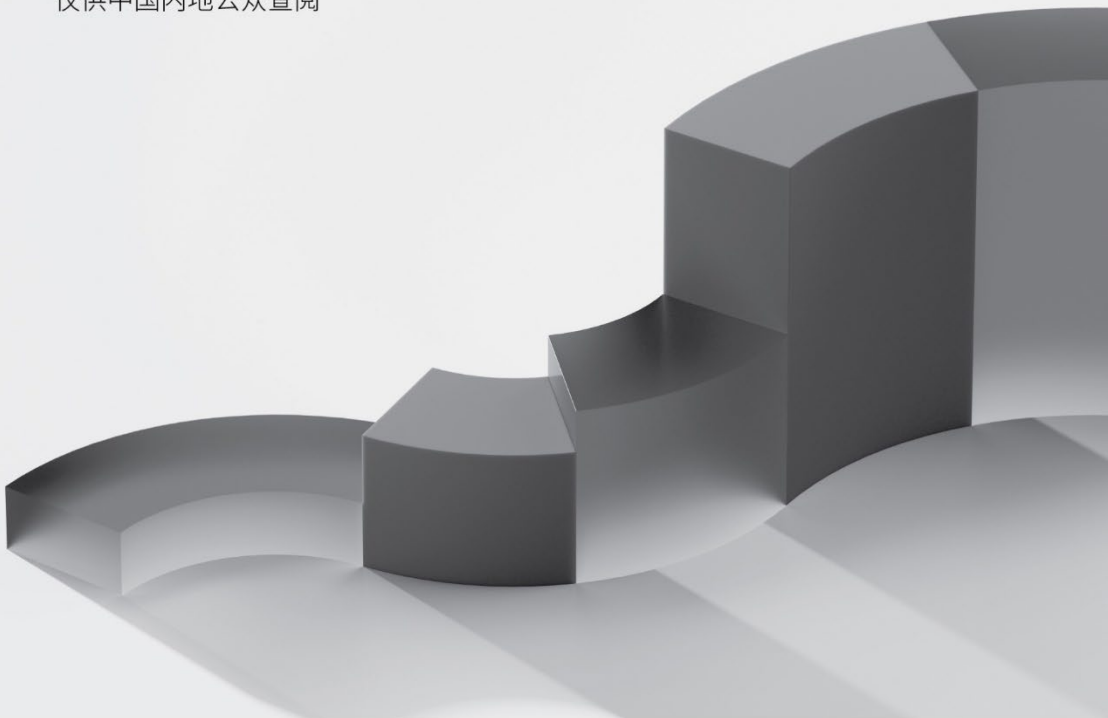


仅供中国内地公众查阅



半年度报告 — 2026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 - 13
投资组合持有变动表	14
金融衍生工具详情	15 - 27
抵押品持有情况	28
财务状况表	29
综合收益表	29
可赎回份额持有人应占净资产变动表	30
现金流量表	30
财务报表之附注	31 - 39
经营与管理	40

投资组合

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
<b>上市投资 (99.0%)</b>				Goldman Sachs Fin C Intl Ser RHM 0% Conv 13Jan2031	欧元 2,500,000	2,719,103	0.1
<b>(I) 可转换证券 (2.3%)</b>				Morgan Stanley Fin LLC Ser 2330 0% Conv 02Feb2029	美元 2,000,000	2,038,500	0.1
<b>澳大利亚(0.1%)</b>				<b>维京群岛(0.1%)</b> Happy Ever Holdings Ltd 0.5% Conv 16Jul2030	港元 14,000,000	1,788,927	0.1
New Hope Corp Ltd 4.25% Conv 12Jul2029	澳元 3,400,000	2,769,529	0.1			62,823,808	2.3
<b>中国内地(0.2%)</b>				<b>(II) 债券证券(89.9%)</b>			
Miniso Group Holding Ltd 0.5% Conv 14Jan2032	美元 4,000,000	3,738,278	0.1	<b>澳大利亚(3.6%)</b> AGI Finance Pty Ltd Ser MTN 4.832% 25Sep2031	澳元 4,270,000	2,792,639	0.1
Yankuang Group Cayman 3.5% Conv 03Oct2029	美元 1,000,000	1,302,556	0.0	AGL Energy Ltd Ser MTN 5.77% 30Sep2035	澳元 1,000,000	654,072	0.0
Zoomlion Heavy Industry 0.7% Conv 05Feb2031	离岸人民币 10,000,000	1,463,221	0.1	Airservices Australia 5.35% 15Nov2037	澳元 3,750,000	2,512,284	0.1
<b>法国(0.0%)</b>				Airservices Australia Ser MTN 5.45% 15May2035	澳元 1,560,000	1,067,921	0.0
Vinci SA 7% Conv 18Feb2030	欧元 1,100,000	1,351,191	0.0	Apa Infrastructure Ltd 5.75% 16Sep2044	美元 1,367,000	1,361,899	0.1
<b>香港特别行政区(1.0%)</b>				Ausgrid Finance Pty Ltd Ser MTN 5.946% 10Dec2035	澳元 4,140,000	2,821,125	0.1
Jinkai Investment Holding 0% Conv 05Feb2031	美元 5,900,000	5,467,825	0.2	Ausnet Services Holdings Ser MTN (Reg) 6.134% 31May2033	澳元 2,700,000	1,912,758	0.1
Link Cb Ltd (Reg) (Reg S) 4.5% Conv 12Dec2027	港元 158,000,000	20,533,335	0.8	Ausnet Services Holdings Ser MTN Var 04Feb2056	澳元 2,160,000	1,456,466	0.1
<b>意大利(0.1%)</b>				Ausnet Services Holdings Ser MTN Var 12Feb2055	澳元 4,960,000	3,390,526	0.1
Eni Spa Ser Eni (Reg) 2.95% Conv 14Sep2030	欧元 1,800,000	3,015,746	0.1	Aust & Nz Banking Group Ser Regs (Reg S) 2.57% 25Nov2035	美元 8,500,000	7,683,158	0.3
<b>日本(0.0%)</b>				Aust & NZ Banking Group Ser Regs Var 18Jun2036	美元 3,200,000	3,310,603	0.1
Taiyo Yuden Co Ltd (Reg) 0% Conv 18Oct2030	日元 100,000,000	701,647	0.0	Commonwealth Bank Aust Ser Regs (Reg S) 5.837% 13Mar2034	美元 6,000,000	6,207,356	0.2
<b>韩国(0.1%)</b>				Gaif Bond Issuer P/L Ser MTN 4.904% 13Nov2031	澳元 3,000,000	2,009,569	0.1
LG Chem Ltd (Reg) (Reg S) 1.6% Conv 18Jul2030	美元 2,800,000	2,769,880	0.1	Goodman US Finance Six Ser Regs (Reg) 5.125% 07Oct2034	美元 2,200,000	2,246,793	0.1
<b>澳门特别行政区(0.2%)</b>				Lonsdale Finance Pty Ltd Ser MTN 5.5% 19Nov2031	澳元 3,420,000	2,352,880	0.1
Wynn Macau Ltd Ser 144A 4.5% Conv 07Mar2029	美元 4,400,000	4,404,400	0.2				
<b>美国(0.5%)</b>							
Citigroup Global Markets Ser GMTN 0.8% Conv 05Feb2030	欧元 1,200,000	1,399,690	0.0				
Goldman Sachs Fin C Intl Ser 0% Conv 29Jan2029	美元 4,200,000	4,946,312	0.2				
Goldman Sachs Fin C Intl Ser 700H 0% Conv 07Mar2030	美元 2,400,000	2,413,668	0.1				

投资组合 (续)

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
<b>澳大利亚 (续)</b>				Toronto-Dominion Bank Ser EMTN 3.41% 16Jun2028	港元 5,000,000	657,429	0.0
Macquarie Bank Ltd Ser MTN FRN 29Nov2035	澳元 1,800,000	1,257,882	0.0				
Macquarie Bank Ltd Ser Regs (Reg S) Var 03Mar2036	美元 3,100,000	2,801,152	0.1	<b>智利 (0.3%)</b> Chile (Rep of) (Reg S) 4.7% 01Sep2030	智利比索 8,000,000,000	8,352,642	0.3
National Australia Bank FRN 14Jan2036	美元 19,396,000	20,178,820	0.8				
NBN Co Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.5% 08Jan2032	美元 392,000	353,385	0.0	<b>中国内地 (8.7%)</b> Alibaba Group Holding (Reg) 4% 06Dec2037	美元 12,500,000	11,513,192	0.4
New S Wales Treasury CRP 2% 08Mar2033	澳元 2,000,000	1,113,668	0.0	Alibaba Group Holding (Reg) 4.2% 06Dec2047	美元 6,000,000	5,045,991	0.2
Newcastle Coal Infrastru 4.7% 12May2031	美元 5,000,000	4,793,719	0.2	Alibaba Group Holding (Reg) 4.5% 28/11/2034	美元 3,000,000	2,984,092	0.1
Newcastle Coal Infrastructure Ser (Reg) (Reg S) 4.4% 9Sep2027	美元 1,877,000	1,795,707	0.1	Alibaba Group Holding 5.25% 26May2035	美元 3,300,000	3,451,877	0.1
NSW Electricity Networks Ser MTN Var 20Nov2055	澳元 1,420,000	955,225	0.0	Azure Orbit IV Intl Fin Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4% 25Jan2028	美元 1,800,000	1,797,271	0.1
Scentre Group Trst 1 Ser MTN 5.35% 18Sep2035	澳元 4,230,000	2,728,110	0.1	Baidu Inc 1.9% 15Mar2029	离岸人民币 10,000,000	1,441,798	0.1
SGSP Australia Assets Ser EMTN 3.375% 08Oct2032	欧元 3,274,000	3,725,811	0.1	Baoding Guokong GP 5.15% 18Jul2027	离岸人民币 7,890,000	1,157,540	0.0
Treasury Corp Victoria Ser MTN (Reg) 4.75% 15Sep2036	澳元 1,000,000	636,159	0.0	Central Plaza Dev Ltd 6.8% 07Apr2029	美元 3,600,000	3,686,938	0.1
Victoria Power Networks 4.714% 27Apr2032	澳元 8,300,000	5,484,501	0.2	Central Plaza Dev Ltd 7.15% 21Mar2028	美元 5,405,000	5,433,150	0.2
Westpac Banking Corp (Reg) Var 15Nov2035	美元 1,385,000	1,258,492	0.1	CFAMC IV Co Ltd Ser EMTN (Regs) 4.5% 29May2029 (formerly known as Huarong Finance 2019 Ser EMTN (Regs) 4.5% 29May2029)	美元 800,000	807,122	0.0
Westpac Banking Corp Ser MTN Var 04Jun2040	澳元 13,000,000	8,707,514	0.3	CFAMC IV Co Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.625% 30Sep2030 (formerly known as Huarong Finance 2019 Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.625% 30Sep2030)	美元 1,800,000	1,718,899	0.1
<b>比利时 (0.2%)</b> KBC Group Nv Var Perp 31Dec2049	欧元 4,600,000	5,424,740	0.2	China Cinda 2020 I Mngm Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3% 20Jan2031	美元 8,900,000	8,341,825	0.3
<b>巴西 (0.2%)</b> Acu Petroleo Luxembourg Ser Regs (Reg) (Reg S) 7.5% 13Jul2035	美元 2,000,000	1,743,261	0.1	China Cinda 2020 I Mngm Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.75% 28May2029	美元 7,010,000	7,389,556	0.3
Braskem Netherlands Ser Regs (Reg S) 8.5% 12Jan2031	美元 4,000,000	1,974,611	0.1	China Cinda 2020 I Mngm Ser EMTN Frn 13Nov2030	美元 9,901,000	10,034,027	0.4
Brazil (Rep of) 7.125% 13May2054	美元 1,000,000	1,011,753	0.0	China Cinda 2020 I Mngm Ser EMTN 2.35% 04Feb2029	离岸人民币 20,000,000	2,910,141	0.1
<b>加拿大 (0.1%)</b> Royal Bank of Canada Ser EMTN (Reg) 4.5% 01Feb2028	港元 2,000,000	264,838	0.0				
Royal Bank of Canada Ser EMTN (Reg) 5.17% 09Mar2028	港元 5,000,000	663,361	0.1				

投资组合 (续)

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比
<b>中国内地 (续)</b>				Joy TRSR Assets Hld Ser EMTN 4.3% 04Dec2028	美元 2,622,000	2,643,105	0.1
China Development Bk/HK Ser EMTN 1.73% 03Dec2028	离岸人民币 60,000,000	8,765,530	0.3	Joy TRSR Assets Holdings Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.75% 06Jun2029	美元 8,300,000	8,728,062	0.3
China Hongqiao Group Ltd 6.925% 29Nov2028	美元 5,855,000	6,214,537	0.2	Kuaishou Technology Ser Regs 4.75% 22Jan2036	美元 3,684,000	3,585,729	0.1
China Mengniu Dairy 2.3% 30Jul2035	离岸人民币 8,270,000	1,164,907	0.0	Longfor Holdings Ltd (Reg) (Reg S) 3.375% 13Apr2027	美元 2,940,000	2,771,122	0.1
China Resources Land Ltd Ser EMTN (Reg) 6.1% 28Oct2029	港元 10,000,000	1,413,140	0.0	Longfor Holdings Ltd (Reg) (Reg S) 3.95% 16Sep2029	美元 3,436,000	2,730,203	0.1
ENN Clean Energy Ser Regs (Reg S) 3.375% 12May2026	美元 7,100,000	7,176,595	0.3	Longfor Properties (Reg) (Reg S) 4.5% 16Jan2028	美元 1,900,000	1,711,134	0.1
Far East Horizon Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4.25% 26Oct2026	美元 6,456,000	6,538,095	0.2	Meituan 4.75% 05Nov2032	美元 3,928,000	3,897,673	0.1
Far East Horizon Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.875% 05Mar2028	美元 1,400,000	1,406,516	0.1	Meituan Ser 3.1% 05Nov2035	离岸人民币 53,570,000	7,592,944	0.3
Far East Horizon Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 6.625% 16Apr2027	美元 4,102,000	4,260,087	0.2	Meituan Ser Regs 4.625% 02Oct2029	美元 4,259,000	4,333,691	0.2
Far East Horizon Ltd Ser EMTN 4.25% 14Feb2028	离岸人民币 2,000,000	291,315	0.0	Ningguo Ningyang Holdings 6.5% 20Nov2027	离岸人民币 9,800,000	1,452,438	0.1
Far East Horizon Ltd Ser EMTN 6.0% 01Oct2028	美元 3,300,000	3,408,583	0.1	Prosus NV Ser Regs (Reg S) 4.987% 19Jan2052	美元 2,000,000	1,545,153	0.1
Fortune Star Bvi Ltd (Reg) (Reg S) 3.95% 02Oct2026	欧元 2,073,000	2,420,068	0.1	Prosus NV Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.832% 08Feb2051	美元 7,200,000	4,689,878	0.2
Fortune Star Bvi Ltd (Reg) (Reg S) 5.05% 27Jan2027	美元 13,827,000	13,558,665	0.5	Seazen Group Ltd 11.88% 26Jun2028	美元 1,000,000	989,095	0.0
Fortune Star Bvi Ltd 8.5% 19May2028	美元 3,000,000	3,093,440	0.1	Tangshan Intl Investment Hk 5.5% 20Sep2026	离岸人民币 11,000,000	1,594,081	0.1
Franshion Brilliant Ltd (Reg) (Reg S) 3.2% 09Apr2026	美元 5,600,000	5,680,442	0.2	Tencent Holdings Ltd Ser GMTN 2.1% 23Sep2030	离岸人民币 15,000,000	2,174,836	0.1
Greentown China Hldgs 8.45% 24Feb2028	美元 2,800,000	2,848,491	0.1	Tencent Holdings Ltd Ser Regs (Reg S) 3.24% 03Jun2050	美元 8,000,000	5,711,397	0.2
Hebei Shunde Inv 8.2% 30Sep2027	美元 2,700,000	2,751,173	0.1	Tencent Holdings Ltd Ser Regs (Reg S) 3.84% 22Apr2051	美元 3,500,000	2,772,024	0.1
Hebei Shunde Inv 8.5% 21Jun2027	美元 600,000	625,440	0.0	Tencent Holdings Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.68% 22Apr2041	美元 6,000,000	5,232,409	0.2
Hong Kong JY Flower 8.5% 20Aug2026	美元 1,500,000	1,517,711	0.1	Tencent Music Ent Grp (Reg) 2% 03Sep2030	美元 1,700,000	1,539,463	0.1
Huantaihu Intl Inv Co Lt 5.8% 09Feb2029	美元 3,000,000	3,017,626	0.1	UETD Con&Dev Cap Invest 7.5% 28Aug2027	美元 2,400,000	2,472,084	0.1
Jiangsu Hanjian Gr 3.4% 28Jul2028	离岸人民币 18,000,000	2,631,884	0.1	Weibo Corp (Reg) 3.375% 08Jul2030	美元 13,469,000	12,788,990	0.5
Joy Delight Intl Ltd 4.1% 12Jul2027	离岸人民币 5,000,000	733,018	0.0	WH Optics Valley Indus I 3.2% 28Jul2028	离岸人民币 8,000,000	1,165,517	0.0
Joy Delight Intl Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4% 15Nov2026	离岸人民币 5,000,000	735,661	0.0	Xiaomi Best Time Intl Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.1% 14Jul2051	美元 2,400,000	1,867,118	0.1

