

仅供中国内地公众查阅



年度报告 — 2024年9月30日（经审核）

摩根亚洲总收益 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	11
金融衍生工具详情 - 未经审计	12
金融衍生工具风险敞口信息 - 未经审计	12
抵押品持有情况 - 未经审计	13
财务状况表	14
综合收益表	14
可赎回份额持有人应占净资产变动表	15
现金流量表	15
财务报表之附注	16 - 47
独立核数师报告	48 - 49
管理人及受托人的责任声明	50
受托人对份额持有人的报告	50
业绩纪录 - 未经审计	50 - 51
经营与管理	52

投资组合
于二零二四年九月三十日 (未经审计)

(续)

单位数目	占资产 公平值 美元	占资产 净值百 分比	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (99.1%)			Newcastle Coal Infrastru Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.4% 29Sep2027 (Partial Redemption)	美元 6,018,000	5,782,588 0.3
(I) 可转换证券 (4.8%)			Santos Finance Ltd Ser Regs (Reg S) 3.649% 29Apr2031	美元 5,000,000	4,623,239 0.3
中国 (3.1%)			Santos Finance Ltd Ser Regs (Reg S) 6.875% 19Sep2033	美元 7,900,000	8,715,025 0.5
JD.com Inc Ser 144A 0.25% Conv 01Jun2029	美元 1,900,000	2,186,123 0.1	Scentre Group Trust 1/2 Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.375% 28May2030	美元 4,000,000	4,034,632 0.2
Meituan (Reg) (Reg S) 0% Conv 27Apr2027	美元 13,400,000	13,048,250 0.8	Scentre Group Trust 2 Ser Regs (Reg S) Var 24Sep2080	美元 635,000	632,032 0.0
Meituan (Reg) (Reg S) 0% Conv 27Apr2028	美元 21,500,000	20,328,250 1.2	Transurban Finance Co Ser Regs (Reg S) 2.45% 16Mar2031	美元 6,000,000	5,226,956 0.3
Xiaomi Best Time Intl (Reg) (Reg S) 0% Conv 17Dec2027	美元 10,200,000	10,123,500 0.6	Westpac Banking Corp (Reg) Var 04Feb2030	美元 900,000	896,523 0.1
Zhongsheng Group (Reg) (Reg S) 0% Conv 21May2025	港元 40,000,000	5,832,693 0.4	Westpac Banking Corp (Reg) Var 15Nov2035	美元 4,900,000	4,326,210 0.3
韩国 (0.8%)			巴西 (0.5%)		
LG Chem Ltd (Reg) (Reg S) 1.25% Conv 18Jul2028	美元 13,600,000	13,345,472 0.8	Braskem Netherlands Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.5% 10Jan2028	美元 3,500,000	3,338,639 0.2
美国 (0.6%)			Cb Suzano Intl Fin B V 5.5% 17Jan2027	美元 1,600,000	1,648,614 0.1
Citigroup Global Markets Ser 1299 (Reg) (Reg S) 0% Conv 26Feb2026	港元 26,000,000	3,225,041 0.2	Suzano Austria Gmbh (Reg) 2.5% 15Sep2028	美元 2,000,000	1,834,218 0.1
Goldman Sachs Fin C Intl Ser 1MTN (Reg) 0% Conv 10May2027	美元 2,300,000	2,744,820 0.2	Suzano Austria Gmbh 3.75% 15Jan2031	美元 1,000,000	930,052 0.1
Goldman Sachs Fin C Intl Ser 700 (Reg) 0% Conv 15Mar2027	美元 2,400,000	3,046,800 0.2	智利 (0.3%)		
维京群岛 (0.3%)			Codelco Inc Ser Regs (Reg) (Reg S) 3% 30Sep2029	美元 2,000,000	1,849,083 0.1
Link Cb Ltd (Reg) (Reg S) 4.5% Conv 12Dec2027	港元 43,000,000	5,653,682 0.3	Empresa De Los Ferrocarr Ser Regs (Reg S) 3.068% 18Aug2050	美元 4,000,000	2,613,586 0.2
		79,534,631 4.8			

(II) 债务证券 (92.7%)			中国 (10.0%)		
澳大利亚 (3.7%)			Alibaba Group Holding (Reg) 4.2% 06Dec2047	美元 3,400,000	3,029,117 0.2
Apa Infrastructure Ltd 5.75% 16Sep2044	美元 1,367,000	1,390,856 0.1	Alibaba Group Holding 3.15% 09Feb2051	美元 5,000,000	3,605,928 0.2
Aust & Nz Banking Group Ser Regs (Reg S) 2.57% 25Nov2035	美元 8,500,000	7,455,932 0.5	Alibaba Group Holdings (Reg) 4.5% 28/11/2034	美元 3,000,000	3,004,270 0.2
Commonwealth Bank Aust Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.61% 12Sep2034	美元 4,628,000	4,366,765 0.3	Azure Orbit IV Intl Fin Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4% 25Jan2028	美元 1,800,000	1,781,862 0.1
Macquarie Bank Ltd Ser Regs (Reg S) Var 03Mar2036	美元 2,100,000	1,841,995 0.1	Bank of China Frn Perp 31Dec2049	美元 2,600,000	2,635,387 0.2
Macquarie Group Ltd Ser Regs (Reg S) Var 15Jun2034	美元 7,500,000	8,110,972 0.5	BOC Aviation USA Corp Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.875% 03May2033	美元 7,200,000	7,452,977 0.4
National Australia Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 02Aug2034	美元 3,493,000	3,364,022 0.2			

投资组合 (续)

于二零二四年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比
中国 (续)				Huarong Finance 2019			
Central Plaza Dev Ltd Ser				Ser EMTN (Reg S) Frn			
EMTN (Reg) (Reg S)				24Feb2025	美元 500,000	507,190	0.0
3.85% 14Jul2025	美元 1,700,000	1,675,579	0.1	Huarong Finance 2019			
China Cinda 2020 I				Ser EMTN (Regs) 4.5%	美元 2,200,000	2,139,258	0.1
Mngmn Ser EMTN (Reg)				29May2029			
(Reg S) 3% 20Jan2031	美元 9,100,000	8,106,118	0.5	Huarong Finance 2019			
China Cinda 2020 I				Ser GMTN (Reg S) Var	美元 2,800,000	2,764,799	0.2
Mngmn Ser EMTN (Reg)				Perp 31Dec2049			
(Reg S) 5.375%	美元 4,000,000	4,089,005	0.2	Huarong Finance II Co			
23Jul2027				Ltd (Reg) (Reg S) 4.625	美元 3,000,000	3,005,879	0.2
China Cinda 2020 I				03Jun2026			
Mngmn Ser EMTN (Reg)				JD.com Inc 4.125%	美元 7,000,000	6,055,108	0.4
(Reg S) 5.75%	美元 3,410,000	3,587,826	0.2	14Jan2050			
28May2029				Jinan URB Const Intl Inv			
China Greatwall Vi (Reg)				(Reg) (Reg S) 2.4%	美元 2,800,000	2,633,541	0.2
(Reg S) 4.25%	美元 1,400,000	1,416,159	0.1	23Sep2026			
28Apr2025				Lenovo Group Ltd Ser			
China Greatwall Vi (Reg)				Regs (Reg S) 3.421%	美元 5,800,000	5,483,399	0.3
(Reg S) 6.375%	美元 600,000	627,412	0.0	02Nov2030			
02Jan2028				Longfor Holdings Ltd			
China Grt Wall Intl Iii Ser				(Reg) (Reg S) 3.95%	美元 1,500,000	1,106,890	0.1
EMTN (Reg) (Reg S)				16Sep2029			
3.875% 31Aug2027	美元 800,000	775,210	0.0	Longfor Properties (Reg)			
China Huadian Overseas				(Reg S) 4.5%	美元 1,300,000	1,076,855	0.1
(Reg) (Reg S) Var Perp				16Jan2028			
31Dec2049	美元 2,500,000	2,495,231	0.2	Meituan Ser Regs	美元 2,759,000	2,745,629	0.2
CN Huaneng Gp HK				4.625000 % 02Oct2029			
Treasur (Reg) (Reg S)				Prosus Nv Ser Regs (Reg	美元 3,200,000	3,027,690	0.2
Var Perp 31Dec2049	美元 4,900,000	4,839,599	0.3	S) 4.193% 19Jan2032			
Dianjian Haiyu Ltd (Reg)				Prosus Nv Ser Regs (Reg	美元 1,900,000	1,624,541	0.1
(Reg S) Var Perp				S) 4.987% 19Jan2052			
31Dec2049	美元 6,400,000	6,304,209	0.4	Prosus NV Ser Regs (Reg)			
ENN Clean Energy Ser				(Reg S) 3.68%	美元 1,600,000	1,520,895	0.1
Regs (Reg S) 3.375%				21Jan2030			
12May2026	美元 7,100,000	6,988,571	0.4	Prosus Nv Ser Regs (Reg)			
Far East Horizon Ltd Ser				(Reg S) 3.832%	美元 2,200,000	1,561,853	0.1
EMTN (Reg) (Reg S)				08Feb2051			
4.25% 26Oct2026	美元 3,000,000	2,957,553	0.2	Talent Yield Intntnl (Reg)			
Far East Horizon Ltd Ser				(Reg S) 3.125%	美元 4,600,000	4,293,623	0.2
EMTN (Reg) (Reg S)				06May2031			
6.625% 16Apr2027	美元 2,902,000	3,027,130	0.2	Tencent Holdings Ltd			
Franshion Brilliant Ltd				Ser Regs (Reg S) 3.84%	美元 13,400,000	11,097,411	0.7
(Reg) (Reg S) 3.2%				22Apr2051			
09Apr2026	美元 2,600,000	2,475,782	0.1	Tencent Holdings Ltd			
Geely Automobile (Reg)				Ser Regs (Reg) (Regs)	美元 3,000,000	2,765,152	0.2
(Reg S) Var Perp				3.925% 19Jan2038			
31Dec2049	美元 4,625,000	4,662,700	0.3	Tencent Music Ent Grp			
GLP China Holdings Ltd				(Reg) 2% 03Sep2030	美元 1,700,000	1,481,542	0.1
Ser EMTN (Reg) (Reg S)				Vanke Real Estate Hk Ser			
2.95% 29Mar2026	美元 800,000	706,131	0.0	EMTN (Reg) (Reg S)	美元 1,000,000	909,543	0.1
Huarong Finance 2017 Co				3.15% 12May2025			
(Reg) (Reg S) 3.8%	新加坡元			Vanke Real Estate HK Ser			
07Nov2025	2,000,000	1,572,210	0.1	EMTN (Reg) (Reg S)	美元 1,100,000	756,958	0.0
Huarong Finance 2017 Co				3.975% 09Nov2027			
4.75% 27Apr2027	美元 3,700,000	3,687,307	0.2	Weibo Corp (Reg)	美元 7,469,000	6,923,272	0.4
Huarong Finance 2017 Co				3.375% 08Jul2030			
Ser EMTN (Reg) (Reg S)				Xiaomi Best Time Intl Ser			
4.25% 07Nov2027	美元 6,500,000	6,366,035	0.4	Regs (Reg) (Reg S)	美元 5,400,000	4,458,396	0.3
Huarong Finance 2019				4.1% 14Jul2051			
Ser EMTN (Reg S) 3.25%				Yanlord Land HK Co Ltd			
13Nov2024	美元 2,800,000	2,832,363	0.2	(Reg) (Reg S) 5.125%	美元 500,000	478,450	0.0
				20May2026			

投资组合 (续)
于二零二四年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比
中国 (续)				FWD Group Holdings Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 7.635% 02Jul2031	美元 3,300,000	3,650,060	0.2
Yunda Holding Inv (Reg) (Reg S) 2.25% 19Aug2025	美元 4,400,000	4,283,796	0.2	FWD Group Holdings Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 8.4% 05Apr2029	美元 3,500,000	3,832,742	0.2
Zhongsheng Group (Reg) (Reg S) 5.98% 30Jan2028	美元 1,566,000	1,571,784	0.1	FWD Group Ltd Ser EMTN (Reg S) Var Perp	美元 800,000	802,320	0.0
哥伦比亚 (1.4%)				Goodman HK Finance Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3% 22Jul2030	美元 1,000,000	907,821	0.1
Colombia (Rep of) (Reg) 8.75% 14Nov2053	美元 3,000,000	3,397,532	0.2	Hongkong Land Finance Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.25% 14Jul2033	美元 1,510,000	1,572,264	0.1
Colombia (Rep of) 3.125% 15Apr2031	美元 2,000,000	1,685,819	0.1	Melco Resorts Finance 4.875% 06Jun2025	美元 6,000,000	6,042,228	0.4
Ecopetrol SA (Reg) 8.625% 19Jan2029	美元 5,000,000	5,484,240	0.4	Melco Resorts Finance Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.25% 26Apr2026	美元 6,400,000	6,433,313	0.4
Ecopetrol SA (Reg) 8.875% 13Jan2033	美元 3,000,000	3,276,627	0.2	Melco Resorts Finance Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.625% 17Jul2027	美元 2,900,000	2,858,882	0.2
Republic of Colombia (Reg) 3.875% 25Apr2027	美元 7,000,000	6,879,976	0.4	Melco Resorts Finance Ser Regs (Reqs) 5.75% 21Jul2028	美元 3,900,000	3,819,346	0.2
Republic of Colombia (Reg) 4.5% 28/01/2026	美元 2,000,000	1,997,474	0.1	Nan Fung Treasury Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5% 05Sep2028	美元 2,000,000	1,989,473	0.1
哥斯达黎加 (0.2%)				Nan Fung Treasury Ltd Ser EMTN (Reg) (Reqs) 3.625% 27Aug2030	美元 4,451,000	4,083,942	0.2
Costa Rica Government Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.125% 19Feb2031	美元 3,000,000	3,139,706	0.2	NWD MTN Ltd (Reg) (Reg S) 4.125% 18Jul2029	美元 8,300,000	6,363,627	0.4
法国 (0.3%)				NWD MTN Ltd (Reg) (Reg S) 8.625% 08Feb2028	美元 2,300,000	2,185,195	0.1
BPCE SA Ser 144A Var 19Oct2029	美元 2,000,000	2,199,125	0.1	Prudential Funding (Asia) Plc (Reg) (Reg S) Var 03Nov2033	美元 8,500,000	7,993,764	0.5
Unibail-Rodamco Se 3.28% 26Mar2025	港元 26,000,000	3,381,574	0.2	印度 (13.4%)			
香港 (5.6%)				ABJA Investment Co (Reg) (Reg S) 5.45% 24Jan2028	美元 9,800,000	10,121,700	0.6
AIA Group Ltd Ser GMTN (Reg) (Reg S) Var 09Sep2033	欧元 1,700,000	1,703,566	0.1	Axis Bank Gift City Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 9,900,000	9,471,770	0.6
AIA Group Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.2% 16Sep2040	美元 3,500,000	2,756,057	0.2	Azure Power Energy Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.575% 19Aug2026	美元 8,203,000	6,141,748	0.4
AIA Group Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.375% 05Apr2034	美元 2,000,000	2,118,506	0.1	Azure Power Solar Energy Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.65% 24Dec2024	美元 2,600,000	2,655,181	0.2
Airport Authority HK (Reg) (Reg S) VAR Perp 2.4%	美元 8,000,000	7,585,207	0.5	Continuum Energy Aura Ser Regs (Reg S) 9.5% 24Feb2027	美元 7,500,000	7,954,529	0.5
Bank of East Asia Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 13Mar2027	美元 4,000,000	4,095,108	0.2	Delhi International Airport Limited Ser Regs (Reg) 6.125% 31Oct2026	美元 1,500,000	1,554,568	0.1
Bank of East Asia Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 27Jun2034	美元 4,884,000	5,169,599	0.3				
CAS Capital No1 Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 5,300,000	5,137,504	0.3				
Champion MTN Ltd Ser EMTN (Reg S) 2.85% 20Jun2025	港元 14,000,000	1,795,379	0.1				
Dah Sing Bank Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 02Nov2031	美元 2,800,000	2,707,834	0.2				
Dah Sing Bank Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 15Nov2033	美元 7,000,000	7,682,385	0.5				

