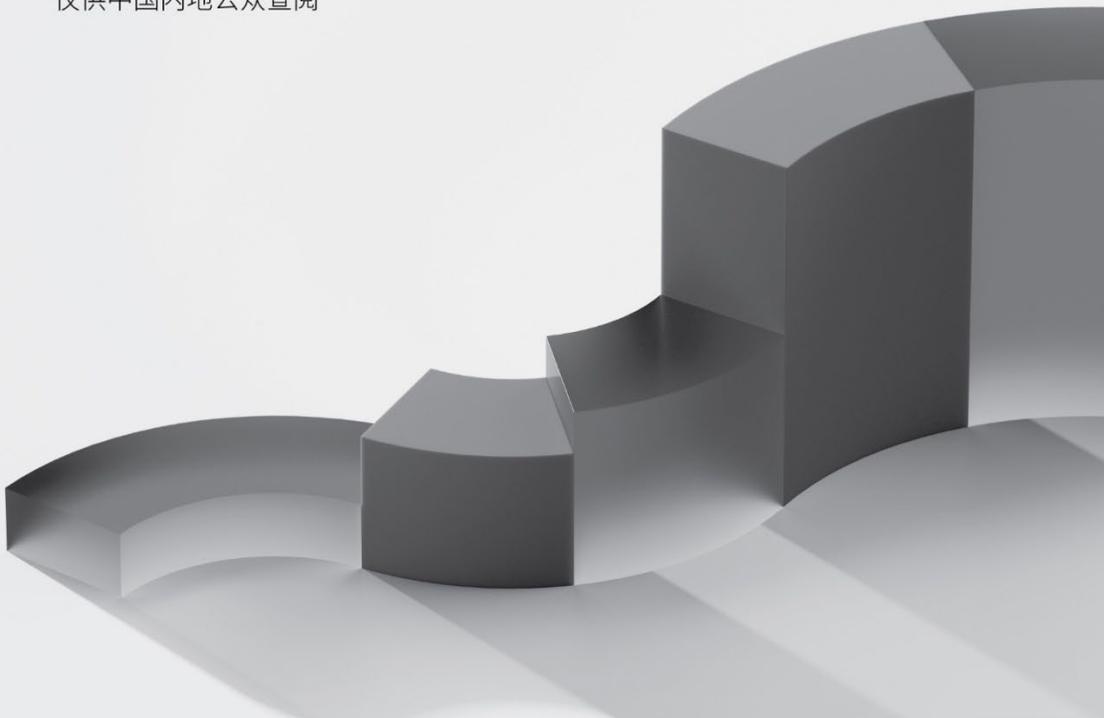


仅供中国内地公众查阅



半年度报告 — 2025年3月31日（未经审核）

# 摩根亚洲总收益 债券基金

内地与香港互认基金系列

摩根  
资产管理

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

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

| 内容               | 页       |
|------------------|---------|
| 投资组合             | 1 - 14  |
| 投资组合持有变动表        | 15      |
| 金融衍生工具详情         | 16 - 24 |
| 抵押品持有情况          | 25      |
| 财务状况表            | 26      |
| 综合收益表            | 26      |
| 可赎回份额持有人应占净资产变动表 | 27      |
| 现金流量表            | 27      |
| 财务报表之附注          | 28 - 35 |
| 经营与管理            | 36      |

投资组合  
于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|  | 单位数目           | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值<br>百分比 |  | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值<br>百分比 |
|--|----------------|------------|------------------|--|---------------|------------|------------------|
| <b>上市投资 (98.5%)</b>  |                |            |                  | Ausnet Services<br>Holdings Ser MTN<br>Var 12Feb2055                   | 澳元 4,960,000  | 3,165,464  | 0.1              |
| <b>(I) 可转换证券 (2.6%)</b>  |                |            |                  | Aust & Nz Banking<br>Group Ser EMTN<br>(Reg) (Reg S) Var<br>31Jul2035  | 欧元 4,000,000  | 4,311,323  | 0.1              |
| <b>中国 (1.1%)</b>   |                |            |                  | Aust & Nz Banking<br>Group Ser MTN Var<br>15Jan2035                    | 澳元 3,000,000  | 1,907,272  | 0.1              |
| Meituan (Reg) (Reg S)<br>0% Conv 27Apr2028                                 | 美元 30,000,000  | 29,094,000 | 0.9              | Aust & Nz Banking<br>Group Ser Regs (Reg<br>S) 2.57% 25Nov2035         | 美元 8,500,000  | 7,424,002  | 0.2              |
| Zhongsheng Group<br>(Reg) (Reg S) 0%<br>Conv 21May2025                     | 港元 40,000,000  | 6,002,324  | 0.2              | Aust & Nz Banking<br>Group Ser Regs (Reg<br>S) Var 30Sep2035           | 美元 3,300,000  | 3,190,856  | 0.1              |
| <b>香港 (0.6%)</b>   |                |            |                  | Australia (Govt of)<br>Ser 168 (Reg S)<br>3.5% 21Dec2034               | 澳元 13,152,000 | 7,705,171  | 0.2              |
| Link Cb Ltd (Reg)<br>(Reg S) 4.5% Conv<br>12Dec2027                        | 港元 140,000,000 | 18,294,762 | 0.6              | Australia Pacific Airpor<br>Ser MTN 5.598%<br>01Nov2032                | 澳元 1,740,000  | 1,121,321  | 0.0              |
| <b>韩国 (0.2%)</b>   |                |            |                  | Commonwealth Bank<br>Aust Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) 3.61%<br>12Sep2034 | 美元 4,628,000  | 4,339,915  | 0.1              |
| LG Chem Ltd (Reg) (Reg<br>S) 1.6% Conv<br>18Jul2030                        | 美元 7,900,000   | 7,390,250  | 0.2              | Goodman US Finance<br>Six Ser Regs (Reg)<br>5.125% 07Oct2034           | 美元 1,919,000  | 1,947,004  | 0.1              |
| <b>美国 (0.7%)</b>   |                |            |                  | Lonsdale Finance Pty<br>Ltd Ser MTN (Reg)<br>(Reg S) 2.1%<br>15Oct2027 | 澳元 1,490,000  | 879,856    | 0.0              |
| Citigroup Global<br>Markets Ser 1299<br>(Reg) (Reg S) 0%<br>Conv 26Feb2026 | 港元 138,000,000 | 17,040,516 | 0.5              | Lonsdale Finance Pty<br>Ltd Ser MTN 5.5%<br>19Nov2031                  | 澳元 4,220,000  | 2,716,676  | 0.1              |
| Goldman Sachs Fin C<br>Intl Ser 700H 0%<br>Conv 13Mar2028                  | 美元 5,800,000   | 5,756,500  | 0.2              | Macquarie Bank Ltd<br>Ser Regs (Reg S) Var<br>03Mar2036                | 美元 2,100,000  | 1,842,396  | 0.1              |
|  |                | 83,578,352 | 2.6              | Macquarie Group Ltd<br>Ser Regs (Reg S) Var<br>15Jun2034               | 美元 7,500,000  | 7,906,342  | 0.2              |
|  |                | -----      | -----            | National Australia<br>Bank FRN<br>14Jan2036                            | 美元 31,300,000 | 32,175,781 | 1.0              |
| <b>(II) 债务证券 (92.5%)</b>   |                |            |                  | National Australia<br>Bank Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) Var<br>02Aug2034  | 美元 3,493,000  | 3,335,999  | 0.1              |
| <b>安哥拉 (0.1%)</b>  |                |            |                  | NBN Co Ltd Ser MTN<br>(Reg) (Reg S) 5%<br>28Aug2031                    | 澳元 2,000,000  | 1,260,277  | 0.0              |
| Azule Energy Finance<br>Plc Ser Regs 8.125%<br>23Jan2030                   | 美元 2,340,000   | 2,382,523  | 0.1              | NBN Co Ltd Ser MTN<br>5.35% 06Mar2035                                  | 澳元 2,980,000  | 1,860,041  | 0.1              |
| <b>澳大利亚 (5.1%)</b>   |                |            |                  | NBN Co Ltd Ser Regs<br>(Reg S) 2.625%<br>05May2031                     | 美元 4,000,000  | 3,615,691  | 0.1              |
| Apa Infrastructure Ltd<br>5.75% 16Sep2044                                  | 美元 1,367,000   | 1,356,914  | 0.0              | NBN Co Ltd Ser Regs<br>(Reg) (Reg S) 2.5%<br>08Jan2032                 | 美元 392,000    | 339,972    | 0.0              |
| Apa Infrastructure Ltd<br>Ser Regs (Reg S)<br>5.125% 16Sep2034             | 美元 4,000,000   | 3,912,318  | 0.1              | New S Wales Treasury<br>CRP 2% 08Mar2033                               | 澳元 2,000,000  | 1,020,284  | 0.0              |
| APT Pipelines Ltd Ser<br>Regs 5% 23Mar2035                                 | 美元 1,700,000   | 1,642,886  | 0.1              |  |               |            |                  |
| Ausnet Services<br>Holdings Ser MTN<br>(Reg) (Reg S)<br>5.9812% 16May2034  | 澳元 2,500,000   | 1,631,743  | 0.1              |  |               |            |                  |
| Ausnet Services<br>Holdings Ser MTN<br>(Reg) 6.134%<br>31May2033           | 澳元 3,500,000   | 2,312,320  | 0.1              |  |               |            |                  |

投资组合

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|  | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值<br>百分比 |   | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值<br>百分比 |
|--|---------------|------------|------------------|---|---------------|------------|------------------|
| <b>澳大利亚 (续)</b>  |               |            |                  | Braskem Netherlands<br>Ser Regs (Reg S)                             |               |            |                  |
| Newcastle Coal Infrastru<br>4.7% 12May2031                               | 美元 5,000,000  | 4,761,437  | 0.2              | 8.5% 12Jan2031  | 美元 5,000,000  | 5,127,209  | 0.1              |
| Newcastle Coal<br>Infrastru Ser Regs<br>(Reg) (Reg S) 4.4%<br>29Sep2027  | 美元 2,889,000  | 2,826,926  | 0.1              | Braskem Netherlands<br>Ser Regs (Reg) (Reg<br>S) 4.5% 10Jan2028     | 美元 6,500,000  | 6,149,956  | 0.2              |
| Northern Territory<br>Treas 4.50%<br>21Mar2035                           | 澳元 3,000,000  | 1,734,009  | 0.1              | Braskem Netherlands<br>Ser Regs 8.0%<br>15Oct2034                   | 美元 2,730,000  | 2,716,593  | 0.1              |
| Nsw Electricity<br>Networks Ser MTN<br>FRN 11Mar2055                     | 澳元 2,250,000  | 1,409,391  | 0.0              | Brazil (Rep of) 3.875%<br>12Jun2030                                 | 美元 2,000,000  | 1,875,965  | 0.1              |
| Nsw Electricity<br>Networks Ser MTN<br>Var 11Mar2055                     | 澳元 1,750,000  | 1,097,538  | 0.0              | CSN Islands XI Corp Ser<br>Regs (Reg) (Reg S)<br>6.75% 28Jan2028    | 美元 7,000,000  | 6,777,564  | 0.2              |
| Santos Finance Ltd Ser<br>EMTN (Reg S) (Br)<br>5.25% 13Mar2029           | 美元 2,400,000  | 2,415,823  | 0.1              | Minerva Luxembourg<br>SA Ser Regs (Reg S)<br>8.875% 13Sep2033       | 美元 4,000,000  | 4,275,422  | 0.1              |
| Santos Finance Ltd Ser<br>Regs (Reg S) 3.649%<br>29Apr2031               | 美元 5,000,000  | 4,612,094  | 0.1              | Raizen Fuels Finance<br>Ser Regs (Reg S)<br>6.45% 05Mar2034         | 美元 5,000,000  | 5,078,832  | 0.1              |
| Santos Finance Ltd Ser<br>Regs (Reg S) 6.875%<br>19Sep2033               | 美元 12,900,000 | 13,859,330 | 0.4              | Suzano Austria GmbH<br>3.75% 15Jan2031                              | 美元 1,000,000  | 911,201    | 0.0              |
| Scentre Group Trst 1<br>Ser MTN 5.9%<br>27Nov2034                        | 澳元 200,000    | 129,311    | 0.0              | Vale Overseas Limited<br>(Reg) 6.125%<br>12Jun2033                  | 美元 3,000,000  | 3,125,481  | 0.1              |
| Scentre Group Trust<br>1/2 Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) 4.375%<br>28May2030 | 美元 4,000,000  | 4,017,644  | 0.1              | Vale Overseas Limited<br>(Reg) 6.4%<br>28Jun2054                    | 美元 6,000,000  | 6,026,354  | 0.2              |
| Scentre Group Trust 2<br>Ser Regs (Reg S) Var<br>24Sep2080               | 美元 3,635,000  | 3,622,287  | 0.1              | <b>智利 (1.2%)</b>  |               |            |                  |
| South Aust Govt Fin<br>Auth (Reg) 1.75%<br>24May2034                     | 澳元 5,000,000  | 2,395,553  | 0.1              | Chile (Rep of) (Reg)<br>4.95% 05Jan2036                             | 美元 5,000,000  | 4,917,875  | 0.1              |
| Transurban Finance Co<br>Ser Regs (Reg S)<br>2.45% 16Mar2031             | 美元 6,000,000  | 5,262,026  | 0.2              | Chile Electricity Lux Ser<br>Regs 6.01%<br>20Jan2033                | 美元 13,000,000 | 12,565,779 | 0.4              |
| Treasury Corp Victoria<br>Ser MTN (Reg) 2.5%<br>22Oct2029                | 澳元 5,000,000  | 2,935,839  | 0.1              | Codelco Inc Ser Regs<br>(Reg S) 6.3%<br>08Sep2053                   | 美元 4,000,000  | 3,996,412  | 0.1              |
| Treasury Corp Victoria<br>Ser MTN (Reg) 4.75%<br>15Sep2036               | 澳元 1,000,000  | 594,594    | 0.0              | Codelco Inc Ser Regs<br>6.33% 13Jan2035                             | 美元 5,000,000  | 5,223,125  | 0.2              |
| Westpac Banking Corp<br>(Reg) Var 15Nov2035                              | 美元 4,900,000  | 4,302,727  | 0.1              | Codelco Inc Ser Regs<br>6.78% 13Jan2055                             | 美元 4,000,000  | 4,167,992  | 0.1              |
| Woodside Finance Ltd<br>5.1% 12Sep2034                                   | 美元 2,000,000  | 1,947,513  | 0.1              | Empresa De Los<br>Ferrocarr Ser Regs<br>(Reg S) 3.068%<br>18Aug2050 | 美元 10,600,000 | 6,478,291  | 0.2              |
| Woodside Finance Ltd<br>Ser Regs (Reg S)<br>4.5% 04Mar2029               | 美元 1,700,000  | 1,682,773  | 0.1              | Republic of Chile 5.65%<br>13Jan2037                                | 美元 3,000,000  | 3,086,825  | 0.1              |
| Woolworths Group Ltd<br>Ser MTN 5.91%<br>29Nov2034                       | 澳元 4,010,000  | 2,584,081  | 0.1              | <b>中国 (7.7%)</b>  |               |            |                  |
| <b>巴西 (1.3%)</b>   |               |            |                  | Alibaba Group Holding<br>(Reg) 4% 06Dec2037                         | 美元 15,000,000 | 13,441,324 | 0.4              |
| Acu Petroleo<br>Luxembourg Ser<br>Regs (Reg) (Reg S)<br>7.5% 13Jul2035   | 美元 2,000,000  | 1,877,034  | 0.1              | Alibaba Group Holding<br>(Reg) 4.2%<br>06Dec2047                    | 美元 3,400,000  | 2,816,652  | 0.1              |
|  |               |            |                  | Alibaba Group Holding<br>(Reg) 4.5%<br>28/11/2034                   | 美元 3,000,000  | 2,918,209  | 0.1              |
|  |               |            |                  | Alibaba Group Holding<br>Ser Regs (Reg)<br>5.625% 26Nov2054         | 美元 3,000,000  | 3,046,732  | 0.1              |

投资组合  
于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|   | 单位数目               | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值<br>百分比 |   | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值<br>百分比 |
|---|--------------------|------------|------------------|---|---------------|------------|------------------|
| <b>中国 (续)</b>   |                    |            |                  | China Cinda 2020 I<br>Mngmn Ser EMTN<br>(Reg) (Reg S) 5.375%<br>23Jul2027 | 美元 2,000,000  | 2,044,624  | 0.1              |
| Alibaba Group Holding<br>Ser Regs 5.25%<br>26May2035  | 美元 3,000,000       | 3,073,356  | 0.1              | China Cinda 2020 I<br>Mngmn Ser EMTN<br>(Reg) (Reg S) 5.75%<br>28May2029  | 美元 13,410,000 | 14,091,460 | 0.4              |
| Azure Orbit IV Intl Fin<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) 4% 25Jan2028   | 美元 1,800,000       | 1,781,908  | 0.1              | China Greatwall Vi<br>(Reg) (Reg S) 4.25%<br>28Apr2025                    | 美元 1,400,000  | 1,424,315  | 0.0              |
| CDB Financial Leasing<br>(Reg) (Reg S) Var<br>28Sep2030   | 美元 8,000,000       | 7,919,917  | 0.2              | China Huadian<br>Overseas (Reg) (Reg<br>S) Var Perp<br>31Dec2049          | 美元 2,500,000  | 2,518,682  | 0.1              |
| Central Plaza Dev Ltd<br>7.15% 21Mar2028  | 美元 2,405,000       | 2,433,841  | 0.1              | China Modern Dairy<br>Holdi (Reg) (Reg S)<br>2.125% 14Jul2026             | 美元 2,050,000  | 1,985,987  | 0.1              |
| Central Plaza Dev Ltd<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) 3.85% 14Jul2025  | 美元 800,000         | 807,292    | 0.0              | ENN Clean Energy Ser<br>Regs (Reg S) 3.375%<br>12May2026                  | 美元 7,100,000  | 7,057,785  | 0.2              |
| CFAMC II Co Ltd (Reg)<br>(Reg S) 4.625%<br>03Jun2026 (原名称:<br>Huarong Finance II<br>Co Ltd (Reg) (Reg S)<br>4.625 03Jun2026)                  | 美元 3,000,000       | 3,036,089  | 0.1              | Far East Horizon Ltd<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) 4.25% 26Oct2026         | 美元 7,956,000  | 7,941,644  | 0.2              |
| CFAMC III Co Ltd (Reg)<br>(Reg S) 3.8%<br>07Nov2025 (原名称:<br>Huarong Finance<br>2017 Co (Reg) (Reg S)<br>3.8% 07Nov2025)                      | 新加坡元<br>18,750,000 | 14,123,822 | 0.4              | Far East Horizon Ltd<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) 6.625% 16Apr2027        | 美元 4,102,000  | 4,282,673  | 0.1              |
| CFAMC III Co Ltd 4.75%<br>27Apr2027 (原名称:<br>Huarong Finance<br>2017 Co 4.75%<br>27Apr2027)   | 美元 3,700,000       | 3,758,269  | 0.1              | Far East Horizon Ltd<br>Ser EMTN 6.0%<br>01Oct2028                        | 美元 3,300,000  | 3,274,141  | 0.1              |
| CFAMC IV Co Ltd Ser<br>EMTN (Reg) (Reg S)<br>3.625% 30Sep2030<br>(原名称: Huarong<br>Finance 2019 Ser<br>EMTN (Reg) (Reg S)<br>3.625% 30Sep2030) | 美元 8,200,000       | 7,530,066  | 0.2              | Fortune Star BVI Ltd<br>(Reg) (Reg S) 3.95%<br>02Oct2026                  | 欧元 15,400,000 | 16,272,357 | 0.5              |
| CFAMC IV Co Ltd Ser<br>EMTN (Regs) 4.5%<br>29May2029 (原名称:<br>Huarong Finance<br>2019 Ser EMTN<br>(Regs) 4.5%<br>29May2029)                   | 美元 2,200,000       | 2,175,514  | 0.1              | Franshion Brilliant Ltd<br>(Reg) (Reg S) 3.2%<br>09Apr2026                | 美元 2,600,000  | 2,570,703  | 0.1              |
| CFAMC IV Co Ltd Ser<br>GMTN (Reg S) Var<br>Perp 31Dec2049 (原<br>名称: Huarong<br>Finance 2019 Ser<br>GMTN (Reg S) Var<br>Perp 31Dec2049)        | 美元 4,561,000       | 4,543,522  | 0.1              | GLP China Holdings Ltd<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) 2.95% 29Mar2026       | 美元 3,600,000  | 3,382,297  | 0.1              |
| China Cinda 2020 I<br>Mngmn Ser EMTN<br>(Reg) (Reg S) 3%<br>20Jan2031   | 美元 14,100,000      | 12,866,993 | 0.4              | Great Wall Intl V (Reg)<br>(Reg S) 2.875%<br>23Nov2026                    | 美元 2,200,000  | 2,145,420  | 0.1              |
|   |                    |            |                  | Hongkong Intl Qingdao<br>(Reg) (Reg S) 5.75%<br>12Sep2027                 | 美元 3,000,000  | 3,036,866  | 0.1              |
|   |                    |            |                  | JD.com Inc 4.125%<br>14Jan2050  | 美元 9,000,000  | 7,382,141  | 0.2              |
|   |                    |            |                  | Jinan URB Const Intl<br>Inv (Reg) (Reg S)<br>2.4% 23Sep2026               | 美元 2,800,000  | 2,694,979  | 0.1              |
|   |                    |            |                  | Lenovo Group Ltd Ser<br>Regs (Reg S) 3.421%<br>02Nov2030                  | 美元 6,800,000  | 6,361,459  | 0.2              |
|   |                    |            |                  | Longfor Holdings Ltd<br>(Reg) (Reg S) 3.95%<br>16Sep2029                  | 美元 1,500,000  | 1,190,125  | 0.0              |
|   |                    |            |                  | Longfor Properties<br>(Reg) (Reg S) 4.5%<br>16Jan2028                     | 美元 1,900,000  | 1,667,038  | 0.1              |
|   |                    |            |                  | Meituan Ser Regs<br>4.625% 02Oct2029                                      | 美元 2,759,000  | 2,792,868  | 0.1              |