投资组合 (续)

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
<b>中国内地 (续)</b>				Airport Authority HK (Reg) (Reg S) Var Perp			
Xuchang City Investment 9.5% 29Jun2026	美元 3,000,000	3,098,831	0.1	2.1%	美元 2,000,000	2,006,433	0.1
Zhongsheng Group (Reg) (Reg S) 5.98% 30Jan2028	美元 1,000,000	964,527	0.0	Airport Authority HK Ser Regs 4.875% 15Jul2030	美元 6,657,000	6,938,954	0.3
<b>哥伦比亚(0.5%)</b>				Bank of East Asia Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 22Apr2032	美元 2,400,000	2,442,764	0.1
Colombia				Bank of East Asia Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 27Jun2034	美元 3,261,000	3,443,130	0.1
Telecomunicacio Ser Regs (Regs) 4.95% 17Jul2030	美元 6,200,000	5,688,717	0.2	CAS Capital No2 Ltd Var Perp (Reg) (Reg S) 31Dec2049	美元 8,212,000	8,204,834	0.3
Ecopetrol SA (Reg) 8.625% 19Jan2029	美元 2,800,000	3,009,538	0.1	Champion MTN Ltd Ser EMTN (Reg S) (Br) 3.73% 06Apr2028	港元 31,000,000	3,925,822	0.1
Republic of Colombia 8.375% 07Nov2054	美元 4,000,000	4,275,880	0.2	CLP Power Hong Kong Ltd Var Perp 31Dec2049	美元 2,400,000	2,541,677	0.1
<b>丹麦(0.1%)</b>				Dah Sing Bank Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 02Nov2031	美元 2,800,000	2,804,587	0.1
Danske Bank A/S (Reg S) (Br) Var Perp 31Dec2049	美元 3,200,000	3,247,396	0.1	Dah Sing Bank Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 15Nov2033	美元 3,500,000	3,781,736	0.1
<b>埃及(0.1%)</b>				FWD Group Holdings (Reg) (Reg S) 5.836% 22Sep2035	美元 7,493,000	7,457,444	0.3
Arab Republic of Egypt Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.875% 16Feb2031	美元 3,000,000	2,789,793	0.1	FWD Group Holdings Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 7.635% 02Jul2031	美元 7,900,000	8,762,788	0.3
<b>法国(0.3%)</b>				HK Govt Infra Bond Prog 1.59% 28Jul2028	离岸人民币 20,000,000	2,910,253	0.1
Credit Agricole SA Ser MTN Var 13Feb2041	澳元 4,200,000	2,814,231	0.1	HKCG Finance Ltd Ser EMTN 3.6% 25Oct2029	港元 10,000,000	1,317,873	0.0
Total Se Ser EMTN (Reg S) 3.088% 14Sep2026	港元 40,000,000	5,193,826	0.2	Hong Kong (Govt of) Ser GMTN (Reg) (Reg S) 2.95% 07Jun2028	离岸人民币 20,000,000	3,016,014	0.1
<b>德国(0.1%)</b>				Hong Kong Mortgage Corp Ser EMTN 2% 26Nov2028	离岸人民币 35,410,000	5,202,262	0.2
Vonovia Se Ser MTN 5.266% 03Sep2032	澳元 2,000,000	1,311,802	0.1	Hongkong Electric Fin Ser EMTN 4.75% 03Feb2036	美元 2,000,000	1,999,295	0.1
<b>香港特别行政区(6.0%)</b>				Hongkong Land Finance Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.25% 14Jul2033	美元 1,510,000	1,572,806	0.1
AIA Group Ltd Ser EMTN 3.58% 11Jun2035	新加坡元 6,250,000	5,097,010	0.2	Li & Fung Ltd 8.375% 05Feb2029	美元 3,601,000	3,674,721	0.1
AIA Group Ltd Ser GMTN (Reg) (Reg S) Var 09Sep2033	欧元 1,700,000	1,851,281	0.1	Link Finance Cayman 2009 Ser EMTN 4.875% 02Feb2036	美元 4,243,000	4,216,436	0.1
AIA Group Ltd Ser GMTN (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 3,000,000	3,037,227	0.1				
AIA Group Ltd Ser GMTN (Reg) (Reg S) Var Perp 5.1% 31Dec2049	新加坡元 3,750,000	3,075,266	0.1				
AIA Group Ltd Ser Regs (Reg S) 5.4% 30Sep2054	美元 16,214,000	15,286,845	0.6				
AIA Group Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.2% 16Sep2040	美元 3,000,000	2,311,183	0.1				
AIA Group Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.375% 05Apr2034	美元 3,000,000	3,147,233	0.1				

投资组合 (续)

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
<b>香港特别行政区 (续)</b>				Delhi International Airport Limited Ser Regs (Reg) 6.125% 31Oct2026	美元 5,500,000	5,651,980	0.2
Melco Resorts Finance Ser Regs (Reg) 5.75% 21Jul2028	美元 2,400,000	2,377,394	0.1	Delhi Intl Airport Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.45% 04Jun2029	美元 1,650,000	1,730,336	0.1
MTR Corp Ci Ltd Ser EMTN Var Perp 31Dec2049	美元 4,459,000	4,673,097	0.2	Greenko Power II Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.3% 13Dec2028	美元 15,975,000	11,583,575	0.4
MTR Corp Ltd Ser MTN 5.582% 29Jan2038	澳元 3,800,000	2,562,449	0.1	Greenko Wind Projects Mu Ser Regs 7.25% 27Sep2028	美元 13,723,000	13,441,536	0.5
Nanyang Commercial Bank (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 2,950,000	3,080,083	0.1	HDFC Bank Ltd Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 30,900,000	30,618,433	1.1
Nanyang Commercial Bank (Reg) (Reg S) Var 06Aug2034	美元 8,400,000	8,700,686	0.3	Hindustan Petroleum Corp (Reg) (Reg S) 4% 12Jul2027	美元 3,300,000	3,302,255	0.1
Prudential Funding (Asia) Plc (Reg) (Reg S) Var 03Nov2033	美元 13,966,000	13,492,039	0.5	IIFL Finance Ltd 8.75% 24Jul2028	美元 1,400,000	1,441,294	0.1
Sun Hung Kai Prop (Cap) 2.68% 29Jun2027	港元 13,000,000	1,654,425	0.1	India Clean Energy Hldg Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.5% 18Apr2027	美元 20,400,000	20,188,532	0.7
Sun Hung Kai Prop (Cap) Ser EMTN (Reg S) (Br) 1.89% 06Nov2027	港元 15,000,000	1,885,976	0.1	India Cleantech Energy 4.7% 10Aug2026	美元 10,399,000	7,704,675	0.3
Sun Hung Kai Prop (Cap) Ser EMTN (Reg S) 2.7% 24Aug2027	港元 5,000,000	637,506	0.0	India Green Power Hold Ser Regs (Reg) (Reg S) 4% 22Feb2027	美元 22,554,000	17,719,726	0.7
Sun Hung Kai Prop (Cap) Ser EMTN (Reg) 3.2% 14Aug2027	离岸人民币 2,000,000	294,931	0.0	IRB Infrastructure Deve Ser Regs (Reg S) 7.11% 11Mar2032	美元 18,639,000	18,797,044	0.7
Swire Propert MTN Fin Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.1% 03Sep2027	离岸人民币 30,000,000	4,417,052	0.2	JSW Hydro Energy Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.125% 18May2031	美元 7,500,000	4,854,272	0.2
<b>印度(13.7%)</b>				JSW Infrastructure Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.95% 21Jan2029	美元 6,870,000	6,762,788	0.2
Adani Ports And Special Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.828% 02Feb2032	美元 4,700,000	4,186,423	0.2	JSW Steel Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.95% 05Apr2027	美元 5,100,000	5,105,322	0.2
Adani Ports and Special Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.375% 03Jul2029	美元 3,000,000	2,909,813	0.1	JSW Steel Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.05% 05Apr2032	美元 9,450,000	9,292,116	0.3
Axis Bank Gift City Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 18,900,000	18,727,031	0.7	Manappuram Finance Ltd Ser EMTN (Reg S) 7.375% 12May2028	美元 700,000	724,390	0.0
Biocon Biologics Global Ser Regs 6.67% 09Oct2029	美元 2,245,000	2,292,574	0.1	Muthoot Finance Ltd Ser Regs (Reg S) 7.125% 14Feb2028	美元 771,000	783,098	0.0
Clean Renewable Power Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.25% 25Mar2027	美元 16,696,000	11,995,237	0.4	Muthoot Finance Ltd Ser Regs 5.75% 04Aug2030	美元 8,270,000	8,017,708	0.3
Continuum Energy Aura Ser Regs (Reg S) 9.5% 24Feb2027	美元 17,939,000	18,222,699	0.7	Muthoot Finance Ltd Ser Regs 6.375% 02Mar2030	美元 8,750,000	8,693,309	0.3
Continuum Grn Spv Co-Iss Ser Regs (Reg) (Reg S) 7.5% 26Jun2033	美元 3,800,000	3,606,510	0.1	Muthoot Finance Ltd Ser Regs 6.375% 23Apr2029	美元 8,425,000	8,616,645	0.3

投资组合 (续)

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
印度 (续)				Cikarang Listrindo PT			
Network I2I Ltd Ser				Ser Regs 5.65%			
31Dec2049				12Mar2035	美元 2,600,000	2,584,119	0.1
Regs (Reg S) Var Perp	美元 15,200,000	15,443,592	0.6	Freeport Indonesia PT			
Periama Holdings				Ser Regs (Reg) (Reg			
Llc/De (Reg) (Reg S)				S) 5.315% 14Apr2032	美元 22,700,000	23,154,236	0.9
5.95% 19Apr2026	美元 11,650,000	11,960,369	0.4	Freeport Indonesia PT			
Piramal Capital & Hous				Ser Regs (Reg) (Reg			
Ser EMTN (Reg) (Reg				S) 6.2% 14Apr2052	美元 5,000,000	4,993,654	0.2
S) 7.8% 29Jan2028	美元 18,885,000	19,341,823	0.7	Hutama Karya Persero			
Power Finance Corp Ltd				PT Ser Regs (Reg S)			
Ser GMTN (Reg) (Reg				S) 3.75% 11Jan2030	美元 5,000,000	4,814,893	0.2
S) 3.35% 16May2031	美元 5,400,000	5,100,848	0.2	Indika Inti Energi PT Ser			
Power Finance Corp Ltd				Regs (Reg S) 8.75%			
Ser Regs (Reg S)				07May2029	美元 2,600,000	2,662,002	0.1
3.95% 23Apr2030	美元 5,600,000	5,457,024	0.2	Indofood CBP Sukses			
Reliance Industries				Makm (Reg) (Reg S)			
6.25% 19Oct2040	美元 9,600,000	10,693,863	0.4	3.398% 09Jun2031	美元 10,000,000	9,303,631	0.3
Reliance Industries Ltd				Indonesia (Rep of) (Reg)			
Ser Regs (Reg) (Reg				4.3% 31Mar2052	美元 5,000,000	3,924,053	0.2
S) 3.625% 12Jan2052	美元 6,000,000	4,291,618	0.2	Indonesia (Rep of) (Reg)			
Renew Power Pvt Ltd				5.65% 11Jan2053	美元 20,000,000	19,476,038	0.7
Ser Regs (Reg) (Reg				Indonesia (Rep of) 4.9%			
S) 5.875% 05Mar2027	美元 2,600,000	2,600,268	0.1	16Apr2036	美元 7,700,000	7,544,807	0.3
Renew Treas Ifsc Pvt				Indonesia (Rep of)			
Ltd Ser Regs 6.5%				4.95% 21Feb2036	美元 23,900,000	23,270,753	0.9
02Feb2031	美元 5,488,000	5,392,703	0.2	Indonesia (Rep of) Ser			
Sammaan Capital Ltd				Fr71 (Reg) 9%		印尼盾	
Ser Regs 8.95%				15Mar2029	100,000,000,000	6,309,272	0.2
28Aug2028	美元 4,183,000	4,266,349	0.2	Indonesia (Rep of) Ser			
Shriram Finance Ltd Ser				Regs (Reg S) 5.2%			
Regs (Reg S) 6.625%				23Jul2035	美元 8,000,000	7,903,578	0.3
22Apr2027	美元 2,700,000	2,801,071	0.1	Indonesia (Rep of) Ser			
Shriram Finance Ltd Ser				Regs 5.95%			
Regs (Reg) 6.15%				08Jan2046	美元 6,000,000	6,140,313	0.2
03Apr2028	美元 8,050,000	8,353,035	0.3	Indonesia (Rep of) Ser			
Tata Capital Ltd Ser				Regs 6.625%			
EMTN 5.389%				17Feb2037	美元 8,000,000	8,773,779	0.3
21Jul2028	美元 9,189,000	9,380,344	0.3	Indonesia (Rep of) Ser			
TML Holdings Pte Ltd				Regs 7.75%			
(Reg) (Reg S) 4.35%				17Jan2038	美元 13,500,000	16,215,646	0.6
09Jun2026	美元 3,950,000	3,995,492	0.1	Krakatau Posco Pt (Reg)			
Ultratech Cement Ltd				(Reg S) 6.375%			
Ser Regs (Reg) (Reg				11Jun2027	美元 2,000,000	2,050,770	0.1
S) 2.8% 16Feb2031	美元 2,388,000	2,187,666	0.1	LLPL Capital Pte Ltd Ser			
Vedanta Resources				Regs (Reg) (Reg S)			
10.875% 17Sep2029	美元 2,300,000	2,416,427	0.1	6.875% 04Feb2039	美元 27,900,000	19,318,652	0.7
Vedanta Resources Ser				Majapahit Holding BV			
Regs (Reg S) 10.25%				Ser Regs 7.875Pct			
03Jun2028	美元 4,130,000	4,354,208	0.2	29/06/2037	美元 12,200,000	14,369,181	0.5
Vedanta Resources Ser				Medco Cypress Tree Pte			
Regs 11.25%				Ser Regs 8.625%			
03Dec2031	美元 1,400,000	1,540,707	0.1	19May2030	美元 9,200,000	9,780,580	0.4
Vedanta Resources Ser				Medco Maple Tree Pte			
Regs 9.475%				Ltd Ser Regs (Reg)			
24Jul2030	美元 1,600,000	1,650,399	0.1	(Reg S) 8.96%			
Vedanta Resources Ser				27Apr2029	美元 15,320,000	16,363,653	0.6
Regs 9.85%				Medco Oak Tree Pte Ltd			
24Apr2033	美元 1,800,000	1,926,632	0.1	Ser Regs (Reg) (Reg			
S) 7.375% 14May2026				S) 7.375% 14May2026	美元 9,565,000	9,847,850	0.4
印度尼西亚(15.7%)							
Bank Negara Indonesia							
(Reg S) Var Perp	美元 25,200,000	24,374,850	0.9				