投资组合 (续)

于二零二四年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
印度 (续)				Network I2I Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049			
Delhi Intl Airport Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.45% 04Jun2029	美元 3,700,000	3,893,186	0.2	美元 5,200,000	5,349,801	0.3	
GMR Hyderabad Internatio Ser Regs (Regs) 4.25% 27Oct2027	美元 5,371,000	5,254,640	0.3	Periama Holdings Llc/De (Reg) (Reg S) 5.95% 19Apr2026	美元 3,550,000	3,639,948	0.2
Greenko Dutch BV Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.85% 29Mar2026	美元 11,000,000	9,520,990	0.6	Piramal Capital & Hous Ser EMTN (Reg) (Reg S) 7.8% 29Jan2028	美元 2,985,000	3,099,021	0.2
Greenko Power II Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.3% 13Dec2028	美元 2,000,000	1,659,047	0.1	Power Finance Corp Ltd Ser GMTN (Reg) (Reg S) 3.35% 16May2031	美元 1,800,000	1,662,032	0.1
Greenko Solar Mauritius Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.55% 29Jan2025	美元 7,300,000	7,353,836	0.4	REC Ltd Ser Regs (Reg S) 4.75% 27Sep2029	美元 3,300,000	3,302,547	0.2
Greenko Solar Mauritius Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.95% 29Jul2026	美元 5,700,000	5,749,645	0.3	Reliance Industries 6.25% 19Oct2040	美元 3,600,000	4,086,896	0.2
Greenko Wind Projects Mu Ser Regs (Reg S) 5.5% 06Apr2025	美元 3,100,000	3,167,115	0.2	Shriram Finance Ltd Ser Regs (Reg S) 6.625% 22Apr2027	美元 8,300,000	8,845,284	0.5
HDFC Bank Ltd Ser Regs (Reg S) Var Perp	美元 13,300,000	12,762,933	0.8	SMRC Automotive Holdings Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.625% 11Jul2029	美元 2,012,000	2,099,130	0.1
Hindustan Petroleum Corp (Reg) (Reg S) 4% 12Jul2027	美元 3,300,000	3,285,860	0.2	TML Holdings Pte Ltd (Reg) (Reg S) 4.35% 09Jun2026	美元 3,950,000	3,957,577	0.2
HPCL-Mittal Energy Ltd (Reg) (Reg S) 5.25% 28Apr2027	美元 4,700,000	4,751,994	0.3	Ultratech Cement Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.8% 16Feb2031	美元 2,388,000	2,114,931	0.1
HPCL-Mittal Energy Ltd Ser EMTN (Reg S) 5.45% 22Oct2026	美元 3,300,000	3,360,871	0.2	印度尼西亚 (18.3%)			
India Clean Energy Hldg Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.5% 18Apr2027	美元 11,600,000	11,249,251	0.7	Bank Negara Indonesia (Reg S) Var Perp	美元 6,300,000	6,068,066	0.4
India Green Power Hold Ser Regs (Reg) (Reg S) 4% 22Feb2027	美元 11,570,000	10,384,549	0.6	Bank Negara Indonesia Ser EMTN (Reg S) 5.28% 05Apr2029	美元 5,416,000	5,688,099	0.3
Indian Railway Finance (Reg) (Regs) 3.835% 13/12/2027	美元 4,200,000	4,180,040	0.3	Dominican (Rep of) Ser Regs (Reg) 6.875% 29Jan2026	美元 5,000,000	5,156,701	0.3
Indian Railway Finance Ser Regs (Reg S) 3.249% 13Feb2030	美元 3,300,000	3,106,480	0.2	Freeport Indonesia PT Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.315% 14Apr2032	美元 4,700,000	4,897,455	0.3
Indian Railway Finance Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.8% 10Feb2031	美元 5,400,000	4,846,766	0.3	Freeport Indonesia Pt Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.2% 14Apr2052	美元 6,000,000	6,562,729	0.4
IRB Infrastructure Deve Ser Regs (Reg S) 7.11% 11Mar2032	美元 9,500,000	9,934,150	0.6	Hutama Karya Persero PT Ser Regs (Reg S) 3.75% 11May2030	美元 12,500,000	12,174,792	0.7
JSW Infrastructure Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.95% 21Jan2029	美元 11,970,000	11,772,471	0.7	Indika Energy Capital IV Ser Regs (Reg) (Reg S) 8.25% 22Oct2025	美元 7,700,000	8,031,096	0.5
JSW Steel Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.05% 05Apr2032	美元 8,300,000	7,836,419	0.5	Indika Inti Energi Pt Ser Regs (Reg S) 8.75% 07May2029	美元 2,000,000	2,117,972	0.1
Muthoot Finance Ltd Ser Regs (Reg S) 7.125% 14Feb2028	美元 10,600,000	11,186,722	0.7	Indonesia (Rep of) (Reg) 4.3% 31Mar2052	美元 5,000,000	4,541,465	0.3
Network I2I Ltd Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 11,300,000	11,164,628	0.7	Indonesia (Rep of) (Reg) 5.65% 11Jan2053	美元 3,500,000	3,849,845	0.2
				Indonesia (Rep of) 3.2% 23Sep2061	美元 4,000,000	2,809,415	0.2
				Indonesia (Rep of) Ser 103 6.75% 15Jul2035	113,363,000,000	7,727,226	0.5

投资组合 (续)

于二零二四年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
印度尼西亚 (续)				Perusahaan Listrik			
Indonesia (Rep of) Ser Fr68 8.375% 15Mar2034	印尼盾 30,000,000,000	2,244,289	0.1	Negar Ser Regs (Reg) 6.15% 21May2048	美元 8,600,000	9,247,110	0.6
Indonesia (Rep of) Ser Fr80 7.5% 15Jun2035	印尼盾 150,000,000,000	10,730,171	0.7	PT Adaro Indonesia Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.25% 31Oct2024	美元 16,800,000	17,061,767	1.0
Indonesia (Rep of) Ser Fr83 7.5% 15Apr2040	印尼盾 158,000,000,000	11,508,556	0.7	PT Bank Tabungan Negara (Reg) (Reg S) 4.2% 23Jan2025	美元 4,300,000	4,309,599	0.3
Indonesia (Rep of) Ser Fr91 6.375% 15Apr2032	印尼盾 130,000,000,000	8,799,825	0.5	PT Indonesia Asahan Aluminium and Pt Mineral Industri Indonesia (Persero) Ser Regs (Reg S) 5.45% 15May2030	美元 4,000,000	4,168,928	0.3
Indonesia (Rep of) Ser Fr98 7.125% 15Jun2038	印尼盾 393,246,000,000	27,598,973	1.7	PT Indonesia Asahan Aluminium And Pt Mineral Industri Indonesia (Persero) Ser Regs (Reg S) 5.8% 15May2050	美元 3,200,000	3,265,764	0.2
Indonesia (Rep of) Ser Regs 5.95% 08Jan2046	美元 6,000,000	6,804,573	0.4	PT Indonesia Asahan Aluminium and Pt Mineral Industri Indonesia (Persero) Ser Regs (Reg S) 6.53% 15Nov2028	美元 2,600,000	2,826,943	0.2
Indonesia (Rep of) Ser Regs 6.625% 17Feb2037	美元 10,000,000	11,781,152	0.7	PT Indonesia Asahan Aluminium and Pt Mineral Ser Regs (Reg S) 4.75% 15May2025	美元 9,575,000	9,729,708	0.6
Indonesia (Rep of) Ser Regs 8.5Pct 12/10/2035	美元 1,500,000	2,037,229	0.1	PT Pelabuhan Indo li Ser Regs (Reg S) 5.375% 05/05/2045	美元 8,300,000	8,547,237	0.5
Listrindo Capital BV Ser Regs (Reg) (Regs) 4.95% 14/09/2026	美元 12,350,000	12,194,310	0.7	PT Pertamina (Persero) Ser Regs (Reg S) 4.7% 30Jul2049	美元 2,000,000	1,822,472	0.1
LLPL Capital Pte Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.875% 04Feb2039	美元 6,500,000	5,139,533	0.3	国际 (0.6%)			
Majapahit Holding Bv Ser Regs 7.875Pct 29/06/2037	美元 21,600,000	26,763,863	1.6	European Investment Bank Ser EMTN (Reg) (Reg S) 9.25% 28Jan2027	巴西雷亚尔 28,945,000	5,531,562	0.3
Medco Bell Pte Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.375% 30Jan2027	美元 3,224,000	3,247,071	0.2	Intl Bk Recon & Develop Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.75% 14Jan2028	巴西雷亚尔 25,000,000	4,169,057	0.3
Medco Laurel Tree Ser Regs (Reg S) 6.95% 12Nov2028	美元 3,400,000	3,494,716	0.2	爱尔兰 (0.2%)			
Medco Oak Tree Pte Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 7.375% 14May2026	美元 6,000,000	6,264,456	0.4	Avolon Holdings Fndg Ltd Ser Regs (Reg S) 6.375% 04May2028	美元 3,500,000	3,751,196	0.2
Minejesa Capital BV Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 10Aug2030	美元 4,000,000	3,418,220	0.2	日本 (4.3%)			
Minejesa Capital BV Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.625% 10Aug2037	美元 5,600,000	5,435,823	0.3	Chiba Bank Ltd Ser EMTN (Reg S) 2.65% 30Oct2024	美元 350,000	353,219	0.0
Pelabuhan Indonesia III Ser Regs 4.875% 01Oct2024	美元 2,400,000	2,460,000	0.2	Jera Co Inc (Reg) (Reg S) 4.614% 04Sep2029	美元 2,600,000	2,621,723	0.2
Pertamina Geothermal Ene Ser Regs (Reg S) 5.15% 27Apr2028	美元 700,000	728,538	0.0	Kyushu Electric Power Co (Reg) 4.447000 % 02Oct2029	美元 10,000,000	10,023,370	0.6
Pertamina Persero Pt Ser Regs (Reg) 6.5% 07Nov2048	美元 6,200,000	7,171,075	0.4	Meiji Yasuda Life Insura Ser Regs (Reg S) Var 11Sep2054	美元 6,666,000	6,877,354	0.4
Pertamina Persero Ser (Regs) 6.45% 30May2044	美元 7,400,000	8,372,102	0.5				
Pertamina Persero Ser Regs (Reg) 6Pct 03/05/2042	美元 6,500,000	7,038,276	0.4				

投资组合 (续)