投资组合  
于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|                        | 单位数目          | 公允价值<br>美元 | 占资产<br>净值<br>百分比 |                         | 单位数目          | 公允价值<br>美元 | 占资产<br>净值<br>百分比 |
|------------------------|---------------|------------|------------------|-------------------------|---------------|------------|------------------|
| <b>中国 (续)</b>          |               |            |                  | Ecopetrol SA (Reg)      |               |            |                  |
| Prosus NV Ser (Reg)    |               |            |                  | 8.625% 19Jan2029        | 美元 10,000,000 | 10,786,910 | 0.3              |
| (Reg S) 3.257%         |               |            |                  | Ecopetrol SA (Reg)      |               |            |                  |
| 19Jan2027              | 美元 2,500,000  | 2,437,879  | 0.1              | 8.875% 13Jan2033        | 美元 3,000,000  | 3,155,856  | 0.1              |
| Prosus NV Ser Regs     |               |            |                  | <b>哥斯达黎加 (0.2%)</b>     |               |            |                  |
| (Reg S) 4.193%         |               |            |                  | Costa Rica Government   |               |            |                  |
| 19Jan2032              | 美元 6,200,000  | 5,706,644  | 0.2              | Ser Regs (Reg) (Reg S)  |               |            |                  |
| Prosus NV Ser Regs     |               |            |                  | 6.125% 19Feb2031        | 美元 6,000,000  | 6,125,015  | 0.2              |
| (Reg S) 4.987%         |               |            |                  | <b>丹麦 (0.1%)</b>        |               |            |                  |
| 19Jan2052              | 美元 1,900,000  | 1,498,035  | 0.1              | Danske Bank A/S (Reg S) |               |            |                  |
| Prosus NV Ser Regs     |               |            |                  | (Br) Var Perp           |               |            |                  |
| (Reg) (Reg S) 3.68%    |               |            |                  | 31Dec2049               | 美元 3,200,000  | 3,179,434  | 0.1              |
| 21Jan2030              | 美元 6,600,000  | 6,147,353  | 0.2              | <b>多米尼加 (0.2%)</b>      |               |            |                  |
| Prosus NV Ser Regs     |               |            |                  | Dominican (Rep of) Ser  |               |            |                  |
| (Reg) (Reg S) 3.832%   |               |            |                  | Regs (Reg S) 5.5%       |               |            |                  |
| 08Feb2051              | 美元 2,200,000  | 1,426,854  | 0.0              | 22Feb2029               | 美元 5,500,000  | 5,458,246  | 0.2              |
| Talent Yield Intntnl   |               |            |                  | <b>法国 (0.3%)</b>        |               |            |                  |
| (Reg) (Reg S) 3.125%   |               |            |                  | BNP Paribas Ser EMTN    |               |            |                  |
| 06May2031              | 美元 4,600,000  | 4,283,142  | 0.1              | (Reg S) (Br) Var        |               |            |                  |
| Tencent Holdings Ltd   |               |            |                  | 15Nov2035               | 英镑 3,800,000  | 5,020,361  | 0.1              |
| Ser Regs (Reg S)       |               |            |                  | BNP Paribas Ser EMTN    |               |            |                  |
| 3.24% 03Jun2050        | 美元 10,000,000 | 6,950,260  | 0.2              | Var 15Jan2031           | 欧元 3,400,000  | 3,706,579  | 0.1              |
| Tencent Holdings Ltd   |               |            |                  | BPCE SA Ser 144A Var    |               |            |                  |
| Ser Regs (Reg S)       |               |            |                  | 19Oct2029               | 美元 2,000,000  | 2,167,393  | 0.1              |
| 3.84% 22Apr2051        | 美元 6,400,000  | 4,976,730  | 0.2              | <b>德国 (0.1%)</b>        |               |            |                  |
| Tencent Holdings Ltd   |               |            |                  | Deutsche Bank AG Ser    |               |            |                  |
| Ser Regs (Reg) (Reg    |               |            |                  | EMTN Var 13Feb2031      | 欧元 400,000    | 428,965    | 0.0              |
| S) 2.88% 22Apr2031     | 美元 4,000,000  | 3,689,994  | 0.1              | LB Baden-               |               |            |                  |
| Tencent Holdings Ltd   |               |            |                  | Wuerttemberg Ser        |               |            |                  |
| Ser Regs (Reg) (Reg    |               |            |                  | MTN (Reg S) 5.25%       |               |            |                  |
| S) 3.68% 22Apr2041     | 美元 6,000,000  | 4,965,905  | 0.2              | 02Aug2029               | 澳元 3,000,000  | 1,906,758  | 0.1              |
| Tencent Music Ent Grp  |               |            |                  | <b>危地马拉 (0.1%)</b>      |               |            |                  |
| (Reg) 2% 03Sep2030     | 美元 1,700,000  | 1,481,072  | 0.1              | Republic of Guatemala   |               |            |                  |
| Weibo Corp (Reg)       |               |            |                  | Ser Regs (Reg S)        |               |            |                  |
| 3.375% 08Jul2030       | 美元 12,469,000 | 11,611,348 | 0.4              | 6.05% 06Aug2031         | 美元 4,000,000  | 4,027,372  | 0.1              |
| Xiaomi Best Time Intl  |               |            |                  | <b>香港 (4.8%)</b>        |               |            |                  |
| Ser Regs (Reg) (Reg    |               |            |                  | AIA Group Ltd Ser       |               |            |                  |
| S) 4.1% 14Jul2051      | 美元 1,400,000  | 1,115,297  | 0.0              | GMTN (Reg) (Reg S)      |               |            |                  |
| Yanlord Land HK Co     |               |            |                  | Var 09Sep2033           | 欧元 1,700,000  | 1,685,472  | 0.1              |
| Ltd (Reg) (Reg S)      |               |            |                  | AIA Group Ltd Ser       |               |            |                  |
| 5.125% 20May2026       | 美元 900,000    | 899,248    | 0.0              | GMTN (Reg) (Reg S)      | 新加坡元          |            |                  |
| Yunda Holding Inv      |               |            |                  | Var Perp 31Dec2049      | 3,750,000     | 2,943,544  | 0.1              |
| (Reg) (Reg S) 2.25%    |               |            |                  | AIA Group Ltd Ser Regs  |               |            |                  |
| 19Aug2025              | 美元 7,331,000  | 7,257,767  | 0.2              | (Reg S) 5.4%            |               |            |                  |
| Zhongsheng Group       |               |            |                  | 30Sep2054               | 美元 16,214,000 | 15,234,488 | 0.5              |
| (Reg) (Reg S) 3%       |               |            |                  | AIA Group Ltd Ser Regs  |               |            |                  |
| 13Jan2026              | 美元 450,000    | 444,010    | 0.0              | (Reg) (Reg S) 3.2%      |               |            |                  |
| Zhongsheng Group       |               |            |                  | 16Sep2040               | 美元 3,000,000  | 2,314,179  | 0.1              |
| (Reg) (Reg S) 5.98%    |               |            |                  | AIA Group Ltd Ser Regs  |               |            |                  |
| 30Jan2028              | 美元 4,566,000  | 4,591,110  | 0.1              | (Reg) (Reg S) 5.375%    |               |            |                  |
| <b>哥伦比亚 (0.8%)</b>     |               |            |                  | 05Apr2034               | 美元 6,000,000  | 6,248,381  | 0.2              |
| Colombia (Rep of)      |               |            |                  | Airport Authority HK    |               |            |                  |
| (Reg) 3% 30Jan2030     | 美元 5,000,000  | 4,275,667  | 0.1              | (Reg) (Reg S) Var Perp  |               |            |                  |
| Colombia (Rep of)      |               |            |                  | 2.1%                    | 美元 2,000,000  | 1,966,275  | 0.1              |
| (Reg) 8.75%            |               |            |                  |                         |               |            |                  |
| 14Nov2053              | 美元 3,000,000  | 3,086,816  | 0.1              |                         |               |            |                  |
| Colombia (Rep of)      |               |            |                  |                         |               |            |                  |
| (Reg) 3.125% 15Apr2031 | 美元 2,000,000  | 1,651,019  | 0.1              |                         |               |            |                  |
| Colombia               |               |            |                  |                         |               |            |                  |
| Telecomunicacio Ser    |               |            |                  |                         |               |            |                  |
| Regs (Regs) 4.95%      |               |            |                  |                         |               |            |                  |
| 17Jul2030              | 美元 2,000,000  | 1,822,524  | 0.1              |                         |               |            |                  |

投资组合

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|   | 单位数目          | 公允价值<br>美元 | 占资产<br>净值<br>百分比 |   | 单位数目          | 公允价值<br>美元 | 占资产<br>净值<br>百分比 |
|---|---------------|------------|------------------|---|---------------|------------|------------------|
| <b>香港 (续)</b>   |               |            |                  |   |               |            |                  |
| Airport Authority HK<br>(Reg) (Reg S) VAR<br>Perp 2.4%                  | 美元 8,000,000  | 7,567,167  | 0.2              | Nan Fung Treasury Ltd<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) 3.875% 03Oct2027                     | 美元 3,000,000  | 2,964,197  | 0.1              |
| Airport Authority HK<br>Ser Regs 4.875%<br>15Jul2030                    | 美元 17,657,000 | 18,167,723 | 0.6              | Nan Fung Treasury Ltd<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) 5% 05Sep2028                         | 美元 6,400,000  | 6,349,217  | 0.2              |
| Bank of East Asia Ltd<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) Var 13Mar2027        | 美元 4,000,000  | 4,065,210  | 0.1              | Nan Fung Treasury Ltd<br>Ser EMTN (Reg)<br>(Regs) 3.625%<br>27Aug2030                   | 美元 4,451,000  | 4,059,840  | 0.1              |
| Bank of East Asia Ltd Ser<br>EMTN (Reg) (Reg S)<br>Var 27Jun2034        | 美元 3,741,000  | 3,873,895  | 0.1              | Nanyang Commercial<br>Bank (Reg) (Reg S)<br>Var 06Aug2034                               | 美元 3,200,000  | 3,300,290  | 0.1              |
| Bank of East Asia Ltd Ser<br>EMTN (Reg) (Reg S)<br>Var 29May2030        | 美元 3,200,000  | 3,235,898  | 0.1              | Prudential Funding<br>(Asia) Plc (Reg) (Reg<br>S) Var 03Nov2033                         | 美元 11,766,000 | 11,059,731 | 0.3              |
| CAS Capital No1 Ltd<br>(Reg) (Reg S) Var<br>Perp 31Dec2049              | 美元 11,800,000 | 11,509,310 | 0.3              | <b>匈牙利 (0.1%)</b>   |               |            |                  |
| Champion MTN Ltd Ser<br>EMTN (Reg S) 2.85%<br>20Jun2025                 | 港元 14,000,000 | 1,830,374  | 0.1              | OTP Bank Nyrt Ser<br>EMTN Var 30Jul2035   | 美元 4,551,000  | 4,709,293  | 0.1              |
| Dah Sing Bank Ltd Ser<br>EMTN (Reg) (Reg S)<br>Var 02Nov2031            | 美元 2,800,000  | 2,730,296  | 0.1              | <b>印度 (15.0%)</b>   |               |            |                  |
| Dah Sing Bank Ltd Ser<br>EMTN (Reg) (Reg S)<br>Var 15Nov2033            | 美元 6,500,000  | 7,032,034  | 0.2              | ABJA Investment Co<br>(Reg) (Reg S) 5.45%<br>24Jan2028                                  | 美元 6,700,000  | 6,822,178  | 0.2              |
| Elect Global Inv Ltd Var<br>Perp 31Dec2049                              | 美元 1,866,000  | 1,897,824  | 0.1              | Adani Ports and<br>Special Ser Regs<br>(Reg) (Reg S) 4.2%<br>04Aug2027                  | 美元 4,000,000  | 3,791,308  | 0.1              |
| FWD Group Holdings<br>Ltd Ser EMTN (Reg)<br>(Reg S) 7.635%<br>02Jul2031 | 美元 12,300,000 | 13,535,097 | 0.4              | Adani Ports and<br>Special Ser Regs<br>(Reg) 4% 30Jul2027                               | 美元 2,000,000  | 1,897,616  | 0.1              |
| FWD Group Ltd Ser<br>EMTN (Reg S) Var<br>Perp                           | 美元 1,700,000  | 1,724,853  | 0.0              | Axis Bank Gift City Ser<br>Regs (Reg S) Var<br>Perp 31Dec2049                           | 美元 18,900,000 | 18,317,964 | 0.6              |
| Goodman HK Finance<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) 3% 22Jul2030            | 美元 1,000,000  | 915,920    | 0.0              | Azure Power Energy<br>Ltd Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) 3.575%<br>19Aug2026                 | 美元 17,903,000 | 12,814,138 | 0.4              |
| Hongkong Land<br>Finance Ser EMTN<br>(Reg) (Reg S) 5.25%<br>14Jul2033   | 美元 1,510,000  | 1,534,624  | 0.0              | Bharti Airtel Ltd Ser<br>Regs (Regs) 3.25%<br>03Jun2031                                 | 美元 2,500,000  | 2,298,721  | 0.1              |
| JMH Co Ltd (Reg) (Reg<br>S) 2.875% 09Apr2036                            | 美元 4,800,000  | 3,974,240  | 0.1              | Biocon Biologics<br>Global Ser Regs<br>6.67% 09Oct2029                                  | 美元 12,992,000 | 12,628,286 | 0.4              |
| Melco Resorts Finance<br>4.875% 06Jun2025                               | 美元 7,000,000  | 7,083,649  | 0.2              | Continuum Energy<br>Aura Ser Regs (Reg<br>S) 9.5% 24Feb2027                             | 美元 14,100,000 | 14,803,772 | 0.4              |
| Melco Resorts Finance<br>Ser Regs (Reg) (Reg<br>S) 7.625% 17Apr2032     | 美元 1,900,000  | 1,959,767  | 0.1              | Continuum Grn Spv Co-<br>Iss Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) 7.5%<br>26Jun2033                | 美元 3,500,000  | 3,602,786  | 0.1              |
| Melco Resorts Finance<br>Ser Regs (Regs)<br>5.75% 21Jul2028             | 美元 2,000,000  | 1,947,243  | 0.1              | Delhi International<br>Airport Limited Ser<br>Regs (Reg) (Reg S)<br>6.125%<br>31Oct2026 | 美元 9,500,000  | 9,767,387  | 0.3              |
| MTR Corp Ltd Ser<br>EMTN 5.25%<br>01Apr2055                             | 美元 3,238,000  | 3,219,514  | 0.1              | Delhi Intl Airport Ser<br>Regs (Reg) (Reg S)<br>6.45% 04Jun2029                         | 美元 3,700,000  | 3,832,860  | 0.1              |
|   |               |            |                  | GMR Hyderabad<br>Internatio Ser Regs<br>(Reg S) 4.75%<br>02Feb2026                      | 美元 8,500,000  | 8,489,551  | 0.3              |

投资组合  
于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|   | 单位数目               | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值<br>百分比 |  | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值<br>百分比 |
|---|--------------------|------------|------------------|--|---------------|------------|------------------|
| <b>印度 (续)</b>   |                    |            |                  |  |               |            |                  |
| GMR Hyderabad Internatio Ser Regs (Regs) 4.25% 27Oct2027      | 美元 7,371,000       | 7,181,945  | 0.2              | JSW Steel Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.05% 05Apr2032             | 美元 8,300,000  | 7,709,869  | 0.2              |
| Greenko Dutch BV Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.85% 29Mar2026       | 美元 20,300,000      | 17,699,687 | 0.5              | Muthoot Finance Ltd Ser Regs (Reg S) 7.125% 14Feb2028            | 美元 11,100,000 | 11,334,572 | 0.3              |
| Greenko Power II Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.3% 13Dec2028    | 美元 21,275,000      | 16,674,552 | 0.5              | Muthoot Finance Ltd Ser Regs 6.375% 23Apr2029                    | 美元 8,656,000  | 8,762,912  | 0.3              |
| Greenko Wind Projects Mu Ser Regs (Reg S) 5.5% 06Apr2025      | 美元 3,100,000       | 3,180,597  | 0.1              | Network I2I Ltd Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049              | 美元 28,600,000 | 28,512,918 | 0.9              |
| Greenko Wind Projects Mu Ser Regs 7.25% 27Sep2028             | 美元 8,163,000       | 8,067,526  | 0.2              | Periama Holdings Llc/De (Reg) (Reg S) 5.95% 19Apr2026            | 美元 19,650,000 | 20,156,872 | 0.6              |
| HDFC Bank Ltd Ser Regs (Reg S) Var Perp                       | 美元 25,300,000      | 24,322,459 | 0.7              | Piramal Capital & Hous Ser EMTN (Reg) (Reg S) 7.8% 29Jan2028     | 美元 5,385,000  | 5,422,899  | 0.2              |
| Hindustan Petroleum Corp (Reg) (Reg S) 4% 12Jul2027           | 美元 3,300,000       | 3,275,403  | 0.1              | Power Finance Corp Ltd Ser GMTN (Reg) (Reg S) 3.35% 16May2031    | 美元 6,800,000  | 6,248,795  | 0.2              |
| HPCL-Mittal Energy Ltd (Reg) (Reg S) 5.25% 28Apr2027          | 美元 8,100,000       | 8,142,788  | 0.2              | REC Ltd Ser Regs (Reg S) 4.75% 27Sep2029                         | 美元 3,300,000  | 3,272,999  | 0.1              |
| HPCL-Mittal Energy Ltd Ser EMTN (Reg S) 5.45% 22Oct2026       | 美元 9,300,000       | 9,442,484  | 0.3              | Reliance Industries 6.25% 19Oct2040                              | 美元 9,600,000  | 10,618,742 | 0.3              |
| IIFL Finance Ltd Ser Regs 8.75% 24Jul2028                     | 美元 4,672,000       | 4,756,450  | 0.1              | Reliance Industries Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.625% 12Jan2052  | 美元 3,000,000  | 2,105,578  | 0.1              |
| India (Govt of) 7.1% 08Apr2034                                | 印度卢比 2,000,000,000 | 24,761,065 | 0.8              | Shriram Finance Ltd Ser Regs (Reg S) 6.625% 22Apr2027            | 美元 15,700,000 | 16,288,772 | 0.5              |
| India (Govt of) 7.17% 17Apr2030                               | 印度卢比 1,230,000,000 | 15,160,753 | 0.5              | Shriram Finance Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.15% 03Apr2028       | 美元 5,000,000  | 5,118,162  | 0.2              |
| India Clean Energy Hldg Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.5% 18Apr2027 | 美元 25,800,000      | 25,068,725 | 0.8              | Shriram Transport Fin Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.15% 18Jul2025     | 美元 1,963,000  | 1,966,018  | 0.1              |
| India Green Power Hold Ser Regs (Reg) (Reg S) 4% 22Feb2027    | 美元 15,570,000      | 12,931,524 | 0.4              | SMRC Automotive Holdings Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.625% 11Jul2029 | 美元 2,012,000  | 2,060,949  | 0.1              |
| Indian Railway Finance (Reg) (Regs) 3.835% 13/12/2027         | 美元 4,200,000       | 4,163,475  | 0.1              | Tata Capital Ltd Ser EMTN 5.389% 21Jul2028                       | 美元 21,639,000 | 22,062,067 | 0.7              |
| Indian Railway Finance Ser Regs (Reg S) 3.249% 13Feb2030      | 美元 3,300,000       | 3,072,109  | 0.1              | TML Holdings Pte Ltd (Reg) (Reg S) 4.35% 09Jun2026               | 美元 3,950,000  | 3,956,387  | 0.1              |
| Indian Railway Finance Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.8% 10Feb2031  | 美元 1,900,000       | 1,692,160  | 0.0              | Ultratech Cement Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.8% 16Feb2031       | 美元 2,388,000  | 2,120,240  | 0.1              |
| IRB Infrastructure Deve Ser Regs (Reg S) 7.11% 11Mar2032      | 美元 18,500,000      | 18,756,003 | 0.6              | Vedanta Resources 10.875% 17Sep2029                              | 美元 3,100,000  | 3,216,666  | 0.1              |
| JSW Infrastructure Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.95% 21Jan2029     | 美元 14,170,000      | 13,790,152 | 0.4              | Vedanta Resources Ser Regs (Reg S) 10.25% 03Jun2028              | 美元 4,250,000  | 4,524,778  | 0.1              |
| JSW Steel Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.95% 05Apr2027          | 美元 3,000,000       | 2,932,626  | 0.1              | <b>印度尼西亚 (15.0%)</b>   |               |            |                  |
|   |                    |            |                  | Bank Bukopin PT 5.658% 30Oct2027                                 | 美元 15,823,000 | 16,013,883 | 0.5              |

投资组合  
于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|   | 单位数目            | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值<br>百分比 |  | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值<br>百分比 |
|---|-----------------|------------|------------------|--|---------------|------------|------------------|
| <b>印度尼西亚 (续)</b>  |                 |            |                  |  |               |            |                  |
| Bank Mandiri PT Ser EMTN 4.9% 24Mar2028                       | 美元 4,676,000    | 4,658,735  | 0.1              | Medco Maple Tree Pte Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 8.96% 27Apr2029  | 美元 8,000,000  | 8,584,823  | 0.3              |
| Bank Negara Indonesia (Reg S) Var Perp                        | 美元 24,300,000   | 23,087,700 | 0.7              | Medco Oak Tree Pte Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 7.375% 14May2026   | 美元 12,165,000 | 12,563,695 | 0.4              |
| Bank Negara Indonesia Ser EMTN (Reg S) 5.28% 05Apr2029        | 美元 5,416,000    | 5,548,943  | 0.2              | Minejesa Capital BV Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 10Aug2030  | 美元 9,000,000  | 6,978,323  | 0.2              |
| Bank Negara Indonesia Ser EMTN (Reg S) 3.75% 30Mar2026        | 美元 3,900,000    | 3,848,184  | 0.1              | Minejesa Capital BV Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.625% 10Aug2037  | 美元 12,000,000 | 11,390,373 | 0.3              |
| Freeport Indonesia PT Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.315% 14Apr2032 | 美元 26,800,000   | 26,973,736 | 0.8              | Pertamina Geothermal Ene Ser Regs (Reg S) 5.15% 27Apr2028  | 美元 3,700,000  | 3,789,636  | 0.1              |
| Freeport Indonesia PT Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.2% 14Apr2052   | 美元 6,000,000    | 6,002,695  | 0.2              | Pertamina Persero PT Ser Regs (Reg) 6.5% 07Nov2048   | 美元 12,200,000 | 12,668,864 | 0.4              |
| Hutama Karya Persero PT Ser Regs (Reg S) 3.75% 11May2030      | 美元 12,500,000   | 11,939,829 | 0.4              | Pertamina Persero Ser (Regs) 6.45% 30May2044   | 美元 16,400,000 | 17,107,474 | 0.5              |
| Indika Inti Energi PT Ser Regs (Reg S) 8.75% 07May2029        | 美元 5,400,000    | 5,516,330  | 0.2              | Pertamina Persero Ser Regs (Reg) 6Pct 03/05/2042   | 美元 18,500,000 | 18,445,659 | 0.6              |
| Indofood CBP Sukses Makm (Reg) (Reg S) 3.398% 09Jun2031       | 美元 3,600,000    | 3,252,516  | 0.1              | Pertamina Persero Ser Regs 5.625% 20May2043  | 美元 5,000,000  | 4,759,704  | 0.1              |
| Indofood CBP Sukses Makm (Reg) (Reg S) 4.745% 09Jun2051       | 美元 6,000,000    | 4,893,958  | 0.2              | Pertamina Ser Regs 6.5Pct 27/05/2041   | 美元 10,900,000 | 11,475,541 | 0.4              |
| Indonesia (Rep of) 5.15% 10Sep2054                            | 美元 14,500,000   | 13,413,720 | 0.4              | Perusahaan Listrik Negar Ser Regs (Reg) (Regs) 6.25% 25Jan2049   | 美元 5,000,000  | 4,928,442  | 0.1              |
| Indonesia (Rep of) Ser Fr71 (Reg) 9% 15Mar2029                | 557,000,000,000 | 36,253,605 | 1.1              | Perusahaan Listrik Negar Ser Regs (Reg) 6.15% 21May2048  | 美元 26,600,000 | 26,264,530 | 0.8              |
| Indonesia (Rep of) Ser Fr87 6.5% 15Feb2031                    | 500,000,000,000 | 29,705,646 | 0.9              | Perusahaan Listrik Negara (Regs) (Reg) 5.25Pct 24/10/2042  | 美元 15,000,000 | 13,564,363 | 0.4              |
| Indonesia (Rep of) Ser Regs 5.95% 08Jan2046                   | 美元 6,000,000    | 6,239,220  | 0.2              | Perusahaan Penerbit SBSN Ser Regs (Br) 5.25% 25Nov2034   | 美元 16,000,000 | 16,234,480 | 0.5              |
| Indonesia (Rep of) Ser Regs 7.75% 17Jan2038                   | 美元 7,100,000    | 8,709,439  | 0.3              | Perusahaan Penerbit SBSN Ser Regs 5.65% 25Nov2054  | 美元 15,500,000 | 15,396,723 | 0.5              |
| Listrindo Capital BV Ser Regs (Reg) (Regs) 4.95% 14/09/2026   | 美元 14,050,000   | 14,063,650 | 0.4              | PT Indonesia Asahan Aluminium and PT Mineral Industri Indonesia (Persero) Ser Regs (Reg S) 5.45% 15May2030 | 美元 10,408,000 | 10,704,002 | 0.3              |
| LLPL Capital Pte Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.875% 04Feb2039  | 美元 10,500,000   | 7,749,962  | 0.2              | PT Indonesia Asahan Aluminium and PT Mineral Industri Indonesia (Persero) Ser Regs (Reg S) 5.8% 15May2050  | 美元 6,800,000  | 6,418,534  | 0.2              |
| Majapahit Holding BV Ser Regs 7.875Pct 29/06/2037             | 美元 9,582,000    | 11,503,332 | 0.4              |  |               |            |                  |
| Medco Bell Pte Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.375% 30Jan2027    | 美元 6,224,000    | 6,268,291  | 0.2              |  |               |            |                  |
| Medco Laurel Tree Ser Regs (Reg S) 6.95% 12Nov2028            | 美元 3,400,000    | 3,441,357  | 0.1              |  |               |            |                  |