投资组合 (续)

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
<b>印度尼西亚 (续)</b>				<b>国际(0.4%)</b>			
Minejasa Capital BV Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.625% 10Aug2037	美元 40,000,000	38,494,543	1.4	European Investment Bank Ser EMTN 11% 03Jul2030	巴西雷亚尔 30,000,000	5,975,340	0.2
Pertamina Geothermal Ene Ser Regs (Reg S) 5.15% 27Apr2028	美元 3,700,000	3,798,445	0.1	Intl Bk Recon & Develop Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.75% 14Jan2028	巴西雷亚尔 25,000,000	4,344,451	0.2
Pertamina Hulu Energi PT Ser Regs 5.25% 21May2030	美元 1,200,000	1,226,740	0.0	<b>象牙海岸(0.2%)</b>			
Pertamina Persero Ser (Regs) 6.45% 30May2044	美元 16,400,000	16,898,454	0.6	Ivory Coast Ser Regs 6.75% 25Feb2041	美元 6,000,000	5,324,271	0.2
Pertamina Persero Ser Regs (Reg) 6Pct 03/05/2042	美元 25,000,000	24,742,845	0.9	<b>日本(4.4%)</b>			
Pertamina Persero Ser Regs 5.625% 20May2043	美元 8,600,000	8,121,119	0.3	Chugoku Electric Power 5.742% 14Jan2035	美元 5,684,000	5,906,102	0.2
Pertamina Ser Regs 6.5Pct 27/05/2041	美元 10,900,000	11,384,646	0.4	Hikari Tsushin Inc 6.13% 18Sep2035	美元 2,000,000	1,988,449	0.1
Perusahaan Listrik Negar Ser Regs (Reg S) 4% 30Jun2050	美元 6,000,000	4,170,016	0.2	Kyushu Electric 5.246% 09Sep2035	美元 3,684,000	3,669,566	0.1
Perusahaan Listrik Negar Ser Regs (Reg) 6.15% 21May2048	美元 10,000,000	9,758,461	0.4	Meiji Yasuda Life Insurance Ser Regs (Reg S) Var 11Sep2054	美元 14,166,000	14,103,249	0.5
Perusahaan Listrik Negara (Regs) (Reg) 5.25Pct 24/10/2042	美元 4,000,000	3,635,280	0.1	Mitsubishi Estat 4.352% 02Oct2030	美元 7,734,000	7,849,655	0.3
Perusahaan Penerbit SBSN Ser Regs (Br) 5.25% 25Nov2034	美元 10,000,000	10,056,626	0.4	Mitsubishi HC Cap UK Plc Ser EMTN 4.69% 26Jun2026	港元 4,000,000	530,980	0.0
Perusahaan Penerbit SBSN Ser Regs 5.65% 25Nov2054	美元 17,050,000	16,696,639	0.6	Mitsubishi UFJ Fin Var Perp 31Dec2049	美元 1,420,000	1,420,328	0.1
PT Indonesia Asahan Aluminium and PT Mineral Industri Indonesia (Persero) Ser Regs (Reg S) 5.45% 15May2030	美元 5,408,000	5,585,409	0.2	Nippon Life Insurance Ser Regs (Reg S) Var 23Jan2050	美元 3,000,000	2,814,157	0.1
PT Indonesia Asahan Aluminium and PT Mineral Industri Indonesia (Persero) Ser Regs (Reg S) 5.8% 15May2050	美元 3,000,000	2,795,861	0.1	Nippon Life Insurance Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 16Sep2051	美元 1,000,000	877,091	0.0
PT Pelabuhan Indo II Ser Regs (Regs) 5.375% 05/05/2045	美元 8,000,000	7,399,297	0.3	Nippon Life Insurance Ser Var 02Sep2055	欧元 641,000	726,214	0.0
Republic of Indonesia 5.475% 21Feb2056	美元 4,000,000	3,782,969	0.1	Nomura Holdings Inc Var 10Jun2036	美元 9,524,000	9,391,534	0.4
Republic of Indonesia 5.6% 15Jan2035	美元 8,000,000	8,242,499	0.3	Rakuten Group Inc Ser Regs (Reg S) 11.25% 15Feb2027	美元 2,000,000	2,101,107	0.1
Star Energy Co Issue Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.85% 14Oct2038	美元 1,800,000	1,727,113	0.1	Rakuten Group Inc Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 12,841,000	13,116,255	0.5
Star Energy Geothermal Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.75% 24Apr2033	美元 2,200,000	1,451,143	0.1	Rakuten Group Inc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	欧元 14,300,000	16,658,950	0.6
				Rakuten Group Inc Ser Regs 6% 24Apr2029	日元 600,000,000	4,140,744	0.2
				Resona Bank Ltd 4.983% 22Jan2028	美元 4,038,000	4,108,365	0.2
				Softbank Group Corp Ser 58 2.84% 14Dec2029	日元 300,000,000	1,863,388	0.1
				Sumitomo Mitsui Trust Var 11Sep2036	美元 3,970,000	3,920,997	0.1
				Sumitomo Mitsui Finl Grp Var 03Mar2041	美元 3,000,000	2,923,143	0.1

投资组合 (续)

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比
<b>日本 (续)</b>				<b>Shinhan Financial</b>			
Sumitomo Mitsui Finl Grp Var Perp 31Dec2049	美元 10,550,000	10,494,167	0.4	Group Ser Regs (Reg) (Reg S) 5% 24Jul2028	美元 1,600,000	1,635,634	0.0
TOHOKU Electric Power 4.324% 04Mar2031	美元 9,049,000	8,918,532	0.3	Shinhan Financial Group Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 7,400,000	7,473,917	0.3
<b>哈萨克斯坦(0.0%)</b>				<b>SK Battery America Inc</b>			
Development Bank 3.35% 01Sep2028	离岸人民币 8,000,000	1,200,144	0.0	4.25% 22Jan2029	美元 3,913,000	3,925,161	0.1
<b>韩国(4.0%)</b>				<b>SK Hynix Inc Ser Regs</b>			
GS Caltex Corp Ser Regs 4.25% 28Oct2030	美元 4,423,000	4,432,827	0.2	(Reg S) 5.5% 16Jan2029	美元 4,400,000	4,575,057	0.2
Hanwha Life Insurance Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 04Feb2032	美元 5,250,000	5,209,652	0.2	<b>SK Hynix Inc Ser Regs</b> (Reg S) 6.375% 17Jan2028	美元 1,400,000	1,464,009	0.0
Hyundai Capital Services Ser EMTN (Reg S) 4.72% 02Apr2027	港元 20,000,000	2,706,565	0.1	<b>SK Hynix Inc Ser Regs</b> (Reg S) 6.5% 17Jan2033	美元 6,000,000	6,612,751	0.2
Kookmin Bank Ser GMTN (Reg) (Reg S) 4.5% 01Feb2029	美元 1,900,000	1,904,183	0.1	<b>Tongyang life insurance</b> co Var 07May2035	美元 7,000,000	7,369,670	0.3
Korea Development Bank Ser GMTN (Reg) (Reg S) 3.5% 20Aug2027	港元 36,000,000	4,721,975	0.2	<b>Woori Bank Ser Regs</b> (Reg) (Reg S) Var Perp 6.375%	美元 4,243,000	4,422,963	0.2
Korea Housing Finance Co Ser Regs 5.125% 21Jan2030	美元 6,816,000	7,084,385	0.3	<b>科威特 (0.2%)</b>			
Korea Ocean Business Co 4.625% 09May2030	美元 5,123,000	5,254,210	0.2	<b>NBK Tier 1 Fnc Ltd Ser</b> Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 6,300,000	6,220,406	0.2
KT Corp Ser Regs 4.375% 03Jan2029	美元 1,906,000	1,928,638	0.1	<b>澳门特别行政区(4.4%)</b>			
Kyobo Life Insurance Co Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 2,400,000	2,481,461	0.1	<b>Champion Path</b>			
LG Energy Solution Ser Regs 5.875% 02Apr2035	美元 2,500,000	2,572,485	0.1	Holdings (Reg) (Reg S) 4.85% 27Jan2028	美元 5,492,000	5,290,238	0.2
Mirage Asset Securities Ser EMTN 4.25% 11Mar2029	美元 5,804,000	5,748,399	0.2	<b>MGM China Holdings</b> Ltd Ser Regs (Reg S) 4.75% 01Feb2027	美元 1,100,000	1,096,614	0.0
Momentive Performance Materials Inc 4.125% 22Oct2028	美元 6,371,000	6,443,958	0.2	<b>MGM China Holdings</b> Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.875% 15May2026	美元 13,070,000	13,307,993	0.5
NH Investment & Secs 4.625% 10Jul2028	美元 8,268,000	8,368,639	0.3	<b>Sands China Ltd Ser Wi</b> (Reg) 5.4% 08Aug2028	美元 7,600,000	7,722,117	0.3
Posco Ser Regs 5% 16Jan2036	美元 4,247,000	4,184,551	0.1	<b>SJM International Ltd</b> 6.5% 15Jan2031	美元 22,990,000	22,285,943	0.8
Shinhan Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.375% 13Apr2032	美元 1,400,000	1,397,409	0.0	<b>Studio City Co Ltd Ser</b> Regs (Reg) (Reg S) 7% 15Feb2027	美元 19,100,000	19,265,231	0.7
Shinhan Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.75% 15Apr2034	美元 6,800,000	7,219,784	0.3	<b>Studio City Finance Ltd</b> Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.5% 15Jan2028	美元 8,763,000	8,790,752	0.3
				<b>Studio City Finance Ltd</b> Ser Regs (Reg) (Regs) 5% 15Jan2029	美元 20,702,000	19,648,868	0.7
				<b>Wynn Macau Ltd Ser</b> Regs (Reg) (Reg S) 5.625% 26Aug2028	美元 20,900,000	20,659,802	0.8
				<b>Wynn Macau Ltd Ser</b> Regs 6.75% 15Feb2034	美元 1,800,000	1,773,807	0.1

投资组合 (续)

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
<b>马来西亚(2.5%)</b>				<b>荷兰(0.4%)</b>			
Ambank M Bhd Ser EMTN 5.252% 23Jan2030	美元 12,972,000	13,325,809	0.5	Cooperatieve Rabobank UA Ser MTN (Reg S) Var 26Oct2032	澳元 770,000	553,299	0.0
Malaysian (Govt of) Ser 0417 3.899% 16Nov2027	马来西亚林吉特 100,680,000	25,542,762	0.9	ING Groep NV (Reg S) (Br) Var Perp 31Dec2049	美元 3,100,000	3,259,834	0.1
Petronas Capital Ltd Ser Regs 5.34% 03Apr2035	美元 17,000,000	17,907,916	0.7	ING Groep NV Var Perp 31Dec2049	美元 4,400,000	4,491,853	0.2
Petronas Capital Ltd Ser Regs 5.848% 03Apr2055	美元 10,000,000	10,520,762	0.4	Rabobank Ua/Au Ser MTN 4.295% 10Jul2030	澳元 2,000,000	1,324,529	0.1
<b>墨西哥(2.6%)</b>				<b>新西兰(0.1%)</b>			
Banco Mercantil De Norte Ser Regs (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 2,400,000	2,491,892	0.1	Meridian Energy Limited Ser MTN 6.214% 31Mar2033	澳元 1,040,000	715,377	0.0
Banco Mercantil De Norte Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 1,700,000	1,791,236	0.1	Watercare Services Ltd Ser MTN 5.203% 20Aug2031	澳元 2,500,000	1,698,319	0.1
BBVA Bancomer SA Texas Ser Regs (Reg S) Var 29Jun2038	美元 8,000,000	8,706,148	0.3	<b>巴基斯坦(1.3%)</b>			
Comision Federal De Elec Ser Regs (Reg S) 3.348% 09Feb2031	美元 3,000,000	2,704,125	0.1	Islamic Rep of Pakistan Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.875% 05Dec2027	美元 5,700,000	5,765,262	0.2
Mexichem Sab De CV Ser Regs (Reg) 5.875% 17Sep2044	美元 2,000,000	1,434,439	0.0	Pakistan (Rep of) Ser Regs (Reg S) 6% 08Apr2026	美元 10,900,000	11,211,557	0.4
Mexico Bonos DeSarr Fix Rt 8% 21Feb2036	墨西哥比索 6,700,000	34,274,855	1.3	Pakistan (Rep of) Ser Regs (Reg S) 7.375% 08Apr2031	美元 11,300,000	10,873,960	0.4
Mexico City Airport Trus Ser Regs 5.5% 31Oct2046	美元 5,000,000	4,281,532	0.2	Pakistan (Rep of) Ser Regs (Reg S) 7.95% 31Jan2029	美元 3,000,000	3,011,195	0.1
Orbia Advance Corp SAb Ser Regs 6.8% 13May2030	美元 4,010,000	4,050,568	0.1	Pakistan (Republic of) Ser Regs (Reg S) 8.875% 08Apr2051	美元 3,400,000	3,188,033	0.2
Petroleos Mexicanos Ser WI (Reg) 7.69% 23Jan2050	美元 4,000,000	3,524,593	0.1	<b>菲律宾(5.7%)</b>			
Tierra Mojada Lux II Srl Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.75% 01Dec2040	美元 2,000,000	1,639,049	0.1	Bank of Philippine Islan Ser EMTN 5.0% 07Apr2030	美元 1,676,000	1,742,686	0.1
United Mexican States 6.875% 13May2037	美元 6,200,000	6,673,396	0.2	Globe Telecom Inc (Reg) (Reg S) 3% 23Jul2035	美元 11,600,000	9,843,966	0.4
<b>蒙古(0.8%)</b>				Globe Telecom Inc (Reg) (Reg S) Var Perp ICTSI Treasury BV (Reg) (Reg S) 3.5% 16Nov2031	美元 8,708,000	8,754,574	0.3
Dev't Bank of Mongolia 8.5% 03Jul2028	美元 4,300,000	4,425,182	0.2	Metropolitan Bank & Trus Ser EMTN (Reg S) 5.5% 06Mar2034	美元 2,600,000	2,478,249	0.1
Mongolia Intl Bond Ser Regs (Reg S) 4.45% 07Jul2031	美元 4,700,000	4,378,955	0.2	Petron Corp Var Perp 31Dec2049	美元 1,942,000	1,993,104	0.1
Mongolia Intl Bond Ser Regs (Reg S) 7.875% 05Jun2029	美元 9,900,000	10,598,111	0.4	Philippine National Bank Ser EMTN (Reg S) 4.85% 23Oct2029	美元 1,400,000	1,385,551	0.0
Mongolia Intl Bond Ser Regs (Reg S) 8.65% 19Jan2028	美元 803,000	855,667	0.0	Philippines (Rep of) (Reg) 3.95% 20Jan2040	美元 10,300,000	8,756,187	0.3
Mongolian Mining Corp Ser Regs 8.44% 03Apr2030	美元 1,000,000	1,038,017	0.0	Philippines (Rep of) (Reg) 4.75% 05Mar2035	美元 10,000,000	9,668,461	0.4

投资组合 (续)