于二零二四年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比
日本 (续)				Korea Inv & Secs Co Ltd			
Meiji Yasuda Life Insura Ser Regs (Regs) 5.2% 20/10/2045	美元 4,000,000	4,105,838	0.2	(Reg) (Reg S) 6.875% 06Nov2026	美元 4,600,000	4,914,442	0.3
Mitsubishi Ufj Fin Grp (Reg) Var 11Oct2025	美元 4,200,000	4,213,933	0.3	Korea National Oil Corp Ser Regs 4.250000 % 30Sep2029	美元 2,675,000	2,662,515	0.2
Mitsubishi Ufj Fin Grp (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 2,500,000	2,808,853	0.2	Korearehabnresource (Reg) (Reg S) 5.125% 08May2029	美元 5,518,000	5,761,367	0.3
Mizuho Financial Group (Reg) Var 16Jul2030	美元 4,500,000	4,264,507	0.3	Kyobo Life Insurance Co Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 9,500,000	9,956,686	0.6
Mizuho Financial Group 2.564% 13Sep2031	美元 3,800,000	3,267,054	0.2	LGenergy solution Ser Regs (Reg S) 5.375% 02Jul2027	美元 6,160,000	6,330,995	0.4
Nippon Life Insurance Ser Regs (Reg S) Var 16Apr2054	美元 2,900,000	3,108,721	0.2	LGenergy solution Ser Regs (Reg S) 5.375% 02Jul2029	美元 2,148,000	2,229,205	0.1
Nippon Life Insurance Ser Regs (Reg S) Var 23Jan2050	美元 3,000,000	2,797,165	0.2	Mirae Asset Securities (Reg) (Reg S) 5.5% 31Jul2027	美元 5,035,000	5,150,475	0.3
Nippon Life Insurance Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 16Sep2051	美元 1,000,000	869,699	0.1	Shinhan Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.375% 13Apr2032	美元 3,000,000	2,928,539	0.2
Nissan Motor Co Ser Regs (Reg S) 3.522% 17Sep2025	美元 5,800,000	5,712,685	0.3	Shinhan Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.75% 15Apr2034	美元 2,800,000	2,982,866	0.2
Norinchukin Bank Ser Regs (Reg S) 4.867% 14Sep2027	美元 4,900,000	4,943,761	0.3	Shinhan Financial Group Ser Regs (Reg) (Reg S) 5% 24Jul2028	美元 3,600,000	3,698,610	0.2
Rakuten Group Inc Ser Regs (Reg S) 11.25% 15Feb2027	美元 2,200,000	2,441,762	0.1	Shinhan Financial Group Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 05Feb2030	美元 3,000,000	3,009,026	0.2
Rakuten Group Inc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	欧元 2,400,000	2,353,115	0.1	Shinhan Financial Group Ser Regs (Reg)(Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 6,000,000	5,805,934	0.4
Sumitomo Life Insur Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 6,855,000	7,186,914	0.4	SK Hynix Inc Ser Regs (Reg S) 5.5% 16Jan2029	美元 2,500,000	2,610,788	0.2
Sumitomo Mitsui Finance (Reg) (Reg S) 2.512% 22Jan2025	美元 3,400,000	3,390,276	0.2	SK Hynix Inc Ser Regs (Reg S) 6.375% 17Jan2028	美元 1,400,000	1,490,318	0.1
韩国 (7.2%)				科威特 (0.3%)			
Hana Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 1,600,000	1,558,520	0.1	SK Hynix Inc Ser Regs (Reg S) 6.5% 17Jan2033	美元 7,700,000	8,602,922	0.5
Hanwha Life Insurance Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 04Feb2032	美元 7,650,000	7,431,876	0.4	Tongyang life insurance Co (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 3,200,000	3,186,190	0.2
Hyundai Capital Services Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.125% 05Feb2029	美元 3,100,000	3,195,036	0.2	Woori Bank (Reg S) 5.125% 06Aug2028	美元 4,000,000	4,067,458	0.2
Hyundai Card Co Ltd (Reg) (Reg S) 5.75% 24Apr2029	美元 5,378,000	5,732,810	0.3	Woori Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 4.25%	美元 7,950,000	8,108,335	0.5
KB Capital Co Ltd (Reg) (Reg S) 1.5% 28Oct2025	美元 1,360,000	1,320,546	0.1	Woori Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 6.375%	美元 4,654,000	4,841,645	0.3
Kookmin Bank Ser GMTN (Reg) (Reg S) 4.5% 01Feb2029	美元 6,900,000	6,870,099	0.4	科威特 (0.3%)			
Korea Housing Finance Co Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 24Feb2033	美元 5,650,000	5,704,344	0.3	Equate Petrochemical BV Ser Regs (Reg) (Regs) 4.25% 03Nov2026	美元 2,850,000	2,868,603	0.2
				Meglobal Canada Ulc Ser Regs (Reg S) 5% 18May2025	美元 2,000,000	2,036,133	0.1

投资组合 (续)

于二零二四年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
澳门 (5.4%)				BBVA Bancomer SA Texas			
Champion Path				Ser Regs (Reg) (Reg S)			
Holdings (Reg) (Reg S)				Var 13Sep2034	美元 2,000,000	1,953,503	0.1
4.5% 27Jan2026	美元 2,400,000	2,365,069	0.1	BBVA Bancomer SA Texas			
Champion Path				Var 18Jan2033	美元 3,700,000	3,561,046	0.2
Holdings (Reg) (Reg S)				Mexico (Utd States of)			
4.85% 27Jan2028	美元 300,000	283,651	0.0	(Reg) 5% 27Apr2051	美元 4,237,000	3,674,241	0.2
MGM China Holdings Ltd				Mexico (Utd States of)			
Ser Regs (Reg S)				(Reg) 6.338%			
4.75% 01Feb2027	美元 4,100,000	4,021,024	0.2	04May2053	美元 5,000,000	5,113,051	0.3
MGM China Holdings Ltd				Mexico City Arpt Trust Ser			
Ser Regs (Reg S)				Regs (Reg) 5.5%			
5.25% 18Jun2025	美元 2,150,000	2,172,085	0.1	31Jul2047	美元 4,500,000	3,950,561	0.2
MGM China Holdings Ltd				Petroleos Mexicano			
Ser Regs (Reg) (Reg S)				6.875% 04Aug2026	美元 1,000,000	1,007,592	0.1
7.125% 26Jun2031	美元 2,682,000	2,812,506	0.2	Petroleos Mexicanos			
Sands China Ltd Ser Wi				(Reg) 6.875%			
(Reg) 3.8% 08Jan2026	美元 8,200,000	8,139,633	0.5	16Oct2025	美元 3,000,000	3,099,673	0.2
Sands China Ltd Ser Wi				荷兰 (0.3%)			
(Reg) 4.375%				Cooperatieve Rabobank			
18Jun2030	美元 11,000,000	10,680,630	0.6	UA (Reg S) (Br) Var Perp			
Sands China Ltd Ser Wi				31 Dec2049	欧元 2,600,000	2,866,347	0.2
(Reg) 5.125%				ING Groep NV Var Perp	美元 2,800,000	2,840,322	0.1
08Aug2025	美元 11,600,000	11,669,648	0.7	巴基斯坦 (0.8%)			
Studio City Finance Ltd				Islamic Rep of Pakistan			
Ser Regs (Reg) (Reg S)				Ser Regs (Reg) (Reg S)			
6% 15Jul2025	美元 13,512,000	13,731,106	0.8	6.875% 05Dec2027	美元 8,000,000	7,456,658	0.5
Studio City Finance Ltd				Pakistan (Rep of) Ser			
Ser Regs (Reg) (Reg S)				Regs (Reg S) 6%			
6.5% 15Jan2028	美元 6,400,000	6,351,617	0.4	08Apr2026	美元 3,700,000	3,583,971	0.2
Studio City Finance Ltd				Pakistan (Rep of) Ser			
Ser Regs (Reg) (Regs)				Regs 8.25% 30Sep2025	美元 1,600,000	1,574,747	0.1
5% 15Jan2029	美元 8,065,000	7,504,987	0.5	巴拿马 (0.4%)			
Wynn Macau Ltd Ser				Panama (Govt of) (Reg)			
Regs (Reg) (Reg S)				7.5% 01Mar2031	美元 3,500,000	3,854,522	0.2
5.5% 15Jan2026	美元 11,100,000	11,153,081	0.7	Panama (Govt of) (Reg)			
Wynn Macau Ltd Ser				8.875% 30Sep2027	美元 1,200,000	1,334,523	0.1
Regs (Reg) (Reg S)				Republic of Panama (Reg)			
5.625% 26Aug2028	美元 5,900,000	5,765,007	0.4	3.875% 17/03/2028	美元 2,000,000	1,936,288	0.1
Wynn Macau Ltd Ser				巴拉圭 (0.1%)			
Regs (Reg) 4.875%				Republic of Paraguay Ser			
01Oct2024	美元 3,400,000	3,487,125	0.2	Regs (Reg) (Reg S)			
马来西亚 (2.6%)				2.739% 29Jan2033	美元 2,000,000	1,716,704	0.1
Axiata Spv5 Labuan Ltd				秘鲁 (0.4%)			
Ser EMTN (Reg S)				Southern Copper Corp			
3.064% 19Aug2050	美元 1,369,000	991,938	0.0	Regs 7.5% 27Jul2035	美元 6,000,000	7,221,698	0.4
GOHL Capital Ltd 4.25%				菲律宾 (3.2%)			
24Jan2027	美元 9,500,000	9,441,900	0.6	Globe Telecom Inc (Reg)			
Khazanah Capital Ltd				(Reg S) 3% 23Jul2035	美元 3,600,000	2,989,320	0.2
Ser EMTN (Reg) (Reg				Globe Telecom Inc (Reg)			
S) 4.759% 05Sep2034	美元 7,843,000	7,933,826	0.5	(Reg S) Var Perp	美元 5,000,000	4,972,729	0.3
Malaysia Government				Ictsi Treasury Bv (Reg)			
Ser 123 4.457%	马来西亚林吉特			(Reg S) 3.5%			
31Mar2053	66,000,000	16,742,263	1.0	16Nov2031	美元 2,600,000	2,415,660	0.1
Petronas Capital Ltd Ser				Metropolitan Bank & Trus			
Regs (Reg) (Reg S)				Ser EMTN (Reg S) 5.5%			
4.55% 21Apr2050	美元 9,000,000	8,550,817	0.5	06Mar2034	美元 3,942,000	4,106,931	0.2
墨西哥 (1.4%)							
Banco Mercantil De							
Norte Ser Regs (Reg)							
(Reg S) Var Perp							
31Dec2049	美元 1,400,000	1,494,124	0.1				

投资组合 (续)

于二零二四年九月三十日 (未经审计)

(续)

单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		
菲律宾 (续)			Temasek Financial I Ltd				
Metropolitan Bank & Trus Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.375% 06Mar2029	美元 5,646,000	5,873,337	0.4	离岸人民币 10,000,000	1,445,737	0.1	
Philippines (Rep of) (Reg) 4.2% 29Mar2047	美元 4,602,000	4,125,218	0.2	Temasek Financial I Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.1% 28Aug2054	离岸人民币 57,000,000	8,247,709	0.5
Philippines (Rep of) (Reg) 5.6% 14May2049	美元 3,000,000	3,309,476	0.2	United Overseas Bank Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 07Oct2032	美元 2,000,000	1,995,781	0.1
Philippines (Rep of) (Reg) 5.95% 13Oct2047	美元 5,000,000	5,776,913	0.4	斯里兰卡 (0.6%)			
Philippines (Rep of) 6.25Pct 14/01/2036	菲律宾比索 367,000,000	6,514,569	0.4	Republic of Sri Lanka 6.2% 11May2027	美元 1,200,000	674,327	0.0
PLDT Inc (Reg) (Reg S) 2.5% 23Jan2031	美元 3,600,000	3,196,250	0.2	Republic of Sri Lanka Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.75% 18Apr2028	美元 1,500,000	847,340	0.1
PLDT Inc (Reg) (Reg S) 3.45% 23Jun2050	美元 4,300,000	3,230,662	0.2	Republic of Sri Lanka Ser Regs (Reg) (Reg S) 7.55% 28Mar2030	美元 2,000,000	1,130,144	0.1
Rizal Commercial Banking (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 4,310,000	4,320,197	0.3	Sri Lanka (Rep of) Ser Regs (Reg) 6.85% 03/11/2025	美元 4,300,000	2,437,188	0.1
Rizal Commercial Banking Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.5% 18Jan2029	美元 500,000	522,270	0.0	Sri Lanka Government International Bond Ser Regs (Reg S) 6.825% 18Jul2026	美元 1,400,000	791,169	0.0
Royal Capital Bv (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 1,150,000	1,172,198	0.1	Sri Lanka Govt Bond Ser A 20% 15Sep2027	斯里兰卡卢比 600,000,000	2,457,325	0.2
卡塔尔 (0.4%)			斯里兰卡 (0.6%)				
ABQ Finance Ser EMTN (Reg) (Reg S) 1.875% 08Sep2025	美元 3,500,000	3,408,751	0.2	Sri Lanka Govt Bond Ser A 22.5% 15May2026	斯里兰卡卢比 200,000,000	851,443	0.1
QNB Finance Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.625% 12May2025	美元 2,600,000	2,588,392	0.2	台湾 (0.9%)			
罗马尼亚 (0.4%)			台湾 (0.9%)				
Romania (Govt of) Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.375% 18Sep2033	欧元 5,000,000	6,014,634	0.4	Cathaylife Singapore (Reg) (Reg S) Var 05Sep2039	美元 2,133,000	2,166,140	0.1
沙特阿拉伯 (0.4%)			泰国 (3.2%)				
Eig Pearl Holdings Sarl Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.387% 30Nov2046	美元 3,500,000	2,903,627	0.2	Bangkok Bank PCL/HK Ser Regs (Reg S) Var Perp	美元 10,800,000	10,714,411	0.6
Greensaif Pipelines Bidc Ser Regs (Reg S) 6.51% 23Feb2042	美元 2,000,000	2,168,479	0.1	Export-Import Bk Thailand Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.354% 16May2029	美元 1,228,000	1,302,546	0.1
Greensaif Pipelines Bidc Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.1027% 23Aug2042	美元 1,974,000	2,067,187	0.1	Kasikornbank PCL HK Ser EMTN (Reg S) Var Perp 4%	美元 3,613,000	3,483,328	0.2
新加坡 (1.7%)			泰国 (3.2%)				
DBS Group Holdings Ltd Ser GMTN (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 10,000,000	9,942,512	0.5	Kasikornbank PCL HK Ser EMTN (Reg S) Var Perp 5.275%	美元 3,000,000	3,044,067	0.2
GLP Pte Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.875% 04Jun2025	美元 3,300,000	3,178,622	0.2	Kasikornbank PCL HK Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 02Oct2031	美元 7,100,000	6,932,761	0.4
Oversea-Chinese Banking Ser GMTN (Reg S) Var 21May2034	美元 4,000,000	4,226,023	0.3	Krung Thai Bank/Cayman (Reg S) Var Perp	美元 4,200,000	4,122,965	0.3
				Muangthai Capital PCL (Reg) 6.875000% 30Sep2028	美元 1,700,000	1,713,257	0.1
				Thailand (Govt of) W/I 3.45% 17Jun2043	泰铢 260,000,000	8,835,319	0.5