投资组合

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|   | 单位数目                | 公允价值<br>美元 | 占资产<br>净值<br>百分比 |   | 单位数目          | 公允价值<br>美元 | 占资产<br>净值<br>百分比 |
|---|---------------------|------------|------------------|---|---------------|------------|------------------|
| <b>印度尼西亚 (续)</b>  |                     |            |                  | Meiji Yasuda Life Insura  |               |            |                  |
| PT Indonesia Asahan<br>Aluminium and PT<br>Mineral Industri<br>Indonesia (Persero)<br>Ser Regs (Reg S)<br>6.53% 15Nov2028 | 美元 2,600,000        | 2,788,573  | 0.1              | Ser Regs Var<br>11Jun2055   | 美元 5,000,000  | 5,011,864  | 0.2              |
| PT Indonesia Asahan<br>Aluminium and PT<br>Mineral Ser Regs<br>(Reg S) 4.75%<br>15May2025                                 | 美元 9,575,000        | 9,740,278  | 0.3              | Mitsubishi HC Cap UK<br>Plc Ser EMTN 5.302%<br>23Jan2028          | 美元 15,070,000 | 15,454,525 | 0.5              |
| PT Pelabuhan Indo II<br>Ser Regs (Regs)<br>5.375% 05/05/2045  | 美元 8,000,000        | 7,563,085  | 0.2              | Mizuho Financial<br>Group (Reg) Var<br>16Jul2030                  | 美元 4,500,000  | 4,241,141  | 0.1              |
| PT Pertamina (Persero)<br>Ser Regs (Reg S)<br>4.7% 30Jul2049  | 美元 2,000,000        | 1,633,148  | 0.1              | Mizuho Financial<br>Group 2.564%<br>13Sep2031                     | 美元 1,500,000  | 1,289,842  | 0.0              |
| Republic of Indonesia<br>5.6% 15Jan2035   | 美元 16,333,000       | 16,897,554 | 0.5              | Nippon Life Insurance<br>Ser Regs (Reg S) Var<br>16Apr2054        | 美元 2,900,000  | 2,997,342  | 0.1              |
| <b>国际 (0.3%)</b>  |                     |            |                  | Nippon Life Insurance<br>Ser Regs (Reg S) Var<br>23Jan2050        |               |            |                  |
| European Investment<br>Bank Ser EMTN (Reg)<br>(Reg S) 9.25%<br>28Jan2027  | 巴西雷亚尔<br>28,945,000 | 4,836,611  | 0.2              | Nippon Life Insurance<br>Ser Regs (Reg) (Reg<br>S) Var 16Sep2051  | 美元 1,000,000  | 863,603    | 0.0              |
| Intl Bk Recon &<br>Develop Ser EMTN<br>(Reg) (Reg S) 5.75%<br>14Jan2028   | 巴西雷亚尔<br>25,000,000 | 3,668,957  | 0.1              | Nissan Motor Co Ser<br>Regs (Reg S) 3.522%<br>17Sep2025           | 美元 4,126,000  | 4,088,663  | 0.1              |
| <b>爱尔兰 (0.1%)</b>   |                     |            |                  | Norinchukin Bank Ser<br>Regs (Reg S) 4.867%<br>14Sep2027          |               |            |                  |
| AIB Group Plc (Reg)<br>(Reg S) Var Perp<br>31Dec2049  | 欧元 3,600,000        | 3,978,136  | 0.1              | Rakuten Group Inc Ser<br>Regs (Reg S) 11.25%<br>15Feb2027         | 美元 2,200,000  | 2,419,580  | 0.1              |
| <b>意大利 (0.1%)</b>   |                     |            |                  | Rakuten Group Inc Ser<br>Regs (Reg S) 9.75%<br>15Apr2029          |               |            |                  |
| Unicredit SPA (Reg S)<br>(Br) Var Perp<br>31Dec2049   | 欧元 2,300,000        | 2,633,000  | 0.1              | Rakuten Group Inc Ser<br>Regs (Reg S) Var<br>Perp 31Dec2049       | 美元 4,541,000  | 4,528,768  | 0.1              |
| <b>日本 (4.5%)</b>  |                     |            |                  | Rakuten Group Inc Ser<br>Regs (Reg) (Reg S)<br>Var Perp 31Dec2049 |               |            |                  |
| Chugoku Electric<br>Power 5.742%<br>14Jan2035   | 美元 17,284,000       | 18,031,861 | 0.6              | Resona Bank Ltd<br>4.983% 22Jan2028                               | 美元 10,238,000 | 10,461,355 | 0.3              |
| Dai-ichi Life Holdings<br>Ser Regs Var Perp<br>31Dec2049  | 美元 11,582,000       | 11,796,993 | 0.4              | Sumitomo Life Insur<br>Ser Regs (Reg S) Var<br>Perp 31Dec2049     | 美元 3,855,000  | 3,878,458  | 0.1              |
| Kansai Electric Power<br>Co 5.037%<br>26Feb2030   | 美元 9,574,000        | 9,779,794  | 0.3              | Sumitomo Mitsui Finl<br>Grp (Reg) Var Perp<br>31Dec2049           | 美元 1,500,000  | 1,532,650  | 0.0              |
| Kyushu Electric Power<br>Co (Reg) 4.447%<br>02Oct2029   | 美元 7,000,000        | 7,098,350  | 0.2              | Sumitomo Mitsui Finl<br>Grp FRN 15Apr2030                         | 美元 3,000,000  | 3,049,204  | 0.1              |
| Meiji Yasuda Life Insura<br>Ser Regs (Reg S) Var<br>11Sep2054   | 美元 9,866,000        | 9,781,046  | 0.3              | Sumitomo Mitsui Finl<br>Grp Var Perp<br>31Dec2049                 | 美元 12,550,000 | 12,409,126 | 0.4              |
| Meiji Yasuda Life Insura<br>Ser Regs (Regs) 5.2%<br>20/10/2045  | 美元 4,000,000        | 4,103,570  | 0.1              | <b>韩国 (4.5%)</b>  |               |            |                  |
|   |                     |            |                  | Export-Import Bank<br>Korea 5.25%<br>14Jan2035                    | 美元 16,500,000 | 17,300,905 | 0.5              |
|   |                     |            |                  | Hana Bank Ser Regs<br>(Reg) (Reg S) Var<br>Perp 31Dec2049         | 美元 6,600,000  | 6,517,922  | 0.2              |
|   |                     |            |                  | Hanwha Life Insurance<br>Ser Regs (Reg) (Reg<br>S) Var 04Feb2032  | 美元 12,650,000 | 12,336,085 | 0.4              |

投资组合  
于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|  | 单位数目         | 公允价值<br>美元 | 占资产<br>净值<br>百分比 |   | 单位数目          | 公允价值<br>美元 | 占资产<br>净值<br>百分比 |
|--|--------------|------------|------------------|---|---------------|------------|------------------|
| <b>韩国 (续)</b>  |              |            |                  |   |               |            |                  |
| Hyundai Assan<br>Otomotiv 1.625%<br>12/07/26-RegS                          | 美元 4,700,000 | 4,541,166  | 0.1              | SK Hynix Inc Ser Regs<br>(Reg S) 6.375%<br>17Jan2028                    | 美元 1,400,000  | 1,476,083  | 0.0              |
| Hyundai Capital<br>Services Ser Regs<br>(Reg) (Reg S) 5.125%<br>05Feb2029  | 美元 3,100,000 | 3,147,525  | 0.1              | SK Hynix Inc Ser Regs<br>(Reg S) 6.5%<br>17Jan2033                      | 美元 8,670,000  | 9,430,078  | 0.3              |
| Hyundai Capital<br>Services Ser Regs<br>5.25% 22Jan2028                    | 美元 3,243,000 | 3,316,473  | 0.1              | Tongyang life<br>insurance Co (Reg S)<br>Var Perp 31Dec2049             | 美元 8,050,000  | 8,041,302  | 0.3              |
| KB Capital Co Ltd (Reg)<br>(Reg S) 1.5%<br>28Oct2025                       | 美元 1,360,000 | 1,344,867  | 0.0              | Woori Bank (Reg S)<br>5.125% 06Aug2028                                  | 美元 4,000,000  | 4,067,587  | 0.1              |
| Kookmin Bank Ser<br>GMTN (Reg) (Reg S)<br>4.5% 01Feb2029                   | 美元 1,900,000 | 1,892,392  | 0.1              | Woori Bank Ser Regs<br>(Reg) (Reg S) Var<br>Perp 6.375%                 | 美元 10,337,000 | 10,625,114 | 0.3              |
| Korea Housing Finance<br>Co Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) 4.625%<br>24Feb2033  | 美元 3,000,000 | 2,984,896  | 0.1              | <b>科威特 (0.2%)</b>   |               |            |                  |
| Korea Housing Finance<br>Co Ser Regs 5.125%<br>21Jan2030                   | 美元 6,816,000 | 7,053,972  | 0.2              | Equate Petrochemical<br>BV Ser Regs (Reg)<br>(Regs) 4.25%<br>03Nov2026  | 美元 2,850,000  | 2,871,555  | 0.1              |
| Korea Inv & Secs Co Ltd<br>(Reg) (Reg S) 6.875%<br>06Nov2026               | 美元 2,300,000 | 2,436,255  | 0.1              | Meglobal Canada Ulc<br>Ser Regs (Reg S) 5%<br>18May2025                 | 美元 2,000,000  | 2,038,051  | 0.0              |
| Korea Ocean Business<br>Co (Reg) (Reg S)<br>4.5% 03May2028                 | 美元 3,000,000 | 3,050,561  | 0.1              | NBK Tier 1 Fnc Ltd Ser<br>Regs (Reg S) Var<br>Perp 31Dec2049            | 美元 3,300,000  | 3,209,863  | 0.1              |
| Korearehabnresource<br>(Reg) (Reg S) 5.125%<br>08May2029                   | 美元 8,798,000 | 9,122,265  | 0.3              | <b>卢森堡 (0.1%)</b>   |               |            |                  |
| Mirae Asset Securities<br>(Reg) (Reg S) 6.875%<br>26Jul2026                | 美元 1,500,000 | 1,559,100  | 0.1              | Selp Finance Sarl Ser<br>EMTN 3.75%<br>16Jan2032                        | 欧元 1,764,000  | 1,906,035  | 0.1              |
| Posco Ser Regs (Reg S)<br>5.875% 17Jan2033                                 | 美元 3,000,000 | 3,162,445  | 0.1              | <b>澳门 (5.0%)</b>  |               |            |                  |
| Shinhan Bank Ser MTN<br>(Reg) 5% 30Aug2028                                 | 澳元 2,670,000 | 1,636,289  | 0.1              | Champion Path<br>Holdings (Reg) (Reg<br>S) 4.5% 27Jan2026               | 美元 14,400,000 | 14,321,974 | 0.4              |
| Shinhan Bank Ser Regs<br>(Reg) (Reg S) 4.375%<br>13Apr2032                 | 美元 4,000,000 | 3,893,337  | 0.1              | Champion Path<br>Holdings (Reg) (Reg<br>S) 4.85% 27Jan2028              | 美元 300,000    | 290,417    | 0.0              |
| Shinhan Bank Ser Regs<br>(Reg) (Reg S) 5.75%<br>15Apr2034                  | 美元 6,800,000 | 7,157,601  | 0.2              | MGM China Holdings<br>Ltd Ser Regs (Reg S)<br>4.75% 01Feb2027           | 美元 1,100,000  | 1,087,367  | 0.0              |
| Shinhan Card Co Ltd<br>Ser MTN (Reg) 5.05%<br>22Oct2027                    | 澳元 7,870,000 | 5,026,778  | 0.2              | MGM China Holdings<br>Ltd Ser Regs (Reg S)<br>5.25% 18Jun2025           | 美元 2,150,000  | 2,175,186  | 0.1              |
| Shinhan Financial<br>Group Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) 5%<br>24Jul2028       | 美元 3,600,000 | 3,680,179  | 0.1              | MGM China Holdings<br>Ltd Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) 5.875%<br>15May2026 | 美元 1,700,000  | 1,736,646  | 0.1              |
| Shinhan Financial<br>Group Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) Var Perp<br>31Dec2049 | 美元 6,000,000 | 5,886,917  | 0.2              | MGM China Holdings<br>Ltd Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) 7.125%<br>26Jun2031 | 美元 1,982,000  | 2,061,302  | 0.1              |
| SK Hynix Inc Ser Regs<br>(Reg S) 5.5%<br>16Jan2029                         | 美元 4,400,000 | 4,545,501  | 0.1              | Sands China Ltd (Reg)<br>3.25% 08Aug2031                                | 美元 1,500,000  | 1,307,782  | 0.0              |
|  |              |            |                  | Sands China Ltd Ser Wi<br>(Reg) 3.8%<br>08Jan2026                       | 美元 10,700,000 | 10,686,573 | 0.3              |
|  |              |            |                  | Sands China Ltd Ser Wi<br>(Reg) 4.375%<br>18Jun2030                     | 美元 14,500,000 | 13,938,899 | 0.4              |
|  |              |            |                  | Sands China Ltd Ser Wi<br>(Reg) 5.125%<br>08Aug2025                     | 美元 11,600,000 | 11,684,774 | 0.4              |

投资组合

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|   | 单位数目                  | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值<br>百分比 |   | 单位数目         | 公平值<br>美元 | 占资产<br>净值<br>百分比 |
|---|-----------------------|------------|------------------|---|--------------|-----------|------------------|
| <b>澳门 (续)</b>   |                       |            |                  | <b>Comision Federal De</b>  |              |           |                  |
| Sands China Ltd Ser Wi<br>(Reg) 5.4%<br>08Aug2028                           | 美元 19,500,000         | 19,692,290 | 0.6              | Elec Ser Regs (Reg S)<br>3.348% 09Feb2031                             | 美元 3,000,000 | 2,571,741 | 0.1              |
| Studio City Co Ltd Ser<br>Regs (Reg) (Reg S)<br>7% 15Feb2027                | 美元 14,105,000         | 14,360,998 | 0.4              | Comision Federal De<br>Elec Ser Regs 5.7%<br>24Jan2030                | 美元 8,000,000 | 7,919,667 | 0.2              |
| Studio City Finance Ltd<br>Ser Regs (Reg) (Reg<br>S) 6% 15Jul2025           | 美元 13,512,000         | 13,713,959 | 0.4              | Mexichem Sab De CV<br>Ser Regs (Reg)<br>5.875% 17Sep2044              | 美元 2,000,000 | 1,726,989 | 0.1              |
| Studio City Finance Ltd<br>Ser Regs (Reg) (Reg<br>S) 6.5% 15Jan2028         | 美元 9,400,000          | 9,266,015  | 0.3              | Mexico (Utd States of)<br>(Reg) 3.25%<br>16Apr2030                    | 美元 5,000,000 | 4,594,119 | 0.1              |
| Studio City Finance Ltd<br>Ser Regs (Reg) (Regs)<br>5% 15Jan2029            | 美元 21,465,000         | 19,570,897 | 0.6              | Mexico (Utd States of)<br>(Reg) 5% 27Apr2051                          | 美元 4,237,000 | 3,349,196 | 0.1              |
| Wynn Macau Ltd Ser<br>Regs (Reg) (Reg S)<br>5.5% 15Jan2026                  | 美元 11,100,000         | 11,161,739 | 0.4              | Mexico (Utd States of)<br>(Reg) 6.338%<br>04May2053                   | 美元 5,000,000 | 4,686,701 | 0.2              |
| Wynn Macau Ltd Ser<br>Regs (Reg) (Reg S)<br>5.625% 26Aug2028                | 美元 17,900,000         | 17,330,784 | 0.5              | Mexico (Utd States of)<br>(Reg) 6.35%<br>09Feb2035                    | 美元 6,000,000 | 6,080,293 | 0.2              |
| <b>马来西亚 (2.0%)</b>  |                       |            |                  | <b>Mexico City Arpt Trust</b>   |              |           |                  |
| Ambank M Bhd Ser<br>EMTN 5.252%<br>23Jan2030                                | 美元 12,972,000         | 13,353,175 | 0.4              | Ser Regs (Reg)<br>3.875% 30Apr2028                                    | 美元 3,500,000 | 3,403,255 | 0.1              |
| Axiata Spv5 Labuan Ltd<br>Ser EMTN (Reg S)<br>3.064% 19Aug2050              | 美元 6,369,000          | 4,274,743  | 0.1              | Mexico City Arpt Trust<br>Ser Regs (Reg) 5.5%<br>31Jul2047            | 美元 4,500,000 | 3,756,278 | 0.1              |
| GOHL Capital Ltd<br>4.25% 24Jan2027   | 美元 3,200,000          | 3,175,201  | 0.1              | Petroleos Mexicano<br>6.875% 04Aug2026                                | 美元 6,000,000 | 6,033,446 | 0.2              |
| Malaysia Government<br>Ser 124 4.054%<br>18Apr2039                          | 马来西亚林吉特<br>52,800,000 | 12,300,914 | 0.4              | Petroleos Mexicanos<br>(Reg) 6.5%<br>13Mar2027                        | 美元 7,500,000 | 7,366,732 | 0.2              |
| Malaysia Government<br>Ser 224 4.18%<br>16May2044                           | 马来西亚林吉特<br>70,000,000 | 16,420,058 | 0.5              | Petroleos Mexicanos<br>Ser Wi (Reg) 5.35%<br>12Feb2028                | 美元 3,000,000 | 2,803,983 | 0.1              |
| Petronas Capital Ltd<br>4.5% 18Mar2045                                      | 美元 11,000,000         | 9,504,264  | 0.3              | Tierra Mojada Lux II Srl<br>Ser Regs (Reg) (Reg<br>S) 5.75% 01Dec2040 | 美元 2,000,000 | 1,648,424 | 0.1              |
| Petronas Capital Ltd<br>Ser Regs 5.848%<br>03Apr2055                        | 美元 5,000,000          | 5,074,123  | 0.2              | <b>蒙古 (0.1%)</b>  |              |           |                  |
| <b>墨西哥 (2.4%)</b>   |                       |            |                  | <b>Mongolia Intl Bond Ser</b>   |              |           |                  |
| Alfa 6.875% (Reg S)<br>25Mar2044  | 美元 3,000,000          | 3,213,216  | 0.1              | Regs (Reg S) 8.65%<br>19Jan2028                                       | 美元 1,500,000 | 1,584,401 | 0.0              |
| Banco Mercantil De<br>Norte Ser Regs (Reg<br>S) Var Perp<br>31Dec2049       | 美元 4,400,000          | 4,409,131  | 0.1              | Mongolia Intl Bond Ser<br>Regs 6.625%<br>25Feb2030                    | 美元 3,000,000 | 2,965,470 | 0.1              |
| Banco Mercantil De<br>Norte Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) Var Perp<br>31Dec2049 | 美元 4,400,000          | 4,535,754  | 0.1              | <b>荷兰 (0.2%)</b>  |              |           |                  |
| BBVA Bancomer SA<br>Texas Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) Var<br>13Sep2034        | 美元 4,000,000          | 3,864,874  | 0.1              | <b>Cooperatieve</b>   |              |           |                  |
| BBVA Bancomer SA<br>Texas Var 18Jan2033                                     | 美元 5,700,000          | 5,482,372  | 0.2              | <b>Rabobank UA (Reg S)</b>  |              |           |                  |
|   |                       |            |                  | <b>(Br) Var Perp 31</b>   |              |           |                  |
|   |                       |            |                  | <b>Dec2049</b>  |              |           |                  |
|   |                       |            |                  | <b>Cooperatieve</b>   |              |           |                  |
|   |                       |            |                  | <b>Rabobank UA Ser</b>  |              |           |                  |
|   |                       |            |                  | <b>MTN (Reg S) Var</b>  |              |           |                  |
|   |                       |            |                  | <b>26Oct2032</b>  |              |           |                  |
|   |                       |            |                  | <b>ING Groep NV Var Perp</b>  |              |           |                  |
|   |                       |            |                  | <b>澳元 770,000</b>   |              |           |                  |
|   |                       |            |                  | <b>516,135</b>  |              |           |                  |
|   |                       |            |                  | <b>美元 4,400,000</b>   |              |           |                  |
|   |                       |            |                  | <b>4,463,934</b>  |              |           |                  |
|   |                       |            |                  | <b>0.1</b>  |              |           |                  |
|   |                       |            |                  | <b>0.0</b>  |              |           |                  |
|   |                       |            |                  | <b>0.1</b>  |              |           |                  |
|   |                       |            |                  | <b>0.3</b>  |              |           |                  |