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比
<b>菲律宾 (续)</b>				Great Eastern Life Assur Ser EMTN Var Perp 31Dec2049	美元 13,650,000	13,710,008	0.5
Philippines (Rep of) (Reg) 5.25% 14May2034	美元 4,000,000	4,092,312	0.1	Housing & Development Brd Ser EMTN (Reg S) (Br) 2.94% 13Jul2027	新加坡元 5,000,000	3,958,915	0.2
Philippines (Rep of) (Reg) 5.6% 14May2049	美元 10,000,000	9,871,136	0.4	Housing & Development Brd Ser MTN (Reg S) (Br) 4.09% 26Oct2027	新加坡元 7,000,000	5,715,649	0.2
Philippines (Rep of) (Reg) 5.95% 13Oct2047	美元 23,000,000	23,944,141	0.9	Oversea Chinese Banking Ser GMTN Var 04Mar2036	美元 5,900,000	5,813,968	0.2
Philippines (Rep of) 6.25Pct 14/01/2036	菲律宾比索 600,000,000	9,573,457	0.4	Oversea-Chinese Banking Ser GMTN (Reg S) Var 21May2034	美元 1,400,000	1,460,330	0.1
Philippines (Rep of) Ser 1071 6.625% 17Aug2033	菲律宾比索 858,000,000	14,012,676	0.5	Singapore Government 2.625% 01May2028	新加坡元 25,000,000	20,000,961	0.7
PLDT Inc (Reg) (Reg S) 2.5% 23Jan2031	美元 600,000	551,052	0.0	SP Group Treasury Pte Ser Regs (Reg S) 3.375% 27Feb2029	美元 1,250,000	1,228,443	0.1
PLDT Inc (Reg) (Reg S) 3.45% 23Jun2050	美元 6,800,000	4,853,341	0.2	Spore Airport Terminal S Ser GMTN (Reg) (Reg S) 4.828% 23Jan2029	美元 3,000,000	3,067,426	0.1
Republic of Philippines (Reg) 2.65% 10Dec2045	美元 10,000,000	6,387,656	0.2	Temasek Financial I Ltd Ser EMTN 1.85% 30Jul2030	离岸人民币 15,000,000	2,172,139	0.1
Republic of Philippines 5% 27Jan2036	美元 19,000,000	18,672,360	0.7	Temasek Financial I Ltd Ser Ser 5.375Pct 23/11/2039	美元 2,000,000	2,196,993	0.1
Republic of Philippines 5.5% 04Feb2035	美元 3,720,000	3,804,121	0.1				
Republic of Philippines 5.9% 04Feb2050	美元 5,000,000	5,063,655	0.2				
Rizal Commercial Banking Ser EMTN 5.375% 29Jan2030	美元 2,937,000	3,026,331	0.1				
Royal Capital BV (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 5,350,000	5,442,562	0.2				
<b>卡塔尔 (0.0%)</b>				<b>南非(0.1%)</b> Republic of South Africa Ser Regs (Reg) 7.95% 19Nov2054	美元 3,000,000	3,056,132	0.1
QNB Finance Ltd Ser EMTN 4.517% 21Feb2027	港元 4,000,000	520,102	0.0				
<b>沙特阿拉伯(0.8%)</b>				<b>西班牙(0.1%)</b> Banco Santander Sa Ser 0 Var Perp 31Dec2049	美元 2,400,000	2,390,665	0.1
AL Rajhi Tier 1 Sukuk Ser EMTN Var Perp 31Dec2049	美元 6,000,000	5,932,050	0.2				
Eig Pearl Holdings Sarl Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.387% 30Nov2046	美元 5,100,000	4,044,973	0.1	<b>斯里兰卡(1.0%)</b> Republic of Sri Lanka Ser Regs (Reg) (Reg S) STP 15Jun2035	美元 10,708,920	8,225,875	0.3
Greensaif Pipelines Bidc Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.8528% 23Feb2036	美元 7,400,000	7,480,408	0.3	Republic of Sri Lanka Ser Regs (Reg) (Reg S) STP 15Mar2033	美元 9,200,000	7,714,834	0.3
Saudi Arabian Oil Co Ser Regs 6.375% 02Jun2055	美元 5,100,000	5,189,561	0.2	Republic of Sri Lanka Ser Regs 4.0% 15Apr2028	美元 16,427,114	11,685,749	0.4
<b>新加坡(2.9%)</b>				<b>苏里南(0.1%)</b> Republic of Suriname Int Ser Regs 7.7% 06Nov2030	美元 1,500,000	1,567,146	0.1
Clifford Capital Holding 3.97% 30Sep2028	美元 10,890,000	10,817,160	0.4				
GLP Pte Ltd (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 1,800,000	871,667	0.0	<b>瑞典(0.3%)</b> Svenska Handelsbanken Ab (Reg S) (Br) Var Perp 31Dec2049	美元 9,000,000	8,885,930	0.3
GLP PTE Ltd 9.75% 20May2028	美元 7,100,000	6,082,937	0.2				

投资组合 (续)

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
<b>瑞士 (0.3%)</b>				<b>Thaioil Trsry Center Ser Regs (Regs) 4.875%</b>			
UBS Group AG (Reg S) Var Perp	美元 2,400,000	2,445,881	0.1	23Jan2043	美元 4,700,000	4,171,677	0.2
UBS Group AG Ser 144A (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 2,400,000	2,644,592	0.1	<b>土耳其(0.5%)</b>			
UBS Group Ag Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 2,600,000	2,593,277	0.1	Republic of Turkiye 6.5% 03Jan2035	美元 3,000,000	2,869,013	0.1
<b>台湾地区(0.5%)</b>				Turk Ihracat Kr Bk Ser Regs 6.375%	美元 3,401,000	3,320,805	0.1
Fubon Life Singa 5.45% 10Dec2035	美元 4,071,000	4,136,633	0.2	15Jan2031	美元 3,000,000	2,579,125	0.1
Nanshan Life Pte Ltd (Reg) (Reg S) 5.45% 11Sep2034	美元 2,300,000	2,231,548	0.1	Turkey (Govt of) 6.25% 17Feb2045	美元 3,000,000	2,954,680	0.1
Nanshan Life Pte Ltd Var 17Mar2041	美元 3,749,000	3,650,981	0.1	Turkiye Varlik F 6.875% 10Feb2031	美元 3,000,000	2,106,911	0.1
Shin Kong Life Sg Pte (Reg) 6.95% 26Jun2035	美元 2,750,000	2,914,635	0.1	Yapi Ve Kredi Bankasi Var Perp Ser Regs (Reg S) 03Sep2095	美元 2,167,000	2,106,911	0.1
<b>泰国(3.2%)</b>				<b>阿联酋(0.7%)</b>			
Advanced Info Service PC 4.26% 04Mar2031	美元 9,379,000	9,208,214	0.3	Aldar Properties PJSC Var 14Apr2056	美元 5,405,000	5,040,679	0.2
Bangkok Bank Pcl/HK Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 25Sep2034	美元 1,800,000	1,700,835	0.1	Aldar Properties PJSC Var 15Apr2055	美元 1,500,000	1,485,701	0.1
Bangkok Bank Pcl/HK Ser Regs Var 25Mar2040	美元 7,000,000	7,046,314	0.3	Dubai Govt Int' L Bonds Ser EMTN (Reg S) 3.9% 09Sep2050	美元 6,000,000	4,142,366	0.1
GC Treasury Centre Co Ser Regs Var Perp 31Dec2049	美元 4,600,000	4,496,485	0.2	Emirates Nbd Bank PJSC 6.1% 21Feb2033	澳元 320,000	217,452	0.0
GC Treasury Centre Var Perp 31Dec2049	美元 3,500,000	3,531,841	0.1	Emirates Nbd Bank PJSC Ser EMTN (Reg S) (Br) 2.1% 27Sep2028	港元 1,000,000	124,519	0.0
Kasikornbank Pcl HK Ser EMTN (Reg S) Var Perp 4%	美元 3,613,000	3,573,821	0.1	Galaxy Pipeline Assets Ser Regs (Reg S) 2.16% 31Mar2034	美元 11,100,000	6,588,738	0.2
Kasikornbank Pcl HK Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 02Oct2031	美元 8,100,000	8,158,179	0.3	Galaxy Pipeline Assets Ser Regs (Reg S) 2.94% 30Sep2040	美元 3,000,000	2,064,215	0.1
Muang Thai Life Assuranc (Reg) (Reg S) Var 27Jan2037	美元 5,952,000	5,919,752	0.2	<b>英国(1.8%)</b>			
Muangthai Capital Pcl (Reg) 6.875% 30Sep2028	美元 6,910,000	6,866,454	0.3	Barclays Plc Ser MTN Var 28May2035	澳元 2,800,000	1,938,889	0.1
Thailand (Govt of) (Reg) 3.39% 17Jun2037	泰铢 204,000,000	6,825,387	0.3	CK Hutchison Intl 20 Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.375% 08May2050	美元 4,000,000	2,918,600	0.1
Thailand Government Bond 3.3% 17Jun2038	泰铢 208,000,000	6,758,184	0.2	CK Hutchison Intl 24 Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.5% 26Apr2034	美元 1,500,000	1,587,396	0.1
Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg S) 2.5% 18Jun2030	美元 6,750,000	6,163,271	0.2	HSBC Holdings Plc (Reg) Var 13Nov2034	美元 1,200,000	1,360,447	0.0
Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg S) 3.75% 18Jun2050	美元 1,700,000	1,217,547	0.0	HSBC Holdings Plc (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 2,000,000	2,076,695	0.1
Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 10,089,000	9,869,365	0.4	HSBC Holdings Plc (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 1,600,000	1,482,960	0.1
				HSBC Holdings Plc FRN 13May2031	美元 2,600,000	2,639,911	0.1
				HSBC Holdings Plc Ser EMTN (Reg S) (Br) 7% 07Apr2038	英镑 2,000,000	2,944,993	0.1
				HSBC Holdings Plc Ser EMTN Var Perp 31Dec2049	新加坡元 4,250,000	3,358,091	0.1

投资组合 (续)

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比
<b>英国 (续)</b>				Wells Fargo Bank Na Ser EMTN 3.9% 29Apr2028	港元 5,000,000	668,393	0.0
HSBC Holdings Plc Ser MTN (Reg) (Reg S) Var 21Mar2034	澳元 2,100,000	1,443,463	0.1				
HSBC Holdings Plc Ser MTN Var 11Mar2035	澳元 5,830,000	3,932,554	0.1		2,427,764,759		89.9
HSBC Holdings Plc Var Perp 31Dec2049	美元 3,600,000	3,710,577	0.1				
Lloyds Banking Group Plc Ser (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 1,406,000	1,399,931	0.0	<b>(III) 集体投资计划 (7.2%)</b>			
Lloyds Banking Group Plc Ser MTN (Reg S) Var 06Mar2030	澳元 2,000,000	1,374,222	0.0	<b>卢森堡 (7.2%)</b> JPMLIQ-JPM USD Liquidity LVNAV 'X' (dist)**	195,398,832	195,398,832	7.2
Nationwide Bldg Ser (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	英镑 659,000	893,406	0.0	<b>(IV) 衍生性产品 (-0.4%)</b>			
Natwest Group Pl (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 2,900,000	2,633,863	0.1	<b>信贷违约掉期 (0.1%)</b> (D) Credit Default Swap Index-604~ 271 15,000,000.00 USD 24/03/2026 20/06/2031		672,960	0.0
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg S) Var 09Jan2029	美元 1,500,000	1,562,668	0.1	(D) Credit Default Swap Index ~602~ 274 8,300,000.00 USD 26/03/2026 20/06/2031		38,698	0.0
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg S) Var 16Nov2028	美元 3,800,000	4,094,470	0.1	(D) Credit Default Swap Index ~602~ 273 8,300,000.00 USD 26/03/2026 20/06/2031		(4,473)	(0.0)
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 4,794,000	4,566,398	0.2	<b>远期外汇合约 (-0.2%)</b>		(4,516,637)	(0.2)
Standard Chartered Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 1,575,000	1,627,540	0.1	<b>期货 (-0.2%)</b> Aust 10Yr Bond Fut 15/06/2026	857	(379,073)	(0.0)
<b>美国 (1.0%)</b>				Euro-Bund Future 08/06/2026	(250)	187,233	0.0
Citigroup Inc Ser Y (Reg) Var Perp 31Dec2049	美元 3,000,000	2,972,858	0.1	Long Gilt Future 26/06/2026	433	(2,367,343)	(0.1)
Goldman Sachs Group Inc 4.5% 16May2028	澳元 1,000,000	680,856	0.0	US 5Yr Note (CBT) 30/06/2026	1,288	(538,288)	(0.0)
Hyundai Capital America Ser Regs 5.15% 27Mar2030	美元 3,000,000	3,034,874	0.1	US 10Yr Note (CBT) 18/06/2026	644	(1,536,563)	(0.1)
Hyundai Capital America Ser Regs FRN 18Sep2030	美元 1,500,000	1,539,219	0.1	US 10Yr Ultra Fut 18/06/2026	154	128,953	0.0
Hyundai Capital America Ser Regs FRN 27Mar2030	美元 1,800,000	1,844,692	0.1	<b>利率掉期 (-0.0%)</b> (D) Interest Rate Swap~619~ 251 203,040,000.00 BRL 10/03/2026 02/01/2030		(775,506)	(0.0)
Las Vegas Sands Corp (Reg) 6.2% 15Aug2034	美元 2,000,000	2,066,328	0.1	(D) Interest Rate Swap ~619~ 253 147,978,620,000.00 COP 17/06/2026 17/06/2031		(350,894)	(0.0)
Las Vegas Sands Corp 6% 14Jun2030	美元 1,400,000	1,465,627	0.0	(D) Interest Rate Swap ~619~ 259 120,000,000.00 MYR 18/06/2026 18/06/2031		69,168	0.0
Meta Platforms Inc 5.75% 15Nov2065	美元 3,200,000	3,050,152	0.1				
Resorts World/RWLV Cap Ser Regs (Reg S) 4.625% 06Apr2031	美元 8,900,000	7,228,738	0.3				
Resorts World/Rwlv Cap Ser Regs (Reg) (Reg S) 8.45% 27Jul2030	美元 2,800,000	2,700,441	0.1				

投资组合 (续)

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
(D) Interest Rate Swap ~619~ 263 883,000,000.00 MXN 18/03/2026 11/06/2031	(495,544)	(0.0)
(D) Interest Rate Swap ~619~ 268 122,000,000.00 MYR 18/06/2026 18/06/2031	21,407	0.0
(D) Interest Rate Swap ~619~ 275 60,000,000.00 MYR 18/06/2026 18/06/2036	15,593	0.0
(D) Interest Rate Swap ~619~ 277 23,000,000.00 SGD 02/04/2026 17/06/2031	7,273	0.0
(D) Interest Rate Swap ~619~ 278 12,000,000.00 SGD 02/04/2026 17/06/2036	21,493	0.0
	<u>(9,801,543)</u>	<u>(0.4)</u>
<b>总上市投资</b>	<b>2,676,185,856</b>	<b>99.0</b>
<b>其他净资产</b>	<b>26,011,238</b>	<b>1.0</b>
<b>于二零二六年三月三十一日可赎回份 额持有人应占净资产</b>	<b><u>2,702,197,094</u></b>	<b><u>100.0</u></b>
<b>总投资，按成本</b>	<b><u>2,665,320,832</u></b>	

\* 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  
截至二零二六年三月三十一日止期间(未经审计)

(续)

	持有占资产净值百分比			持有占资产净值百分比	
	31.3.2026	30.9.2025		31.3.2026	30.9.2025
<b>上市投资</b>			德国	0.1	0.0
			新西兰	0.1	-
<b>可转换证券</b>			苏里南	0.1	-
			哈萨克斯坦	0.0	0.0
香港特别行政区	1.0	0.7	卡塔尔	0.0	0.0
美国	0.5	0.3	秘鲁	-	0.6
中国内地	0.2	1.4	安哥拉	-	0.1
澳门特别行政区	0.2	-	保加利亚	-	0.1
韩国	0.1	0.1	哥斯达黎加	-	0.1
澳大利亚	0.1	-	危地马拉	-	0.1
意大利	0.1	-	意大利	-	0.1
维京群岛	0.1	-	罗马尼亚	-	0.1
法国	0.0	-			
日本	0.0	-	<b>集体投资计划</b>		
台湾地区	-	0.4	卢森堡	7.2	3.5
马来西亚	-	0.2			
<b>债务证券</b>			<b>衍生性产品</b>		
印度尼西亚	15.7	14.5	信贷违约掉期	0.0	(0.0)
印度	13.7	16.3	利率掉期	(0.0)	(0.0)
中国内地	8.7	8.8	期货	(0.2)	(0.0)
香港特别行政区	6.0	6.5	远期外汇合约	(0.2)	(0.1)
菲律宾	5.7	3.5			
日本	4.4	5.0	<b>总上市投资</b>	<b>99.0</b>	<b>97.8</b>
澳门特别行政区	4.4	4.3			
韩国	4.0	6.2	<b>其他净资产</b>	<b>1.0</b>	<b>2.2</b>
澳大利亚	3.6	3.5			
泰国	3.2	2.6	<b>可赎回份额持有人应占净资产</b>	<b>100.0</b>	<b>100.0</b>
新加坡	2.9	1.6			
墨西哥	2.6	4.2			
马来西亚	2.5	1.0			
英国	1.8	2.2			
巴基斯坦	1.3	1.1			
美国	1.0	0.9			
斯里兰卡	1.0	0.8			
沙特阿拉伯	0.8	1.4			
蒙古	0.8	0.6			
阿联酋	0.7	0.1			
台湾地区	0.5	0.5			
哥伦比亚	0.5	0.2			
土耳其	0.5	0.2			
荷兰	0.4	0.5			
国际	0.4	0.3			
智利	0.3	0.5			
法国	0.3	0.5			
瑞士	0.3	0.4			
瑞典	0.3	-			
巴西	0.2	0.9			
比利时	0.2	0.2			
科威特	0.2	0.1			
象牙海岸	0.2	-			
西班牙	0.1	0.3			
加拿大	0.1	0.1			
丹麦	0.1	0.1			
埃及	0.1	0.1			
南非	0.1	0.1			