投资组合 (续)
于二零二四年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 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
泰国 (续)				美国 (1.3%)			
Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg S) 2.5% 18Jun2030	美元 2,250,000	2,010,813	0.1	Ford Motor Credit Co LLC (Reg) 4.687% 09Jun2025	美元 4,615,000	4,667,386	0.3
Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg S) 3.5% 17Oct2049	美元 1,900,000	1,379,034	0.1	Hyundai Capital America Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.65% 10Feb2025	美元 2,600,000	2,586,274	0.1
Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg S) 3.75% 18Jun2050	美元 7,200,000	5,419,402	0.3	Las Vegas Sands Corp (Reg) 3.5% 18Aug2026	美元 2,800,000	2,754,356	0.2
Thaioil Trsry Center Ser Regs (Regs) 4.875% 23Jan2043	美元 3,000,000	2,752,029	0.2	Las Vegas Sands Corp (Reg) 3.9% 08Aug2029	美元 3,500,000	3,358,179	0.2
Thaioil Trsry Center Ser Regs 5.375% 20Nov2048	美元 2,000,000	1,943,430	0.1	Las Vegas Sands Corp (Reg) 6.2% 15Aug2034	美元 1,600,000	1,713,510	0.1
阿联酋 (0.4%)				National Grid Na Inc Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.62% 09Jun2025	港元 26,000,000	3,330,977	0.2
Aldar Investment Prop Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.5% 16May2034	美元 3,600,000	3,900,935	0.2	Nissan Motor Acceptance Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.75% 09Mar2028	美元 4,200,000	3,854,498	0.2
Emirates NBD Bank Pjsc Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.625% 18Feb2025	美元 3,000,000	2,979,766	0.2				
英国 (2.5%)							
Ck Hutchison Intl 24 Ser Regs 4.750000 % 13Sep2034	美元 5,000,000	4,994,338	0.3			1,540,160,427	92.7
Hutchison Wham Int 03/33 Ser Regs (Reg S) 7.45% 24Nov2033	美元 3,000,000	3,658,548	0.2	(III) 集体投资计划 (1.5%)			
Royal BK Scotlnd Grp PLC (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 2,900,000	2,906,231	0.2	卢森堡 (1.5%)			
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg S) 6.296% 06Jul2034	美元 9,160,000	10,067,037	0.6	JPMLIQ-JPM USD Liquidity LVNAV 'X' (dist)**	24,091,566	24,091,566	1.5
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg S) 6.75% 08Feb2028	美元 3,100,000	3,280,025	0.2	(IV) 衍生性产品 (0.1%)			
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg S) Var 09Jan2029	美元 1,500,000	1,600,136	0.1	信贷违约掉期 (-0.4%)			
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg S) Var 16Nov2028	美元 6,600,000	7,397,651	0.4	(D) Credit Default Swap Index~604~ 64 93,000,000.00 USD 01/10/2024 20/12/2029		(6,931,538)	(0.4)
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 18Feb2036	美元 1,200,000	1,080,509	0.1	远期外汇合约 (0.6%)		10,341,459	0.6
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 6%	美元 4,700,000	4,753,177	0.3	期货 (-0.0%)			
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 7.875%	美元 587,000	627,166	0.0	Aust 10yr Bond Fut 16/12/2024	268	(16,683)	(0.0)
Standard Chartered Ser Regs (Reg S) Var 29Jun2032	美元 1,134,000	997,349	0.1	US 10yr Note (CBT) 19/12/2024	(247)	81,047	0.0
				US 2yr Note (CBT) 31/12/2024	399	(65,461)	(0.0)
				US 5yr Note (CBT) 31/12/2024	182	(177,734)	(0.0)

投资组合 (续)

于二零二四年九月三十日 (未经审计)

	单位数 目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
利率掉期 (-0.1%)			
(D) Interest Rate Swap~619~ 42 200,000,000.00 BRL 21/06/2024 04/01/2027		(531,270)	(0.0)
(D) Interest Rate Swap~619~ 43 165,000,000.00 BRL 12/06/2024 02/01/2026		(282,228)	(0.0)
(D) Interest Rate Swap~619~ 49 240,000,000.00 BRL 15/08/2024 04/01/2027		(875,451)	(0.1)
(D) Interest Rate Swap~619~ 54 1,500,000,000.00 INR 28/08/2024 18/12/2029		(145)	(0.0)
(D) Interest Rate Swap~619~ 57 120,000,000.00 CNY 04/09/2024 18/12/2029		(63,180)	(0.0)
(D) Interest Rate Swap~619~ 58 25,000,000,000.00 KRW 05/09/2024 18/12/2029		49,926	0.0
(D) Interest Rate Swap~619~ 59 130,000,000.00 CNY 09/09/2024 18/12/2029		(103,178)	(0.0)
(D) Interest Rate Swap~619~ 61 22,300,000,000.00 KRW 12/09/2024 18/12/2029		(30,000)	(0.0)
		1,395,564	0.1
总上市投资		1,645,182,188	99.1
其他净资产		15,876,409	0.9
于二零二四年九月三十日 可赎回份额持有人应占 净资产		1,661,058,597	100.0
总投资, 按成本		1,566,851,273	

* 由管理人的关联人士发行和管理 (关联人士的定义, 参见附注 8)

在香港未获认可及并非供香港公众投资

投资组合持有变动表

(续)

截至二零二四年九月三十日止年度 (未经审计)

	持有占资产净值百分比		持有占资产净值百分比	
	2024	2023*	2024	2023*
上市投资				
可转换证券				
中国	3.1	-		
韩国	0.8	-		
美国	0.6	-		
维京群岛	0.3	-		
债务证券				
印度尼西亚	18.3	8.1		
印度	13.4	9.4		
中国	10.0	17.0		
韩国	7.2	14.0		
香港	5.6	10.3		
澳门	5.4	3.1		
日本	4.3	2.1		
澳大利亚	3.7	4.3		
泰国	3.2	2.9		
菲律宾	3.2	1.0		
马来西亚	2.6	1.3		
英国	2.5	4.4		
新加坡	1.7	2.6		
墨西哥	1.4	3.3		
哥伦比亚	1.4	-		
美国	1.3	2.0		
台湾	0.9	1.3		
巴基斯坦	0.8	0.2		
国际	0.6	-		
斯里兰卡	0.6	-		
巴西	0.5	-		
阿联酋	0.4	1.3		
巴拿马	0.4	-		
秘鲁	0.4	-		
罗马尼亚	0.4	-		
沙特阿拉伯	0.4	-		
卡塔尔	0.4	-		
法国	0.3	0.2		
智利	0.3	-		
科威特	0.3	-		
荷兰	0.3	-		
爱尔兰	0.2	0.3		
哥斯达黎加	0.2	-		
巴拉圭	0.1	-		
新西兰	-	1.5		
塞尔维亚	-	1.3		
加拿大	-	0.3		
丹麦	-	0.3		
意大利	-	0.2		
蒙古	-	0.3		
西班牙	-	0.3		
集体投资计划				
卢森堡	1.5	6.1		
			衍生性产品	
			远期外汇合约	0.6
			期货	(0.0)
			利率掉期	(0.1)
			信贷违约掉期	(0.4)
			总上市投资	<u>99.1</u>
			其他净资产	<u>0.9</u>
			于九月三十日可赎回份额持有人应占净资产	<u>100.0</u>
				<u>100.0</u>

* 比较金额已更新，以符合本年度之呈列或分类方式。

金融衍生工具详情

于二零二四年九月三十日 (未经审计)

(a) 可转换证券

于二零二四年九月三十日，本基金持有之可转换证券，其标的资产和交易对手均为发行机构，详情请参阅投资组合。

(b) 信贷违约掉期

于二零二四年九月三十日，本基金持有之信贷违约掉期合约，详情请参阅附注 11。

(c) 远期外汇合约

于二零二四年九月三十日，本基金持有之未平仓远期外汇合约，详情请参阅附注 11。

(d) 期货

于二零二四年九月三十日，本基金持有之期货合约，详情请参阅附注 11。

(e) 利率掉期

于二零二四年九月三十日，本基金持有之利率掉期合约，详情请参阅附注 11。

金融衍生工具风险敞口信息

截至二零二四年九月三十日止年度 (未经审计)

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

	2024
	占资产净值百分比
最低总敞口	51.4
最高总敞口	364.2
平均总敞口	142.6

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

	2024
	占资产净值百分比
最低净敞口	5.1
最高净敞口	43.5
平均净敞口	24.1

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
于二零二四年九月三十日 (未经审计)

抵押品提供方	抵押品的性质	到期期限	计价货币	抵押品所涵盖资产净值 百分比	抵押品价值 美元
Citibank N.A., 伦敦	现金	不适用	美元	0.0	616,762

现金抵押品再投资详情

截至二零二四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	收到/持有的抵押品 金额 2024 美元	计划下提供的抵押品 所占比例 2024 百分比
隔离账户 香港上海汇丰银行有限公司	616,762	100.0

财务状况表

于二零二四年九月三十日

	2024 美元	2023 美元
资产		
流动资产		
银行现金	24,866,024	24,735,540
现金抵押品	616,762	485,000
应收经纪款项	9,580,637	2,685,949
分配应收款项	6,434,887	2,507,017
保证金	24,406,721	3,604,964
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 11]	13,989,777	6,774,766
投资 [附注 4(l)(a)]	1,643,786,624	1,375,968,393
股息及其他应收款项	3,500	442,009
总资产	<u>1,723,684,932</u>	<u>1,417,203,638</u>
负债		
流动负债		
应付经纪款项	33,229,268	12,505,661
赎回应付款项	10,439,786	7,943,307
应付收益分配 [附注 6]	4,437,588	5,768,606
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 11]	12,594,213	5,073,759
其他应付款项	1,925,480	1,610,737
总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)	<u>62,626,335</u>	<u>32,902,070</u>
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	<u>1,661,058,597</u>	<u>1,384,301,568</u>

由受托人及管理人于二零二五年一月二十四日批准

签署人:

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

截至二零二四年九月三十日止年度

	2024 美元	2023 美元
收入		
投资及衍生性产品净收益 [附注 5]	205,441,723	9,836,020
股息收入 [附注 8(a)]	3,112,503	306,520
存款利息 [附注 8(i), 8(j)]	601,991	1,601,828
汇兑净亏损	(1,855,126)	(4,235,916)
其他收入	24,274	84,434
	<u>207,325,365</u>	<u>7,592,886</u>
支出		
管理费用 [附注 8(e)]	14,397,424	14,865,866
托管费用及银行费用 [附注 8(i), 8(j)]	441,918	396,752
受托人费用 [附注 8(g)]	378,445	389,009
基金注册登记机构费用 [附注 8(h)]	219,408	220,899
交易成本 [附注 8(j)]	120,484	117,484
核数师酬金	80,472	18,826
法律及专业服务费	18,229	22,054
估值费用 [附注 8(e)]	17,150	17,080
印刷及出版支出	8,600	5,966
其他经营费用	9,117	8,717
	<u>15,691,247</u>	<u>16,062,653</u>
净经营利润 / (亏损)	<u>191,634,118</u>	<u>(8,469,767)</u>
财务成本		
收益分配 [附注 6]	(59,870,402)	(67,789,728)
利息支出 [附注 8(j)]	-	(454)
	<u>(59,870,402)</u>	<u>(67,790,182)</u>
除税前利润 / (亏损)	<u>131,763,716</u>	<u>(76,259,949)</u>
税项 [附注 7]	(279,186)	(727,494)
可赎回份额持有人应占净资产 及总综合收益 / (亏损) 之 增加 / (减少)	<u>131,484,530</u>	<u>(76,987,443)</u>

第十六至四十七页之附注乃属本财务报表之一部分。

可赎回份额持有人应占净资产变动表
截至二零二四年九月三十日止年度

	2024 美元	2023 美元
年初可赎回份额持有人应占净资产	1,384,301,568	1,361,534,429
分配可赎回份额 [附注 3]	831,119,386	652,450,452
赎回可赎回份额 [附注 3]	(685,846,887)	(552,695,870)
净分配	145,272,499	99,754,582
	1,529,574,067	1,461,289,011
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益 / (亏损) 之增加 / (减少)	131,484,530	(76,987,443)
年末可赎回份额持有人应占净资产	1,661,058,597	1,384,301,568

现金流量表
截至二零二四年九月三十日止年度

	2024 美元	2023 美元
经营业务		
购入投资及衍生性产品	(3,752,541,907)	(2,953,063,802)
出售投资及衍生性产品所得款项	3,704,704,359	2,855,990,574
已收股息	3,112,503	306,520
已收利息	601,991	1,601,828
已付交易成本	(118,745)	(116,670)
现金抵押品之 (增加) / 减少	(131,762)	3,962,035
已付基金注册登记机构费用	(209,460)	(222,257)
已付税项	(279,186)	(727,494)
已付受托人费用	(371,917)	(390,818)
已付管理费用	(14,114,835)	(14,915,393)
保证金之 (增加) / 减少	(20,801,757)	2,928,001
其他	(2,327,475)	(5,725,097)
经营业务所运用之现金净额	(82,478,191)	(110,372,573)
融资活动		
已付利息	-	(454)
分配可赎回份额所得款项	827,191,516	650,906,488
赎回可赎回份额付款	(683,350,408)	(558,905,127)
已付收益分配	(61,201,420)	(68,337,059)
融资活动所产生之现金净额	82,639,688	23,663,848
现金及现金等价物之增加 / (减少)	161,497	(86,708,725)
年初现金及现金等价物	24,735,540	110,369,125
现金及现金等价物之汇兑 (亏损) / 收益	(31,013)	1,075,140
年末现金及现金等价物	24,866,024	24,735,540
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	24,866,024	24,735,540

