镑对冲类别（每月派息）	英镑 5,603,013	英镑 6.75
- 港元类别（每月派息）	港元 2,038,454,890	港元 6.95
- 纽元对冲类别（每月派息）	纽元 46,587,636	纽元 6.36
- PRC人民币对冲份额（累计）	人民币 437,407,794	人民币 11.28
- PRC人民币对冲份额（每月派息）	人民币 351,740,162	人民币 7.15
- PRC美元份额（累计）	美元 128,311,762	美元 9.87
- PRC美元份额（每月派息）	美元 17,065,170	美元 7.20
- 人民币对冲类别（累计）	人民币 11,271,909	人民币 11.88
- 人民币对冲类别（每月派息）	人民币 2,280,668,217	人民币 6.62
- 美元类别（累计）	美元 10,505,581	美元 11.05
- 美元类别（每月派息）	美元 355,501,134	美元 7.90
30/9/21		
- 澳元对冲类别（每月派息）	澳元 191,366,724	澳元 8.32
- 加元对冲类别（每月派息）	加元 125,506,796	加元 8.42
- 英镑对冲类别（每月派息）	英镑 5,300,020	英镑 8.80
- 港元类别（每月派息）	港元 4,079,907,047	港元 8.98
- 纽元对冲类别（每月派息）	纽元 76,304,693	纽元 8.29
- PRC人民币对冲份额（累计）	人民币 791,153,106	人民币 13.62
- PRC人民币对冲份额（每月派息）	人民币 571,858,247	人民币 9.32
- PRC美元份额（累计）	美元 374,577,855	美元 12.12
- PRC美元份额（每月派息）	美元 30,423,683	美元 9.37
- 人民币对冲类别（累计）	人民币 15,519,544	人民币 14.34
- 人民币对冲类别（每月派息）	人民币 4,067,566,571	人民币 8.62
- 美元类别（累计）	美元 12,949,102	美元 13.57
- 美元类别（每月派息）	美元 652,534,891	美元 10.29

业绩记录 (未经审计) (续)

(续)

最高卖出价 / 最低买入价

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价	财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
30/9/23			30/9/18		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 6.73	澳元 6.02	- 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 6.81	加元 6.09	- 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 7.13	英镑 6.36	- 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 7.33	港元 6.55	- 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 6.70	纽元 5.99	- 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 12.07	人民币 10.69	- 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 7.54	人民币 6.74	- 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 10.64	美元 9.36	- 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 7.59	美元 6.79	- 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 12.71	人民币 11.26	- 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 6.98	人民币 6.24	- 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 11.92	美元 10.48	- 美元类别 (累计)	美元 12.30	美元 11.75
- 美元类别 (每月派息)	美元 8.33	美元 7.45	- 美元类别 (每月派息)	美元 11.13	美元 10.42
30/9/22			30/9/17		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.32	澳元 6.39	- 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 8.42	加元 6.46	- 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 8.80	英镑 6.75	- 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 8.97	港元 6.95	- 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 8.28	纽元 6.36	- 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 13.61	人民币 11.28	- 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 9.31	人民币 7.15	- 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 12.11	美元 9.87	- 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 9.37	美元 7.20	- 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 14.34	人民币 11.88	- 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 8.62	人民币 6.62	- 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 13.56	美元 11.05	- 美元类别 (累计)	美元 12.24	美元 11.60
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.28	美元 7.90	- 美元类别 (每月派息)	美元 11.63	美元 10.95
30/9/21			30/9/16		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.85	澳元 8.32	- 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 8.95	加元 8.42	- 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 9.34	英镑 8.80	- 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 9.50	港元 8.97	- 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 8.81	纽元 8.29	- 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 13.84	人民币 13.19	- 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 9.94	人民币 9.32	- 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 12.39	美元 12.03	- 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 9.97	美元 9.37	- 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 14.57	人民币 13.84	- 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 9.19	人民币 8.62	- 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 13.86	美元 13.41	- 美元类别 (累计)	美元 12.29	美元 11.09
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.93	美元 10.29	- 美元类别 (每月派息)	美元 11.73	美元 10.93
30/9/20			30/9/15		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.01	澳元 7.92	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.97	澳元 9.05
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.06	加元 8.00	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.95	加元 9.07
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.47	英镑 8.36	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.35	英镑 9.45
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.61	港元 8.51	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.46	港元 9.53
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.94	纽元 7.88	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.90	纽元 8.98
- 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 (累计)	人民币 10.92	人民币 10.12
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.98	人民币 8.89	- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.32	人民币 9.32
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12.05	美元 10.66	- 美元类别 (累计)	美元 11.83	美元 11.06
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.02	美元 8.92	- 美元类别 (每月派息)	美元 12.04	美元 10.97
- 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			30/9/14		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.98	澳元 8.48	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.05	澳元 9.41
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.02	加元 8.53	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.06	加元 9.42
- 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 10.54	港元 9.89
- 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 10.00	纽元 9.36
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.91	纽元 8.42	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 10.49	人民币 10.01
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 12.55	人民币 11.41	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.41	人民币 9.91
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.96	人民币 9.40	- 美元类别 (累计)	美元 11.61	美元 10.53
- PRC 美元份额 (累计)	美元 11.60	美元 10.58	- 美元类别 (每月派息)	美元 12.13	美元 11.36
- 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			



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

**管理人董事**

于二零二四年一月二十四日  
Ayaz Hatim EBRAHIM  
Daniel James WATKINS  
Ka Li NG  
Kit Yee Elka LEUNG  
Stiofan Seamus DEBURCA

**投资管理**

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

Tsun Kay Edwin CHAN

**受托人**

汇丰机构信托服务  
（亚洲）有限公司  
香港

**助理管理人**

二零二三年十月三十一日之前  
JPMorgan Asset Management

中环皇后大道中1号

(UK) Limited

60 Victoria Embankment  
London  
EC4Y 0JP  
United Kingdom

**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