金融衍生工具详情

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

于二零二六年三月三十一日，本基金持有之金融衍生工具概述如下：

(a) 信贷违约掉期

以下为于二零二六年三月三十一日未平仓之信贷违约掉期合约：

	标的资产	交易对手	公平值 美元
于 2026 年 3 月 31 日			
(D) Credit Default Swap ~604~ 271 15,000,000.00 USD 24/03/2026 20/06/2031	CDX.EM.45	Citigroup Global Markets Ltd	672,960
(D) Credit Default Swap ~602~ 274 8,300,000.00 USD 26/03/2026 20/06/2031	REP PHILIPPINES	Citigroup Global Markets Ltd	38,698
		金融资产总额	711,658
(D) Credit Default Swap ~602~ 273 8,300,000.00 USD 26/03/2026 20/06/2031	REP INDONESIA	Citigroup Global Markets Ltd	(4,473)
		金融负债总额	(4,473)
		金融资产净额	707,185

(b) 远期外汇合约

以下为于二零二六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/ (亏损) 美元
于 2026 年 3 月 31 日				
未平仓合约：				
澳元 6,998	美元 4,821	2026 年 4 月 1 日	巴克莱银行, 伦敦	28
纽元 9,814	美元 5,650	2026 年 4 月 1 日	巴克莱银行, 伦敦	52
美元 6,208,290	离岸人民币 42,938,631	2026 年 4 月 1 日	高盛国际, 伦敦	8,663
美元 424,602	离岸人民币 2,936,768	2026 年 4 月 1 日	巴克莱银行, 伦敦	603
美元 93,966	离岸人民币 649,916	2026 年 4 月 1 日	巴克莱银行, 伦敦	133
美元 44,803	离岸人民币 309,878	2026 年 4 月 1 日	巴克莱银行, 伦敦	64
澳元 5,675	美元 3,891	2026 年 4 月 2 日	巴克莱银行, 伦敦	4
英镑 140,246	美元 187,249	2026 年 4 月 2 日	巴克莱银行, 伦敦	2,307
港元 29,603	美元 3,780	2026 年 4 月 2 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4
美元 419,687	离岸人民币 2,901,899	2026 年 4 月 2 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	470
美元 63,698	离岸人民币 440,449	2026 年 4 月 2 日	巴克莱银行, 伦敦	73
美元 39,377	离岸人民币 272,277	2026 年 4 月 2 日	巴克莱银行, 伦敦	45
离岸人民币 1,641,598	美元 237,795	2026 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	1
美元 1,079,682	离岸人民币 7,465,466	2026 年 4 月 8 日	Citibank N.A., 伦敦	1,730
美元 495,324	离岸人民币 3,425,004	2026 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	806
美元 226,523	离岸人民币 1,566,335	2026 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	369
美元 105,775	离岸人民币 731,401	2026 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	172
美元 4,531	离岸人民币 31,301	2026 年 4 月 8 日	法国巴黎银行	4
美元 1,102	离岸人民币 7,610	2026 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	0
美元 420,036	离岸人民币 2,899,473	2026 年 4 月 9 日	Citibank N.A., 伦敦	1
美元 26,102	澳元 38,115	2026 年 4 月 9 日	Citibank N.A., 伦敦	0
美元 4	港元 30	2026 年 4 月 9 日	美国道富银行	0
加元 2,137	美元 1,532	2026 年 4 月 10 日	巴克莱银行, 伦敦	0
澳元 2,260,458	美元 1,615,362	2026 年 4 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	67,552
澳元 1,553,746	美元 1,096,404	2026 年 4 月 21 日	法国巴黎银行	32,503
澳元 472,589	美元 334,127	2026 年 4 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	10,530
澳元 407,946	美元 288,411	2026 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	9,077

未实现收益/  
(亏损)  
美元

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
澳元 544,579	美元 380,852	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	7,960
澳元 245,411	美元 175,372	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	7,331
澳元 482,187	美元 337,219	2026年4月21日	法国巴黎银行	7,050
澳元 437,444	美元 306,263	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	6,731
澳元 270,274	美元 190,343	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	5,278
澳元 338,015	美元 236,714	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	5,265
澳元 217,221	美元 153,908	2026年4月21日	法国巴黎银行	5,170
澳元 1,256,607	美元 865,389	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	4,949
澳元 314,032	美元 219,571	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	4,543
澳元 221,564	美元 156,252	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,539
澳元 156,220	美元 110,848	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	3,879
澳元 134,190	美元 95,609	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	3,725
澳元 195,144	美元 137,251	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	3,629
澳元 237,546	美元 166,122	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	3,466
澳元 266,027	美元 185,210	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	3,053
澳元 93,764	美元 67,020	2026年4月21日	法国巴黎银行	2,816
澳元 80,433	美元 56,867	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,792
澳元 134,005	美元 93,297	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,539
澳元 207,621	美元 143,470	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,305
澳元 270,586	美元 186,343	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,063
澳元 16,537	美元 11,565	2026年4月21日	法国巴黎银行	242
澳元 7,304	美元 5,220	2026年4月21日	法国巴黎银行	219
澳元 246,108	美元 168,676	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	157
澳元 3,230	美元 2,308	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	96
澳元 5,103	美元 3,588	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	94
澳元 4,717	美元 3,303	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	73
澳元 1,935	美元 1,363	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	38
澳元 1,579	美元 1,099	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	18
澳元 1,935	美元 1,333	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	8
澳元 1,597	美元 1,094	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1
澳元 1,597	美元 1,094	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1
加元 1,015,058	美元 747,552	2026年4月21日	法国巴黎银行	19,588
加元 351,203	美元 259,189	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	7,319
加元 506,075	美元 369,430	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	6,490
加元 339,249	美元 248,855	2026年4月21日	高盛国际, 伦敦	5,558
加元 312,390	美元 229,531	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	5,496
加元 331,410	美元 243,110	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	5,435
加元 431,545	美元 314,655	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	5,166
加元 238,226	美元 175,928	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	5,080
加元 407,260	美元 296,944	2026年4月21日	高盛国际, 伦敦	4,872
加元 243,372	美元 177,978	2026年4月21日	法国巴黎银行	3,441
加元 224,228	美元 163,941	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	3,132
加元 197,102	美元 144,248	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,893
加元 257,080	美元 186,970	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,601
加元 143,380	美元 104,645	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,817
加元 85,757	美元 62,797	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,295
加元 63,850	美元 46,962	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,171
加元 265,563	美元 191,483	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,030
加元 43,718	美元 32,070	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	717
加元 47,323	美元 34,572	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	634
加元 234,902	美元 168,898	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	435
加元 1,505	美元 1,106	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	26
加元 1,511	美元 1,106	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	22
离岸人民币 259,682,997	美元 37,744,084	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	88,533
离岸人民币 146,305,412	美元 21,281,558	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	66,419
离岸人民币 23,700,842	美元 3,458,929	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	22,169
离岸人民币 30,300,404	美元 4,404,216	2026年4月21日	法国巴黎银行	10,481
离岸人民币 18,589,638	美元 2,703,991	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	8,385
离岸人民币 29,956,072	美元 4,351,880	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	8,074
离岸人民币 6,450,105	美元 941,336	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	6,033
离岸人民币 15,675,165	美元 2,278,496	2026年4月21日	高盛国际, 伦敦	5,505
离岸人民币 24,461,043	美元 3,552,384	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	5,390
离岸人民币 5,142,926	美元 750,576	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	4,821
离岸人民币 12,304,860	美元 1,789,048	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,771
离岸人民币 14,553,275	美元 2,114,187	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	3,877
离岸人民币 3,141,528	美元 459,288	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	3,748
离岸人民币 3,562,844	美元 519,966	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	3,333
离岸人民币 20,063,619	美元 2,912,305	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	2,963

未实现收益/  
(亏损)  
美元

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
离岸人民币 3,453,998	美元 1,503,681	2026年4月21日	法国巴黎银行	2,831
离岸人民币 8,011,749	美元 1,164,522	2026年4月21日	法国巴黎银行	2,771
离岸人民币 2,756,658	美元 402,316	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	2,584
离岸人民币 5,564,088	美元 809,343	2026年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,518
离岸人民币 9,907,507	美元 1,438,781	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	2,135
离岸人民币 3,181,953	美元 463,154	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,752
离岸人民币 4,821,356	美元 700,798	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,673
离岸人民币 2,279,029	美元 331,995	2026年4月21日	法国巴黎银行	1,522
离岸人民币 4,366,127	美元 634,624	2026年4月21日	法国巴黎银行	1,510
离岸人民币 10,118,630	美元 1,468,756	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,496
离岸人民币 6,607,126	美元 959,550	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,478
离岸人民币 3,201,426	美元 465,674	2026年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,449
离岸人民币 3,956,061	美元 575,041	2026年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,389
离岸人民币 3,278,722	美元 476,705	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,271
离岸人民币 2,726,617	美元 396,613	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,238
离岸人民币 983,625	美元 143,805	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,173
离岸人民币 13,519,418	美元 1,961,562	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,167
离岸人民币 3,961,243	美元 575,462	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,059
离岸人民币 3,010,215	美元 437,473	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	974
离岸人民币 1,680,691	美元 244,635	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	925
离岸人民币 3,695,023	美元 536,626	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	826
离岸人民币 2,248,107	美元 326,778	2026年4月21日	高盛国际, 伦敦	790
离岸人民币 958,235	美元 139,735	2026年4月21日	法国巴黎银行	785
离岸人民币 1,955,000	美元 284,247	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	761
离岸人民币 3,444,396	美元 500,205	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	747
离岸人民币 1,077,241	美元 156,926	2026年4月21日	法国巴黎银行	719
离岸人民币 1,830,879	美元 266,198	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	710
离岸人民币 6,174,965	美元 896,042	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	636
离岸人民币 6,908,866	美元 1,002,461	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	635
离岸人民币 1,382,664	美元 201,123	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	629
离岸人民币 2,326,371	美元 337,965	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	628
离岸人民币 2,856,063	美元 414,765	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	620
离岸人民币 1,105,318	美元 160,886	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	609
离岸人民币 2,164,189	美元 314,398	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	578
离岸人民币 1,150,003	美元 167,280	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	523
离岸人民币 1,474,505	美元 214,323	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	512
离岸人民币 1,047,902	美元 152,310	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	358
离岸人民币 429,758	美元 62,670	2026年4月21日	法国巴黎银行	352
离岸人民币 2,198,891	美元 319,177	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	325
离岸人民币 847,530	美元 123,198	2026年4月21日	法国巴黎银行	301
离岸人民币 2,697,798	美元 391,496	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	299
离岸人民币 765,475	美元 111,296	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	297
离岸人民币 517,821	美元 75,372	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	285
离岸人民币 1,215,276	美元 176,486	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	264
离岸人民币 490,425	美元 71,360	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	245
离岸人民币 1,017,799	美元 147,806	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	219
离岸人民币 935,135	美元 135,803	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	203
离岸人民币 297,742	美元 43,373	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	198
离岸人民币 218,385	美元 31,846	2026年4月21日	法国巴黎银行	179
离岸人民币 399,638	美元 58,105	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	156
离岸人民币 417,838	美元 60,734	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	145
离岸人民币 151,585	美元 22,122	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	142
离岸人民币 1,601,619	美元 232,382	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	138
离岸人民币 508,605	美元 73,888	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	137
离岸人民币 1,158,913	美元 168,178	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	128
离岸人民币 2,593,250	美元 376,159	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	122
离岸人民币 215,713	美元 31,377	2026年4月21日	高盛国际, 伦敦	98
离岸人民币 193,578	美元 28,158	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	88
离岸人民币 181,202	美元 26,358	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	82
离岸人民币 149,933	美元 21,816	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	75
离岸人民币 186,767	美元 27,147	2026年4月21日	法国巴黎银行	65
离岸人民币 547,462	美元 79,446	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	61
离岸人民币 260,264	美元 37,796	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	56
离岸人民币 81,269	美元 11,838	2026年4月21日	高盛国际, 伦敦	53
离岸人民币 98,058	美元 14,253	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	33
离岸人民币 94,939	美元 13,800	2026年4月21日	高盛国际, 伦敦	33
离岸人民币 82,632	美元 12,014	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	32
离岸人民币 95,486	美元 13,872	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	26

未实现收益/  
(亏损)  
美元

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
离岸人民币 89,447	美元 12,994	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	24
离岸人民币 25,318	美元 3,692	2026年4月21日	法国巴黎银行	21
离岸人民币 88,261	美元 12,818	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	20
离岸人民币 105,712	美元 15,340	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	11
离岸人民币 103,920	美元 15,080	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	11
离岸人民币 223,457	美元 32,413	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	11
离岸人民币 43,225	美元 6,277	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	9
离岸人民币 7,526	美元 1,100	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	9
离岸人民币 7,526	美元 1,100	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	9
离岸人民币 7,526	美元 1,100	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	9
离岸人民币 7,526	美元 1,100	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	9
离岸人民币 16,032	美元 2,334	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	9
离岸人民币 80,937	美元 11,745	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	8
离岸人民币 74,762	美元 10,849	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	8
离岸人民币 9,367	美元 1,366	2026年4月21日	法国巴黎银行	8
离岸人民币 7,600	美元 1,109	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	7
离岸人民币 8,196	美元 1,195	2026年4月21日	法国巴黎银行	7
离岸人民币 7,583	美元 1,104	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	4
离岸人民币 7,583	美元 1,104	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	4
离岸人民币 7,574	美元 1,102	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	4
离岸人民币 7,574	美元 1,102	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	4
离岸人民币 7,574	美元 1,102	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	4
离岸人民币 7,574	美元 1,102	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	4
离岸人民币 24,131	美元 3,502	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	2
离岸人民币 7,582	美元 1,101	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 7,547	美元 1,095	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	1
离岸人民币 7,585	美元 1,101	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	1
离岸人民币 7,585	美元 1,101	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	1
离岸人民币 7,585	美元 1,101	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	1
英镑 465,145	美元 622,609	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	9,241
英镑 242,785	美元 324,672	2026年4月21日	法国巴黎银行	4,521
英镑 158,087	美元 211,296	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	2,834
英镑 117,350	美元 157,070	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,325
英镑 108,705	美元 145,606	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	2,261
英镑 100,556	美元 134,402	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,802
英镑 61,709	美元 83,039	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,665
英镑 78,801	美元 105,321	2026年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,409
英镑 63,056	美元 84,370	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,221
英镑 52,748	美元 70,652	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,096
英镑 91,911	美元 122,272	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,073
英镑 60,558	美元 80,482	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	626
英镑 50,469	美元 67,137	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	585
英镑 49,211	美元 65,456	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	563
英镑 98,874	美元 130,886	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	505
英镑 58,906	美元 77,745	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	68
英镑 821	美元 1,096	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	13
欧元 594,657	美元 354,630	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	15,178
欧元 388,206	美元 230,499	2026年4月21日	法国巴黎银行	8,897
欧元 211,827	美元 126,323	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	5,405
欧元 337,832	美元 198,093	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	5,246
欧元 190,177	美元 112,969	2026年4月21日	高盛国际, 伦敦	4,409
欧元 185,809	美元 110,381	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	4,314
欧元 274,973	美元 160,791	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	3,826
欧元 126,707	美元 74,422	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,093
欧元 198,067	美元 115,094	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,030
欧元 107,775	美元 63,546	2026年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,024
欧元 133,986	美元 78,412	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,928
欧元 135,783	美元 79,049	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,539
欧元 44,795	美元 26,449	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	879
欧元 140,919	美元 81,191	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	749
欧元 30,048	美元 17,717	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	564
欧元 46,578	美元 27,112	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	524
欧元 33,497	美元 19,604	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	482
欧元 34,224	美元 20,014	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	477
欧元 128,775	美元 73,675	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	166
欧元 1,859	美元 1,109	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	47
欧元 1,876	美元 1,114	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	44
欧元 1,936	美元 1,145	2026年4月21日	法国巴黎银行	40