投资组合

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|   | 单位数目          | 公允价值<br>美元 | 占资产<br>净值<br>百分比 |                          | 单位数目          | 公允价值<br>美元  | 占资产<br>净值<br>百分比 |     |
|---|---------------|------------|------------------|--------------------------|---------------|-------------|------------------|-----|
| <b>巴基斯坦 (续)</b>                                       |               |            |                  | Philippines (Rep of)     |               |             |                  |     |
| Pakistan (Rep of) Ser<br>Regs (Reg S) 6%<br>08Apr2026 | 美元 17,700,000 | 17,313,181 | 0.5              | (Reg) 3.95%<br>20Jan2040 | 美元 36,300,000 | 31,186,955  | 0.9              |     |
| Pakistan (Rep of) Ser<br>Regs 8.25%<br>30Sep2025      | 美元 5,200,000  | 5,190,011  | 0.2              | Philippines (Rep of)     | 美元 4,602,000  | 3,795,685   | 0.1              |     |
|   |               |            |                  | (Reg) 4.2%<br>29Mar2047  |               |             |                  |     |
| <b>巴拿马 (0.3%)</b>                                     |               |            |                  | Philippines (Rep of)     | 美元 15,000,000 | 15,430,997  | 0.5              |     |
| Panama (Govt of) (Reg)                                | 美元 3,500,000  | 3,647,175  | 0.1              | (Reg) 5.25%<br>14May2034 |               |             |                  |     |
| 7.5% 01Mar2031  |               |            |                  | Philippines (Rep of)     | 美元 12,600,000 | 12,541,001  | 0.4              |     |
| Panama (Govt of) (Reg)                                | 美元 1,200,000  | 1,296,596  | 0.0              | (Reg) 5.5%<br>17Jan2048  |               |             |                  |     |
| 8.875% 30Sep2027                                      |               |            |                  | Philippines (Rep of)     | 美元 9,000,000  | 9,062,762   | 0.3              |     |
| Panama (Govt of)                                      | 美元 3,000,000  | 2,927,473  | 0.1              | (Reg) 5.6%<br>14May2049  |               |             |                  |     |
| 6.875% 31Jan2036                                      |               |            |                  | Philippines (Rep of)     | 美元 5,000,000  | 5,332,371   | 0.2              |     |
| Republic of Panama                                    | 美元 2,000,000  | 1,904,714  | 0.1              | (Reg) 5.95%<br>13Oct2047 |               |             |                  |     |
| (Reg) 3.875%<br>17/03/2028                            |               |            |                  | Philippines (Rep of)     | 欧元 8,176,000  | 8,755,755   | 0.3              |     |
|   |               |            |                  | 3.625% 04Feb2032         |               |             |                  |     |
| <b>巴拉圭 (0.4%)</b>                                     |               |            |                  | Philippines (Rep of)     | 菲律宾比索         | 727,000,000 | 12,737,994       | 0.4 |
| Republic of Paraguay                                  | 美元 4,000,000  | 3,969,030  | 0.1              | 6.25Pct 14/01/2036       |               |             |                  |     |
| Ser Regs (Reg) (Reg                                   |               |            |                  | PLDT Inc (Reg) (Reg S)   | 美元 600,000    | 524,905     | 0.0              |     |
| S) 4.95% 28Apr2031                                    |               |            |                  | 2.5% 23Jan2031           |               |             |                  |     |
| Republic of Paraguay                                  | 美元 4,000,000  | 3,444,800  | 0.1              | PLDT Inc (Reg) (Reg S)   | 美元 4,300,000  | 3,039,512   | 0.1              |     |
| Ser Regs (Reg) (Reg                                   |               |            |                  | 3.45% 23Jun2050          |               |             |                  |     |
| S) 5.4% 30Mar2050                                     |               |            |                  | Republic of Philippines  | 美元 13,720,000 | 14,245,398  | 0.4              |     |
| Republic of Paraguay                                  | 美元 5,000,000  | 5,049,688  | 0.2              | 5.5% 04Feb2035           |               |             |                  |     |
| Ser Regs 6.65%<br>04Mar2055                           |               |            |                  | Republic of Philippines  | 美元 4,000,000  | 4,157,803   | 0.1              |     |
|   |               |            |                  | 5.9% 04Feb2050           |               |             |                  |     |
| <b>秘鲁 (0.3%)</b>                                      |               |            |                  | Rizal Commercial         |               |             |                  |     |
| Peru (Rep of) 5.375%<br>08Feb2035                     | 美元 3,500,000  | 3,468,021  | 0.1              | Banking (Reg) (Reg S)    | 美元 4,310,000  | 4,334,502   | 0.1              |     |
| Southern Copper Corp                                  | 美元 6,000,000  | 6,906,848  | 0.2              | Var Perp                 |               |             |                  |     |
| Regs 7.5% 27Jul2035                                   |               |            |                  | Rizal Commercial         |               |             |                  |     |
|   |               |            |                  | Banking Ser EMTN         |               |             |                  |     |
| <b>菲律宾 (5.5%)</b>                                     |               |            |                  | (Reg) (Reg S) 5.5%       | 美元 500,000    | 512,893     | 0.0              |     |
| Bank of Philippine                                    |               |            |                  | 18Jan2029                |               |             |                  |     |
| Islan Ser EMTN 5.0%<br>07Apr2030                      | 美元 5,476,000  | 5,447,223  | 0.2              | Rizal Commercial         |               |             |                  |     |
| Globe Telecom Inc                                     | 美元 8,100,000  | 6,543,274  | 0.2              | Banking Ser EMTN         | 美元 6,937,000  | 7,057,900   | 0.2              |     |
| (Reg) (Reg S) 3%<br>23Jul2035                         |               |            |                  | 5.375% 29Jan2030         |               |             |                  |     |
| Globe Telecom Inc                                     | 美元 5,858,000  | 5,864,879  | 0.2              | Royal Capital BV (Reg)   | 美元 1,150,000  | 1,170,134   | 0.0              |     |
| (Reg) (Reg S) Var<br>Perp                             |               |            |                  | (Reg S) Var Perp         |               |             |                  |     |
| ICTSI Treasury BV (Reg)                               | 美元 2,600,000  | 2,381,236  | 0.1              | 31Dec2049                |               |             |                  |     |
| (Reg S) 3.5%<br>16Nov2031                             |               |            |                  | Smic Sg Holdings Pte     | 美元 3,000,000  | 3,045,592   | 0.1              |     |
| Jollibee Worldwide Pte                                | 美元 6,293,000  | 6,345,131  | 0.2              | Ltd Ser EMTN (Reg S)     |               |             |                  |     |
| L 5.332% 02Apr2030                                    |               |            |                  | 5.375% 24Jul2029         |               |             |                  |     |
| Metropolitan Bank &                                   | 美元 6,942,000  | 7,032,398  | 0.2              | <b>卡塔尔 (0.2%)</b>        |               |             |                  |     |
| Trus Ser EMTN (Reg                                    |               |            |                  | ABQ Finance Ser EMTN     |               |             |                  |     |
| S) 5.5% 06Mar2034                                     |               |            |                  | (Reg) (Reg S) 1.875%     | 美元 3,500,000  | 3,456,593   | 0.1              |     |
| Metropolitan Bank &                                   | 美元 4,000,000  | 4,088,029  | 0.1              | 08Sep2025                |               |             |                  |     |
| Trus Ser EMTN (Reg)                                   |               |            |                  | QNB Finance Ltd Ser      | 美元 2,600,000  | 2,620,008   | 0.1              |     |
| (Reg S) 5.375%<br>06Mar2029                           |               |            |                  | EMTN (Reg) (Reg S)       |               |             |                  |     |
| Philippine National                                   | 美元 5,484,000  | 5,545,578  | 0.2              | 2.625% 12May2025         |               |             |                  |     |
| Bank Ser EMTN (Reg                                    |               |            |                  | <b>罗马尼亚 (0.2%)</b>       |               |             |                  |     |
| S) 4.85% 23Oct2029                                    |               |            |                  | Romania (Govt of) Ser    | 欧元 5,000,000  | 5,699,922   | 0.2              |     |
|   |               |            |                  | Regs (Reg) (Reg S)       |               |             |                  |     |
|   |               |            |                  | 6.375% 18Sep2033         |               |             |                  |     |
|   |               |            |                  | <b>沙特阿拉伯 (1.5%)</b>      |               |             |                  |     |
|   |               |            |                  | Eig Pearl Holdings Sarl  | 美元 3,500,000  | 2,797,572   | 0.1              |     |
|   |               |            |                  | Ser Regs (Reg) (Reg S)   |               |             |                  |     |
|   |               |            |                  | 4.387% 30Nov2046         |               |             |                  |     |

投资组合

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|  | 单位数目               | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值<br>百分比 |  | 单位数目                    | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值<br>百分比 |
|--|--------------------|------------|------------------|--|-------------------------|------------|------------------|
| <b>沙特阿拉伯 (续)</b>   |                    |            |                  | <b>南非 (0.3%)</b>   |                         |            |                  |
| Gaci First Investment<br>5.625% 29Jul2034                                  | 美元 8,788,000       | 9,080,768  | 0.3              | Republic of South<br>Africa (Reg) 4.85%<br>27Sep2027                       | 美元 2,000,000            | 1,966,608  | 0.0              |
| Greensaif Pipelines<br>Bidc Ser Regs (Reg S)<br>6.129% 23Feb2038           | 美元 4,000,000       | 4,138,604  | 0.1              | South Africa (Rep of)<br>(Reg) 4.3%<br>12/10/2028                          | 美元 6,000,000            | 5,784,606  | 0.2              |
| Greensaif Pipelines<br>Bidc Ser Regs (Reg S)<br>6.51% 23Feb2042            | 美元 2,000,000       | 2,102,692  | 0.1              | South Africa (Rep of)<br>(Reg) 4.85%<br>30Sep2029                          | 美元 4,000,000            | 3,772,259  | 0.1              |
| Greensaif Pipelines<br>Bidc Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) 5.8528%<br>23Feb2036 | 美元 3,800,000       | 3,875,223  | 0.1              | <b>西班牙 (0.2%)</b>  |                         |            |                  |
| Greensaif Pipelines<br>Bidc Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) 6.1027%<br>23Aug2042 | 美元 1,974,000       | 1,994,847  | 0.1              | Banco Bilbao Vizcaya<br>Arg Var Perp<br>31Dec2049                          | 美元 2,000,000            | 1,995,855  | 0.1              |
| Saudi Arabian Oil Co<br>Ser Regs (Reg S)<br>5.25% 17Jul2034                | 美元 1,500,000       | 1,526,857  | 0.0              | Banco Santander SA<br>(Reg) (Reg S) Var<br>17Jul2034                       | 澳元 6,200,000            | 4,023,066  | 0.1              |
| Saudi Arabian Oil Co<br>Ser Regs (Reg S)<br>5.75% 17Jul2054                | 美元 8,300,000       | 7,945,494  | 0.2              | <b>斯里兰卡 (0.7%)</b>   |                         |            |                  |
| Saudi Electricity Sukuk<br>5.489% 18Feb2035                                | 美元 10,981,000      | 11,201,085 | 0.3              | Republic of Sri Lanka<br>Ser Regs (Reg) (Reg<br>S) STP 15Jun2035           | 美元 2,208,920            | 1,511,674  | 0.0              |
| Saudi International<br>Bond Ser Regs (Reg<br>S) 5% 16Jan2034               | 美元 5,000,000       | 5,021,208  | 0.2              | Republic of Sri Lanka<br>Ser Regs 4.0%<br>15Apr2028                        | 美元 14,227,114           | 12,618,905 | 0.4              |
| <b>新加坡 (2.0%)</b>  |                    |            |                  | Sri Lanka Govt Bond<br>Ser A 10.3%<br>15Oct2027                            | 斯里兰卡卢比<br>1,050,000,000 | 3,785,574  | 0.1              |
| DBS Bank Ltd/Australia<br>Ser MTN FRN<br>21Feb2028                         | 澳元 7,400,000       | 4,634,144  | 0.1              | Sri Lanka Govt Bond<br>Ser A 20%<br>15Sep2027                              | 斯里兰卡卢比<br>1,250,000,000 | 5,232,837  | 0.2              |
| GLP Pte Ltd Ser EMTN<br>(Reg) (Reg S) 3.875%<br>04Jun2025                  | 美元 3,300,000       | 3,299,884  | 0.1              | <b>瑞士 (0.2%)</b>   |                         |            |                  |
| Great Eastern Life<br>Assur Ser EMTN Var<br>Perp 31Dec2049                 | 美元 15,100,000      | 15,138,598 | 0.5              | UBS Group AG (Reg S)<br>Var Perp   | 美元 2,400,000            | 2,421,123  | 0.1              |
| Oversea-Chinese<br>Banking Ser GMTN<br>(Reg S) Var<br>21May2034            | 美元 4,000,000       | 4,183,123  | 0.1              | UBS Group AG Ser 144A<br>(Reg) Var Perp<br>31Dec2049                       | 美元 2,400,000            | 2,697,596  | 0.1              |
| Singapore (Govt of)<br>2.125% 01Jun2026                                    | 新加坡元<br>13,000,000 | 9,694,763  | 0.3              | <b>台湾 (0.6%)</b>   |                         |            |                  |
| Singapore Government<br>2.75% 01Mar2035                                    | 新加坡元<br>24,700,000 | 18,519,618 | 0.6              | Cathaylife Singapore<br>(Reg) (Reg S) Var<br>05Sep2039                     | 美元 2,133,000            | 2,141,259  | 0.1              |
| SP Group Treasury Pte<br>Ser Regs (Reg S)<br>3.375% 27Feb2029              | 美元 1,250,000       | 1,215,831  | 0.0              | Nanshan Life Pte Ltd<br>(Reg) (Reg S) 5.45%<br>11Sep2034                   | 美元 17,000,000           | 16,611,920 | 0.5              |
| Spore Airport Terminal<br>S Ser GMTN (Reg)<br>(Reg S) 4.828%<br>23Jan2029  | 美元 3,000,000       | 3,054,605  | 0.1              | <b>泰国 (3.8%)</b>   |                         |            |                  |
| Temasek Financial I<br>Ltd Ser Regs<br>5.375Pct 23/11/2039                 | 美元 2,000,000       | 2,204,310  | 0.1              | Bangkok Bank PCL/HK<br>Ser Regs (Reg S) Var<br>Perp                        | 美元 19,000,000           | 18,921,095 | 0.6              |
| United Overseas Bank<br>Ltd Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) Var<br>07Oct2032     | 美元 2,000,000       | 1,995,742  | 0.1              | Export-Import Bk<br>Thailand Ser EMTN<br>(Reg) (Reg S) 5.354%<br>16May2029 | 美元 1,228,000            | 1,287,514  | 0.0              |
|  |                    |            |                  | Kasikornbank PCL HK<br>Ser EMTN (Reg S) Var<br>Perp 4%                     | 美元 3,613,000            | 3,491,732  | 0.1              |
|  |                    |            |                  | Kasikornbank PCL HK<br>Ser EMTN (Reg S) Var<br>Perp 5.275%                 | 美元 16,800,000           | 17,142,739 | 0.5              |

投资组合

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|   | 单位数目              | 公允价值<br>美元 | 占资产<br>净值<br>百分比 |   | 单位数目              | 公允价值<br>美元 | 占资产<br>净值<br>百分比 |
|---|-------------------|------------|------------------|---|-------------------|------------|------------------|
| <b>泰国 (续)</b>   |                   |            |                  | CK Hutchison Intl 24  |                   |            |                  |
| Kasikornbank PCL HK<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) Var 02Oct2031    | 美元 8,100,000      | 7,993,587  | 0.2              | Ser Regs (Reg) (Reg<br>S) 5.5% 26Apr2034                          | 美元 1,500,000      | 1,562,645  | 0.1              |
| Krung Thai<br>Bank/Cayman (Reg<br>S) Var Perp                     | 美元 18,700,000     | 18,375,711 | 0.6              | HSBC Holdings Plc<br>(Reg) Var 11Aug2033                          | 美元 3,200,000      | 3,260,271  | 0.1              |
| Muang Thai Life<br>Assuranc (Reg) (Reg<br>S) Var 27Jan2037        | 美元 2,001,000      | 1,971,516  | 0.1              | HSBC Holdings Plc Ser<br>EMTN (Reg S) (Br) 7%<br>07Apr2038        | 英镑 2,000,000      | 2,867,660  | 0.1              |
| Muangthai Capital PCL<br>(Reg) 6.875%<br>30Sep2028                | 美元 3,300,000      | 3,330,238  | 0.1              | HSBC Holdings Plc Ser<br>EMTN Var Perp                            | 新加坡元<br>4,250,000 | 3,244,488  | 0.1              |
| Thailand (Govt of)<br>(Reg) 3.39%<br>17Jun2037                    | 泰铢<br>250,000,000 | 8,426,058  | 0.3              | HSBC Holdings Plc Ser<br>MTN (Reg) (Reg S)<br>Var 21Mar2034       | 澳元 2,400,000      | 1,532,271  | 0.0              |
| Thailand (Govt of) 2.8%<br>17Jun2034                              | 泰铢<br>250,000,000 | 7,928,679  | 0.2              | HSBC Holdings Plc Ser<br>MTN FRN 11Mar2035                        | 澳元 5,830,000      | 3,625,142  | 0.1              |
| Thailand (Govt of)<br>3.35% 17Jun2033                             | 泰铢<br>250,000,000 | 8,225,346  | 0.3              | HSBC Holdings Plc Ser<br>MTN Var 11Mar2035                        | 澳元 5,830,000      | 3,648,860  | 0.1              |
| Thailand (Govt of) W/I<br>3.45% 17Jun2043                         | 泰铢<br>350,000,000 | 11,846,142 | 0.4              | Hutchison Wham Int<br>03/33 Ser Regs (Reg<br>S) 7.45% 24Nov2033   | 美元 3,000,000      | 3,533,839  | 0.1              |
| Thailand Government<br>Bond 3.3%<br>17Jun2038                     | 泰铢<br>240,000,000 | 8,020,918  | 0.2              | Royal BK ScotInd Grp<br>PLC (Reg) Var Perp<br>31Dec2049           | 美元 2,900,000      | 2,903,085  | 0.1              |
| Thaioil Trsry Center Ser<br>Regs (Reg S) 2.5%<br>18Jun2030        | 美元 2,250,000      | 1,966,779  | 0.1              | Standard Chartered Plc<br>Ser Regs (Reg S)<br>6.296% 06Jul2034    | 美元 5,860,000      | 6,261,589  | 0.2              |
| Thaioil Trsry Center Ser<br>Regs (Reg S) 3.5%<br>17Oct2049        | 美元 539,000        | 346,027    | 0.0              | Standard Chartered Plc<br>Ser Regs (Reg S)<br>6.75% 08Feb2028     | 美元 3,100,000      | 3,236,037  | 0.1              |
| Thaioil Trsry Center Ser<br>Regs (Reg S) 3.75%<br>18Jun2050       | 美元 1,700,000      | 1,131,450  | 0.0              | Standard Chartered Plc<br>Ser Regs (Reg S) Var<br>09Jan2029       | 美元 1,500,000      | 1,576,321  | 0.1              |
| Thaioil Trsry Center Ser<br>Regs (Regs) 4.875%<br>23Jan2043       | 美元 3,000,000      | 2,512,656  | 0.1              | Standard Chartered Plc<br>Ser Regs (Reg S) Var<br>16Nov2028       | 美元 6,600,000      | 7,261,206  | 0.2              |
| <b>土耳其 (0.3%)</b>   |                   |            |                  | Standard Chartered Plc<br>Ser Regs (Reg) (Reg<br>S) Var 12Jan2033 |                   |            |                  |
| Aydem Yenilenebilir<br>Ener Ser Regs (Reg S)<br>7.75% 02Feb2027   | 美元 3,000,000      | 2,728,521  | 0.1              | Standard Chartered Plc<br>Ser Regs (Reg) (Reg<br>S) Var 14May2035 | 美元 1,600,000      | 1,676,510  | 0.1              |
| Turkey (Govt of) (Reg)<br>9.875% 15Jan2028                        | 美元 3,000,000      | 3,333,367  | 0.1              | Standard Chartered Plc<br>Ser Regs (Reg) (Reg<br>S) Var Perp 6%   | 美元 4,700,000      | 4,756,105  | 0.1              |
| Turkiye Varlik Fonu<br>(Reg) (Reg S) 8.25%<br>14Feb2029           | 美元 5,000,000      | 5,196,741  | 0.1              | Standard Chartered<br>Ser Regs (Reg S) Var<br>29Jun2032           | 美元 1,134,000      | 989,745    | 0.0              |
| <b>阿联酋 (0.1%)</b>   |                   |            |                  | United Kingdom Gilt<br>4.5% 07Mar2035                             |                   |            |                  |
| Aldar Investment Prop<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) 5.5% 16May2034 | 美元 3,600,000      | 3,777,111  | 0.1              | 英镑 16,000,000   | 20,477,839        | 0.6        |                  |
| <b>英国 (2.6%)</b>  |                   |            |                  | <b>美国 (0.7%)</b>  |                   |            |                  |
| Barclays Plc (Reg) (Reg<br>S) Var Perp<br>31Dec2049               | 英镑 700,000        | 907,076    | 0.0              | Goldman Sachs Group<br>Inc 4.5% 16May2028                         | 澳元 1,000,000      | 621,718    | 0.0              |
| Barclays Plc (Reg) Var<br>Perp 31Dec2049                          | 美元 4,200,000      | 4,213,441  | 0.1              | National Grid Na Inc<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) 2.62% 09Jun2025 | 港元 78,000,000     | 10,202,449 | 0.3              |
| Barclays Plc Ser MTN<br>Var 28May2035                             | 澳元 7,700,000      | 4,984,733  | 0.2              |   |                   |            |                  |

投资组合 (续)  
于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

|  | 单位数目         | 公平值<br>美元            | 占资产<br>净值百<br>分比 |  | 单位数目                 | 公平值<br>美元    | 占资产<br>净值百<br>分比 |
|--|--------------|----------------------|------------------|--|----------------------|--------------|------------------|
| <b>美国 (续)</b>  |              |                      |                  | (D) Interest Rate Swap~619~ 112<br>24,700,000.00 SGD 19/03/2025<br>18/06/2035      | 72,406               | 0.0          |                  |
| Resorts World/RWLV<br>Cap Ser Regs (Reg<br>S) 4.625%<br>06Apr2031                    | 美元 8,900,000 | 7,739,561            | 0.2              | (D) Interest Rate Swap~619~ 113<br>140,000,000.00 MYR 21/03/2025<br>18/06/2030     | (13,458)             | (0.0)        |                  |
| Resorts World/RWLV<br>Cap Ser Regs (Reg<br>(Reg S) 4.625%<br>16Apr2029               | 美元 1,800,000 | 1,639,492            | 0.1              | (D) Interest Rate Swap~619~ 114<br>1,800,000,000.00 THB<br>18/06/2025 18/06/2028   | 260,083              | 0.0          |                  |
| WPC 3.75%<br>19Nov2034   | 欧元 1,443,000 | 1,509,466            | 0.1              | (D) Interest Rate Swap~619~ 115<br>230,000,000,000.00 KRW<br>01/04/2025 18/06/2027 | (20,071)             | 0.0          |                  |
|  |              | <u>3,014,256,247</u> | <u>92.5</u>      |  | <u>(16,194,643)</u>  | <u>(0.5)</u> |                  |
| <b>(III) 集体投资计划 (3.9%)</b>   |              |                      |                  | <b>总上市投资</b>   | 3,209,377,542        | 98.5         |                  |
| <b>卢森堡 (3.9%)</b>  |              |                      |                  | <b>其他净资产</b>   | 49,263,710           | 1.5          |                  |
| JPMLIQ-JPM USD<br>Liquidity LVNAV<br>'X' (dist)*#                                    | 127,737,586  | 127,737,586          | 3.9              | <b>于二零二五年三月三十一日可赎回份<br/>额持有人应占净资产</b>  | <u>3,258,641,252</u> | <u>100.0</u> |                  |
| <b>(IV) 衍生性产品 (-0.5%)</b>  |              |                      |                  | <b>总投资, 按成本</b>  | <u>3,159,156,733</u> |              |                  |
| <b>信用违约掉期 (0.1%)</b>   |              |                      |                  |  |                      |              |                  |
| (D) Credit Default Swap Index~604~<br>99 20,000,000.00 USD 18/02/2025<br>20/12/2029  |              | 558,287              | 0.0              |  |                      |              |                  |
| (D) Credit Default Swap Index~604~<br>102 30,000,000.00 USD 24/02/2025<br>20/12/2029 |              | 837,431              | 0.1              |  |                      |              |                  |
| <b>远期外汇合约 (-0.6%)</b>  |              | (18,124,235)         | (0.6)            |  |                      |              |                  |
| <b>期货 (0.0%)</b>   |              |                      |                  |  |                      |              |                  |
| Aust 10yr Bond Fut<br>16/06/2025   | 843          | 145,668              | 0.0              |  |                      |              |                  |
| Aust 3yr Bond Fut<br>16/06/2025  | 880          | 64,126               | 0.0              |  |                      |              |                  |
| Euro-BOBL Fut<br>06/06/2025  | 218          | (227,523)            | (0.0)            |  |                      |              |                  |
| US 10yr Note (CBT)<br>18/06/2025   | 852          | 372,672              | 0.0              |  |                      |              |                  |
| US 10yr Ultra Fut<br>18/06/2025  | 109          | (11,922)             | (0.0)            |  |                      |              |                  |
| US 2yr Note (CBT)<br>30/06/2025  | (427)        | (284,891)            | (0.0)            |  |                      |              |                  |
| US 5yr Note (CBT)<br>30/06/2025  | 751          | (180,195)            | (0.0)            |  |                      |              |                  |
| US Ultra Bond (CBT)<br>18/06/2025  | 85           | 226,719              | 0.0              |  |                      |              |                  |
| <b>利率掉期 (0.0%)</b>   |              |                      |                  |  |                      |              |                  |
| (D) Interest Rate Swap~619~ 105<br>485,000,000.00 CNY 27/02/2025<br>18/06/2030       |              | 77,714               | 0.0              |  |                      |              |                  |
| (D) Interest Rate Swap~619~ 109<br>150,000,000.00 MYR 06/03/2025<br>18/06/2030       |              | 52,546               | 0.0              |  |                      |              |                  |