第十六至四十七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 重要会计政策

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

(a) 财务报表之编制基础

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

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

于二零二三年十月一日生效的新准则及对现有准则的修订

本基金于二零二三年十月一日开始的财政年度首次采纳以下准则和修订：

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

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

于二零二三年十月一日后生效且并未提早采纳的新准则、对准则的修订和解释

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

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公平值为负数的衍生性产品合约列示为按公平值透过损益列账的负债。

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公平值透过损益列账的金融资产或负债。

确认、取消确认及计量

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

公允价值估计

公允价值指在计量日期，于一项有序交易中由市场参与者出售一项资产而应收取或转让一项负债而应支付的价格。在活跃市场中买卖的金融资产和负债的公允价值，按最后交易价计算。当被投资公司的证券交易暂停，该投资的价值按基金管理人估计的公允价值计算。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净资产价值得出的公允价值而计算，或如集体投资计划为上市或在交易所买卖，则以最后交易价计算。

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

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

公允价值级次分层间的转拨

在公允价值级次分层之间的转拨视为于报告期间开始时已发生。

结构化主体

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

(c) 金融工具抵销

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

(d) 收入及支出

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

投资利息收入乃作为投资及衍生性产品净收益/亏损的一部分，在综合收益表确认。

银行现金及短期存款利息收入乃按实际利息法在综合收益表确认。

支出乃按应计基准在综合收益表确认。

(e) 交易成本

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

(f) 外币交易

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

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

(g) 现金及现金等价物

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

(h) 现金抵押品及保证金

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

本基金提供的现金抵押品在财务状况表中确认为保证金，不计入现金及现金等价物。

(i) 应收/应付经纪款项

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

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

(j) 分配份额所得款项及赎回份额支付款项

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

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

(k) 应付可赎回份额持有人的收益分配

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

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

2024

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目：					
年初	19,098,165.720	13,957,815.202	1,756,326.936	298,113,944.487	8,681,253.030
总分配 总赎回	1,593,662.057 (7,249,960.395)	1,361,844.527 (4,301,827.237)	408,254.742 (869,980.296)	32,754,693.567 (106,584,298.563)	1,934,613.853 (3,717,806.339)
年末	13,441,867.382	11,017,832.492	1,294,601.382	224,284,339.491	6,898,060.544
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净资产	86,189,330	71,667,903	8,786,380	1,555,927,665	43,974,919
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	6.41	6.50	6.79	6.94	6.37
	PRC 人民币对冲 份额 (累计) 份额	PRC 人民币对冲 份额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额
已发行份额数目：					
年初	123,401,721.060	41,841,452.530	10,230,867.790	2,019,087.710	4,469,155.559
总分配 总赎回	337,789,992.370 (179,210,342.710)	110,517,480.440 (22,060,565.940)	1,132,420.210 (2,507,576.680)	4,623,158.870 (652,210.100)	1,791,990.361 (3,874,493.262)
年末	281,981,370.720	130,298,367.030	8,855,711.320	5,990,036.480	2,386,652.658
	人民币	人民币	美元	美元	人民币
可赎回份额持有人应占净资产	3,497,384,846	938,136,758	100,749,385	43,463,162	30,928,198
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	12.40	7.20	11.38	7.26	12.96
	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额		
已发行份额数目：					
年初	294,546,700.947	1,090,950.638	42,825,272.750		
总分配 总赎回	21,191,492.881 (71,740,827.840)	400,454.483 (514,943.436)	4,939,586.475 (12,486,752.594)		
年末	243,997,365.988	976,461.685	35,278,106.631		

2024

	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	美元类别 (累计) 美元	美元类别 (每月派息) 美元
可赎回份额持有人应占净资产	1,625,504,501	12,440,724	281,037,222
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	6.66	12.74	7.97

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
已发行份额数目:	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
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 总赎回	42,369,645.705 (92,434,310.760)	601,966.717 (461,714.538)	13,081,033.132 (15,249,386.848)
年末	294,546,700.947	1,090,950.638	42,825,272.750
	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应占净资产	1,863,716,717	12,341,257	324,128,294
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	6.33	11.31	7.57

4 财务风险管理

(I) 财务风险因素

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

本基金于集体投资计划中持有的单位数目占集体投资计划的净资产值总额的百分比将根据集体投资计划的分配与赎回数量随时变化。本基金有可能会在任何时点持有集体投资计划的大多数已发行的份额。本基金在被投资基金中的权益所面临的最大损失风险敞口等于其对集体投资计划投资的公平值总额。截至二零二四年九月三十日止年度，对集体投资计划的购买总额为928,560,165 美元（二零二三年：313,000,000 美元）。截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，投资集体投资计划未获得净收益或未产生净亏损。

(a) 市场风险

(i) 市场价格风险

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

(ii) 利率风险

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

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

	1 年以内 美元	1 至 5 年 美元	5 年以上 美元	无确定到期日 美元	总额 美元
<u>2024</u>					
银行现金	24,866,024	-	-	-	24,866,024
保证金	24,406,721	-	-	-	24,406,721
衍生性产品	(178,831)	(1,688,949)	(146,577)	-	(2,014,357)
投资 (注*)	140,706,155	569,020,456	909,968,447	24,091,566	1,643,786,624
总利率敏感性缺口	189,800,069	567,331,507	909,821,870	24,091,566	1,691,045,012
<u>2023</u>					
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

注：

* 投资的票面息率范围介乎年率 0.00% - 22.50% (二零二三年：年率 0.03% - 8.65%)。

于九月三十日，本基金投资及衍生性产品之公平值如下：

	2024		2023*	
	投资之公平值 美元	占资产净值 百分比	投资之公平值 美元	占资产净值 百分比
上市投资				
<u>资产</u>				
可转换证券				
- 其他	79,534,631	4.8	-	-
债务证券				
- 印度尼西亚	303,837,140	18.3	112,005,237	8.1
- 印度	222,478,256	13.4	129,841,130	9.4
- 中国	164,975,125	10.0	235,175,479	17.0
- 韩国	120,151,547	7.2	194,192,195	14.0
- 香港	93,286,122	5.6	142,814,940	10.3
- 澳门	90,137,169	5.4	42,534,359	3.1
- 其他	545,295,068	32.8	434,548,533	31.4
	1,540,160,427	92.7	1,291,111,873	93.3
集体投资计划				
- 卢森堡	24,091,566	1.5	84,856,520	6.1
衍生性产品				
- 远期外汇合约	13,858,804	0.8	6,746,860	0.5
- 期货	81,047	0.0	27,906	0.0
- 利率掉期	49,926	0.0	-	-
	13,989,777	0.8	6,774,766	0.5
	1,657,776,401	99.8	1,382,743,159	99.9

	2024		2023*	
	投资之公平值 美元	占资产净值 百分比	投资之公平值 美元	占资产净值 百分比
上市投资				
负债				
衍生性产品				
- 期货	(259,878)	(0.0)	(1,431,766)	(0.1)
- 利率掉期	(1,885,452)	(0.1)	-	-
- 远期外汇合约	(3,517,345)	(0.2)	(3,641,993)	(0.3)
- 信贷违约掉期	(6,931,538)	(0.4)	-	-
	(12,594,213)	(0.7)	(5,073,759)	(0.4)
总上市投资	1,645,182,188	99.1	1,377,669,400	99.5

* 比较金额已更新，以符合本年度之呈列或分类方式。

有关衍生性产品的风险亦请参阅附注 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。于二零二四年九月三十日，投资管理人估计本基金的修正久期为 5.29（二零二三年：4.83）。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 21,967,500 美元（二零二三年：16,715,441 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
2024			
澳元	66,989,835	+7.5	5,024,238
巴西雷亚尔	(1,698,774)	-8.1	137,601
加元	53,301,172	+0.1	53,301
人民币 (离岸)	873,359,479	+4.1	35,807,739
人民币 (在岸)	(467,372)	+4.1	(19,162)
欧元	(3,657,870)	+5.4	(197,525)
港元	(24,138,831)	+0.8	(193,111)
印尼盾	41,430,209	+2.1	870,034
印度卢比	24,057,314	-0.9	(216,516)
韩元	4,114,116	+3.2	131,652
马来西亚林吉特	8,578,003	+13.9	1,192,342
墨西哥比索	(2,550,797)	-11.3	288,240
纽元	28,220,128	+5.9	1,664,988
秘鲁新索尔	12,082,080	+1.9	229,560
菲律宾比索	2,305,329	+1.0	23,053
新加坡元	33,259,873	+6.5	2,161,892
斯里兰卡卢比	3,308,768	+9.4	311,024
英镑	11,891,794	+9.9	1,177,288
台币	191,394	+2.0	3,828
泰铢	4,546,847	+13.2	600,184
	<u>1,135,122,697</u>		<u>49,050,650</u>
2023			
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>

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。

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

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

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

下表概述于九月三十日按照信贷评级的债务证券。

	2024 占资产净值百分比	2023 占资产净值百分比
标准普尔(AAA)/穆迪(Aaa)/惠誉(AAA)	1.2	5.4
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	1.2	9.4
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	17.5	26.7
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	39.4	28.1
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	20.5	8.4
标准普尔(B)/穆迪(B)/惠誉(B)	3.1	8.7
标准普尔(CCC)/穆迪(Caa)/惠誉(CCC)	0.8	0.2
未评级	9.0	6.2
	92.7	93.1

于九月三十日，按照发行机构的信贷评级，下表概述上述未评级债务证券。

	2024 占资产净值百分比	2023 占资产净值百分比
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	-	1.4
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	1.0	0.5
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	5.3	2.0
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	0.2	-
未评级	2.5	2.3
	9.0	6.2

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

下表概述本基金于九月三十日存放金融资产的银行/经纪/托管机构的信贷评级。

	2024 交易对手风险承担 美元	2023 交易对手风险承担 美元
银行结余		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	3,705,562	2,408,109
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	21,160,462	22,327,431
托管机构的现金抵押品		
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	616,762	485,000
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)	9,582,845	5,156,271
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	28,813,653	5,223,459
托管机构的投资余额		
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	1,643,786,624	1,375,968,393

(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。

	2024		2023	
	1 个月以内 美元	1 至 12 个月 美元	1 个月以内 美元	1 至 12 个月 美元
应付经纪款项	33,229,268	-	12,505,661	-
赎回应付款项	10,439,786	-	7,943,307	-
应付收益分配	4,437,588	-	5,768,606	-
其他应付款项	1,925,480	-	1,610,737	-
衍生性产品	339,907	12,254,306	1,215,371	3,858,388
可赎回份额持有人应占净资产	1,661,058,597	-	1,384,301,568	-
总金融负债	1,711,430,626	12,254,306	1,413,345,250	3,858,388

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

(d) 受总净额结算协议及类似协议规限的抵销与金额

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

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

(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显示，基金的分配和赎回乃由份额持有人决定。本基金以保障为份额持有人提供回报和长期资本增值为目标。

为了维持资本结构，本基金的政策执行如下：

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

(III) 公平值估计

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

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

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

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

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

上市投资	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总额 美元
<u>2023</u>				
<u>资产</u>				
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>-</u>	<u>1,382,743,159</u>
<u>负债</u>				
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>-</u>	<u>5,073,759</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。

截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，公允价值层次之间并无转拨。

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

5 投资及衍生性产品净收益

	2024 美元	2023 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益/亏损之变动	158,051,764	132,652,958
投资及衍生性产品销售之实现收益/(亏损)	47,389,959	(122,816,938)
	<u>205,441,723</u>	<u>9,836,020</u>