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
纽元 1,882	美元 1,104	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	29
纽元 1,892	美元 1,094	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	14
纽元 1,911	美元 1,093	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	2
美元 2,884,406	离岸人民币 19,921,131	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,275
美元 943,957	离岸人民币 6,519,633	2026年4月21日	法国巴黎银行	1,427
美元 841,747	离岸人民币 5,812,430	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,089
美元 457,344	离岸人民币 3,158,641	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	678
美元 281,475	离岸人民币 1,943,591	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	357
美元 71,677	离岸人民币 495,050	2026年4月21日	法国巴黎银行	108
美元 19,791	离岸人民币 136,686	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	29
美元 10,156	离岸人民币 70,142	2026年4月21日	法国巴黎银行	15
美元 8,084	离岸人民币 55,833	2026年4月21日	法国巴黎银行	12
美元 1,738	离岸人民币 12,003	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	2
美元 1,066	离岸人民币 7,364	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1
澳元 12,500,000	美元 8,954,500	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	395,437
澳元 11,500,000	美元 8,186,735	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	312,397
澳元 11,800,000	美元 8,358,778	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	279,023
澳元 10,000,000	美元 7,082,600	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	235,350
澳元 10,200,000	美元 7,216,513	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	232,318
澳元 11,000,000	美元 7,711,892	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	179,917
澳元 10,500,000	美元 7,341,414	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	151,802
澳元 8,310,000	美元 5,835,298	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	145,233
澳元 10,500,000	美元 7,328,759	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	139,146
澳元 10,000,000	美元 6,911,737	2026年4月22日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	64,487
巴西雷亚尔 38,000,000	美元 7,291,175	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	41,493
离岸人民币 200,000,000	美元 29,131,587	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	128,098
离岸人民币 375,000,000	美元 54,467,607	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	86,065
离岸人民币 200,000,000	美元 29,089,217	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	85,727
离岸人民币 200,000,000	美元 29,053,720	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	50,231
离岸人民币 200,000,000	美元 29,040,685	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	37,195
离岸人民币 135,000,000	美元 19,601,964	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	24,609
离岸人民币 50,000,000	美元 7,267,326	2026年4月22日	美国道富银行	16,454
离岸人民币 190,000,000	美元 27,554,462	2026年4月22日	法国巴黎银行	1,147
欧元 18,300,000	美元 21,705,145	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	598,712
欧元 12,500,000	美元 14,880,070	2026年4月22日	美国道富银行	463,107
欧元 11,700,000	美元 13,942,747	2026年4月22日	法国巴黎银行	448,470
欧元 12,800,000	美元 15,090,336	2026年4月22日	美国道富银行	327,366
欧元 14,794,964	美元 17,327,748	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	263,873
欧元 11,000,000	美元 12,900,294	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	213,367
欧元 6,200,000	美元 7,321,192	2026年4月22日	法国巴黎银行	170,378
欧元 6,500,000	美元 7,606,515	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	109,694
欧元 12,500,000	美元 14,477,428	2026年4月22日	法国巴黎银行	60,465
欧元 3,500,000	美元 4,081,739	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	44,989
英镑 34,000,000	美元 45,299,733	2026年4月22日	美国道富银行	465,361
英镑 4,802,000	美元 6,469,481	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	137,285
港元 461,861,000	美元 59,388,022	2026年4月22日	法国巴黎银行	409,294
印尼盾 365,000,000,000	美元 21,683,727	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	215,046
印尼盾 250,000,000,000	美元 14,881,933	2026年4月22日	美国道富银行	177,357
印尼盾 532,000,000,000	美元 31,425,922	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	134,585
印尼盾 250,000,000,000	美元 14,827,819	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	123,244
印尼盾 250,000,000,000	美元 14,782,753	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	78,177
印尼盾 120,000,000,000	美元 7,123,057	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	64,861
印尼盾 90,000,000,000	美元 5,308,889	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	15,242
印度卢比 2,825,100,000	美元 31,033,903	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	1,310,377
印度卢比 2,600,000,000	美元 28,447,915	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	1,092,717
印度卢比 1,327,000,000	美元 14,411,820	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	450,148
印度卢比 1,300,000,000	美元 14,056,501	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	378,902
印度卢比 700,000,000	美元 7,635,553	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	270,692
印度卢比 650,000,000	美元 7,016,309	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	177,510
印度卢比 650,000,000	美元 6,965,430	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	126,631
印度卢比 850,000,000	美元 9,025,942	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	82,896
印度卢比 510,000,000	美元 5,404,094	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	38,267
日元 2,330,000,000	美元 14,844,877	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	170,570
日元 2,235,000,000	美元 14,167,736	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	91,737
日元 1,050,000,000	美元 6,685,529	2026年4月22日	美国道富银行	72,643
日元 430,000,000	美元 2,731,900	2026年4月22日	美国道富银行	23,766
韩元 22,000,000,000	美元 15,084,611	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	712,632

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
韩元 21,200,000,000	美元 14,499,494	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	650,133
韩元 38,000,000,000	美元 25,428,776	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	604,449
韩元 10,500,000,000	美元 7,372,560	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	513,207
韩元 11,000,000,000	美元 7,668,444	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	482,455
韩元 11,200,000,000	美元 7,790,979	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	474,335
韩元 10,600,000,000	美元 7,335,843	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	411,163
韩元 25,000,000,000	美元 16,688,696	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	356,902
韩元 10,500,000,000	美元 7,184,547	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	325,194
韩元 18,000,000,000	美元 11,962,279	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	203,387
墨西哥比索 135,000,000	美元 7,827,979	2026年4月22日	美国道富银行	357,864
墨西哥比索 250,000,000	美元 14,191,355	2026年4月22日	美国道富银行	357,807
墨西哥比索 130,000,000	美元 7,519,366	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	325,921
墨西哥比索 150,000,000	美元 8,623,954	2026年4月22日	美国道富银行	323,825
墨西哥比索 137,000,000	美元 7,868,140	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	287,356
墨西哥比索 130,000,000	美元 7,316,880	2026年4月22日	美国道富银行	123,435
墨西哥比索 120,000,000	美元 6,760,043	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	119,940
墨西哥比索 135,000,000	美元 7,578,777	2026年4月22日	美国道富银行	108,661
墨西哥比索 250,000,000	美元 13,937,644	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	104,097
墨西哥比索 103,000,000	美元 5,702,473	2026年4月22日	美国道富银行	3,052
马来西亚林吉特 71,500,000	美元 18,242,123	2026年4月22日	法国巴黎银行	571,933
马来西亚林吉特 56,000,000	美元 14,376,300	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	536,711
马来西亚林吉特 57,000,000	美元 14,607,519	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	520,795
马来西亚林吉特 56,000,000	美元 14,236,323	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	396,734
马来西亚林吉特 46,000,000	美元 11,732,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	363,767
马来西亚林吉特 40,000,000	美元 10,207,727	2026年4月22日	法国巴黎银行	322,307
马来西亚林吉特 58,500,000	美元 14,768,625	2026年4月22日	法国巴黎银行	311,197
马来西亚林吉特 29,000,000	美元 7,401,736	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	234,806
马来西亚林吉特 53,000,000	美元 13,183,424	2026年4月22日	法国巴黎银行	85,241
马来西亚林吉特 92,000,000	美元 22,738,507	2026年4月22日	法国巴黎银行	2,040
马来西亚林吉特 55,000,000	美元 13,593,397	2026年4月22日	法国巴黎银行	944
纽元 91,800,000	美元 53,216,368	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	811,512
纽元 13,500,000	美元 8,113,985	2026年4月22日	法国巴黎银行	407,388
纽元 27,000,000	美元 15,742,148	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	328,954
秘鲁新索尔 45,000,000	美元 13,168,291	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	290,558
秘鲁新索尔 55,000,000	美元 15,773,323	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	33,872
菲律宾比索 850,000,000	美元 14,545,828	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	568,294
菲律宾比索 850,000,000	美元 14,309,042	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	331,507
菲律宾比索 420,000,000	美元 7,217,090	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	310,544
菲律宾比索 850,000,000	美元 14,245,730	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	268,196
菲律宾比索 450,000,000	美元 7,628,541	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	228,670
菲律宾比索 602,500,000	美元 10,123,498	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	215,893
菲律宾比索 850,000,000	美元 14,158,879	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	181,345
菲律宾比索 410,000,000	美元 6,843,249	2026年4月22日	美国道富银行	101,144
菲律宾比索 325,000,000	美元 5,375,188	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	30,837
新加坡元 38,000,000	美元 30,153,281	2026年4月22日	美国道富银行	654,939
新加坡元 38,000,000	美元 30,143,347	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	645,006
新加坡元 55,000,000	美元 43,221,596	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	526,628
新加坡元 18,000,000	美元 14,357,273	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	384,374
新加坡元 22,000,000	美元 17,439,114	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	361,126
新加坡元 18,600,000	美元 14,789,747	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	351,085
新加坡元 37,000,000	美元 29,045,988	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	323,919
新加坡元 20,200,000	美元 15,965,161	2026年4月22日	法国巴黎银行	284,464
新加坡元 18,500,000	美元 14,560,692	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	199,657
新加坡元 36,200,000	美元 28,275,551	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	174,499
新加坡元 19,000,000	美元 14,913,330	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	164,159
新加坡元 18,500,000	美元 14,478,247	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	117,212
新加坡元 16,500,000	美元 12,925,564	2026年4月22日	美国道富银行	117,074
新加坡元 14,200,000	美元 11,136,531	2026年4月22日	美国道富银行	113,466
新加坡元 4,500,000	美元 3,529,221	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	35,996
泰铢 225,000,000	美元 7,218,804	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	385,118
泰铢 180,000,000	美元 5,849,169	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	382,221
泰铢 180,000,000	美元 5,842,069	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	375,121
泰铢 355,000,000	美元 10,800,286	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	18,248
台币 500,000,000	美元 15,896,684	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	233,377
台币 426,537,753	美元 13,554,651	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	192,667
台币 450,000,000	美元 14,219,896	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	122,920
台币 455,000,000	美元 14,373,126	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	119,517
台币 550,000,000	美元 17,336,158	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	106,520

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
台币 460,000,000	美元 14,492,708	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	82,465
台币 265,000,000	美元 8,339,076	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	37,524
美元 7,196,106	巴西雷亚尔 39,500,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	339,748
	哥伦比亚比索			
美元 8,829,693	33,500,000,000	2026年4月22日	美国道富银行	279,897
美元 5,679,568	巴西雷亚尔 31,200,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	272,803
美元 30,297,640	离岸人民币 210,000,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	156,024
	哥伦比亚比索			
美元 7,142,781	26,800,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	144,890
美元 6,538,231	巴西雷亚尔 35,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	139,108
美元 12,974,651	离岸人民币 90,000,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	76,920
美元 14,798,222	离岸人民币 102,500,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	66,067
	哥伦比亚比索			
美元 7,694,450	28,500,000,000	2026年4月22日	美国道富银行	55,499
美元 6,882,577	欧元 6,000,000	2026年4月22日	法国巴黎银行	37,565
美元 46,382,754	离岸人民币 320,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	22,829
美元 7,224,326	日元 1,150,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	18,358
美元 2,094,680	离岸人民币 14,528,976	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	12,275
美元 7,140,577	欧元 6,200,000	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	10,237
美元 6,922,710	日元 1,100,000,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	5,074
美元 7,289,144	印尼盾 124,000,000,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	4,326
台币 700,000,000	美元 24,808,883	2026年4月30日	Citibank N.A., 伦敦	2,867,199
台币 200,000,000	美元 7,099,499	2026年4月30日	高盛国际, 伦敦	830,447
台币 115,000,000	美元 4,060,319	2026年4月30日	Citibank N.A., 伦敦	455,614
台币 60,000,000	美元 2,107,001	2026年4月30日	渣打银行, 伦敦	226,285
港元 200,000,000	美元 25,884,671	2026年5月15日	美国道富银行	312,555
港元 100,000,000	美元 12,954,408	2026年5月15日	法国巴黎银行	168,351
港元 47,000,000	美元 6,076,252	2026年5月15日	高盛国际, 伦敦	66,804
台币 155,000,000	美元 5,574,597	2026年5月20日	渣打银行, 伦敦	709,639
澳元 38,115	美元 26,088	2026年5月21日	Citibank N.A., 伦敦	1
美元 238,518	离岸人民币 1,641,598	2026年5月21日	巴克莱银行, 伦敦	14
印尼盾 100,000,000,000	美元 5,972,039	2026年8月31日	Citibank N.A., 伦敦	110,319
			未实现总收益	40,312,700
离岸人民币 12,003	美元 1,736	2026年4月1日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
离岸人民币 83,852	美元 12,124	2026年4月1日	Citibank N.A., 伦敦	(17)
美元 34	港元 270	2026年4月1日	美国道富银行	(0)
美元 9,772	港元 76,465	2026年4月1日	高盛国际, 伦敦	(19)
美元 143,505	澳元 207,621	2026年4月1日	巴克莱银行, 伦敦	(1,305)
离岸人民币 11,249	美元 1,627	2026年4月2日	高盛国际, 伦敦	(2)
离岸人民币 1,943,591	美元 281,084	2026年4月2日	巴克莱银行, 伦敦	(322)
美元 953	港元 7,463	2026年4月2日	高盛国际, 伦敦	(1)
美元 865,591	澳元 1,256,607	2026年4月2日	巴克莱银行, 伦敦	(4,941)
港元 489,474	美元 62,448	2026年4月8日	法国巴黎银行	(5)
美元 1,518	离岸人民币 10,483	2026年4月8日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
美元 1,095	澳元 1,597	2026年4月8日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
美元 4,405	港元 34,510	2026年4月8日	美国道富银行	(1)
美元 17,338	港元 135,809	2026年4月8日	Citibank N.A., 伦敦	(10)
美元 23,686	离岸人民币 163,499	2026年4月9日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
美元 68,203	纽元 119,534	2026年4月9日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
美元 160,839	离岸人民币 1,110,257	2026年4月9日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
美元 2,563	港元 20,076	2026年4月9日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
美元 144,047	港元 1,128,869	2026年4月9日	法国巴黎银行	(5)
美元 1,168,134	离岸人民币 8,063,340	2026年4月9日	法国巴黎银行	(25)
离岸人民币 7,593	美元 1,099	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
离岸人民币 7,593	美元 1,099	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
离岸人民币 24,359	美元 3,526	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(6)
离岸人民币 32,676	美元 4,731	2026年4月21日	法国巴黎银行	(7)
离岸人民币 55,477	美元 8,032	2026年4月21日	法国巴黎银行	(12)
离岸人民币 100,330	美元 14,529	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(19)
离岸人民币 82,431	美元 11,932	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(21)
离岸人民币 272,277	美元 39,428	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(53)
离岸人民币 309,878	美元 44,858	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(76)
离岸人民币 342,981	美元 49,658	2026年4月21日	法国巴黎银行	(76)
离岸人民币 440,449	美元 63,782	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(86)
离岸人民币 436,235	美元 63,160	2026年4月21日	法国巴黎银行	(97)
离岸人民币 649,916	美元 94,082	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(160)
离岸人民币 731,401	美元 105,867	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(191)