\* 由管理人的关联人士发行和管理  
# 在香港未获认可及并非供香港公众投资

投资组合持有变动表 (续)  
截至二零二五年三月三十一日止期间(未经审计)

|              | 持有占资产净值百分比 |           | 持有占资产净值百分比           |           |
|--------------|------------|-----------|----------------------|-----------|
|              | 31.3.2025  | 30.9.2024 | 31.3.2025            | 30.9.2024 |
| <b>上市投资</b>  |            |           |                      |           |
|              |            |           | 卢森堡                  | 0.1       |
|              |            |           | 蒙古                   | -         |
| <b>可转换证券</b> |            |           |                      |           |
|              |            |           | <b>集体投资计划</b>        |           |
| 中国           | 1.1        | 3.1       |                      |           |
| 美国           | 0.7        | 0.6       | 卢森堡                  | 3.9       |
| 香港           | 0.6        | -         |                      | 1.5       |
| 韩国           | 0.2        | 0.8       | <b>衍生性产品</b>         |           |
| 维京群岛         | -          | 0.3       |                      |           |
| <b>债务证券</b>  |            |           | 信用违约掉期               | 0.1       |
|              |            |           | 期货                   | (0.4)     |
|              |            |           | 利率掉期                 | 0.0       |
|              |            |           | 远期外汇合约               | (0.1)     |
| 印度尼西亚        | 15.0       | 18.3      |                      | 0.6       |
| 印度           | 15.0       | 13.4      |                      |           |
| 中国           | 7.7        | 10.0      | <b>总上市投资</b>         | 98.5      |
| 菲律宾          | 5.5        | 3.2       |                      | 99.1      |
| 澳大利亚         | 5.1        | 3.7       | <b>其他净资产</b>         | 1.5       |
| 澳门           | 5.0        | 5.4       |                      | 0.9       |
| 香港           | 4.8        | 5.6       | <b>可赎回份额持有人应占净资产</b> | 100.0     |
| 韩国           | 4.5        | 7.2       |                      | 100.0     |
| 日本           | 4.5        | 4.3       |                      |           |
| 泰国           | 3.8        | 3.2       |                      |           |
| 英国           | 2.6        | 2.5       |                      |           |
| 墨西哥          | 2.4        | 1.4       |                      |           |
| 马来西亚         | 2.0        | 2.6       |                      |           |
| 新加坡          | 2.0        | 1.7       |                      |           |
| 沙特阿拉伯        | 1.5        | 0.4       |                      |           |
| 巴西           | 1.3        | 0.5       |                      |           |
| 智利           | 1.2        | 0.3       |                      |           |
| 巴基斯坦         | 1.0        | 0.8       |                      |           |
| 哥伦比亚         | 0.8        | 1.4       |                      |           |
| 美国           | 0.7        | 1.3       |                      |           |
| 斯里兰卡         | 0.7        | 0.6       |                      |           |
| 台湾           | 0.6        | 0.9       |                      |           |
| 巴拉圭          | 0.4        | 0.1       |                      |           |
| 国际           | 0.3        | 0.6       |                      |           |
| 巴拿马          | 0.3        | 0.4       |                      |           |
| 秘鲁           | 0.3        | 0.4       |                      |           |
| 法国           | 0.3        | 0.3       |                      |           |
| 南非           | 0.3        | -         |                      |           |
| 土耳其          | 0.3        | -         |                      |           |
| 卡塔尔          | 0.2        | 0.4       |                      |           |
| 罗马尼亚         | 0.2        | 0.4       |                      |           |
| 科威特          | 0.2        | 0.3       |                      |           |
| 荷兰           | 0.2        | 0.3       |                      |           |
| 哥斯达黎加        | 0.2        | 0.2       |                      |           |
| 多米尼加         | 0.2        | -         |                      |           |
| 西班牙          | 0.2        | -         |                      |           |
| 瑞士           | 0.2        | -         |                      |           |
| 阿联酋          | 0.1        | 0.4       |                      |           |
| 爱尔兰          | 0.1        | 0.2       |                      |           |
| 安哥拉          | 0.1        | -         |                      |           |
| 丹麦           | 0.1        | -         |                      |           |
| 德国           | 0.1        | -         |                      |           |
| 危地马拉         | 0.1        | -         |                      |           |
| 匈牙利          | 0.1        | -         |                      |           |
| 意大利          | 0.1        | -         |                      |           |

金融衍生工具详情

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

于二零二五年三月三十一日，本基金持有之金融衍生工具概述如下：

(a) 信用违约掉期

以下为于二零二五年三月三十一日未平仓之信用违约掉期合约：

|   | 标的资产      | 交易对手                         | 公平值<br>美元 |
|---|-----------|------------------------------|-----------|
| 于 2025 年 3 月 31 日   |           |                              |           |
| (D) Credit Default Swap Index~604~ 99<br>20,000,000.00 USD 18/02/2025 20/12/2029  | CDX.EM.42 | Citigroup Global Markets Ltd | 558,287   |
| (D) Credit Default Swap Index~604~ 102<br>30,000,000.00 USD 24/02/2025 20/12/2029 | CDX.EM.42 | Citigroup Global Markets Ltd | 837,431   |
|   |           | 金融资产总额                       | 1,395,718 |

(b) 远期外汇合约

以下为于二零二五年三月三十一日未平仓之远期外汇合约：

| 交付合约              | 折算额               | 交割日期            | 交易对手              | 未实现收益/<br>(亏损)<br>美元 |
|-------------------|-------------------|-----------------|-------------------|----------------------|
| 于 2025 年 3 月 31 日 |                   |                 |                   |                      |
| 离岸人民币 17,067,690  | 美元 2,350,023      | 2025 年 4 月 1 日  | 巴克莱银行, 伦敦         | 1,010                |
| 离岸人民币 2,696,324   | 美元 371,253        | 2025 年 4 月 1 日  | 巴克莱银行, 伦敦         | 160                  |
| 纽元 6,550          | 美元 3,758          | 2025 年 4 月 1 日  | 巴克莱银行, 伦敦         | 48                   |
| 美元 1,349,040      | 离岸人民币 9,816,959   | 2025 年 4 月 1 日  | 法国巴黎银行            | 2,061                |
| 美元 144,216        | 离岸人民币 1,049,459   | 2025 年 4 月 1 日  | 法国巴黎银行            | 220                  |
| 美元 56,860         | 离岸人民币 413,770     | 2025 年 4 月 1 日  | 法国巴黎银行            | 87                   |
| 澳元 60,604         | 美元 38,212         | 2025 年 4 月 2 日  | 法国巴黎银行            | 447                  |
| 美元 1,316,036      | 离岸人民币 9,562,679   | 2025 年 4 月 2 日  | Citibank N.A., 伦敦 | 67                   |
| 美元 191,768        | 离岸人民币 1,393,436   | 2025 年 4 月 2 日  | Citibank N.A., 伦敦 | 10                   |
| 美元 69,742         | 离岸人民币 506,768     | 2025 年 4 月 2 日  | Citibank N.A., 伦敦 | 4                    |
| 英镑 100,000        | 美元 129,613        | 2025 年 4 月 3 日  | Citibank N.A., 伦敦 | 538                  |
| 美元 1,578,827      | 离岸人民币 11,476,583  | 2025 年 4 月 3 日  | Citibank N.A., 伦敦 | 801                  |
| 美元 63,001         | 离岸人民币 457,962     | 2025 年 4 月 3 日  | 法国巴黎银行            | 32                   |
| 美元 2,577          | 离岸人民币 18,722      | 2025 年 4 月 3 日  | Citibank N.A., 伦敦 | 0                    |
| 美元 1,101          | 离岸人民币 7,997       | 2025 年 4 月 3 日  | 法国巴黎银行            | 0                    |
| 澳元 29,474         | 美元 18,565         | 2025 年 4 月 7 日  | Citibank N.A., 伦敦 | 198                  |
| 纽元 5,075          | 美元 2,907          | 2025 年 4 月 7 日  | Citibank N.A., 伦敦 | 33                   |
| 纽元 389,056        | 美元 220,364        | 2025 年 4 月 7 日  | Citibank N.A., 伦敦 | 0                    |
| 美元 2,072,264      | 离岸人民币 15,051,458  | 2025 年 4 月 7 日  | 法国巴黎银行            | 9                    |
| 美元 1,494,070      | 离岸人民币 10,851,874  | 2025 年 4 月 7 日  | Citibank N.A., 伦敦 | 8                    |
| 美元 380,734        | 离岸人民币 2,765,383   | 2025 年 4 月 7 日  | Citibank N.A., 伦敦 | 2                    |
| 美元 78,654         | 离岸人民币 571,283     | 2025 年 4 月 7 日  | 法国巴黎银行            | 0                    |
| 美元 3,865,249      | 菲律宾比索 225,000,000 | 2025 年 4 月 21 日 | 高盛国际, 伦敦          | 64,839               |
| 澳元 433,269        | 美元 273,638        | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 3,602                |
| 澳元 327,563        | 美元 206,651        | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 2,497                |
| 澳元 257,327        | 美元 162,519        | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | 2,140                |
| 澳元 156,322        | 美元 99,313         | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 1,885                |
| 澳元 145,180        | 美元 91,734         | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 1,250                |
| 澳元 150,592        | 美元 95,085         | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | 1,228                |
| 澳元 75,004         | 美元 47,816         | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 1,070                |
| 澳元 143,387        | 美元 89,843         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 478                  |
| 澳元 37,479         | 美元 23,644         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 285                  |
| 澳元 27,862         | 美元 17,577         | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 212                  |
| 澳元 12,843         | 美元 8,093          | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 88                   |
| 澳元 7,492          | 美元 4,712          | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 42                   |
| 澳元 1,726          | 美元 1,097          | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 21                   |
| 澳元 1,750          | 美元 1,104          | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 13                   |
| 澳元 1,744          | 美元 1,097          | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 9                    |

未实现收益/  
(亏损)  
美元

| 交付合约             | 折算额          | 交割日期            | 交易对手              | 未实现收益/<br>(亏损)<br>美元 |
|------------------|--------------|-----------------|-------------------|----------------------|
| 澳元 1,746         | 美元 1,094     | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 6                    |
| 加元 187,755       | 美元 131,626   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 1,045                |
| 加元 98,783        | 美元 69,371    | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 669                  |
| 加元 122,040       | 美元 85,243    | 2025 年 4 月 22 日 | 高盛国际, 伦敦          | 365                  |
| 加元 65,413        | 美元 45,778    | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 284                  |
| 加元 58,497        | 美元 40,898    | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 215                  |
| 加元 305,558       | 美元 212,687   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 175                  |
| 加元 80,553        | 美元 56,053    | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 30                   |
| 加元 2,880         | 美元 2,017     | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 14                   |
| 加元 1,582         | 美元 1,108     | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 8                    |
| 加元 3,121         | 美元 2,174     | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 3                    |
| 离岸人民币 17,023,962 | 美元 2,357,767 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 11,169               |
| 离岸人民币 13,132,626 | 美元 1,819,750 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 9,537                |
| 离岸人民币 10,678,725 | 美元 1,480,903 | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 8,937                |
| 离岸人民币 14,386,483 | 美元 1,991,699 | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 8,653                |
| 离岸人民币 12,654,035 | 美元 1,752,634 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 8,390                |
| 离岸人民币 12,310,548 | 美元 1,705,078 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 8,180                |
| 离岸人民币 11,692,662 | 美元 1,619,611 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 7,883                |
| 离岸人民币 9,201,618  | 美元 1,275,819 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 7,459                |
| 离岸人民币 11,255,683 | 美元 1,558,918 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 7,425                |
| 离岸人民币 7,638,670  | 美元 1,059,897 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 6,976                |
| 离岸人民币 8,398,390  | 美元 1,162,799 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 5,157                |
| 离岸人民币 6,659,467  | 美元 922,879   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 4,932                |
| 离岸人民币 16,482,671 | 美元 2,276,635 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 4,648                |
| 离岸人民币 5,963,016  | 美元 826,278   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 4,331                |
| 离岸人民币 4,355,253  | 美元 604,310   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 3,977                |
| 离岸人民币 12,592,490 | 美元 1,739,308 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 3,547                |
| 离岸人民币 5,572,203  | 美元 771,089   | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 3,011                |
| 离岸人民币 3,387,570  | 美元 469,406   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 2,460                |
| 离岸人民币 11,375,148 | 美元 1,570,410 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 2,449                |
| 离岸人民币 8,036,316  | 美元 1,110,033 | 2025 年 4 月 22 日 | 美林国际, 伦敦          | 2,299                |
| 离岸人民币 2,803,920  | 美元 388,531   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 2,036                |
| 离岸人民币 2,617,202  | 美元 362,696   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 1,938                |
| 离岸人民币 2,842,223  | 美元 393,691   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 1,916                |
| 离岸人民币 19,170,589 | 美元 2,644,152 | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 1,660                |
| 离岸人民币 2,403,646  | 美元 332,906   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 1,586                |
| 离岸人民币 12,705,373 | 美元 1,752,827 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 1,506                |
| 离岸人民币 2,146,064  | 美元 296,970   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 1,155                |
| 离岸人民币 1,479,355  | 美元 205,011   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 1,096                |
| 离岸人民币 18,116,042 | 美元 2,498,227 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 1,095                |
| 离岸人民币 12,672,910 | 美元 1,747,929 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 1,083                |
| 离岸人民币 3,327,640  | 美元 459,637   | 2025 年 4 月 22 日 | 美林国际, 伦敦          | 952                  |
| 离岸人民币 1,391,173  | 美元 192,613   | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 852                  |
| 离岸人民币 1,397,762  | 美元 193,510   | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 841                  |
| 离岸人民币 789,829    | 美元 109,532   | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 661                  |
| 离岸人民币 1,040,833  | 美元 144,096   | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 627                  |
| 离岸人民币 752,894    | 美元 104,390   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 610                  |
| 离岸人民币 768,176    | 美元 106,444   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 558                  |
| 离岸人民币 1,917,767  | 美元 264,896   | 2025 年 4 月 22 日 | 美林国际, 伦敦          | 549                  |
| 离岸人民币 589,295    | 美元 81,707    | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 478                  |
| 离岸人民币 667,304    | 美元 92,420    | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 438                  |
| 离岸人民币 545,775    | 美元 75,627    | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 396                  |
| 离岸人民币 339,630    | 美元 47,099    | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 284                  |
| 离岸人民币 449,887    | 美元 62,288    | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 276                  |
| 离岸人民币 1,209,912  | 美元 167,033   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 258                  |
| 离岸人民币 810,059    | 美元 111,888   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 228                  |
| 离岸人民币 809,040    | 美元 111,742   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 223                  |
| 离岸人民币 265,706    | 美元 36,800    | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 175                  |
| 离岸人民币 296,408    | 美元 41,017    | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 160                  |
| 离岸人民币 546,069    | 美元 75,424    | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 154                  |
| 离岸人民币 1,199,355  | 美元 165,462   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 142                  |
| 离岸人民币 162,580    | 美元 22,517    | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 107                  |
| 离岸人民币 309,569    | 美元 42,759    | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 88                   |
| 离岸人民币 733,526    | 美元 101,197   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 87                   |
| 离岸人民币 66,942     | 美元 9,289     | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 61                   |
| 离岸人民币 208,355    | 美元 28,779    | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 59                   |
| 离岸人民币 65,085     | 美元 9,020     | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 48                   |
| 离岸人民币 191,808    | 美元 26,480    | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 41                   |
| 离岸人民币 489,116    | 美元 67,450    | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 30                   |
| 离岸人民币 314,172    | 美元 43,333    | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 27                   |

| 交付合约                | 折算额              | 交割日期       | 交易对手              | 未实现收益/<br>(亏损)<br>美元 |
|---------------------|------------------|------------|-------------------|----------------------|
| 离岸人民币 72,393        | 美元 9,999         | 2025年4月22日 | 美林国际, 伦敦          | 21                   |
| 离岸人民币 20,430        | 美元 2,835         | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 19                   |
| 离岸人民币 304,719       | 美元 42,021        | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 18                   |
| 离岸人民币 27,024        | 美元 3,742         | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 17                   |
| 离岸人民币 7,986         | 美元 1,108         | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 7                    |
| 离岸人民币 7,986         | 美元 1,108         | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 7                    |
| 离岸人民币 7,986         | 美元 1,108         | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 7                    |
| 离岸人民币 26,757        | 美元 3,694         | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | 6                    |
| 离岸人民币 7,996         | 美元 1,108         | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | 6                    |
| 离岸人民币 7,971         | 美元 1,104         | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 5                    |
| 离岸人民币 7,971         | 美元 1,104         | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 5                    |
| 离岸人民币 7,953         | 美元 1,101         | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 5                    |
| 离岸人民币 13,831        | 美元 1,910         | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 4                    |
| 离岸人民币 21,241        | 美元 2,930         | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 3                    |
| 离岸人民币 7,980         | 美元 1,102         | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | 2                    |
| 离岸人民币 7,980         | 美元 1,102         | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 2                    |
| 离岸人民币 7,961         | 美元 1,100         | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | 2                    |
| 离岸人民币 8,027         | 美元 1,107         | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 1                    |
| 英镑 187,318          | 美元 242,445       | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 675                  |
| 英镑 26,839           | 美元 34,714        | 2025年4月22日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | 73                   |
| 英镑 17,436           | 美元 22,571        | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 67                   |
| 英镑 17,311           | 美元 22,379        | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 35                   |
| 英镑 3,844            | 美元 4,990         | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 29                   |
| 英镑 3,792            | 美元 4,917         | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | 22                   |
| 英镑 1,549            | 美元 2,004         | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 5                    |
| 英镑 2,573            | 美元 3,323         | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | 2                    |
| 纽元 982,089          | 美元 561,129       | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 4,661                |
| 纽元 269,971          | 美元 154,955       | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 1,985                |
| 纽元 119,415          | 美元 68,998        | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 1,336                |
| 纽元 126,532          | 美元 72,908        | 2025年4月22日 | 高盛国际, 伦敦          | 1,213                |
| 纽元 151,399          | 美元 86,718        | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 933                  |
| 纽元 71,349           | 美元 41,282        | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 855                  |
| 纽元 31,543           | 美元 18,340        | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 467                  |
| 纽元 79,880           | 美元 45,726        | 2025年4月22日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | 464                  |
| 纽元 44,759           | 美元 25,734        | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 373                  |
| 纽元 38,898           | 美元 22,344        | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | 304                  |
| 纽元 36,715           | 美元 21,092        | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | 288                  |
| 纽元 6,021            | 美元 3,463         | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 52                   |
| 纽元 1,893            | 美元 1,100         | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 28                   |
| 纽元 1,902            | 美元 1,094         | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 17                   |
| 纽元 1,922            | 美元 1,098         | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 9                    |
| 美元 2,243,984        | 离岸人民币 16,318,136 | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 5,323                |
| 美元 554,201          | 纽元 985,349       | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 4,114                |
| 美元 1,434,290        | 离岸人民币 10,434,087 | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 3,954                |
| 美元 1,408,353        | 离岸人民币 10,241,470 | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 3,341                |
| 美元 1,034,131        | 离岸人民币 7,514,487  | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | 1,673                |
| 美元 1,384,211        | 离岸人民币 10,048,688 | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | 909                  |
| 美元 323,513          | 离岸人民币 2,353,470  | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 892                  |
| 美元 1,587,506        | 离岸人民币 11,519,070 | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 293                  |
| 美元 57,985           | 离岸人民币 421,348    | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | 94                   |
| 美元 2,036            | 英镑 1,617         | 2025年4月22日 | 渣打银行, 伦敦          | 51                   |
| 美元 22,010           | 离岸人民币 160,000    | 2025年4月22日 | 美国道富银行            | 44                   |
| 美元 7,054            | 纽元 12,523        | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 42                   |
| 美元 11,731           | 离岸人民币 85,337     | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 32                   |
| 美元 16,764           | 离岸人民币 121,700    | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | 11                   |
| 美元 55,155           | 离岸人民币 400,210    | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 10                   |
| 美元 3,991            | 加元 5,748         | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 7                    |
| 美元 1,567            | 离岸人民币 11,399     | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 4                    |
| 美元 2,026            | 离岸人民币 14,722     | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | 3                    |
| 美元 1,521            | 英镑 1,179         | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 1                    |
| 美元 2,198            | 离岸人民币 15,952     | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | 0                    |
| 离岸人民币 230,000,000   | 美元 31,846,208    | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | 135,266              |
| 离岸人民币 120,000,000   | 美元 16,617,322    | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | 72,483               |
| 欧元 12,300,000       | 美元 13,428,334    | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | 125,368              |
| 英镑 6,200,000        | 美元 8,040,978     | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | 38,744               |
| 港元 391,861,000      | 美元 50,445,760    | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | 45,547               |
| 港元 75,000,000       | 美元 9,659,072     | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | 12,754               |
| 印尼盾 900,000,000,000 | 美元 54,443,167    | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | 173,850              |
| 印尼盾 175,000,000,000 | 美元 10,719,230    | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 166,862              |
| 印尼盾 200,000,000,000 | 美元 12,157,216    | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | 97,368               |