6 收益分配

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

本年末未结转未分配收入（二零二三年：无）。

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
<u>2024</u>					
澳元对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	澳元 0.0285	19,079,707.027	(344,289)
加元对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	加元 0.0332	13,421,046.121	(320,964)
英镑对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	英镑 0.0364	1,775,966.701	(78,444)
港元类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	港元 0.0386	286,193,667.797	(1,411,839)
纽元对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	纽元 0.0351	8,375,319.424	(170,990)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	人民币 0.0331	41,395,671.400	(186,623)
PRC 美元份额（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	美元 0.0400	1,963,240.930	(78,530)
人民币对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	人民币 0.0306	289,613,393.950	(1,207,043)
美元类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	美元 0.0440	42,054,795.563	(1,850,409)
澳元对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	澳元 0.0294	17,983,177.047	(350,558)
加元对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	加元 0.0334	12,924,380.802	(318,379)
英镑对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	英镑 0.0364	1,831,560.472	(84,399)
港元类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	港元 0.0384	274,078,481.908	(1,347,530)
纽元对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	纽元 0.0348	8,012,008.442	(172,212)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	人民币 0.0265	41,103,943.090	(152,535)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	美元 0.0401	1,940,841.620	(77,828)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	人民币 0.0244	286,400,645.833	(978,599)
美元类别 (每月派息)	2023 年 11 月 30 日	2023 年 12 月 8 日	美元 0.0440	41,153,915.390	(1,810,770)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	澳元 0.0288	17,664,887.867	(347,144)
加元对冲类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	加元 0.0330	12,137,795.820	(303,767)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	英镑 0.0357	1,813,188.634	(82,519)
港元类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	港元 0.0385	266,288,877.038	(1,312,935)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	纽元 0.0345	7,774,798.117	(169,830)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	人民币 0.0239	40,726,636.420	(136,697)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	美元 0.0401	1,895,299.460	(76,001)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	人民币 0.0221	283,260,423.084	(879,147)
美元类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	美元 0.0440	40,500,343.991	(1,782,013)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	澳元 0.0289	16,688,076.003	(318,815)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	加元 0.0330	11,927,494.959	(294,605)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	英镑 0.0362	1,875,260.099	(86,447)
港元类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	港元 0.0386	253,089,752.210	(1,249,706)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 9 日	纽元 0.0345	7,443,473.484	(158,073)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	人民币 0.0236	45,103,173.600	(148,380)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	美元 0.0401	2,261,777.670	(90,697)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	人民币 0.0218	271,154,596.012	(824,006)
美元类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	美元 0.0440	37,817,695.784	(1,663,977)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	澳元 0.0296	15,614,009.806	(300,945)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	加元 0.0335	11,542,188.267	(285,076)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	英镑 0.0363	1,858,345.040	(85,331)
港元类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	港元 0.0386	250,369,586.969	(1,234,450)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	纽元 0.0352	7,341,003.261	(157,432)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	人民币 0.0272	58,133,166.730	(219,454)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	美元 0.0401	3,053,355.800	(122,440)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	人民币 0.0251	267,202,836.845	(930,820)
美元类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	美元 0.0440	37,268,781.105	(1,639,824)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	澳元 0.0294	15,457,539.787	(296,484)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	加元 0.0331	11,296,932.163	(276,319)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	英镑 0.0363	1,842,768.836	(84,502)
港元类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	港元 0.0385	246,548,795.624	(1,212,827)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	纽元 0.0351	7,239,051.923	(151,984)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	人民币 0.0242	87,157,514.740	(290,509)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	美元 0.0401	4,255,249.760	(170,636)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	人民币 0.0225	260,758,441.817	(808,091)
美元类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	美元 0.0440	36,727,873.433	(1,616,024)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	澳元 0.0299	14,979,946.726	(290,844)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	加元 0.0331	11,127,003.343	(268,081)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	英镑 0.0364	1,456,110.121	(66,367)
港元类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	港元 0.0386	237,213,386.856	(1,170,720)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	纽元 0.0352	7,262,595.123	(151,277)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	人民币 0.0320	122,801,942.260	(541,802)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	美元 0.0401	5,742,162.700	(230,261)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	人民币 0.0296	259,220,748.337	(1,057,905)
美元类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	美元 0.0440	36,121,642.252	(1,589,350)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	澳元 0.0295	14,563,909.818	(285,729)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	加元 0.0329	11,120,608.065	(268,399)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	英镑 0.0364	1,450,543.802	(67,224)
港元类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	港元 0.0385	233,312,230.501	(1,148,168)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	纽元 0.0352	7,023,195.931	(151,890)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	人民币 0.0266	133,792,834.230	(489,669)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	美元 0.0401	6,156,803.150	(246,888)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	人民币 0.0247	255,485,887.499	(868,264)
美元类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	美元 0.0440	36,265,996.500	(1,595,702)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	澳元 0.0298	14,572,940.227	(290,029)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	加元 0.0320	11,039,364.784	(258,165)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	英镑 0.0364	1,428,509.997	(65,730)
港元类别 (每月派息)	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	港元 0.0385	231,190,753.424	(1,140,052)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	纽元 0.0352	7,080,845.443	(151,878)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	人民币 0.0216	131,282,297.340	(388,406)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	美元 0.0401	6,090,072.090	(244,212)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	人民币 0.0200	251,336,412.242	(688,513)
美元类别 (每月派息)	2024 年 6 月 28 日	2024 年 7 月 9 日	美元 0.0440	36,046,499.611	(1,586,044)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 7 月 31 日	2024 年 8 月 8 日	澳元 0.0301	14,327,002.089	(281,601)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 7 月 31 日	2024 年 8 月 8 日	加元 0.0313	11,035,580.403	(250,037)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 7 月 31 日	2024 年 8 月 8 日	英镑 0.0362	1,340,035.967	(62,308)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
港元类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	港元 0.0385	225,307,803.905	(1,110,388)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	纽元 0.0353	6,978,594.525	(146,316)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	人民币 0.0245	127,402,924.610	(431,868)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	美元 0.0401	6,035,755.170	(242,034)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	人民币 0.0227	245,043,170.604	(769,616)
美元类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	美元 0.0440	35,099,568.768	(1,544,379)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	澳元 0.0300	13,772,586.354	(280,341)
加元对冲类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	加元 0.0299	10,795,349.803	(239,496)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	英镑 0.0352	1,320,041.294	(61,067)
港元类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	港元 0.0384	221,146,563.564	(1,088,666)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	纽元 0.0346	7,040,776.451	(152,415)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	人民币 0.0190	133,212,080.080	(357,137)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	美元 0.0401	6,133,550.560	(245,955)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	人民币 0.0175	242,389,182.555	(598,534)
美元类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	美元 0.0440	34,528,214.527	(1,519,239)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月10日	澳元 0.0310	13,441,867.382	(289,084)
加元对冲类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	加元 0.0301	11,017,832.492	(245,484)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	英镑 0.0360	1,316,323.242	(63,563)
港元类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	港元 0.0385	222,308,142.472	(1,101,881)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	纽元 0.0348	6,898,060.544	(152,733)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	人民币 0.0154	131,167,276.780	(288,624)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	美元 0.0401	5,990,036.480	(240,201)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	人民币 0.0142	243,863,746.506	(494,791)
美元类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	美元 0.0440	35,482,480.953	(1,561,227)
可赎回份额持有人的总收益分配					(59,870,402)

2023

澳元对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	澳元 0.0321	16,031,733.123	(329,073)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	加元 0.0363	11,903,583.157	(316,777)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	英镑 0.0332	830,522.264	(31,746)
港元类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	港元 0.0387	283,939,159.316	(1,399,829)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	纽元 0.0345	7,267,755.380	(145,666)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	人民币 0.0332	48,415,211.570	(219,285)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	美元 0.0401	2,308,869.180	(92,586)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	人民币 0.0307	335,786,294.188	(1,406,344)
美元类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	美元 0.0440	43,810,078.239	(1,927,641)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	澳元 0.0300	15,584,433.207	(313,107)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	加元 0.0352	11,638,931.096	(302,198)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	英镑 0.0323	882,671.807	(33,953)
港元类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	港元 0.0385	278,467,611.869	(1,373,519)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	纽元 0.0329	7,310,581.009	(149,386)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	人民币 0.0263	48,156,378.010	(178,796)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	美元 0.0401	2,273,174.780	(91,154)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	人民币 0.0243	329,560,391.315	(1,130,551)
美元类别 (每月派息)	2022年11月30日	2022年12月8日	美元 0.0440	43,019,753.278	(1,892,867)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	澳元 0.0273	15,402,499.612	(285,154)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	加元 0.0333	11,670,257.016	(286,815)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	英镑 0.0299	888,834.189	(31,968)
港元类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	港元 0.0384	276,172,844.005	(1,358,758)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	纽元 0.0322	7,165,360.778	(145,922)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	人民币 0.0213	47,272,058.670	(145,529)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	美元 0.0401	2,258,190.020	(90,553)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	人民币 0.0198	325,821,398.894	(932,419)
美元类别 (每月派息)	2022年12月30日	2023年1月10日	美元 0.0440	42,704,805.293	(1,879,009)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	澳元 0.0271	15,955,192.209	(304,680)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	加元 0.0348	12,173,358.592	(317,483)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	英镑 0.0316	885,490.606	(34,448)
港元类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	港元 0.0386	281,455,890.539	(1,385,996)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月9日	纽元 0.0321	7,573,923.563	(157,118)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	人民币 0.0228	46,808,434.330	(157,949)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	美元 0.0401	2,257,858.620	(90,540)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	人民币 0.0212	323,651,947.748	(1,015,484)
美元类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	美元 0.0440	43,365,864.969	(1,908,096)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	澳元 0.0281	15,886,572.230	(301,038)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	加元 0.0349	12,357,114.812	(316,767)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	英镑 0.0333	1,333,064.712	(53,742)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
港元类别 (每月派息)	2023年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	(855,827)
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)
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	港元 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)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 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)
可赎回份额持有人的总收益分配					(67,789,728)

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。

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

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

香港税项

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

其他司法管辖区

截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，已就若干收到的利息收入和所得的资本收益预扣或缴付海外税项。

8 与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之交易

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

(a) 以下为与受托人及管理人之关联人士之投资交易：

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

截至二零二四年九月三十日止年度，综合收益表中的股息收入为 3,112,503 美元（二零二三年：306,520 美元），为管理人之关联人士发行和管理的集体投资计划的投资分配。

公司名称	投资买卖总价值 美元	占本基金本年度 之总交易价值 百分比	支付佣金 美元	占本基金本年度 支付之总佣金 百分比	平均佣金率 百分比
<u>2024</u>					
汇丰银行（中国）有限公司	58,661,005	0.43	-	-	-
HSBC Bank Plc, 伦敦	55,607,881	0.41	-	-	-
HSBC Securities & Capital Markets (India) Private Limited	65,141,042	0.48	-	-	-
HSBC Securities (USA) Inc, 纽约	2,835,128	0.02	-	-	-
JPMorgan Chase Bank, N.A.	1,915,409,747	14.14	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司	523,507,310	3.86	-	-	-
<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	-	-	-

(b) 与管理人及其关联人士之年末结余：

	2024 美元	2023 美元
银行现金	3,705,562	2,408,109
应付款项	(1,479,495)	(1,186,914)

于二零二四年九月三十日，本基金的投资结余 24,091,566 美元（二零二三年：84,856,520 美元），为管理人之关联人士发行和管理的集体投资计划的投资。

(c) 截至二零二四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 10,364,339 美元（二零二三年：实现亏损 34,231,710 美元）。

截至二零二四年九月三十日止年度，本基金与受托人与受托人之关联人士签订了掉期合约，实现收益 415,559 美元（二零二三年：无）。

(d) 截至二零二四年九月三十日止年度，扣除支付给代理机构的佣金后，管理人取得本基金分配及赎回收益为 36 美元（二零二三年：251 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人或其关联人士管理的集体投资计划，在考虑针对该集体投资计划中归属于本基金的利益已征收的管理费以后，相应减少支付给管理人的管理费用。

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

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

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

	年初	总分配	总赎回	年末	交易利润 美元
<u>2024</u>					
摩根资产管理（亚太）有限公司					
- 美元类别（累计）	19,288.704	9,274.771	(7,755.355)	20,808.120	-
<u>2023</u>					
摩根资产管理（亚太）有限公司					
- 美元类别（累计）	24,737.714	7,248.733	(12,697.743)	19,288.704	-
JPMorgan Asset Management (S) Limited					
- 美元类别（累计）	111.846	-	(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零六计算；资产净值介乎 4,000 万美元至 7,000 万美元，按年率百分之零点零四计算；超过 7,000 万美元时，按年率百分之零点零二五计算。受托人费用于每个交易日累计，并于每月月底支付。

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

- (i) 截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，除附注 8(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列示如下：

	2024 美元	2023 美元
存款利息	33,183	45,839
托管费用及银行费用	(29,785)	(31,284)

- (j) 截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，除附注 8(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列示如下：

	2024 美元	2023 美元
存款利息	313,670	178,305
利息支出	-	(454)
交易成本	(34,597)	(24,126)
托管费用及银行费用	(279,174)	(279,155)

9 借款

截至二零二四年九月三十日止年度，本基金无银行借款。截至二零二三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

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

11 衍生性产品

(a) 以下为于二零二四年九月三十日未平仓之信贷违约掉期合约：

	标的资产	交易对手	公平值 美元
<u>2024</u>			
(D) Credit Default Swap Index~604~ 64 93,000,000.00 USD 01/10/2024 20/12/2029	CDX.NA.HY.43	Citigroup Global Markets Ltd	(6,931,538)
		金融负债总额	<u>(6,931,538)</u>
		金融负债净额	<u>(6,931,538)</u>
<u>2023</u>			
无			

(b) 以下为于九月三十日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／(亏损) 美元
<u>2024</u>				
未平仓合约：				
美元 145,552	澳元 212,079	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	1,577
美元 39,632	纽元 62,894	2024 年 10 月 2 日	巴克莱银行，伦敦	384
美元 1,103	纽元 1,746	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	8
美元 1,102	英镑 823	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	1
美元 641,476	澳元 931,308	2024 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	4,630
美元 7,468	纽元 11,823	2024 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	54
加元 200,295	美元 148,725	2024 年 10 月 4 日	法国巴黎银行	457
美元 2,084	澳元 3,007	2024 年 10 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	2
美元 1,101	澳元 1,587	2024 年 10 月 4 日	巴克莱银行，伦敦	0
美元 1,099	纽元 1,728	2024 年 10 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	0
加元 275,697	美元 204,480	2024 年 10 月 7 日	Citibank N.A., 伦敦	383
美元 194,292	英镑 144,848	2024 年 10 月 7 日	Citibank N.A., 伦敦	0
离岸人民币 2,408,865	美元 345,233	2024 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	895
离岸人民币 57,632	美元 8,260	2024 年 10 月 8 日	法国巴黎银行	21
加元 436,388	美元 323,910	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	740
加元 142,359	美元 105,498	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	72
加元 14,012	美元 10,412	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	35
加元 3,400	美元 2,523	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	5
加元 9,858	美元 7,302	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1
加元 1,493	美元 1,107	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1
加元 1,486	美元 1,101	2024 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	0
离岸人民币 2,858,200	美元 410,089	2024 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,015