未实现收益/  
(亏损)  
美元

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
离岸人民币 1,566,335	美元 226,719	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(408)
离岸人民币 2,260,487	美元 327,350	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(434)
离岸人民币 2,052,875	美元 297,213	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(466)
离岸人民币 1,995,559	美元 288,851	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(517)
离岸人民币 2,936,768	美元 425,127	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(721)
离岸人民币 4,171,329	美元 604,059	2026年4月21日	高盛国际, 伦敦	(808)
离岸人民币 3,596,415	美元 520,685	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(816)
离岸人民币 3,425,004	美元 495,753	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(893)
离岸人民币 3,680,613	美元 532,757	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(954)
离岸人民币 6,865,646	美元 994,033	2026年4月21日	法国巴黎银行	(1,526)
离岸人民币 14,872,767	美元 2,153,757	2026年4月21日	高盛国际, 伦敦	(2,881)
离岸人民币 14,608,365	美元 2,114,943	2026年4月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(3,355)
离岸人民币 13,668,083	美元 1,978,408	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3,544)
美元 1,486	离岸人民币 10,238	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
美元 4,927	离岸人民币 33,963	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
美元 1,424	离岸人民币 9,804	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
美元 1,101	离岸人民币 7,573	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(3)
美元 1,282	离岸人民币 8,815	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
美元 3,890	澳元 5,675	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(4)
美元 2,340	离岸人民币 16,108	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(4)
美元 2,018	离岸人民币 13,890	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
美元 1,550	离岸人民币 10,663	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
美元 3,382	离岸人民币 23,277	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
美元 2,733	离岸人民币 18,800	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
美元 2,878	离岸人民币 19,802	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
美元 1,608	离岸人民币 11,036	2026年4月21日	法国巴黎银行	(7)
美元 2,285	离岸人民币 15,705	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(8)
美元 2,158	离岸人民币 14,828	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
美元 15,245	离岸人民币 105,055	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(11)
美元 1,455	英镑 1,094	2026年4月21日	法国巴黎银行	(13)
美元 6,924	离岸人民币 47,600	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(22)
美元 1,432	英镑 1,069	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(22)
美元 1,439	澳元 2,067	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(24)
美元 34,659	离岸人民币 238,845	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(25)
美元 4,820	澳元 6,998	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(28)
美元 1,649	纽元 2,837	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(29)
美元 1,183	加元 1,609	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(30)
美元 4,822	离岸人民币 33,035	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(31)
美元 14,674	离岸人民币 100,948	2026年4月21日	法国巴黎银行	(36)
美元 1,617	加元 2,198	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(40)
美元 2,095	加元 2,862	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(42)
美元 6,935	离岸人民币 47,514	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(45)
美元 19,194	离岸人民币 132,009	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(52)
美元 5,654	纽元 9,814	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(52)
美元 3,838	英镑 2,869	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(56)
美元 44,122	离岸人民币 303,811	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(67)
美元 21,384	离岸人民币 147,000	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(68)
美元 3,461	澳元 4,948	2026年4月21日	法国巴黎银行	(72)
美元 4,544	加元 6,232	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(75)
美元 31,508	离岸人民币 216,771	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(75)
美元 34,015	离岸人民币 233,990	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(86)
美元 15,898	离岸人民币 109,015	2026年4月21日	美林国际, 伦敦	(90)
美元 3,967	加元 5,375	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(112)
美元 17,627	离岸人民币 120,770	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(114)
美元 60,275	离岸人民币 414,651	2026年4月21日	法国巴黎银行	(148)
美元 4,204	纽元 7,094	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(155)
美元 96,115	离岸人民币 661,765	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(155)
美元 6,942	纽元 11,862	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(171)
美元 45,442	离岸人民币 312,190	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(173)
美元 206,309	离岸人民币 1,421,564	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(174)
美元 13,288	英镑 9,937	2026年4月21日	法国巴黎银行	(185)
美元 12,219	英镑 9,120	2026年4月21日	法国巴黎银行	(193)
美元 6,991	澳元 9,852	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(245)
美元 13,231	英镑 9,840	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(256)
美元 352,679	离岸人民币 2,430,124	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(297)
美元 12,807	纽元 21,905	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(303)
美元 12,044	纽元 20,505	2026年4月21日	法国巴黎银行	(339)
美元 57,860	离岸人民币 396,432	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(375)
美元 33,101	英镑 24,777	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(428)

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 241,268	离岸人民币 1,660,719	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(454)
美元 56,560	离岸人民币 386,843	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(465)
美元 125,480	英镑 94,786	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(489)
美元 3,603,816	离岸人民币 24,849,376	2026年4月21日	法国巴黎银行	(512)
美元 493,359	离岸人民币 3,398,730	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(523)
美元 65,275	英镑 49,068	2026年4月21日	法国巴黎银行	(571)
美元 51,516	英镑 38,614	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(597)
美元 65,949	英镑 49,505	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(669)
美元 201,703	离岸人民币 1,386,139	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(705)
美元 117,049	离岸人民币 801,966	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(759)
美元 742,091	离岸人民币 5,112,238	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(787)
美元 51,079	英镑 38,134	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(794)
美元 225,850	离岸人民币 1,551,604	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(859)
美元 76,111	英镑 57,049	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(883)
美元 30,711	加元 41,584	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(888)
美元 164,556	离岸人民币 1,128,409	2026年4月21日	法国巴黎银行	(931)
美元 232,187	离岸人民币 1,593,861	2026年4月21日	法国巴黎银行	(1,068)
美元 3,034,613	离岸人民币 20,919,736	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(1,129)
美元 359,466	离岸人民币 2,471,116	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,139)
美元 47,368	加元 64,420	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(1,169)
美元 137,617	澳元 199,148	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(1,254)
美元 79,546	英镑 59,369	2026年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,258)
美元 1,652,446	离岸人民币 11,386,139	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(1,390)
美元 115,834	英镑 86,757	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,431)
美元 114,704	纽元 198,376	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,463)
美元 52,961	澳元 75,198	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,470)
美元 199,918	英镑 150,301	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,722)
美元 47,756	纽元 80,430	2026年4月21日	法国巴黎银行	(1,844)
美元 334,784	离岸人民币 2,295,695	2026年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,894)
美元 728,452	离岸人民币 5,010,024	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,969)
美元 97,580	加元 133,255	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(2,014)
美元 41,707	纽元 69,379	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(2,103)
美元 275,103	加元 380,635	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(2,124)
美元 187,248	英镑 140,246	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(2,311)
美元 260,328	澳元 376,719	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(2,377)
美元 370,184	离岸人民币 2,536,343	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(2,399)
美元 188,623	加元 259,346	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2,629)
美元 82,212	纽元 139,412	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(2,631)
美元 144,956	加元 198,216	2026年4月21日	法国巴黎银行	(2,803)
美元 79,630	纽元 134,579	2026年4月21日	美林国际, 伦敦	(2,808)
美元 187,045	英镑 139,604	2026年4月21日	法国巴黎银行	(2,954)
美元 134,454	澳元 192,037	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(2,959)
美元 113,221	澳元 160,543	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3,292)
美元 598,604	离岸人民币 4,104,779	2026年4月21日	美林国际, 伦敦	(3,387)
美元 102,927	澳元 145,267	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3,457)
美元 181,545	加元 248,292	2026年4月21日	法国巴黎银行	(3,479)
美元 233,185	加元 319,802	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(3,834)
美元 116,635	纽元 196,791	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(4,299)
美元 139,316	澳元 197,044	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(4,393)
美元 500,525	英镑 376,238	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(4,396)
美元 135,949	纽元 230,219	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(4,531)
美元 184,088	加元 249,956	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(4,828)
美元 172,350	澳元 241,172	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(7,212)
美元 266,125	澳元 377,866	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(7,388)
美元 195,716	澳元 273,810	2026年4月21日	美林国际, 伦敦	(8,230)
美元 340,018	纽元 578,712	2026年4月21日	法国巴黎银行	(9,667)
美元 489,924	加元 666,288	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(12,086)
美元 958,706	英镑 717,625	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(12,403)
美元 2,194,019	离岸人民币 15,044,941	2026年4月21日	美林国际, 伦敦	(12,415)
美元 543,173	加元 737,543	2026年4月21日	法国巴黎银行	(14,233)
美元 106,966,734	离岸人民币 737,567,185	2026年4月21日	法国巴黎银行	(15,185)
美元 552,511	澳元 782,977	2026年4月21日	法国巴黎银行	(16,381)
美元 750,753	纽元 1,277,786	2026年4月21日	Citibank N.A., 伦敦	(21,345)
美元 7,218,823	离岸人民币 49,608,904	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(25,242)
美元 184,805,493	离岸人民币 1,274,288,393	2026年4月21日	法国巴黎银行	(26,235)
美元 1,698,630	加元 2,323,500	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(32,297)
美元 1,090,361	澳元 1,545,176	2026年4月21日	法国巴黎银行	(32,328)
美元 729,697,927	离岸人民币 5,031,482,466	2026年4月21日	法国巴黎银行	(103,588)

未实现收益/  
(亏损)  
美元

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
美元 24,571,200	英镑 18,429,355	2026年4月21日	美国道富银行	(269,146)
美元 25,368,316	纽元 43,119,957	2026年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(753,849)
美元 57,960,171	加元 79,014,058	2026年4月21日	渣打银行, 伦敦	(1,294,044)
美元 60,700,473	澳元 86,611,794	2026年4月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,394,519)
澳元 8,343,029	美元 5,599,933	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(112,748)
澳元 11,000,000	美元 7,361,402	2026年4月22日	美国道富银行	(170,573)
澳元 34,800,000	美元 23,357,363	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(471,067)
巴西雷亚尔 38,700,000	美元 7,173,497	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(209,732)
巴西雷亚尔 40,000,000	美元 7,259,396	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(371,848)
巴西雷亚尔 42,200,000	美元 7,639,461	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(411,502)
离岸人民币 60,000,000	美元 8,695,148	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(5,899)
离岸人民币 100,000,000	美元 14,490,654	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(11,091)
离岸人民币 100,000,000	美元 14,484,995	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(16,750)
离岸人民币 110,000,000	美元 15,924,194	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(27,725)
离岸人民币 100,000,000	美元 14,473,879	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(27,866)
离岸人民币 100,000,000	美元 14,473,841	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(27,904)
离岸人民币 190,000,000	美元 27,522,674	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(30,641)
离岸人民币 300,000,000	美元 43,468,811	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(36,423)
离岸人民币 180,000,000	美元 26,060,982	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(42,158)
离岸人民币 200,000,000	美元 28,945,956	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(57,533)
离岸人民币 50,000,000	美元 7,188,349	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(62,523)
离岸人民币 200,000,000	美元 28,882,243	2026年4月22日	美国道富银行	(121,246)
哥伦比亚比索 32,700,000,000	美元 8,777,932	2026年4月22日	美国道富银行	(114,115)
哥伦比亚比索 25,500,000,000	美元 6,794,474	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(139,691)
哥伦比亚比索 29,700,000,000	美元 7,892,618	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(183,645)
欧元 12,500,000	美元 14,412,360	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(4,603)
印尼盾 125,000,000,000	美元 7,349,439	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(2,848)
墨西哥比索 527,000,000	美元 29,126,554	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(34,564)
秘鲁新索尔 50,000,000	美元 14,279,187	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(29,405)
泰铢 247,000,000	美元 7,489,864	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(12,004)
台币 450,000,000	美元 14,093,815	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(3,162)
台币 450,000,000	美元 14,075,696	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(21,280)
台币 230,000,000	美元 7,179,916	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(25,205)
台币 460,000,000	美元 14,316,303	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(93,939)
美元 14,881,325	台币 475,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(1,184)
美元 88,438	韩元 130,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(3,512)
美元 14,109,370	台币 450,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(12,393)
美元 9,471,317	欧元 8,200,000	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(13,789)
美元 7,264,793	离岸人民币 50,000,000	2026年4月22日	美国道富银行	(13,921)
美元 8,146,014	印尼盾 138,000,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(29,089)
美元 14,126,999	台币 450,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(30,022)
美元 13,729,102	澳元 20,000,000	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(34,602)
美元 6,868,300	泰铢 225,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(34,614)
美元 8,352,311	日元 1,320,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(38,969)
美元 15,926,573	印尼盾 270,000,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(45,631)
美元 14,555,405	离岸人民币 100,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(53,660)
美元 28,334,786	离岸人民币 195,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(56,384)
美元 6,732,496	马来西亚林吉特 27,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(59,837)
美元 34,574,429	离岸人民币 238,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(60,277)
美元 7,638,414	印度卢比 720,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(63,129)
美元 29,076,022	离岸人民币 200,000,000	2026年4月22日	法国巴黎银行	(72,533)
美元 6,658,344	菲律宾比索 400,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(80,681)
美元 43,590,079	离岸人民币 300,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(84,845)
美元 7,143,452	印尼盾 120,000,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(85,256)
美元 11,047,746	欧元 9,500,000	2026年4月22日	法国巴黎银行	(90,854)
美元 14,804,638	印尼盾 250,000,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(100,063)
美元 15,317,909	新加坡元 19,600,000	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(102,975)
美元 15,242,005	纽元 26,500,000	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(114,242)
美元 8,574,259	台币 270,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(116,074)
美元 6,763,861	墨西哥比索 120,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(123,758)
美元 7,706,469	墨西哥比索 137,000,000	2026年4月22日	美国道富银行	(125,685)
美元 29,788,502	马来西亚林吉特 120,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(132,240)
美元 12,321,108	新加坡元 15,700,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(133,636)
美元 14,886,560	新加坡元 19,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(137,390)
美元 14,267,057	新加坡元 18,200,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(138,904)
美元 13,726,147	新加坡元 17,500,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(141,384)
美元 7,185,144	墨西哥比索 127,232,628	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(144,830)