| 交付合约                  | 折算额                | 交割日期       | 交易对手              | 未实现收益/<br>(亏损)<br>美元 |
|-----------------------|--------------------|------------|-------------------|----------------------|
| 印尼盾 320,000,000,000   | 美元 19,389,709      | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | 93,952               |
| 印尼盾 250,000,000,000   | 美元 15,145,732      | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 70,922               |
| 印尼盾 265,000,000,000   | 美元 16,036,309      | 2025年4月25日 | 澳大利亚和新西兰银行集团有限公司  | 57,010               |
| 印尼盾 200,000,000,000   | 美元 12,105,585      | 2025年4月25日 | 美林国际, 伦敦          | 45,737               |
| 日元 2,500,000,000      | 美元 16,944,252      | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | 183,138              |
| 日元 1,200,000,000      | 美元 8,153,002       | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | 107,667              |
| 日元 2,200,000,000      | 美元 14,781,860      | 2025年4月25日 | 美林国际, 伦敦          | 32,079               |
| 韩元 21,500,000,000     | 美元 14,975,378      | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 356,497              |
| 韩元 11,000,000,000     | 美元 7,709,360       | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | 229,933              |
| 韩元 11,500,000,000     | 美元 7,925,405       | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 106,004              |
| 韩元 16,200,000,000     | 美元 11,120,554      | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | 105,397              |
| 韩元 10,800,000,000     | 美元 7,438,221       | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 94,784               |
| 韩元 22,000,000,000     | 美元 15,001,602      | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 42,748               |
| 韩元 10,760,000,000     | 美元 7,340,150       | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | 23,911               |
| 韩元 540,000,000        | 美元 372,506         | 2025年4月25日 | 美林国际, 伦敦          | 5,334                |
| 马来西亚林吉特<br>55,000,000 | 美元 12,457,813      | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | 52,077               |
| 新加坡元 70,000,000       | 美元 52,620,817      | 2025年4月25日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 474,319              |
| 新加坡元 24,500,000       | 美元 18,433,734      | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | 182,460              |
| 新加坡元 17,000,000       | 美元 12,793,864      | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | 129,714              |
| 新加坡元 16,000,000       | 美元 12,033,731      | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 114,531              |
| 新加坡元 28,500,000       | 美元 21,342,976      | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | 111,902              |
| 新加坡元 10,000,000       | 美元 7,513,504       | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | 64,004               |
| 泰铢 420,000,000        | 美元 12,433,393      | 2025年4月25日 | 澳大利亚和新西兰银行集团有限公司  | 33,564               |
| 台币 500,000,000        | 美元 15,382,911      | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | 293,987              |
| 台币 1,500,000,000      | 美元 45,456,474      | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 189,699              |
| 台币 500,000,000        | 美元 15,253,203      | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | 164,278              |
| 台币 520,000,000        | 美元 15,841,729      | 2025年4月25日 | 美林国际, 伦敦          | 149,247              |
| 台币 249,000,000        | 美元 7,619,153       | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | 104,868              |
| 台币 261,800,000        | 美元 7,961,682       | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | 61,121               |
| 台币 150,000,000        | 美元 4,587,310       | 2025年4月25日 | 美林国际, 伦敦          | 60,633               |
| 台币 248,200,000        | 美元 7,545,678       | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | 55,536               |
| 台币 64,000,000         | 美元 1,951,636       | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | 20,254               |
| 美元 18,430,077         | 英镑 15,000,000      | 2025年4月25日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 930,168              |
| 美元 18,029,879         | 英镑 14,500,000      | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | 685,025              |
| 美元 16,701,760         | 欧元 16,000,000      | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | 602,912              |
| 美元 59,017,463         | 新加坡元 80,000,000    | 2025年4月25日 | 美林国际, 伦敦          | 578,536              |
| 美元 11,853,676         | 欧元 11,330,000      | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | 400,195              |
| 美元 29,437,869         | 新加坡元 40,000,000    | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 360,130              |
| 美元 17,161,680         | 印度卢比 1,500,000,000 | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | 351,255              |
| 美元 6,854,789          | 日元 1,070,000,000   | 2025年4月25日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 318,967              |
| 美元 14,871,504         | 印度卢比 1,300,000,000 | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 306,372              |
| 美元 15,466,008         | 印度卢比 1,350,000,000 | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 295,633              |
| 美元 9,534,151          | 秘鲁新索尔 36,000,000   | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 290,354              |
| 美元 14,735,827         | 秘鲁新索尔 55,000,000   | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 273,833              |
| 美元 7,644,764          | 欧元 7,280,000       | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | 228,861              |
| 美元 10,833,291         | 印度卢比 944,000,000   | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 188,182              |
| 美元 12,927,387         | 新加坡元 17,604,994    | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | 187,453              |
| 美元 8,932,814          | 新加坡元 12,200,000    | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 155,576              |
| 美元 9,191,388          | 印度卢比 800,000,000   | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | 148,844              |
| 美元 8,589,147          | 菲律宾比索 500,000,000  | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | 143,612              |
| 美元 61,694,258         | 新加坡元 83,000,000    | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | 136,591              |
| 美元 7,119,855          | 印度卢比 621,000,000   | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | 130,500              |
| 美元 30,208,203         | 离岸人民币 220,000,000  | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | 124,002              |
| 美元 2,941,216          | 巴西雷亚尔 17,600,000   | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | 117,952              |
| 美元 33,414,394         | 新加坡元 45,000,000    | 2025年4月25日 | 美林国际, 伦敦          | 108,355              |
| 美元 17,404,455         | 新加坡元 23,500,000    | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 101,870              |
| 美元 6,640,616          | 新加坡元 9,000,000     | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | 63,934               |
| 美元 15,103,002         | 离岸人民币 110,000,000  | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | 63,100               |
| 美元 3,453,730          | 菲律宾比索 200,000,000  | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | 39,373               |
| 美元 22,320,665         | 新加坡元 30,000,000    | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | 27,835               |
| 美元 7,992,566          | 英镑 6,200,000       | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | 9,669                |
| 澳元 24,500,000         | 美元 15,536,001      | 2025年4月28日 | 美国道富银行            | 265,617              |
| 澳元 12,800,000         | 美元 8,182,003       | 2025年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 204,006              |
| 澳元 12,367,999         | 美元 7,817,287       | 2025年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 108,548              |
| 澳元 12,800,000         | 美元 8,058,979       | 2025年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 80,982               |
| 澳元 30,000,000         | 美元 18,775,878      | 2025年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 77,448               |
| 澳元 12,800,000         | 美元 8,038,833       | 2025年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 60,836               |
| 美元 7,961,792          | 澳元 12,800,000      | 2025年4月28日 | 澳大利亚和新西兰银行集团有限公司  | 16,205               |
| 印尼盾 545,000,000,000   | 美元 33,945,811      | 2025年5月8日  | Citibank N.A., 伦敦 | 1,104,792            |

| 交付合约               | 折算额               | 交割日期             | 交易对手              | 未实现收益 / (亏损)<br>美元 |
|--------------------|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|
| 美元 1,117,434       | 离岸人民币 8,092,246   | 2025 年 5 月 21 日  | Citibank N.A., 伦敦 | 254                |
| 美元 265,269         | 离岸人民币 1,921,214   | 2025 年 5 月 21 日  | 法国巴黎银行            | 86                 |
| 美元 220,603         | 纽元 389,056        | 2025 年 5 月 21 日  | Citibank N.A., 伦敦 | 5                  |
| 美元 14,198          | 离岸人民币 102,818     | 2025 年 5 月 21 日  | Citibank N.A., 伦敦 | 3                  |
| 印尼盾 70,000,000,000 | 美元 4,238,571      | 2025 年 7 月 25 日  | 渣打银行, 伦敦          | 32,910             |
| 印尼盾 75,000,000,000 | 美元 4,524,614      | 2025 年 7 月 25 日  | 高盛国际, 伦敦          | 18,549             |
| 新加坡元 8,000,000     | 美元 6,055,990      | 2025 年 9 月 17 日  | 美国道富银行            | 52,602             |
| 美元 32,480,715      | 巴西雷亚尔 200,000,000 | 2025 年 11 月 10 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 589,944            |
| 新加坡元 14,200,000    | 美元 10,824,939     | 2026 年 3 月 10 日  | 美国道富银行            | 80,192             |
| 新加坡元 4,500,000     | 美元 3,420,199      | 2026 年 3 月 24 日  | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 13,015             |
|                    |                   |                  | 未实现总收益            | 15,029,569         |
| 离岸人民币 15,952       | 美元 2,195          | 2025 年 4 月 1 日   | Citibank N.A., 伦敦 | (0)                |
| 美元 21,082          | 纽元 36,715         | 2025 年 4 月 1 日   | 法国巴黎银行            | (288)              |
| 离岸人民币 421,348      | 美元 57,906         | 2025 年 4 月 2 日   | 法国巴黎银行            | (84)               |
| 离岸人民币 7,514,487    | 美元 1,032,712      | 2025 年 4 月 2 日   | 法国巴黎银行            | (1,501)            |
| 美元 17,574          | 澳元 27,862         | 2025 年 4 月 2 日   | Citibank N.A., 伦敦 | (212)              |
| 美元 40,859          | 加元 58,497         | 2025 年 4 月 2 日   | Citibank N.A., 伦敦 | (215)              |
| 美元 25,722          | 纽元 44,759         | 2025 年 4 月 2 日   | Citibank N.A., 伦敦 | (373)              |
| 离岸人民币 400,210      | 美元 55,082         | 2025 年 4 月 3 日   | Citibank N.A., 伦敦 | (3)                |
| 离岸人民币 11,519,070   | 美元 1,585,393      | 2025 年 4 月 3 日   | Citibank N.A., 伦敦 | (83)               |
| 美元 2,004           | 英镑 1,549          | 2025 年 4 月 3 日   | Citibank N.A., 伦敦 | (5)                |
| 离岸人民币 121,700      | 美元 16,747         | 2025 年 4 月 7 日   | 法国巴黎银行            | (8)                |
| 离岸人民币 10,048,688   | 美元 1,382,798      | 2025 年 4 月 7 日   | 法国巴黎银行            | (698)              |
| 离岸人民币 102,818      | 美元 14,157         | 2025 年 4 月 8 日   | Citibank N.A., 伦敦 | (0)                |
| 离岸人民币 1,921,214    | 美元 264,530        | 2025 年 4 月 8 日   | 法国巴黎银行            | (1)                |
| 离岸人民币 8,092,246    | 美元 1,114,211      | 2025 年 4 月 8 日   | Citibank N.A., 伦敦 | (5)                |
| 菲律宾比索 225,000,000  | 美元 3,899,108      | 2025 年 4 月 21 日  | 美国道富银行            | (30,979)           |
| 澳元 98,512          | 美元 61,227         | 2025 年 4 月 22 日  | 美国道富银行            | (171)              |
| 澳元 473,288         | 美元 293,855        | 2025 年 4 月 22 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (1,122)            |
| 澳元 610,194         | 美元 378,858        | 2025 年 4 月 22 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (1,447)            |
| 加元 1,580           | 美元 1,097          | 2025 年 4 月 22 日  | 巴克莱银行, 伦敦         | (2)                |
| 加元 10,095          | 美元 6,977          | 2025 年 4 月 22 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (43)               |
| 加元 109,723         | 美元 76,263         | 2025 年 4 月 22 日  | 高盛国际, 伦敦          | (48)               |
| 离岸人民币 8,029        | 美元 1,104          | 2025 年 4 月 22 日  | 美林国际, 伦敦          | (2)                |
| 离岸人民币 8,022        | 美元 1,103          | 2025 年 4 月 22 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (3)                |
| 离岸人民币 79,976       | 美元 11,011         | 2025 年 4 月 22 日  | 法国巴黎银行            | (13)               |
| 离岸人民币 506,768      | 美元 69,835         | 2025 年 4 月 22 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (18)               |
| 离岸人民币 99,954       | 美元 13,744         | 2025 年 4 月 22 日  | 巴克莱银行, 伦敦         | (34)               |
| 离岸人民币 457,962      | 美元 63,083         | 2025 年 4 月 22 日  | 法国巴黎银行            | (43)               |
| 离岸人民币 1,393,436    | 美元 192,022        | 2025 年 4 月 22 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (51)               |
| 离岸人民币 137,983      | 美元 18,966         | 2025 年 4 月 22 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (54)               |
| 离岸人民币 413,770      | 美元 56,940         | 2025 年 4 月 22 日  | 法国巴黎银行            | (94)               |
| 离岸人民币 1,049,459    | 美元 144,420        | 2025 年 4 月 22 日  | 法国巴黎银行            | (238)              |
| 离岸人民币 9,562,679    | 美元 1,317,779      | 2025 年 4 月 22 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (350)              |
| 离岸人民币 2,251,614    | 美元 310,005        | 2025 年 4 月 22 日  | 法国巴黎银行            | (360)              |
| 离岸人民币 1,594,778    | 美元 219,205        | 2025 年 4 月 22 日  | 巴克莱银行, 伦敦         | (621)              |
| 离岸人民币 3,909,192    | 美元 538,222        | 2025 年 4 月 22 日  | 法国巴黎银行            | (625)              |
| 离岸人民币 3,721,677    | 美元 511,966        | 2025 年 4 月 22 日  | 美林国际, 伦敦          | (1,034)            |
| 离岸人民币 11,476,583   | 美元 1,580,788      | 2025 年 4 月 22 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (1,155)            |
| 离岸人民币 9,815,624    | 美元 1,351,426      | 2025 年 4 月 22 日  | 法国巴黎银行            | (1,569)            |
| 离岸人民币 9,816,959    | 美元 1,350,949      | 2025 年 4 月 22 日  | 法国巴黎银行            | (2,230)            |
| 离岸人民币 8,503,318    | 美元 1,169,219      | 2025 年 4 月 22 日  | 巴克莱银行, 伦敦         | (2,887)            |
| 离岸人民币 13,145,505   | 美元 1,806,877      | 2025 年 4 月 22 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (5,112)            |
| 英镑 962             | 美元 1,240          | 2025 年 4 月 22 日  | 法国巴黎银行            | (1)                |
| 英镑 865             | 美元 1,113          | 2025 年 4 月 22 日  | 法国巴黎银行            | (4)                |
| 英镑 874             | 美元 1,109          | 2025 年 4 月 22 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (18)               |
| 英镑 54,709          | 美元 70,372         | 2025 年 4 月 22 日  | 法国巴黎银行            | (240)              |
| 英镑 51,743          | 美元 65,788         | 2025 年 4 月 22 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (995)              |
| 纽元 34,677          | 美元 19,504         | 2025 年 4 月 22 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (145)              |
| 纽元 59,573          | 美元 33,403         | 2025 年 4 月 22 日  | 巴克莱银行, 伦敦         | (352)              |
| 纽元 236,694         | 美元 133,124        | 2025 年 4 月 22 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (990)              |
| 美元 2,832           | 离岸人民币 20,535      | 2025 年 4 月 22 日  | 巴克莱银行, 伦敦         | (1)                |
| 美元 1,272           | 离岸人民币 9,222       | 2025 年 4 月 22 日  | 法国巴黎银行            | (1)                |
| 美元 2,213           | 加元 3,177          | 2025 年 4 月 22 日  | 法国巴黎银行            | (3)                |
| 美元 7,542           | 离岸人民币 54,684      | 2025 年 4 月 22 日  | 巴克莱银行, 伦敦         | (4)                |
| 美元 1,263           | 离岸人民币 9,130       | 2025 年 4 月 22 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (5)                |

未实现收益 /  
(亏损)

| 交付合约          | 折算额              | 交割日期            | 交易对手              | 美元      |
|---------------|------------------|-----------------|-------------------|---------|
| 美元 1,450      | 离岸人民币 10,469     | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (7)     |
| 美元 1,424      | 加元 2,038         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (7)     |
| 美元 1,632      | 离岸人民币 11,781     | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (8)     |
| 美元 1,420      | 离岸人民币 10,245     | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (8)     |
| 美元 3,597      | 加元 5,156         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (11)    |
| 美元 2,336      | 离岸人民币 16,854     | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (12)    |
| 美元 22,097     | 离岸人民币 160,200    | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (15)    |
| 美元 3,222      | 离岸人民币 23,260     | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (16)    |
| 美元 2,774      | 离岸人民币 20,000     | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (17)    |
| 美元 4,367      | 离岸人民币 31,540     | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (19)    |
| 美元 2,660      | 澳元 4,231         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (23)    |
| 美元 13,813     | 离岸人民币 100,000    | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (29)    |
| 美元 2,908      | 纽元 5,075         | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (33)    |
| 美元 4,383      | 纽元 7,670         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (37)    |
| 美元 18,251     | 离岸人民币 132,127    | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (38)    |
| 美元 3,760      | 纽元 6,550         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (48)    |
| 美元 6,314      | 纽元 11,023        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (68)    |
| 美元 14,247     | 离岸人民币 102,744    | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (84)    |
| 美元 52,712     | 离岸人民币 381,800    | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (85)    |
| 美元 219,355    | 加元 315,260       | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (96)    |
| 美元 66,481     | 离岸人民币 481,541    | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (105)   |
| 美元 29,995     | 离岸人民币 216,546    | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (147)   |
| 美元 72,656     | 离岸人民币 526,008    | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (150)   |
| 美元 371,850    | 离岸人民币 2,696,324  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (186)   |
| 美元 38,801     | 离岸人民币 280,140    | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (186)   |
| 美元 18,568     | 澳元 29,474        | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (198)   |
| 美元 45,301     | 离岸人民币 327,179    | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (202)   |
| 美元 269,259    | 离岸人民币 1,951,540  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (257)   |
| 美元 67,691     | 离岸人民币 488,909    | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (299)   |
| 美元 159,054    | 离岸人民币 1,151,520  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (328)   |
| 美元 85,104     | 英镑 65,608        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (424)   |
| 美元 20,915     | 纽元 36,146        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (434)   |
| 美元 146,922    | 英镑 113,494       | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (436)   |
| 美元 38,218     | 澳元 60,604        | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (447)   |
| 美元 20,337     | 澳元 31,900        | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (455)   |
| 美元 18,657     | 纽元 32,088        | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (476)   |
| 美元 188,333    | 英镑 145,510       | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (525)   |
| 美元 129,608    | 英镑 100,000       | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (538)   |
| 美元 1,458,698  | 离岸人民币 10,575,703 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (934)   |
| 美元 84,869     | 纽元 148,065       | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | (974)   |
| 美元 205,037    | 离岸人民币 1,480,220  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (1,002) |
| 美元 41,904     | 纽元 72,082        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (1,061) |
| 美元 2,353,802  | 离岸人民币 17,067,690 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (1,176) |
| 美元 272,633    | 离岸人民币 1,968,381  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (1,310) |
| 美元 115,044    | 澳元 182,357       | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (1,390) |
| 美元 297,989    | 离岸人民币 2,151,450  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (1,431) |
| 美元 245,611    | 离岸人民币 1,771,320  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (1,451) |
| 美元 379,113    | 离岸人民币 2,739,617  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (1,481) |
| 美元 335,777    | 离岸人民币 2,425,220  | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (1,482) |
| 美元 84,564     | 澳元 133,106       | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (1,606) |
| 美元 191,176    | 澳元 304,000       | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (1,708) |
| 美元 323,500    | 离岸人民币 2,332,645  | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (1,966) |
| 美元 1,301,373  | 离岸人民币 9,426,199  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (2,057) |
| 美元 353,110    | 英镑 271,969       | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (2,082) |
| 美元 347,025    | 纽元 608,135       | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (2,446) |
| 美元 212,105    | 纽元 369,232       | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (2,892) |
| 美元 546,312    | 离岸人民币 3,942,329  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (2,897) |
| 美元 1,528,603  | 离岸人民币 11,066,620 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (3,169) |
| 美元 284,423    | 澳元 450,131       | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (3,878) |
| 美元 4,201,178  | 离岸人民币 30,449,343 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (4,013) |
| 美元 1,934,467  | 离岸人民币 14,004,568 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (4,064) |
| 美元 747,962    | 离岸人民币 5,390,220  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (4,969) |
| 美元 1,263,552  | 离岸人民币 9,130,538  | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (4,990) |
| 美元 419,351    | 澳元 664,709       | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (5,070) |
| 美元 1,212,923  | 离岸人民币 8,756,143  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (5,968) |
| 美元 1,088,261  | 离岸人民币 7,847,069  | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (6,614) |
| 美元 1,802,111  | 离岸人民币 13,015,447 | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (8,049) |
| 美元 1,378,060  | 离岸人民币 9,938,398  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (8,142) |
| 美元 12,508,900 | 英镑 9,685,064     | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (8,475) |
| 美元 1,772,769  | 离岸人民币 12,799,193 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (8,517) |