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 4,227,279	美元 605,762	2024年10月21日	美国道富银行	742
离岸人民币 1,280,082	美元 183,434	2024年10月21日	美国道富银行	225
离岸人民币 255,548	美元 36,644	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	69
离岸人民币 125,733	美元 18,040	2024年10月21日	法国巴黎银行	45
纽元 319,247	美元 203,220	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	90
纽元 1,741	美元 1,109	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	0
美元 505,523,200	离岸人民币 3,565,955,597	2024年10月21日	法国巴黎银行	4,847,004
美元 227,392,776	离岸人民币 1,604,026,366	2024年10月21日	法国巴黎银行	2,180,264
美元 59,299,862	澳元 88,021,797	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,784,888
美元 135,067,396	离岸人民币 952,764,064	2024年10月21日	法国巴黎银行	1,295,039
美元 27,890,209	纽元 44,805,419	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	618,449
美元 11,778,865	英镑 8,939,022	2024年10月21日	渣打银行, 伦敦	211,323
美元 4,254,317	离岸人民币 30,009,911	2024年10月21日	法国巴黎银行	40,791
美元 1,612,250	离岸人民币 11,402,947	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	19,773
美元 2,410,778	离岸人民币 16,972,526	2024年10月21日	法国巴黎银行	18,381
美元 404,092	纽元 655,254	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	12,831
美元 726,617	离岸人民币 5,139,138	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	8,912
美元 606,581	离岸人民币 4,296,280	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	8,315
美元 356,920	澳元 525,188	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	7,546
美元 156,151	澳元 234,024	2024年10月21日	高盛国际, 伦敦	6,255
美元 186,677	澳元 276,904	2024年10月21日	高盛国际, 伦敦	5,487
美元 431,091	离岸人民币 3,048,973	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	5,287
美元 643,207	离岸人民币 4,528,353	2024年10月21日	法国巴黎银行	4,904
美元 343,937	离岸人民币 2,435,852	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	4,690
美元 319,863	离岸人民币 2,266,315	2024年10月21日	法国巴黎银行	4,498
美元 346,270	离岸人民币 2,450,083	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	4,393
美元 156,787	澳元 231,687	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	3,997
美元 485,393	离岸人民币 3,417,300	2024年10月21日	法国巴黎银行	3,701
美元 86,727	纽元 140,855	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,896
美元 86,297	澳元 128,000	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	2,531
美元 656,529	离岸人民币 4,604,524	2024年10月21日	法国巴黎银行	2,485
美元 86,153	纽元 139,194	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,413
美元 71,800	澳元 106,716	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	2,258
美元 73,597	纽元 118,833	2024年10月21日	法国巴黎银行	2,014
美元 158,741	离岸人民币 1,123,069	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,996
美元 126,354	澳元 184,819	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,905
美元 70,796	英镑 54,192	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,893
美元 61,121	纽元 98,707	2024年10月21日	法国巴黎银行	1,684
美元 353,153	加元 479,115	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,659
美元 98,974	离岸人民币 703,067	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,651
美元 104,833	离岸人民币 740,238	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,112
美元 109,929	澳元 160,000	2024年10月21日	法国巴黎银行	1,106
美元 149,990	离岸人民币 1,055,289	2024年10月21日	法国巴黎银行	1,046
美元 58,207	纽元 92,972	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	949
美元 74,396	澳元 108,558	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	940
美元 443,020	离岸人民币 3,101,889	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	931
美元 35,646	英镑 27,220	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	864
美元 65,676	离岸人民币 464,764	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	843
美元 18,646	澳元 28,004	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	788
美元 164,164	加元 222,734	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	783
美元 139,732	加元 189,712	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	761
美元 119,307	澳元 172,968	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	728
美元 48,995	离岸人民币 347,208	2024年10月21日	法国巴黎银行	699
美元 111,445	加元 151,362	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	647
美元 37,311	英镑 28,289	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	634
美元 109,505	加元 148,600	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	542
美元 17,760	澳元 26,356	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	530
美元 127,622	加元 173,041	2024年10月21日	法国巴黎银行	524
美元 31,278	英镑 23,701	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	514
美元 53,413	纽元 84,499	2024年10月21日	高盛国际, 伦敦	352
美元 50,986	加元 69,229	2024年10月21日	法国巴黎银行	282
美元 7,496	纽元 12,201	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	267
美元 24,912	离岸人民币 175,742	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	241
美元 15,150	离岸人民币 107,487	2024年10月21日	法国巴黎银行	234
美元 15,129	离岸人民币 107,216	2024年10月21日	法国巴黎银行	216
美元 35,369	加元 48,036	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	205
美元 27,728	离岸人民币 195,000	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	181
美元 24,629	英镑 18,495	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	179

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 11,578	离岸人民币 82,006	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	159
美元 111,590	加元 150,891	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	153
美元 6,398	纽元 10,286	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	147
美元 33,731	离岸人民币 236,536	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	123
美元 43,065	离岸人民币 301,527	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	92
美元 6,790	离岸人民币 48,024	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	83
美元 4,222	离岸人民币 30,000	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	72
美元 9,011	离岸人民币 63,442	2024年10月21日	法国巴黎银行	69
美元 6,649	离岸人民币 46,926	2024年10月21日	法国巴黎银行	67
美元 2,329	英镑 1,780	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	59
美元 1,353	纽元 2,200	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	47
美元 23,828	英镑 17,798	2024年10月21日	法国巴黎银行	45
美元 1,407	离岸人民币 10,000	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	24
美元 5,195	英镑 3,885	2024年10月21日	法国巴黎银行	16
美元 1,102	离岸人民币 7,804	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	15
美元 1,109	离岸人民币 7,843	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	14
美元 4,047	加元 5,482	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	13
美元 1,418	离岸人民币 10,000	2024年10月21日	法国巴黎银行	13
美元 1,582	加元 2,146	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	7
美元 2,101	离岸人民币 14,710	2024年10月21日	法国巴黎银行	4
台币 2,000,000	美元 13,807,705	2024年11月15日	Citibank N.A., 伦敦	483,071
加元 4,062	美元 3,010	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	0
英镑 144,848	美元 194,278	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	1
美元 773,644	离岸人民币 5,393,407	2024年11月21日	法国巴黎银行	253
美元 357,800	离岸人民币 2,494,380	2024年11月21日	法国巴黎银行	117
美元 129,002	离岸人民币 899,632	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	86
美元 208,569	离岸人民币 1,454,022	2024年11月21日	法国巴黎银行	68
美元 42,934	纽元 67,560	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	53
美元 18,436	英镑 13,776	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	42
美元 7,259	离岸人民币 50,609	2024年11月21日	法国巴黎银行	2
印尼盾 152,547,058,290	美元 10,046,566	2025年1月22日	高盛国际, 伦敦	20,982
菲律宾比索 236,000,000	美元 4,219,787	2025年1月22日	高盛国际, 伦敦	10,547
台币 254,000,000	美元 8,115,612	2025年1月22日	渣打银行, 伦敦	13,255
美元 8,141,239	马来西亚林吉特 35,000,000	2025年1月22日	法国巴黎银行	388,585
美元 11,815,929	纽元 19,000,000	2025年1月22日	法国巴黎银行	273,315
美元 24,043,775	新加坡元 31,000,000	2025年1月22日	Citibank N.A., 伦敦	270,198
美元 16,232,976	新加坡元 21,000,000	2025年1月22日	渣打银行, 伦敦	237,782
美元 11,473,950	韩元 15,200,000,000	2025年1月22日	Citibank N.A., 伦敦	223,737
美元 3,419,351	澳元 5,100,000	2025年1月22日	高盛国际, 伦敦	121,161
美元 8,751,888	新加坡元 11,300,000	2025年1月22日	Citibank N.A., 伦敦	110,948
美元 7,954,184	新索尔 30,000,000	2025年1月22日	渣打银行, 伦敦	100,537
美元 4,719,216	韩元 6,250,000,000	2025年1月22日	美国道富银行	90,688
美元 4,079,074	澳元 6,000,000	2025年1月22日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	86,234
美元 8,157,678	新加坡元 10,500,000	2025年1月22日	Citibank N.A., 伦敦	77,700
美元 24,714,359	离岸人民币 172,000,000	2025年1月22日	高盛国际, 伦敦	76,451
美元 3,545,989	澳元 5,200,000	2025年1月22日	美国道富银行	63,945
美元 1,468,269	澳元 2,184,970	2025年1月22日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	48,577
美元 16,566,666	离岸人民币 115,000,000	2025年1月22日	渣打银行, 伦敦	8,584
			未实现总收益	13,858,804
澳元 160,000	美元 109,899	2024年10月2日	法国巴黎银行	(1,101)
英镑 3,885	美元 5,195	2024年10月2日	法国巴黎银行	(16)
美元 1,109	纽元 1,741	2024年10月3日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
美元 203,214	纽元 319,247	2024年10月4日	Citibank N.A., 伦敦	(94)
美元 3,007	加元 4,062	2024年10月7日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
离岸人民币 301,527	美元 43,007	2024年10月8日	Citibank N.A., 伦敦	(95)
离岸人民币 236,536	美元 33,683	2024年10月8日	巴克莱银行, 伦敦	(129)
离岸人民币 3,101,889	美元 442,429	2024年10月8日	Citibank N.A., 伦敦	(975)
离岸人民币 4,604,524	美元 655,700	2024年10月8日	法国巴黎银行	(2,500)
澳元 3,007	美元 2,085	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
澳元 1,602	美元 1,100	2024年10月21日	法国巴黎银行	(12)
澳元 1,625	美元 1,106	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(21)
澳元 1,633	美元 1,105	2024年10月21日	法国巴黎银行	(28)
澳元 1,638	美元 1,104	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(33)

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 1,633	美元 1,099	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(35)
澳元 1,638	美元 1,091	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(46)
澳元 1,655	美元 1,098	2024年10月21日	法国巴黎银行	(50)
澳元 16,865	美元 11,228	2024年10月21日	高盛国际, 伦敦	(476)
澳元 44,607	美元 30,329	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(626)
澳元 30,101	美元 20,252	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(637)
澳元 49,207	美元 33,079	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,069)
澳元 141,326	美元 96,852	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,224)
澳元 212,079	美元 145,594	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,583)
澳元 263,366	美元 180,947	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,822)
澳元 111,979	美元 75,779	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,931)
澳元 102,339	美元 68,996	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2,024)
澳元 163,951	美元 111,364	2024年10月21日	法国巴黎银行	(2,413)
澳元 85,836	美元 57,152	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2,415)
澳元 157,475	美元 105,821	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3,463)
澳元 160,750	美元 107,645	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3,912)
澳元 305,118	美元 207,727	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(4,016)
澳元 931,308	美元 641,650	2024年10月21日	法国巴黎银行	(4,653)
澳元 554,309	美元 376,255	2024年10月21日	美国道富银行	(8,421)
澳元 410,723	美元 272,691	2024年10月21日	法国巴黎银行	(12,340)
加元 1,489	美元 1,099	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
加元 1,496	美元 1,102	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
加元 1,496	美元 1,102	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
加元 1,494	美元 1,101	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
加元 1,495	美元 1,101	2024年10月21日	法国巴黎银行	(6)
加元 3,232	美元 2,380	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
加元 15,456	美元 11,421	2024年10月21日	法国巴黎银行	(25)
加元 39,375	美元 28,975	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(185)
加元 43,486	美元 31,984	2024年10月21日	法国巴黎银行	(220)
离岸人民币 7,722	美元 1,101	2024年10月21日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 7,780	美元 1,106	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
离岸人民币 7,757	美元 1,102	2024年10月21日	法国巴黎银行	(8)
离岸人民币 7,757	美元 1,102	2024年10月21日	法国巴黎银行	(8)
离岸人民币 7,757	美元 1,102	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
离岸人民币 7,804	美元 1,106	2024年10月21日	法国巴黎银行	(11)
离岸人民币 7,804	美元 1,106	2024年10月21日	法国巴黎银行	(11)
离岸人民币 7,821	美元 1,108	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(12)
离岸人民币 7,821	美元 1,108	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(12)
离岸人民币 7,843	美元 1,108	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,808	美元 1,104	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,808	美元 1,104	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,796	美元 1,101	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(15)
离岸人民币 7,829	美元 1,105	2024年10月21日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 7,806	美元 1,102	2024年10月21日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 7,806	美元 1,102	2024年10月21日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 7,792	美元 1,100	2024年10月21日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 7,792	美元 1,100	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
离岸人民币 7,792	美元 1,100	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
离岸人民币 7,792	美元 1,100	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
离岸人民币 7,829	美元 1,102	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	(19)
离岸人民币 26,467	美元 3,763	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(25)
离岸人民币 19,018	美元 2,696	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(26)
离岸人民币 17,928	美元 2,534	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(32)
离岸人民币 42,667	美元 6,049	2024年10月21日	法国巴黎银行	(57)
离岸人民币 48,783	美元 6,891	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(91)
离岸人民币 454,457	美元 64,904	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(139)
离岸人民币 307,996	美元 43,793	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(288)
离岸人民币 136,067	美元 19,147	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(327)
离岸人民币 253,442	美元 35,821	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(452)
离岸人民币 462,180	美元 65,689	2024年10月21日	法国巴黎银行	(460)
离岸人民币 497,547	美元 70,715	2024年10月21日	法国巴黎银行	(495)
离岸人民币 555,860	美元 79,037	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(520)
离岸人民币 1,011,536	美元 144,226	2024年10月21日	法国巴黎银行	(548)
离岸人民币 509,855	美元 72,267	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	(705)
离岸人民币 401,546	美元 56,740	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(731)
离岸人民币 2,643,497	美元 377,535	2024年10月21日	法国巴黎银行	(810)
离岸人民币 445,262	美元 62,828	2024年10月21日	法国巴黎银行	(900)
离岸人民币 738,140	美元 104,651	2024年10月21日	法国巴黎银行	(994)