| 交付合约                | 折算额                 | 交割日期       | 交易对手              | 未实现收益 / (亏损) |
|---------------------|---------------------|------------|-------------------|--------------|
|                     |                     |            |                   | 美元           |
| 美元 1,388,897        | 离岸人民币 10,009,146    | 2025年4月22日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (9,227)      |
| 美元 2,071,880        | 离岸人民币 14,958,765    | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | (9,950)      |
| 美元 2,766,010        | 离岸人民币 19,978,018    | 2025年4月22日 | Citibank N.A., 伦敦 | (12,221)     |
| 美元 3,870,516        | 离岸人民币 27,930,628    | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | (20,532)     |
| 美元 4,222,943        | 离岸人民币 30,462,831    | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | (23,918)     |
| 美元 47,740,757       | 加元 68,330,630       | 2025年4月22日 | 多伦多道明银行           | (217,679)    |
| 美元 25,643,794       | 纽元 44,738,069       | 2025年4月22日 | 渣打银行, 伦敦          | (294,488)    |
| 美元 113,483,565      | 离岸人民币 818,630,720   | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | (642,742)    |
| 美元 54,265,997       | 澳元 85,888,068       | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | (736,172)    |
| 美元 199,569,055      | 离岸人民币 1,439,621,317 | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | (1,130,308)  |
| 美元 479,093,340      | 离岸人民币 3,456,011,672 | 2025年4月22日 | 法国巴黎银行            | (2,713,463)  |
| 巴西雷亚尔 41,658,923    | 美元 6,688,092        | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | (552,911)    |
| 离岸人民币 35,000,000    | 美元 4,798,780        | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | (26,798)     |
| 离岸人民币 115,000,000   | 美元 15,795,122       | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | (60,349)     |
| 离岸人民币 150,000,000   | 美元 20,598,717       | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | (82,332)     |
| 离岸人民币 70,000,000    | 美元 9,558,284        | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | (92,872)     |
| 离岸人民币 65,000,000    | 美元 8,862,718        | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | (99,070)     |
| 离岸人民币 215,000,000   | 美元 29,336,957       | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | (305,879)    |
| 离岸人民币 771,876,245   | 美元 105,386,603      | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | (1,034,800)  |
| 欧元 12,000,000       | 美元 12,494,716       | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | (483,788)    |
| 欧元 17,000,000       | 美元 17,851,635       | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | (534,579)    |
| 欧元 12,500,000       | 美元 12,919,695       | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | (599,580)    |
| 欧元 20,000,000       | 美元 20,968,666       | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | (662,174)    |
| 欧元 32,714,964       | 美元 33,915,188       | 2025年4月25日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (1,467,420)  |
| 英镑 4,100,000        | 美元 4,996,602        | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | (295,199)    |
| 英镑 14,200,000       | 美元 17,970,641       | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | (357,058)    |
| 英镑 17,602,000       | 美元 21,732,163       | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | (986,439)    |
| 英镑 15,000,000       | 美元 18,202,245       | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | (1,158,000)  |
| 印尼盾 207,300,000,000 | 美元 12,462,876       | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | (37,157)     |
| 印度卢比 600,000,000    | 美元 6,889,306        | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | (115,868)    |
| 印度卢比 750,000,000    | 美元 8,522,359        | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | (234,108)    |
| 印度卢比 1,000,000,000  | 美元 11,394,492       | 2025年4月25日 | 美林国际, 伦敦          | (280,798)    |
| 印度卢比 1,600,000,000  | 美元 18,349,802       | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | (330,662)    |
| 印度卢比 1,250,000,000  | 美元 14,248,392       | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | (345,721)    |
| 印度卢比 2,740,000,000  | 美元 31,553,370       | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | (436,924)    |
| 印度卢比 2,000,000,000  | 美元 22,710,893       | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | (639,687)    |
| 日元 1,070,000,000    | 美元 6,951,696        | 2025年4月25日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (222,061)    |
| 韩元 11,700,000,000   | 美元 7,945,336        | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | (10,055)     |
| 墨西哥比索 7,000,000     | 美元 336,006          | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | (5,083)      |
| 马来西亚林吉特 61,500,000  | 美元 13,870,720       | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | (1,148)      |
| 秘鲁新索尔 91,000,000    | 美元 24,347,826       | 2025年4月25日 | 美林国际, 伦敦          | (486,338)    |
| 菲律宾比索 900,000,000   | 美元 15,553,443       | 2025年4月25日 | 澳大利亚和新西兰银行集团有限公司  | (165,523)    |
| 菲律宾比索 500,000,000   | 美元 8,497,187        | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | (235,572)    |
| 新加坡元 20,500,000     | 美元 15,193,300       | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | (78,175)     |
| 新加坡元 9,800,000      | 美元 7,195,829        | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | (104,680)    |
| 新加坡元 21,000,000     | 美元 15,517,968       | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | (125,982)    |
| 新加坡元 20,000,000     | 美元 14,699,073       | 2025年4月25日 | 美林国际, 伦敦          | (199,926)    |
| 新加坡元 40,000,000     | 美元 29,578,667       | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | (219,333)    |
| 新加坡元 20,000,000     | 美元 14,652,036       | 2025年4月25日 | 美林国际, 伦敦          | (246,964)    |
| 新加坡元 60,000,000     | 美元 44,092,035       | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | (604,964)    |
| 新加坡元 55,000,000     | 美元 40,205,531       | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | (766,718)    |
| 新加坡元 115,000,000    | 美元 84,217,927       | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | (1,451,321)  |
| 泰铢 620,000,000      | 美元 18,280,943       | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | (23,567)     |
| 泰铢 350,000,000      | 美元 10,295,783       | 2025年4月25日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (37,408)     |
| 泰铢 534,000,000      | 美元 15,675,592       | 2025年4月25日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (89,905)     |
| 美元 6,467,641        | 台币 214,000,000      | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | (9,581)      |
| 美元 15,897,504       | 离岸人民币 115,000,000   | 2025年4月25日 | 美林国际, 伦敦          | (42,033)     |
| 美元 8,092,241        | 日元 1,200,000,000    | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | (46,906)     |
| 美元 8,102,675        | 日元 1,200,000,000    | 2025年4月25日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (57,341)     |
| 美元 6,548,649        | 欧元 6,000,000        | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | (59,397)     |
| 美元 15,705,608       | 新加坡元 21,000,000     | 2025年4月25日 | 高盛国际, 伦敦          | (61,658)     |
| 美元 31,784,891       | 离岸人民币 230,000,000   | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | (73,949)     |
| 美元 2,930,076        | 韩元 4,200,000,000    | 2025年4月25日 | 渣打银行, 伦敦          | (74,295)     |
| 美元 6,106,348        | 印尼盾 100,000,000,000 | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | (76,424)     |
| 美元 7,620,855        | 台币 249,000,000      | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | (106,570)    |
| 美元 8,153,953        | 日元 1,200,000,000    | 2025年4月25日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (108,618)    |
| 美元 18,189,485       | 英镑 14,000,000       | 2025年4月25日 | 美国道富银行            | (119,923)    |
| 美元 16,509,588       | 新加坡元 22,000,000     | 2025年4月25日 | 法国巴黎银行            | (120,688)    |
| 美元 7,812,284        | 韩元 11,300,000,000   | 2025年4月25日 | Citibank N.A., 伦敦 | (128,872)    |

| 交付合约               | 折算额                 | 交割日期        | 交易对手              | 未实现收益／<br>(亏损) |
|--------------------|---------------------|-------------|-------------------|----------------|
|                    |                     |             |                   | 美元             |
| 美元 19,781,487      | 印尼盾 325,900,000,000 | 2025年4月25日  | Citibank N.A., 伦敦 | (129,964)      |
| 美元 15,903,223      | 泰铢 534,000,000      | 2025年4月25日  | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (137,726)      |
| 美元 7,958,714       | 韩元 11,500,000,000   | 2025年4月25日  | 美国道富银行            | (139,313)      |
| 美元 27,719,451      | 离岸人民币 200,000,000   | 2025年4月25日  | 法国巴黎银行            | (144,719)      |
| 美元 18,537,315      | 印尼盾 305,000,000,000 | 2025年4月25日  | 美国道富银行            | (146,046)      |
| 美元 22,497,576      | 新加坡元 30,000,000     | 2025年4月25日  | Citibank N.A., 伦敦 | (149,076)      |
| 美元 15,797,254      | 新加坡元 21,000,000     | 2025年4月25日  | 法国巴黎银行            | (153,304)      |
| 美元 12,254,902      | 印尼盾 200,000,000,000 | 2025年4月25日  | 澳大利亚和新西兰银行集团有限公司  | (195,054)      |
| 美元 15,508,076      | 韩元 22,500,000,000   | 2025年4月25日  | 美国道富银行            | (209,247)      |
| 美元 15,300,533      | 台币 500,000,000      | 2025年4月25日  | 美林国际, 伦敦          | (211,608)      |
| 美元 15,305,029      | 台币 500,000,000      | 2025年4月25日  | 高盛国际, 伦敦          | (216,104)      |
| 美元 15,915,769      | 台币 520,000,000      | 2025年4月25日  | Citibank N.A., 伦敦 | (223,287)      |
| 美元 20,305,089      | 印尼盾 333,000,000,000 | 2025年4月25日  | 美国道富银行            | (225,441)      |
| 美元 15,635,682      | 台币 510,000,000      | 2025年4月25日  | 渣打银行, 伦敦          | (244,979)      |
| 美元 24,085,268      | 新加坡元 32,000,000     | 2025年4月25日  | Citibank N.A., 伦敦 | (246,868)      |
| 美元 14,868,912      | 韩元 21,500,000,000   | 2025年4月25日  | 渣打银行, 伦敦          | (250,031)      |
| 美元 48,526,729      | 离岸人民币 350,000,000   | 2025年4月25日  | 法国巴黎银行            | (270,948)      |
| 美元 15,709,272      | 日元 2,300,000,000    | 2025年4月25日  | 渣打银行, 伦敦          | (289,047)      |
| 美元 15,407,941      | 台币 500,000,000      | 2025年4月25日  | 美国道富银行            | (319,016)      |
| 美元 30,505,290      | 台币 1,000,000,000    | 2025年4月25日  | Citibank N.A., 伦敦 | (327,440)      |
| 美元 16,011,707      | 韩元 23,000,000,000   | 2025年4月25日  | 美国道富银行            | (372,904)      |
| 美元 15,417,931      | 韩元 22,000,000,000   | 2025年4月25日  | Citibank N.A., 伦敦 | (459,077)      |
| 澳元 7,445,030       | 美元 4,622,664        | 2025年4月28日  | 高盛国际, 伦敦          | (17,682)       |
| 澳元 25,000,000      | 美元 15,356,313       | 2025年4月28日  | 渣打银行, 伦敦          | (225,712)      |
| 澳元 32,000,000      | 美元 19,594,525       | 2025年4月28日  | 澳大利亚和新西兰银行集团有限公司  | (350,467)      |
| 纽元 53,000,000      | 美元 29,308,247       | 2025年4月28日  | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (726,959)      |
| 美元 8,773,968       | 澳元 14,000,000       | 2025年4月28日  | 美林国际, 伦敦          | (48,034)       |
| 美元 16,602,181      | 澳元 26,500,000       | 2025年4月28日  | 美国道富银行            | (85,235)       |
| 美元 5,398,121       | 澳元 8,500,000        | 2025年4月28日  | 渣打银行, 伦敦          | (100,232)      |
| 美元 14,867,299      | 纽元 26,000,000       | 2025年4月28日  | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (133,047)      |
| 美元 15,434,669      | 纽元 27,000,000       | 2025年4月28日  | 美国道富银行            | (133,715)      |
| 美元 9,706,117       | 澳元 15,200,000       | 2025年4月28日  | 法国巴黎银行            | (232,245)      |
| 美元 33,381,313      | 印尼盾 545,000,000,000 | 2025年5月8日   | 渣打银行, 伦敦          | (540,293)      |
| 离岸人民币 7,997        | 美元 1,104            | 2025年5月21日  | 法国巴黎银行            | (0)            |
| 离岸人民币 18,722       | 美元 2,585            | 2025年5月21日  | Citibank N.A., 伦敦 | (1)            |
| 离岸人民币 571,283      | 美元 78,878           | 2025年5月21日  | 法国巴黎银行            | (27)           |
| 离岸人民币 2,765,383    | 美元 381,794          | 2025年5月21日  | Citibank N.A., 伦敦 | (156)          |
| 离岸人民币 10,851,874   | 美元 1,498,223        | 2025年5月21日  | Citibank N.A., 伦敦 | (621)          |
| 离岸人民币 15,051,458   | 美元 2,078,169        | 2025年5月21日  | 法国巴黎银行            | (714)          |
| 印尼盾 82,500,000,000 | 美元 4,959,512        | 2025年6月26日  | Citibank N.A., 伦敦 | (3,093)        |
| 印尼盾 83,750,000,000 | 美元 5,032,448        | 2025年6月26日  | 高盛国际, 伦敦          | (5,348)        |
| 印尼盾 83,750,000,000 | 美元 5,025,141        | 2025年6月26日  | 美国道富银行            | (12,655)       |
| 美元 8,719,077       | 印尼盾 145,000,000,000 | 2025年7月25日  | Citibank N.A., 伦敦 | (7,351)        |
| 印尼盾 85,800,000,000 | 美元 5,132,807        | 2025年9月26日  | 高盛国际, 伦敦          | (7,755)        |
| 印尼盾 87,100,000,000 | 美元 5,209,330        | 2025年9月26日  | 高盛国际, 伦敦          | (9,119)        |
| 印尼盾 87,100,000,000 | 美元 5,200,932        | 2025年9月26日  | Citibank N.A., 伦敦 | (17,517)       |
| 巴西雷亚尔 200,000,000  | 美元 30,998,140       | 2025年11月10日 | 高盛国际, 伦敦          | (2,072,518)    |
|                    |                     |             | 未实现总亏损            | (33,153,804)   |
|                    |                     |             | 未实现净亏损            | (18,124,235)   |

(c) 期货

以下为于二零二五年三月三十一日之未平仓期货合约：

|                                | 标的资产                                       | 交易对手                         | 未实现收益/<br>(亏损)<br>美元 |
|--------------------------------|--|------------------------------|----------------------|
| <u>于 2025 年 3 月 31 日</u>       |  |                              |                      |
| Aust 10yr Bond Fut 16/06/2025  | 10 年期澳大利亚国债                                | Citigroup Global Markets Ltd | 145,668              |
| Aust 3yr Bond Fut 16/06/2025   | 3 年期澳大利亚国债                                 | Citigroup Global Markets Ltd | 64,126               |
| US 10yr Note (CBT) 18/06/2025  | 10 年期美国国债                                  | Citigroup Global Markets Ltd | 372,672              |
| US Ultra Bond (CBT) 18/06/2025 | 30 年期美国国债                                  | Citigroup Global Markets Ltd | 226,719              |
|                                |  | 未实现总收益                       | 809,185              |
|                                | 由联邦德国、意大利共和国、法兰西共和国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 5 年期债务工具 | Citigroup Global Markets Ltd | (227,523)            |
| Euro-BOBL Fut 06/06/2025       |  | Citigroup Global Markets Ltd | (11,922)             |
| US 10yr Ultra Fut 18/06/2025   | 10 年期美国国债                                  | Citigroup Global Markets Ltd | (284,891)            |
| US 2yr Note (CBT) 30/06/2025   | 2 年期美国国债                                   | Citigroup Global Markets Ltd | (180,195)            |
| US 5yr Note (CBT) 30/06/2025   | 5 年期美国国债                                   | Citigroup Global Markets Ltd |                      |
|                                |  | 未实现总亏损                       | (704,531)            |
|                                |  | 未实现净收益                       | 104,654              |

(d) 利率掉期

以下为于二零二五年三月三十一日之未平仓利率掉期合约：

|   | 标的资产                 | 交易对手                         | 公平值<br>美元 |
|---|----------------------|------------------------------|-----------|
| <u>于 2025 年 3 月 31 日</u>  |                      |                              |           |
| (D) Interest Rate Swap~619~ 105<br>485,000,000.00 CNY 27/02/2025<br>18/06/2030      | CNY/REPO7/1W/Reuters | Citigroup Global Markets Ltd | 77,714    |
| (D) Interest Rate Swap ~619~ 109<br>150,000,000.00 MYR 06/03/2025<br>18/06/2030     | MYR/KLIBOR/3M/ABM    | 渣打银行                         | 52,546    |
| (D) Interest Rate Swap ~619~ 112<br>24,700,000.00 SGD 19/03/2025<br>18/06/2035      | SGD/SORA/1D/Reuters  | Citigroup Global Markets Ltd | 72,406    |
| (D) Interest Rate Swap ~619~ 114<br>1,800,000,000.00 THB 18/06/2025<br>18/06/2028   | THB/THOR/1D/BBA      | Citigroup Global Markets Ltd | 260,083   |
|   |                      | 金融资产总额                       | 462,749   |
| (D) Interest Rate Swap ~619~ 113<br>140,000,000.00 MYR 21/03/2025<br>18/06/2030     | MYR/KLIBOR/3M/ABM    | 渣打银行                         | (13,458)  |
| (D) Interest Rate Swap ~619~ 115<br>230,000,000,000.00 KRW<br>01/04/2025 18/06/2027 | KRW/CD/91D/Reuters   | Citigroup Global Markets Ltd | (20,071)  |
|   |                      | 金融负债总额                       | (33,529)  |
|   |                      | 金融资产净额                       | 429,220   |

抵押品持有情况

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

| 抵押品提供方            | 抵押品的性质 | 到期期限 | 计价货币 | 抵押品所涵盖资产净值<br>百分比 | 抵押品价值<br>美元      |
|-------------------|--------|------|------|-------------------|------------------|
| Citibank N.A., 伦敦 | 现金     | 不适用  | 美元   | 0.1               | 2,151,564        |
|                   |        |      |      | <u>0.1</u>        | <u>2,151,564</u> |

现金抵押品再投资详情

截至二零二五年三月三十一日止期间，未进行现金抵押品再投资。

托管/保管安排

| 托管/保管安排      | 收到/持有的抵押品<br>金额<br>31.3.2025<br>美元 | 计划下提供的抵押品<br>所占比例<br>31.3.2025<br>百分比 |
|--------------|------------------------------------|---------------------------------------|
| 现金抵押品的托管机构   |                                    |                                       |
| <b>隔离账户</b>  |                                    |                                       |
| 香港上海汇丰银行有限公司 | <u>2,151,564</u>                   | <u>100.0</u>                          |

财务状况表

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

|                              | 31.3.2025<br>美元      | 30.9.2024<br>美元      |
|------------------------------|----------------------|----------------------|
| <b>资产</b>                    |                      |                      |
| <b>流动资产</b>                  |                      |                      |
| 银行现金                         | 37,642,321           | 24,866,024           |
| 现金抵押品                        | 2,151,564            | 616,762              |
| 应收经纪款项                       | 36,645,759           | 9,580,637            |
| 分配应收款项                       | 26,065,429           | 6,434,887            |
| 保证金                          | 14,094,558           | 24,406,721           |
| 衍生性产品                        | 17,697,221           | 13,989,777           |
| 投资                           | 3,225,572,185        | 1,643,786,624        |
| 股息及其他应收款项                    | 5,279                | 3,500                |
| <b>总资产</b>                   | <b>3,359,874,316</b> | <b>1,723,684,932</b> |
| <b>负债</b>                    |                      |                      |
| <b>流动负债</b>                  |                      |                      |
| 应付经纪款项                       | 44,127,615           | 33,229,268           |
| 赎回应付款项                       | 15,619,863           | 10,439,786           |
| 应付收益分配 [附注 6]                | 4,587,628            | 4,437,588            |
| 衍生性产品                        | 33,891,864           | 12,594,213           |
| 其他应付款项                       | 3,006,094            | 1,925,480            |
| <b>总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)</b> | <b>101,233,064</b>   | <b>62,626,335</b>    |
| <b>可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]</b>  | <b>3,258,641,252</b> | <b>1,661,058,597</b> |

综合收益表

截至二零二五年三月三十一日止期间 (未经审计)

|   | 1.10.2024<br>至<br>31.3.2025<br>美元 | 1.10.2023<br>至<br>31.3.2024<br>美元 |
|---|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>收入</b>                                     |                                   |                                   |
| 投资及衍生性产品净 (亏损) / 收益 [附注 4]                    | (17,618,721)                      | 91,788,310                        |
| 股息收入  | 1,377,575                         | 1,866,027                         |
| 存款利息  | 524,865                           | 220,679                           |
| 汇兑净亏损   | (2,392,370)                       | (1,088,904)                       |
| 其他收入  | 92,487                            | 20,541                            |
|   | <b>(18,016,164)</b>               | <b>92,806,653</b>                 |
| <b>支出</b>                                     |                                   |                                   |
| 管理费用 [附注 5(a)]                                | 11,075,586                        | 6,572,661                         |
| 托管费用及银行费用 [附注 5(a), 5(b)]                     | 409,755                           | 144,659                           |
| 受托人费用 [附注 5(b)]                               | 307,424                           | 173,428                           |
| 交易成本 [附注 5(b)]                                | 111,376                           | 59,640                            |
| 基金注册登记机构费用 [附注 5(a)]                          | 69,796                            | 49,519                            |
| 核数师酬金   | 29,878                            | 53,056                            |
| 法律及专业费用                                       | 18,513                            | 14,062                            |
| 估值费用 [附注 5(a)]                                | 8,540                             | 8,540                             |
| 印刷及出版支出                                       | 4,142                             | 4,976                             |
| 其他经营费用  | 5,983                             | 5,522                             |
|   | <b>12,040,993</b>                 | <b>7,086,063</b>                  |
| <b>净经营 (亏损) / 利润</b>                          | <b>(30,057,157)</b>               | <b>85,720,590</b>                 |
| <b>财务成本</b>                                   |                                   |                                   |
| 收益分配 [附注 6]                                   | (28,117,360)                      | (30,749,848)                      |
| 利息支出 [附注 5(b)]                                | (85,445)                          | -                                 |
|   | <b>(28,202,805)</b>               | <b>(30,749,848)</b>               |
| <b>除税前 (亏损) / 利润</b>                          | <b>(58,259,962)</b>               | <b>54,970,742</b>                 |
| 税项  | (414,009)                         | (225,155)                         |
| <b>可赎回份额持有人应占净资产及总综合 (亏损) / 收益之 (减少) / 增加</b> | <b>(58,673,971)</b>               | <b>54,745,587</b>                 |

第二十八至三十五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

截至二零二五年三月三十一日止期间(未经审计)

|                                      | 1.10.2024<br>至<br>31.3.2025<br>美元 | 1.10.2023<br>至<br>31.3.2024<br>美元 |
|--------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 期初可赎回份额持有人应占净资产                      | 1,661,058,597                     | 1,384,301,568                     |
| 分配可赎回份额 [附注 3]                       | 2,147,542,259                     | 238,543,351                       |
| 赎回可赎回份额 [附注 3]                       | (491,285,633)                     | (295,192,035)                     |
| <b>净分配 / (赎回)</b>                    | <b>1,656,256,626</b>              | <b>(56,648,684)</b>               |
|                                      | 3,317,315,223                     | 1,327,652,884                     |
| 可赎回份额持有人应占净资产及总综合(亏损) / 收益之(减少) / 增加 | (58,673,971)                      | 54,745,587                        |
| 期末可赎回份额持有人应占净资产                      | 3,258,641,252                     | 1,382,398,471                     |

现金流量表

截至二零二五年三月三十一日止期间(未经审计)

|                             | 1.10.2024<br>至<br>31.3.2025<br>美元 | 1.10.2023<br>至<br>31.3.2024<br>美元 |
|-----------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>经营业务</b>                 |                                   |                                   |
| 购入投资及衍生性产品                  | (4,415,576,824)                   | (1,635,438,258)                   |
| 出售投资及衍生性产品所得款项              | 2,817,595,974                     | 1,741,909,825                     |
| 保证金之减少 / (增加)               | 10,312,163                        | (3,477,746)                       |
| 已收股息                        | 1,377,575                         | 1,866,027                         |
| 已收利息                        | 524,865                           | 220,679                           |
| 已付交易成本                      | (115,840)                         | (62,365)                          |
| 已付基金注册登记机构费用                | (132,470)                         | (102,244)                         |
| 已付受托人费用                     | (273,474)                         | (175,985)                         |
| 已付税项                        | (414,009)                         | (225,155)                         |
| 现金抵押品之增加                    | (1,534,802)                       | (909,971)                         |
| 已付管理费用                      | (9,904,831)                       | (6,671,761)                       |
| 其他                          | (2,446,350)                       | (1,427,602)                       |
| <b>经营业务所(运用) / 产生之现金净额</b>  | <b>(1,600,588,023)</b>            | <b>95,505,444</b>                 |
| <b>融资活动</b>                 |                                   |                                   |
| 已付利息                        | (85,445)                          | -                                 |
| 分配可赎回份额所得款项                 | 2,127,911,717                     | 229,224,099                       |
| 赎回可赎回份额付款                   | (486,105,556)                     | (292,859,135)                     |
| 已付收益分配                      | (27,967,320)                      | (31,611,078)                      |
| <b>融资活动所产生 / (运用) 之现金净额</b> | <b>1,613,753,396</b>              | <b>(95,246,114)</b>               |
| <b>现金及现金等价物之增加</b>          | <b>13,165,373</b>                 | <b>259,330</b>                    |
| 期初现金及现金等价物                  | 24,866,024                        | 24,735,540                        |
| 现金及现金等价物之汇兑(亏损) / 收益        | (389,076)                         | 87,407                            |
| <b>期末现金及现金等价物</b>           | <b>37,642,321</b>                 | <b>25,082,277</b>                 |
| <b>现金及现金等价物余额分析:</b>        |                                   |                                   |
| 银行现金                        | 37,642,321                        | 25,082,277                        |

第二十八至三十五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

(a) 中期财务报表之会计政策

编制本末经审计简明中期财务报表所使用的会计政策和计算方法与截至二零二四年九月三十日止年度财务报表所采纳的会计政策和计算方法一致。

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公允价值为负数的衍生性产品合约列示为按公允价值透过损益列账的负债。

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。

确认、取消确认及计量

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

公允价值估计

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

债务证券的公允价值按包括应计利息的报价计算。

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

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

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

结构性主体

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

(c) 外币交易

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。

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

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

(d) 分配份额所得款项及赎回份额支付款项

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

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

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

1.10.2024 至 31.3.2025

|          | 澳元对冲类别<br>(每月派息)<br>份额 | 加元对冲类别<br>(每月派息)<br>份额  | 英镑对冲类别<br>(每月派息)<br>份额    | 港元类别<br>(股息月派)<br>份额      | 港元类别<br>(每月派息)<br>份额        |
|----------|------------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------------|-----------------------------|
| 已发行份额数目: |                        |                         |                           |                           |                             |
| 期初       | 13,441,867.382         | 11,017,832.492          | 1,294,601.382             | -                         | 224,284,339.491             |
| 总分配      | 2,330,744.523          | 391,882.324             | 455,098.896               | 294,339.690               | 22,786,383.736              |
| 总赎回      | (2,154,365.508)        | (686,714.726)           | (230,753.131)             | -                         | (38,549,118.780)            |
| 期末       | 13,618,246.397         | 10,723,000.090          | 1,518,947.147             | 294,339.690               | 208,521,604.447             |
|          | 纽元对冲类别<br>(每月派息)<br>份额 | PRC 人民币份额<br>(累计)<br>份额 | PRC 人民币份额<br>(每月派息)<br>份额 | PRC 人民币对冲份额<br>(累计)<br>份额 | PRC 人民币对冲份额<br>(每月派息)<br>份额 |
| 已发行份额数目: |                        |                         |                           |                           |                             |
| 期初       | 6,898,060.544          | -                       | -                         | 281,981,370.720           | 130,298,367.030             |
| 总分配      | 1,674,570.871          | 1,155,895,419.470       | 29,156,750.760            | 95,926,952.280            | 16,391,814.120              |
| 总赎回      | (1,288,013.612)        | (76,589,241.030)        | (25,819.490)              | (94,724,141.770)          | (32,217,648.820)            |
| 期末       | 7,284,617.803          | 1,079,306,178.440       | 29,130,931.270            | 283,184,181.230           | 114,472,532.330             |

1.10.2024 至 31.3.2025

|            | PRC 美元份额<br>(累计)<br>份额           | PRC 美元份额<br>(每月派息)<br>份额          | 人民币对冲类别<br>(累计)<br>份额          | 人民币对冲类别<br>(每月派息)<br>份额           | 美元类别<br>(累计)<br>份额           |
|------------|----------------------------------|-----------------------------------|--------------------------------|-----------------------------------|------------------------------|
| 已发行份额数目:   |                                  |                                   |                                |                                   |                              |
| 期初         | 8,855,711.320                    | 5,990,036.480                     | 2,386,652.658                  | 243,997,365.988                   | 976,461.685                  |
| 总分配<br>总赎回 | 1,605,533.570<br>(1,483,073.490) | 2,879,728.500<br>(828,072.810)    | 387,866.718<br>(1,683,171.934) | 6,919,230.173<br>(34,434,242.727) | 207,114.462<br>(150,437.650) |
| 期末         | 8,978,171.400                    | 8,041,692.170                     | 1,091,347.442                  | 216,482,353.434                   | 1,033,138.497                |
|            | 美元类别<br>(股息月派)<br>份额             | 美元类别<br>(每月派息)<br>份额              | 美元 X 类别<br>(累计)<br>份额          |                                   |                              |
| 已发行份额数目:   |                                  |                                   |                                |                                   |                              |
| 期初         | -                                | 35,278,106.631                    | -                              |                                   |                              |
| 总分配<br>总赎回 | 100.398<br>-                     | 3,713,136.306<br>(10,573,687.520) | 18,947,592.203<br>-            |                                   |                              |
| 期末         | 100.398                          | 28,417,555.417                    | 18,947,592.203                 |                                   |                              |

1.10.2023 至 31.3.2024

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

1.10.2023 至 31.3.2024

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

31.3.2025

|                        | 澳元对冲类别<br>(每月派息)<br>澳元 | 加元对冲类别<br>(每月派息)<br>加元   | 英镑对冲类别<br>(每月派息)<br>英镑     | 港元类别<br>(资息月派)<br>港元       | 港元类别<br>(每月派息)<br>港元         |
|------------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------|----------------------------|------------------------------|
| 可赎回份额持有人应占净资产          | 84,488,903             | 67,509,152               | 9,975,075                  | 2,941,520                  | 1,401,804,776                |
| 可赎回份额持有人应占净资产<br>(每份额) | 6.20                   | 6.30                     | 6.57                       | 9.99                       | 6.72                         |
|                        | 纽元对冲类别<br>(每月派息)<br>纽元 | PRC 人民币份额<br>(累计)<br>人民币 | PRC 人民币份额<br>(每月派息)<br>人民币 | PRC 人民币对冲份额<br>(累计)<br>人民币 | PRC 人民币对冲份额<br>(每月派息)<br>人民币 |
| 可赎回份额持有人应占净资产          | 44,939,599             | 11,141,858,082           | 292,736,431                | 3,480,205,809              | 797,270,981                  |
| 可赎回份额持有人应占净资产<br>(每份额) | 6.17                   | 10.32                    | 10.05                      | 12.29                      | 6.96                         |
|                        | PRC 美元份额<br>(累计)<br>美元 | PRC 美元份额<br>(每月派息)<br>美元 | 人民币对冲类别<br>(累计)<br>人民币     | 人民币对冲类别<br>(每月派息)<br>人民币   | 美元类别<br>(累计)<br>美元           |
| 可赎回份额持有人应占净资产          | 102,225,140            | 56,446,388               | 13,988,788                 | 1,395,166,966              | 13,173,969                   |
| 可赎回份额持有人应占净资产<br>(每份额) | 11.39                  | 7.02                     | 12.82                      | 6.44                       | 12.75                        |

31.3.2025

|                        | 美元类别<br>(资息月派)<br>美元 | 美元类别<br>(每月派息)<br>美元 | 美元 X 类别<br>(累计)<br>美元 |
|------------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|
| 可赎回份额持有人应占净资产          | 1,005                | 218,997,061          | 192,983,312           |
| 可赎回份额持有人应占净资产<br>(每份额) | 10.01                | 7.71                 | 10.19                 |

30.9.2024

|                        | 澳元对冲类别<br>(每月派息)<br>澳元      | 加元对冲类别<br>(每月派息)<br>加元       | 英镑对冲类别<br>(每月派息)<br>英镑 | 港元类别<br>(每月派息)<br>港元     | 纽元对冲类别<br>(每月派息)<br>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<br>(每份额) | 6.41                        | 6.50                         | 6.79                   | 6.94                     | 6.37                   |
|                        | PRC 人民币对冲<br>份额 (累计)<br>人民币 | PRC 人民币对冲份额<br>(每月派息)<br>人民币 | PRC 美元份额<br>(累计)<br>美元 | PRC 美元份额<br>(每月派息)<br>美元 | 人民币对冲类别<br>(累计)<br>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<br>(每份额) | 12.40                       | 7.20                         | 11.38                  | 7.26                     | 12.96                  |
|                        | 人民币对冲类别<br>(每月派息)<br>人民币    | 美元类别<br>(累计)<br>美元           | 美元类别<br>(每月派息)<br>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<br>(每份额) | 6.66                        | 12.74                        | 7.97                   |                          |                        |

4 投资及衍生性产品净（亏损）／收益

|                       | 1.10.2024<br>至<br>31.3.2025<br>美元 | 1.10.2023<br>至<br>31.3.2024<br>美元 |
|-----------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 投资及衍生性产品价值未实现收益／亏损之变动 | (28,110,106)                      | 94,073,705                        |
| 投资及衍生性产品销售之实现收益／（亏损）  | 10,491,385                        | (2,285,395)                       |
|                       | <u>(17,618,721)</u>               | <u>91,788,310</u>                 |

5 与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之交易

(a) 截至二零二五年及二零二四年三月三十一日止期间，已付管理人摩根基金（亚洲）有限公司及其关联人士支付的金额列示如下：

|            | 1.10.2024<br>至<br>31.3.2025<br>美元 | 1.10.2023<br>至<br>31.3.2024<br>美元 |
|------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 管理费用       | 11,075,586                        | 6,572,661                         |
| 基金注册登记机构费用 | 69,796                            | 49,519                            |
| 托管费用及银行费用  | 11,384                            | 11,100                            |
| 估值费用       | 8,540                             | 8,540                             |

(b) 截至二零二五年及二零二四年三月三十一日止期间，已付受托人汇丰机构信托服务（亚洲）有限公司及其关联人士的金额列示如下：

|           | 1.10.2024<br>至<br>31.3.2025<br>美元 | 1.10.2023<br>至<br>31.3.2024<br>美元 |
|-----------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 托管费用及银行费用 | 314,667                           | 112,802                           |
| 受托人费用     | 307,424                           | 173,428                           |
| 利息支出      | 85,445                            | -                                 |
| 交易成本      | 21,101                            | 11,795                            |

6 收益分配

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

| 收益分配类别                       | 除息日         | 支付日        | 比率         | 份额              | 美元          |
|------------------------------|-------------|------------|------------|-----------------|-------------|
| <u>1.10.2024 至 31.3.2025</u> |             |            |            |                 |             |
| 澳元对冲类别（每月派息）                 | 2024年10月31日 | 2024年11月8日 | 澳元 0.0325  | 14,615,901.841  | (311,136)   |
| 加元对冲类别（每月派息）                 | 2024年10月31日 | 2024年11月8日 | 加元 0.0306  | 11,121,926.884  | (244,148)   |
| 英镑对冲类别（每月派息）                 | 2024年10月31日 | 2024年11月8日 | 英镑 0.0377  | 1,497,359.694   | (72,575)    |
| 港元类别（每月派息）                   | 2024年10月31日 | 2024年11月8日 | 港元 0.0384  | 226,728,205.111 | (1,119,876) |
| 纽元对冲类别（每月派息）                 | 2024年10月31日 | 2024年11月8日 | 纽元 0.0343  | 7,297,048.975   | (148,959)   |
| PRC 人民币对冲份额（每月派息）            | 2024年10月31日 | 2024年11月8日 | 人民币 0.0218 | 126,467,775.330 | (386,792)   |
| PRC 美元份额（每月派息）               | 2024年10月31日 | 2024年11月8日 | 美元 0.0401  | 5,893,982.280   | (236,349)   |
| 人民币对冲类别（每月派息）                | 2024年10月31日 | 2024年11月8日 | 人民币 0.0201 | 243,705,600.797 | (687,231)   |
| 美元类别（每月派息）                   | 2024年10月31日 | 2024年11月8日 | 美元 0.0440  | 31,421,477.695  | (1,382,543) |
| 澳元对冲类别（每月派息）                 | 2024年11月29日 | 2024年12月9日 | 澳元 0.0336  | 14,494,683.137  | (317,270)   |
| 加元对冲类别（每月派息）                 | 2024年11月29日 | 2024年12月9日 | 加元 0.0300  | 11,023,559.983  | (236,194)   |
| 英镑对冲类别（每月派息）                 | 2024年11月29日 | 2024年12月9日 | 英镑 0.0378  | 1,551,423.062   | (74,539)    |

| 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11月29日 | 2024年12月9日 | 港元 0.0384  | 224,018,096.383 | (1,105,473) |
| 纽元对冲类别 (每月派息)      | 2024年11月29日 | 2024年12月9日 | 纽元 0.0338  | 7,340,121.519   | (146,761)   |
| PRC 人民币份额 (每月派息)   | 2024年11月29日 | 2024年12月9日 | 人民币 0.0573 | 712.460         | (6)         |
| PRC 人民币对冲份额 (每月派息) | 2024年11月29日 | 2024年12月9日 | 人民币 0.0283 | 122,300,568.330 | (477,354)   |
| PRC 美元份额 (每月派息)    | 2024年11月29日 | 2024年12月9日 | 美元 0.0401  | 5,699,065.720   | (228,533)   |
| 人民币对冲类别 (每月派息)     | 2024年11月29日 | 2024年12月9日 | 人民币 0.0261 | 238,721,418.784 | (859,326)   |
| 美元类别 (每月派息)        | 2024年11月29日 | 2024年12月9日 | 美元 0.0440  | 30,940,410.823  | (1,361,376) |
| 澳元对冲类别 (每月派息)      | 2024年12月31日 | 2025年1月9日  | 澳元 0.0340  | 14,451,278.779  | (304,215)   |
| 加元对冲类别 (每月派息)      | 2024年12月31日 | 2025年1月9日  | 加元 0.0282  | 10,835,353.688  | (212,458)   |
| 英镑对冲类别 (每月派息)      | 2024年12月31日 | 2025年1月9日  | 英镑 0.0380  | 1,511,723.972   | (71,945)    |
| 港元类别 (每月派息)        | 2024年12月31日 | 2025年1月9日  | 港元 0.0383  | 218,058,565.877 | (1,075,141) |
| 纽元对冲类别 (每月派息)      | 2024年12月31日 | 2025年1月9日  | 纽元 0.0329  | 7,062,494.209   | (130,177)   |
| PRC 人民币份额 (每月派息)   | 2024年12月31日 | 2025年1月9日  | 人民币 0.0575 | 284,231.730     | (2,226)     |
| PRC 人民币对冲份额 (每月派息) | 2024年12月31日 | 2025年1月9日  | 人民币 0.0298 | 117,002,087.400 | (474,925)   |
| PRC 美元份额 (每月派息)    | 2024年12月31日 | 2025年1月9日  | 美元 0.0401  | 5,506,446.590   | (220,809)   |
| 人民币对冲类别 (每月派息)     | 2024年12月31日 | 2025年1月9日  | 人民币 0.0275 | 234,376,880.198 | (877,936)   |
| 美元类别 (每月派息)        | 2024年12月31日 | 2025年1月9日  | 美元 0.0440  | 30,147,817.132  | (1,326,502) |
| 澳元对冲类别 (每月派息)      | 2025年1月28日  | 2025年2月10日 | 澳元 0.0353  | 13,839,408.236  | (305,063)   |
| 加元对冲类别 (每月派息)      | 2025年1月28日  | 2025年2月10日 | 加元 0.0286  | 10,743,330.167  | (213,478)   |
| 英镑对冲类别 (每月派息)      | 2025年1月28日  | 2025年2月10日 | 英镑 0.0392  | 1,492,257.171   | (72,729)    |
| 港元类别 (每月派息)        | 2025年1月28日  | 2025年2月10日 | 港元 0.0384  | 211,515,262.222 | (1,042,549) |
| 纽元对冲类别 (每月派息)      | 2025年1月28日  | 2025年2月11日 | 纽元 0.0341  | 7,014,797.346   | (135,354)   |
| PRC 人民币份额 (每月派息)   | 2025年1月27日  | 2025年2月10日 | 人民币 0.0578 | 1,365,462.650   | (10,889)    |
| PRC 人民币对冲份额 (每月派息) | 2025年1月27日  | 2025年2月10日 | 人民币 0.0340 | 117,021,612.120 | (548,954)   |
| PRC 美元份额 (每月派息)    | 2025年1月27日  | 2025年2月10日 | 美元 0.0401  | 5,806,663.680   | (232,847)   |
| 人民币对冲类别 (每月派息)     | 2025年1月28日  | 2025年2月10日 | 人民币 0.0315 | 225,171,810.554 | (974,455)   |
| 美元类别 (每月派息)        | 2025年1月28日  | 2025年2月10日 | 美元 0.0440  | 29,158,479.942  | (1,282,971) |
| 澳元对冲类别 (每月派息)      | 2025年2月28日  | 2025年3月10日 | 澳元 0.0347  | 13,653,221.075  | (294,612)   |
| 加元对冲类别 (每月派息)      | 2025年2月28日  | 2025年3月10日 | 加元 0.0285  | 10,721,353.750  | (212,112)   |
| 英镑对冲类别 (每月派息)      | 2025年2月28日  | 2025年3月10日 | 英镑 0.0382  | 1,453,902.628   | (69,932)    |
| 港元类别 (每月派息)        | 2025年2月28日  | 2025年3月10日 | 港元 0.0706  | 775.663         | (7)         |
| 港元类别 (每月派息)        | 2025年2月28日  | 2025年3月10日 | 港元 0.0383  | 207,129,538.861 | (1,020,132) |
| 纽元对冲类别 (每月派息)      | 2025年2月28日  | 2025年3月10日 | 纽元 0.0331  | 7,156,723.544   | (132,740)   |
| PRC 人民币份额 (每月派息)   | 2025年2月28日  | 2025年3月10日 | 人民币 0.0575 | 9,551,871.710   | (75,314)    |
| PRC 人民币对冲份额 (每月派息) | 2025年2月28日  | 2025年3月10日 | 人民币 0.0292 | 116,214,708.500 | (465,334)   |
| PRC 美元份额 (每月派息)    | 2025年2月28日  | 2025年3月10日 | 美元 0.0400  | 6,639,783.900   | (265,591)   |
| 人民币对冲类别 (每月派息)     | 2025年2月28日  | 2025年3月10日 | 人民币 0.0270 | 220,852,441.390 | (817,686)   |
| 美元类别 (每月派息)        | 2025年2月28日  | 2025年3月10日 | 美元 0.0707  | 99.701          | (7)         |
| 美元类别 (每月派息)        | 2025年2月28日  | 2025年3月10日 | 美元 0.0440  | 28,731,892.413  | (1,264,201) |
| 澳元对冲类别 (每月派息)      | 2025年3月31日  | 2025年4月9日  | 澳元 0.0339  | 13,618,006.571  | (287,677)   |
| 加元对冲类别 (每月派息)      | 2025年3月31日  | 2025年4月9日  | 加元 0.0271  | 10,722,844.471  | (201,903)   |
| 英镑对冲类别 (每月派息)      | 2025年3月31日  | 2025年4月9日  | 英镑 0.0380  | 1,518,947.147   | (74,502)    |
| 港元类别 (每月派息)        | 2025年3月31日  | 2025年4月9日  | 港元 0.0706  | 294,339.690     | (2,671)     |
| 港元类别 (每月派息)        | 2025年3月31日  | 2025年4月9日  | 港元 0.0383  | 207,666,514.460 | (1,022,278) |
| 纽元对冲类别 (每月派息)      | 2025年3月31日  | 2025年4月9日  | 纽元 0.0317  | 7,222,540.548   | (129,668)   |
| PRC 人民币份额 (每月派息)   | 2025年3月31日  | 2025年4月9日  | 人民币 0.0574 | 28,060,836.570  | (221,678)   |
| PRC 人民币对冲份额 (每月派息) | 2025年3月31日  | 2025年4月9日  | 人民币 0.0245 | 114,281,731.770 | (385,348)   |
| PRC 美元份额 (每月派息)    | 2025年3月31日  | 2025年4月9日  | 美元 0.0401  | 7,960,786.420   | (319,228)   |
| 人民币对冲类别 (每月派息)     | 2025年3月31日  | 2025年4月9日  | 人民币 0.0227 | 216,895,418.959 | (677,621)   |
| 美元类别 (每月派息)        | 2025年3月31日  | 2025年4月9日  | 美元 0.0708  | 100.398         | (7)         |
| 美元类别 (每月派息)        | 2025年3月31日  | 2025年4月9日  | 美元 0.0440  | 28,751,102.829  | (1,265,047) |

可赎回份额持有人之总收益分配 (28,117,360)

1.10.2023 至 31.3.2024

|                    |             |            |            |                 |             |
|--------------------|-------------|------------|------------|-----------------|-------------|
| 澳元对冲类别 (每月派息)      | 2023年10月31日 | 2023年11月8日 | 澳元 0.0285  | 19,079,707.027  | (344,289)   |
| 加元对冲类别 (每月派息)      | 2023年10月31日 | 2023年11月8日 | 加元 0.0332  | 13,421,046.121  | (320,964)   |
| 英镑对冲类别 (每月派息)      | 2023年10月31日 | 2023年11月8日 | 英镑 0.0364  | 1,775,966.701   | (78,444)    |
| 港元类别 (每月派息)        | 2023年10月31日 | 2023年11月8日 | 港元 0.0386  | 286,193,667.797 | (1,411,839) |
| 纽元对冲类别 (每月派息)      | 2023年10月31日 | 2023年11月8日 | 纽元 0.0351  | 8,375,319.424   | (170,990)   |
| PRC 人民币对冲份额 (每月派息) | 2023年10月31日 | 2023年11月8日 | 人民币 0.0331 | 41,395,671.400  | (186,623)   |
| PRC 美元份额 (每月派息)    | 2023年10月31日 | 2023年11月8日 | 美元 0.0400  | 1,963,240.930   | (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) |

| 收益分配类别             | 除息日         | 支付日        | 比率         | 份额              | 美元           |
|--------------------|-------------|------------|------------|-----------------|--------------|
| 美元类别 (每月派息)        | 2023年10月31日 | 2023年11月8日 | 美元 0.0440  | 42,054,795.563  | (1,850,409)  |
| 澳元对冲类别 (每月派息)      | 2023年11月30日 | 2023年12月8日 | 澳元 0.0294  | 17,983,177.047  | (350,558)    |
| 加元对冲类别 (每月派息)      | 2023年11月30日 | 2023年12月8日 | 加元 0.0334  | 12,924,380.802  | (318,379)    |
| 英镑对冲类别 (每月派息)      | 2023年11月30日 | 2023年12月8日 | 英镑 0.0364  | 1,831,560.472   | (84,399)     |
| 港元类别 (每月派息)        | 2023年11月30日 | 2023年12月8日 | 港元 0.0384  | 274,078,481.908 | (1,347,530)  |
| 纽元对冲类别 (每月派息)      | 2023年11月30日 | 2023年12月8日 | 纽元 0.0348  | 8,012,008.442   | (172,212)    |
| PRC 人民币对冲份额 (每月派息) | 2023年11月30日 | 2023年12月8日 | 人民币 0.0265 | 41,103,943.090  | (152,535)    |
| PRC 美元份额 (每月派息)    | 2023年11月30日 | 2023年12月8日 | 美元 0.0401  | 1,940,841.620   | (77,828)     |
| 人民币对冲类别 (每月派息)     | 2023年11月30日 | 2023年12月8日 | 人民币 0.0244 | 286,400,645.833 | (978,599)    |
| 美元类别 (每月派息)        | 2023年11月30日 | 2023年12月8日 | 美元 0.0440  | 41,153,915.390  | (1,810,770)  |
| 澳元对冲类别 (每月派息)      | 2023年12月29日 | 2024年1月9日  | 澳元 0.0288  | 17,664,887.867  | (347,144)    |
| 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)  |
| 可赎回份额持有人的总收益分配     |             |            |            |                 | (30,749,848) |

**经营与管理**

**管理人及服务提供者**

摩根基金（亚洲）有限公司  
香港  
中环干诺道中 8 号  
遮打大厦 19 楼

**投资管理**

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

**管理人董事**

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  
中环德辅道中 1 号  
太子大厦 22 楼