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 513,186	美元 72,418	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,031)
离岸人民币 531,432	美元 74,904	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,156)
离岸人民币 601,847	美元 84,926	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,212)
离岸人民币 687,873	美元 97,223	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,228)
离岸人民币 1,005,634	美元 142,412	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,518)
离岸人民币 700,120	美元 98,546	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,657)
离岸人民币 1,160,204	美元 163,963	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2,089)
离岸人民币 1,225,103	美元 173,112	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2,229)
离岸人民币 7,773,252	美元 1,110,149	2024年10月21日	法国巴黎银行	(2,382)
离岸人民币 1,649,509	美元 233,593	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2,489)
离岸人民币 1,243,898	美元 175,517	2024年10月21日	法国巴黎银行	(2,513)
离岸人民币 5,472,257	美元 780,239	2024年10月21日	法国巴黎银行	(2,967)
离岸人民币 2,014,717	美元 285,312	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3,040)
离岸人民币 3,327,718	美元 473,162	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3,110)
离岸人民币 1,507,168	美元 212,431	2024年10月21日	法国巴黎银行	(3,280)
离岸人民币 1,453,664	美元 204,558	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3,495)
离岸人民币 1,847,274	美元 260,819	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3,569)
离岸人民币 1,982,076	美元 279,851	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3,829)
离岸人民币 2,080,364	美元 293,221	2024年10月21日	法国巴黎银行	(4,527)
离岸人民币 2,308,269	美元 325,729	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(4,638)
离岸人民币 2,819,714	美元 398,118	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(5,448)
离岸人民币 2,546,312	美元 358,415	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(6,020)
离岸人民币 3,560,982	美元 502,463	2024年10月21日	法国巴黎银行	(7,195)
离岸人民币 4,071,241	美元 574,969	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(7,719)
离岸人民币 4,698,997	美元 664,073	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(8,462)
离岸人民币 5,684,879	美元 802,859	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(10,778)
离岸人民币 6,199,456	美元 876,006	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(11,279)
离岸人民币 8,891,470	美元 1,260,600	2024年10月21日	法国巴黎银行	(11,973)
离岸人民币 6,141,198	美元 866,640	2024年10月21日	法国巴黎银行	(12,307)
离岸人民币 6,831,832	美元 964,839	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(12,953)
离岸人民币 10,877,899	美元 1,541,914	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(14,963)
离岸人民币 18,208,929	美元 2,587,953	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(18,163)
英镑 823	美元 1,102	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1)
英镑 841	美元 1,106	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(22)
英镑 843	美元 1,097	2024年10月21日	法国巴黎银行	(33)
英镑 61,545	美元 80,913	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,640)
英镑 82,409	美元 107,663	2024年10月21日	渣打银行, 伦敦	(2,875)
纽元 1,746	美元 1,103	2024年10月21日	法国巴黎银行	(8)
纽元 1,740	美元 1,097	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	(11)
纽元 1,772	美元 1,105	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(23)
纽元 1,778	美元 1,104	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(27)
纽元 1,789	美元 1,103	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(35)
纽元 11,823	美元 7,468	2024年10月21日	法国巴黎银行	(55)
纽元 12,971	美元 8,024	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(229)
纽元 20,609	美元 12,844	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(269)
纽元 62,894	美元 39,632	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	(386)
纽元 128,490	美元 81,224	2024年10月21日	法国巴黎银行	(531)
纽元 337,196	美元 211,388	2024年10月21日	法国巴黎银行	(3,163)
纽元 327,702	美元 204,101	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(4,409)
纽元 780,908	美元 483,233	2024年10月21日	法国巴黎银行	(13,641)
美元 1,109	加元 1,493	2024年10月21日	法国巴黎银行	(3)
美元 7,979	离岸人民币 55,670	2024年10月21日	法国巴黎银行	(12)
美元 8,269	离岸人民币 57,632	2024年10月21日	法国巴黎银行	(21)
美元 102,277	加元 137,776	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(246)
美元 204,540	加元 275,697	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(371)
美元 261,971	离岸人民币 1,827,699	2024年10月21日	法国巴黎银行	(386)
美元 148,779	加元 200,295	2024年10月21日	法国巴黎银行	(449)
美元 440,717	离岸人民币 3,074,751	2024年10月21日	法国巴黎银行	(649)
美元 345,628	离岸人民币 2,408,865	2024年10月21日	法国巴黎银行	(864)
美元 260,064	加元 350,000	2024年10月21日	法国巴黎银行	(869)
美元 978,958	离岸人民币 6,829,906	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,440)
美元 51,881,655	加元 69,974,542	2024年10月21日	法国巴黎银行	(61,520)
美元 13,816,244	台币 420,000,000	2024年11月15日	高盛国际, 伦敦	(491,611)
澳元 1,587	美元 1,102	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
离岸人民币 6,275,304	美元 899,704	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(736)
离岸人民币 15,986,410	美元 2,291,970	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,912)
纽元 1,728	美元 1,100	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
美元 81,583	加元 110,041	2024年11月21日	高盛国际, 伦敦	(28)

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 10,000,000	美元 6,889,810	2025 年 1 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(52,370)
巴西雷亚尔 53,658,923	美元 9,514,373	2025 年 1 月 22 日	美国道富银行	(196,071)
离岸人民币 115,000,000	美元 16,408,202	2025 年 1 月 22 日	法国巴黎银行	(167,049)
离岸人民币 263,317,076	美元 37,515,594	2025 年 1 月 22 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(436,985)
欧元 14,814,964	美元 16,530,641	2025 年 1 月 22 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(78,238)
港元 110,000,000	美元 14,167,801	2025 年 1 月 22 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(14,218)
港元 277,261,000	美元 35,700,044	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	(46,510)
印尼盾 261,000,000,000	美元 17,013,787	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	(139,460)
韩元 5,360,000,000	美元 4,110,083	2025 年 1 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(14,891)
韩元 10,770,000,000	美元 8,215,291	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	(73,136)
马来西亚林吉特 33,500,000	美元 8,139,959	2025 年 1 月 22 日	法国巴黎银行	(24,301)
马来西亚林吉特 35,000,000	美元 8,055,236	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	(474,588)
纽元 19,000,000	美元 11,662,838	2025 年 1 月 22 日	美国道富银行	(426,406)
新加坡元 21,000,000	美元 16,455,604	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	(15,152)
新加坡元 10,400,000	美元 8,122,709	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	(34,237)
泰铢 137,000,000	美元 4,108,417	2025 年 1 月 22 日	美国道富银行	(180,055)
美元 4,031,066	新索尔 15,000,000	2025 年 1 月 22 日	高盛国际, 伦敦	(3,706)
美元 8,058,770	印度卢比 678,188,785	2025 年 1 月 22 日	美国道富银行	(14,401)
美元 15,729,828	离岸人民币 109,000,000	2025 年 1 月 22 日	法国巴黎银行	(19,373)
美元 8,323,196	台币 260,000,000	2025 年 1 月 22 日	高盛国际, 伦敦	(29,444)
美元 16,058,677	印度卢比 1,350,000,000	2025 年 1 月 22 日	渣打银行, 伦敦	(45,587)
离岸人民币 70,000,000	美元 9,903,932	2025 年 2 月 10 日	渣打银行, 伦敦	(196,973)
			未实现总亏损	(3,517,345)
			未实现净收益	10,341,459

2023

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	纽元 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
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 1,098	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	3
离岸人民币 14,572,380	美元 2,004,979	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

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 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
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

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 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)
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)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
加元 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)
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)

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 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)
纽元 1,852	美元 1,103	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(10)
纽元 1,840	美元 1,096	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(10)
纽元 1,862	美元 1,106	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
纽元 1,847	美元 1,096	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
纽元 1,854	美元 1,089	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(24)
纽元 13,776	美元 8,157	2023年10月20日	法国巴黎银行	(120)
纽元 42,757	美元 25,540	2023年10月20日	法国巴黎银行	(151)
纽元 25,052	美元 14,798	2023年10月20日	法国巴黎银行	(254)
纽元 106,776	美元 63,650	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(506)
纽元 103,643	美元 61,533	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(742)
纽元 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)
纽元 140,681	美元 83,429	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,100)
纽元 86,323	美元 50,668	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,199)
纽元 225,907	美元 134,533	2023年10月20日	美林国际, 伦敦	(1,205)
纽元 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)
纽元 150,267	美元 88,689	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,600)
纽元 409,958	美元 243,410	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2,915)
纽元 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)
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)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
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

(c) 以下为于九月三十日之未平仓期货合约:

	长仓 / (短仓) 的合约数目	合约金额 美元	交割日期	标的资产	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
<u>2024</u>						
US 10yr Note (CBT) 19/12/2024	(247)	(28,227,469)	2024 年 12 月	10 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	81,047
					未实现总收益	81,047
Aust 10yr Bond Fut 16/12/2024	268	21,640,977	2024 年 12 月	10 年期 澳大利亚国债	Citigroup Global Markets Ltd	(16,683)
US 2yr Note (CBT) 31/12/2024	399	83,088,633	2024 年 12 月	2 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	(65,461)
US 5yr Note (CBT) 31/12/2024	182	19,998,672	2024 年 12 月	5 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	(177,734)
					未实现总亏损	(259,878)
					未实现净亏损	(178,831)

	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 15/12/2023	253	18,283,610	2023 年 12 月	10 年期 澳大利亚国债	Citigroup Global Markets Ltd	27,906
					未实现总收益	27,906
US 10yr Note (CBT) 19/12/2023	683	73,806,688	2023 年 12 月	10 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	(929,524)
US 5yr Note (CBT) 29/12/2023	174	18,332,531	2023 年 12 月	5 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	(199,828)
US Ultra Bond (CBT) 19/12/2023	33	3,916,688	2023 年 12 月	30 年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	(302,414)
					未实现总亏损	(1,431,766)
					未实现净亏损	(1,403,860)

(d) 以下为于二零二四年九月三十日之未平仓利率掉期合约：

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

2023

无

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十四页至第四十七页的财务报表，包括：

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

我们的意见

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

意见的基础

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

我们相信，我们所获得的审计凭证能充足及适当地为我们的审计意见提供基础。

独立性

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

其他信息

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

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

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

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

管理层就财务报表需承担的责任

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

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

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

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

根据信托契约与证监会守则附录 E 的相关披露条文就相关事项作出的报告

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

罗兵咸永道会计师事务所
执业会计师

香港，二零二五年一月二十四日

管理人及受托人的责任声明

管理人的责任

基金管理人必须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。

管理人亦必须遵照信托契约，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二零二四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

二零二五年一月二十四日

业绩记录 (未经审计)

资产净值

财务期结算日	本基金资产净值	每份额资产净值
30/9/24 - 澳元对冲类别 (每月派息) - 加元对冲类别 (每月派息) - 英镑对冲类别 (每月派息) - 港元类别 (每月派息) - 纽元对冲类别 (每月派息) - PRC 人民币对冲份额 (累计) - PRC 人民币对冲份额 (每月派息) - PRC 美元份额 (累计) - PRC 美元份额 (每月派息) - 人民币对冲类别 (累计) - 人民币对冲类别 (每月派息) - 美元类别 (累计) - 美元类别 (每月派息)	澳元 86,189,330 加元 71,667,903 英镑 8,786,380 港元 1,555,927,665 纽元 43,974,919 人民币 3,497,384,846 人民币 938,136,758 美元 100,749,385 美元 43,463,162 人民币 30,928,198 人民币 1,625,504,501 美元 12,440,724 美元 281,037,222	澳元 6.41 加元 6.50 英镑 6.79 港元 6.94 纽元 6.37 人民币 12.40 人民币 7.20 美元 11.38 美元 7.26 人民币 12.96 人民币 6.66 美元 12.74 美元 7.97
30/9/23 - 澳元对冲类别 (每月派息) - 加元对冲类别 (每月派息) - 英镑对冲类别 (每月派息) - 港元类别 (每月派息) - 纽元对冲类别 (每月派息) - PRC 人民币对冲份额 (累计) - PRC 人民币对冲份额 (每月派息) - PRC 美元份额 (累计) - PRC 美元份额 (每月派息) - 人民币对冲类别 (累计) - 人民币对冲类别 (每月派息) - 美元类别 (累计) - 美元类别 (每月派息)	澳元 116,529,684 加元 86,315,208 英镑 11,342,201 港元 1,980,906,422 纽元 52,716,264 人民币 1,389,825,131 人民币 285,946,232 美元 103,363,951 美元 13,922,104 人民币 52,730,828 人民币 1,863,716,717 美元 12,341,257 美元 324,128,294	澳元 6.10 加元 6.18 英镑 6.46 港元 6.64 纽元 6.07 人民币 11.26 人民币 6.83 美元 10.10 美元 6.90 人民币 11.80 人民币 6.33 美元 11.31 美元 7.57
30/9/22 - 澳元对冲类别 (每月派息) - 加元对冲类别 (每月派息) - 英镑对冲类别 (每月派息) - 港元类别 (每月派息) - 纽元对冲类别 (每月派息) - PRC 人民币对冲份额 (累计) - PRC 人民币对冲份额 (每月派息) - PRC 美元份额 (累计) - PRC 美元份额 (每月派息) - 人民币对冲类别 (累计) - 人民币对冲类别 (每月派息) - 美元类别 (累计) - 美元类别 (每月派息)	澳元 106,130,688 加元 78,934,141 英镑 5,603,013 港元 2,038,454,890 纽元 46,587,636 人民币 437,407,794 人民币 351,740,162 美元 128,311,762 美元 17,065,170 人民币 11,271,909 人民币 2,280,668,217 美元 10,505,581 美元 355,501,134	澳元 6.39 加元 6.46 英镑 6.75 港元 6.95 纽元 6.36 人民币 11.28 人民币 7.15 美元 9.87 美元 7.20 人民币 11.88 人民币 6.62 美元 11.05 美元 7.90

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
30/9/24			30/9/19		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 6.44	澳元 6.00	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.98	澳元 8.48
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 6.54	加元 6.08	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.02	加元 8.53
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 6.82	英镑 6.35	- 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 6.98	港元 6.53	- 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 6.41	纽元 5.97	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.91	纽元 8.42
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 12.40	人民币 11.08	- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 12.55	人民币 11.41
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 7.22	人民币 6.72	- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.96	人民币 9.40
- PRC 美元份额 (累计)	美元 11.38	美元 9.95	- PRC 美元份额 (累计)	美元 11.60	美元 10.58
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 7.30	美元 6.78	- 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 12.96	人民币 11.61	- 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 6.68	人民币 6.23	- 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 12.74	美元 11.14	- 美元类别 (累计)	美元 12.98	美元 11.84
- 美元类别 (每月派息)	美元 8.01	美元 7.44	- 美元类别 (每月派息)	美元 10.96	美元 10.35
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			

经营与管理

管理人及服务提供者

摩根基金（亚洲）有限公司
香港
中环干诺道中 8 号
遮打大厦 19 楼

投资管理人

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

管理人董事

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

受托人

汇丰机构信托服务
（亚洲）有限公司
香港
中环皇后大道中 1 号

基金注册登记机构

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

核数师

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