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 6,722,576	菲律宾比索 400,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(144,913)
美元 7,550,842	菲律宾比索 450,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(150,971)
美元 7,347,260	澳元 10,500,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(157,647)
美元 25,404,588	港元 197,700,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(158,692)
美元 14,287,419	新加坡元 18,200,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(159,266)
美元 6,895,809	印度卢比 640,000,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(162,222)
美元 7,356,479	澳元 10,500,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(166,866)
美元 7,353,285	韩元 11,000,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(167,296)
美元 14,878,656	印尼盾 250,000,000	2026年4月22日	美国道富银行	(174,080)
美元 66,157,761	离岸人民币 455,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(174,822)
美元 7,734,525	日元 1,200,000,000	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(176,942)
美元 6,710,013	韩元 10,000,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(177,296)
美元 47,649,560	英镑 36,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(177,872)
美元 7,694,469	韩元 11,500,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(181,844)
美元 10,453,658	澳元 15,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(182,783)
美元 7,341,068	印度卢比 680,100,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(185,579)
美元 14,308,199	印尼盾 240,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(191,806)
美元 14,943,862	新加坡元 19,000,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(194,691)
美元 9,593,952	台币 300,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(195,968)
美元 7,389,596	澳元 10,500,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(199,983)
美元 7,573,677	印度卢比 700,000,000	2026年4月22日	美国道富银行	(208,817)
美元 7,369,620	印度卢比 680,000,000	2026年4月22日	美国道富银行	(215,184)
美元 7,265,157	印度卢比 670,000,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(215,933)
美元 6,294,672	韩元 9,300,000,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(219,245)
美元 5,187,288	韩元 7,600,000,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(222,423)
美元 10,741,720	墨西哥比索 190,000,000	2026年4月22日	美国道富银行	(228,223)
美元 7,089,111	韩元 10,500,000,000	2026年4月22日	美国道富银行	(229,758)
美元 7,630,429	菲律宾比索 450,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(230,558)
美元 9,004,896	马来西亚林吉特 35,500,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(231,585)
美元 7,228,709	印度卢比 665,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(232,091)
美元 8,885,955	马来西亚林吉特 35,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(236,212)
美元 36,500,272	离岸人民币 250,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(245,910)
美元 20,610,384	台币 650,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(248,085)
美元 32,668,901	新加坡元 41,761,897	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(250,303)
美元 7,167,396	墨西哥比索 125,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(250,622)
美元 7,098,729	秘鲁新索尔 23,900,000	2026年4月22日	美国道富银行	(259,222)
美元 14,998,341	台币 470,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(274,832)
美元 28,609,679	新加坡元 36,500,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(275,746)
美元 8,933,558	欧元 7,500,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(283,380)
美元 5,751,423	泰铢 180,000,000	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(284,475)
美元 29,021,178	新加坡元 37,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(299,109)
美元 7,487,323	韩元 11,000,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(301,333)
美元 15,182,461	台币 475,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(302,320)
美元 13,903,987	马来西亚林吉特 55,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(311,533)
美元 7,498,398	韩元 11,000,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(312,409)
美元 7,743,741	澳元 13,000,000	2026年4月22日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	(322,574)
美元 14,745,102	台币 460,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(334,860)
美元 15,084,609	新加坡元 19,000,000	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(335,438)
美元 6,871,719	韩元 10,000,000,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(339,001)
美元 14,727,119	澳元 21,000,000	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(347,894)
美元 5,816,678	泰铢 180,000,000	2026年4月22日	法国巴黎银行	(349,729)
美元 22,283,981	台币 700,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(355,351)
美元 7,230,758	韩元 10,500,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(371,404)
美元 14,758,635	墨西哥比索 260,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(371,746)
美元 14,051,745	印度卢比 1,300,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(374,146)
美元 11,332,398	澳元 16,000,000	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(376,798)
美元 8,981,115	纽元 15,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(418,230)
美元 15,845,895	纽元 27,000,000	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(432,702)
美元 7,502,081	韩元 10,800,000,000	2026年4月22日	美国道富银行	(446,746)
美元 14,534,884	马来西亚林吉特 57,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(448,159)
美元 14,529,627	澳元 12,200,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(458,671)
美元 14,869,392	澳元 21,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(490,167)
美元 7,680,384	韩元 11,000,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(494,395)
美元 7,702,865	韩元 11,000,000,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(516,876)
美元 28,859,527	新加坡元 36,500,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(525,593)
美元 15,794,347	印度卢比 1,450,000,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(538,564)
美元 30,044,870	新加坡元 38,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(546,528)
美元 14,631,026	韩元 21,500,000,000	2026年4月22日	美林国际, 伦敦	(585,683)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 14,688,829	马来西亚林吉特 57,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(602,104)
美元 14,294,762	印度卢比 1,300,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(617,164)
美元 29,346,493	新加坡元 37,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(624,424)
美元 14,956,178	秘鲁新索尔 50,000,000	2026年4月22日	渣打银行, 伦敦	(647,587)
美元 14,336,925	印度卢比 1,300,000,000	2026年4月22日	美国道富银行	(659,327)
美元 14,417,631	韩元 21,000,000,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(698,924)
美元 22,713,102	秘鲁新索尔 76,500,000	2026年4月22日	高盛国际, 伦敦	(820,957)
美元 33,813,733	马来西亚林吉特 133,500,000	2026年4月22日	法国巴黎银行	(821,142)
美元 21,397,148	菲律宾比索 1,250,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(841,951)
美元 37,941,062	墨西哥比索 670,000,000	2026年4月22日	Citibank N.A., 伦敦	(867,154)
美元 36,438,161	欧元 30,500,000	2026年4月22日	法国巴黎银行	(1,260,772)
美元 30,440,681	纽元 50,800,000	2026年4月22日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,441,044)
美元 7,066,414	台币 200,000,000	2026年4月30日	渣打银行, 伦敦	(797,361)
美元 8,014,217	台币 230,000,000	2026年4月30日	高盛国际, 伦敦	(804,806)
美元 7,109,999	台币 200,000,000	2026年4月30日	渣打银行, 伦敦	(840,946)
美元 7,992,640	台币 225,000,000	2026年4月30日	渣打银行, 伦敦	(939,956)
美元 7,862,928	台币 220,000,000	2026年4月30日	Citibank N.A., 伦敦	(966,970)
美元 6,070,757	港元 47,000,000	2026年5月15日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(61,310)
美元 12,919,838	港元 100,000,000	2026年5月15日	法国巴黎银行	(133,781)
美元 25,834,987	港元 200,000,000	2026年5月15日	高盛国际, 伦敦	(262,871)
美元 2,738,046	台币 75,000,000	2026年5月20日	Citibank N.A., 伦敦	(384,034)
美元 2,910,319	台币 80,000,000	2026年5月20日	渣打银行, 伦敦	(399,372)
离岸人民币 10,483	美元 1,523	2026年5月21日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
离岸人民币 7,610	美元 1,106	2026年5月21日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
离岸人民币 163,499	美元 23,752	2026年5月21日	巴克莱银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 1,110,257	美元 161,289	2026年5月21日	巴克莱银行, 伦敦	(36)
离岸人民币 2,899,473	美元 421,238	2026年5月21日	Citibank N.A., 伦敦	(68)
纽元 119,534	美元 68,299	2026年5月21日	巴克莱银行, 伦敦	(9)
美元 1,535	加元 2,137	2026年5月21日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
美元 3,001,200	印尼盾 50,000,000,000	2026年8月31日	高盛国际, 伦敦	(70,340)
美元 3,008,967	印尼盾 50,000,000,000	2026年8月31日	高盛国际, 伦敦	(78,107)
			未实现总亏损	(44,829,337)
			未实现净亏损	(4,516,637)

(c) 期货

以下为于二零二六年三月三十一日之未平仓期货合约:

于 2026年3月31日	标的资产	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
Euro-Bund Future 08/06/2026	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10年期债务工具	Citigroup Global Markets Ltd	187,233
US 10Yr Ultra Fut 18/06/2026	10年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	128,953
		未实现总收益	316,186
Aust 10Yr Bond Fut 15/06/2026	10年期澳大利亚国债	Citigroup Global Markets Ltd	(379,073)
Long Gilt Future 26/06/2026	10年期英国国债	Citigroup Global Markets Ltd	(2,367,343)
US 10Yr Note (CBT) 18/06/2026	10年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	(1,536,563)
US 5Yr Note (CBT) 30/06/2026	5年期美国国债	Citigroup Global Markets Ltd	(538,288)
		未实现总亏损	(4,821,267)
		未实现净收益	(4,505,081)

(d) 利率掉期

以下为于二零二六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 美元
<u>于 2026 年 3 月 31 日</u>			
(D) Interest Rate Swap ~619~ 259 120,000,000.00 MYR 18/06/2026 18/06/2031	MYR/KLIBOR/3M/ABM	Citigroup Global Markets Ltd	69,168
(D) Interest Rate Swap ~619~ 268 122,000,000.00 MYR 18/06/2026 18/06/2031	MYR/KLIBOR/3M/ABM	Citigroup Global Markets Ltd	21,407
(D) Interest Rate Swap ~619~ 275 60,000,000.00 MYR 18/06/2026 18/06/2036	MYR/KLIBOR/3M/ABM	Citigroup Global Markets Ltd	15,593
(D) Interest Rate Swap ~619~ 277 23,000,000.00 SGD 02/04/2026 17/06/2031	SGD/SORA/1D/Reuters	Citigroup Global Markets Ltd	7,273
(D) Interest Rate Swap ~619~ 278 12,000,000.00 SGD 02/04/2026 17/06/2036	SGD/SORA/1D/Reuters	Citigroup Global Markets Ltd	21,493
		金融资产总额	<u>134,934</u>
(D) Interest Rate Swap ~619~ 251 203,040,000.00 BRL 10/03/2026 02/01/2030	BRL/CDI/1D/BCB	Citigroup Global Markets Ltd	(775,506)
(D) Interest Rate Swap ~619~ 253 147,978,620,000.00 COP 17/06/2026 17/06/2031	COP/OIS/1D/BBA	Citigroup Global Markets Ltd	(350,894)
(D) Interest Rate Swap ~619~ 263 883,000,000.00 MXN 18/03/2026 11/06/2031	MXN/FTIIE/1D/BBA	Citigroup Global Markets Ltd	(495,544)
		金融负债总额	<u>(1,621,944)</u>
		金融资产净额	<u>(1,487,010)</u>

**抵押品持有情况**

于二零二六年三月三十一日 (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 百分比	抵押品价值 美元
Citibank N.A., 伦敦	现金	不适用	美元	0.1	1,621,009
				<u>0.1</u>	<u>1,621,009</u>

**现金抵押品再投资详情**

截至二零二六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**

现金抵押品的托管机构	收到/持有的抵押品 金额 31.3.2026 美元	计划下提供的抵押品 所占比例 31.3.2026 百分比
<b>隔离账户</b> 香港上海汇丰银行有限公司	<u>1,621,009</u>	<u>100.0</u>

财务状况表

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

综合收益表

截至二零二六年三月三十一日止期间 (未经审计)

	31.3.2026 美元	30.9.2025 美元		1.10.2025 至 31.3.2026 美元	1.10.2024 至 31.3.2025 美元
<b>资产</b>					
<b>流动资产</b>			<b>收入</b>		
银行现金	22,950,973	50,441,938	投资及衍生性产品净收益 / (亏损) [附注 4]	29,360,049	(17,618,721)
现金抵押品	1,621,009	9,168,061	股息收入	1,540,498	1,377,575
应收经纪款项	41,130,232	60,447,848	存款利息	772,449	524,865
分配应收款项	3,041,610	40,580,837	汇兑净亏损	(1,653,215)	(2,392,370)
保证金	31,479,751	21,376,765	其他收入	3,734	92,487
衍生性产品	41,475,478	24,372,548			
投资	2,685,987,399	2,887,124,411			
股息及其他应收款项	34,984	149,022			
				30,023,515	(18,016,164)
<b>总资产</b>	<u>2,827,721,436</u>	<u>3,093,661,430</u>			
			<b>支出</b>		
<b>负债</b>			管理费用 [附注 5(a)]	13,622,610	11,075,586
<b>流动负债</b>			托管费用及银行费用 [附注 5(a), 5(b)]		
应付经纪款项	28,754,909	95,413,753	受托人费用 [附注 5(b)]	453,525	409,755
赎回应付款项	36,950,218	11,798,241	交易成本 [附注 5(b)]	381,929	307,424
应付收益分配 [附注 6]	5,752,932	5,704,569	基金注册登记机构费用 [附注 5(a)]	133,632	111,376
衍生性产品	51,277,021	27,360,457	核数师酬金	114,737	69,796
其他应付款项	2,789,262	3,085,770	法律及专业费用	19,702	29,878
			估值费用 [附注 5(a)]	17,190	18,513
<b>总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)</b>	<u>125,524,342</u>	<u>143,362,790</u>	印刷及出版支出	8,470	8,540
			其他经营费用	6,174	4,142
				15,964	5,983
<b>可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]</b>	<u>2,702,197,094</u>	<u>2,950,298,640</u>		14,773,933	12,040,993
			<b>净经营利润 / (亏损)</b>	<u>15,249,582</u>	<u>(30,057,157)</u>
			<b>财务成本</b>		
			收益分配 [附注 6]	(34,668,068)	(28,117,360)
			利息支出 [附注 5(b)]	(3,721)	(85,445)
				(34,671,789)	(28,202,805)
			<b>除税前亏损</b>	(19,422,207)	(58,259,962)
			税项	(38,001)	(414,009)
			<b>可赎回份额持有人应占净资产及总综合亏损之减少</b>	<u>(19,460,208)</u>	<u>(58,673,971)</u>

可赎回份额持有人应占净资产变动表

截至二零二六年三月三十一日止期间(未经审计)

	1.10.2025 至 31.3.2026 美元	1.10.2024 至 31.3.2025 美元
期初可赎回份额持有人应占净资产	2,950,298,640	1,661,058,597
分配可赎回份额 [附注 3]	1,079,199,271	2,147,542,259
赎回可赎回份额 [附注 3]	(1,307,840,609)	(491,285,633)
净(赎回) / 分配	(228,641,338)	1,656,256,626
	2,721,657,302	3,317,315,223
可赎回份额持有人应占净资产及总综合亏损之减少	(19,460,208)	(58,673,971)
期末可赎回份额持有人应占净资产	2,702,197,094	3,258,641,252

现金流量表

截至二零二六年三月三十一日止期间(未经审计)

	1.10.2025 至 31.3.2026 美元	1.10.2024 至 31.3.2025 美元
<b>经营业务</b>		
购入投资及衍生性产品	(3,659,600,350)	(4,415,576,824)
出售投资及衍生性产品所得款项	3,849,685,817	2,817,595,974
现金抵押品之减少 / (增加)	7,547,052	(1,534,802)
已收股息	1,540,498	1,377,575
已收利息	774,449	524,865
已付税项	(38,001)	(414,009)
已付交易成本	(137,436)	(115,840)
已付基金注册登记机构费用	(208,654)	(132,470)
已付受托人费用	(382,440)	(273,474)
保证金之(增加) / 减少	(10,102,986)	10,312,163
已付管理费用	(13,684,184)	(9,904,831)
其他	(2,477,049)	(2,446,350)
<b>经营业务所产生 / (运用) 之现金净额</b>	<b>172,914,716</b>	<b>(1,600,588,023)</b>
<b>融资活动</b>		
已付利息	(3,721)	(85,445)
分配可赎回份额所得款项	1,116,738,498	2,127,911,717
赎回可赎回份额付款	(1,282,688,632)	(486,105,556)
已付收益分配	(34,619,705)	(27,967,320)
<b>融资活动所(运用) / 产生之现金净额</b>	<b>(200,573,560)</b>	<b>1,613,753,396</b>
<b>现金及现金等价物之(减少) / 增加</b>	<b>(27,658,844)</b>	<b>13,165,373</b>
期初现金及现金等价物	50,441,938	24,866,024
现金及现金等价物之汇兑收益 / (亏损)	167,879	(389,076)
<b>期末现金及现金等价物</b>	<b>22,950,973</b>	<b>37,642,321</b>
<b>现金及现金等价物余额分析:</b>		
银行现金	22,950,973	37,642,321

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) 中期财务报表的重要会计政策

编制本未经审计简明中期财务报表所使用的重要会计政策和计算方法与截至二零二五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）

1.10.2025 to 31.3.2026

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (资息月派) 份额	港元类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
期初	14,057,471.871	11,239,739.232	2,078,193.531	848,249.956	259,345,868.531
总分配 总赎回	3,289,630.532 (4,200,850.807)	3,078,248.934 (1,550,090.322)	1,368,558.663 (563,671.968)	1,428,657.432 (615,268.962)	121,726,847.956 (71,928,083.221)
期末	13,146,251.596	12,767,897.844	2,883,080.226	1,661,638.426	309,144,633.266

	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲份额 (累计) 份额	PRC 人民币对冲份额 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
期初	7,043,537.689	604,727,740.810	97,527,654.870	260,080,519.340	116,507,192.070
总分配 总赎回	2,511,741.962 (2,514,550.539)	83,124,679.620 (385,230,913.220)	27,461,081.980 (43,933,234.320)	264,281,125.600 (169,617,134.570)	19,217,172.710 (36,520,746.190)
期末	7,040,729.112	302,621,507.210	81,055,502.530	354,744,510.370	99,203,618.590

1.10.2025 至 31.3.2026

	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	10,299,372.140	12,204,937.210	1,413,016.206	208,223,028.911	3,048,662.830
总分配 总赎回	2,320,379.640 (2,787,416.680)	2,992,707.810 (3,060,164.510)	1,584,089.969 (858,118.814)	20,156,018.622 (30,911,800.697)	4,425,619.684 (336,609.376)
期末	9,832,335.100	12,137,480.510	2,138,987.361	197,467,246.836	7,137,673.138

	美元类别 (股息月派) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 X 类别 (累计) 份额
已发行份额数目:			
期初	87,051.805	33,079,071.822	22,828,246.203
总分配 总赎回	113,940.827 (10,770.883)	13,207,940.187 (14,327,219.606)	1,947,446.000 (1,610,561.000)
期末	190,221.749	31,959,792.403	23,165,131.203

1.10.2024 至 31.3.2025

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (股息月派) 份额	港元类别 (每月派息) 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 总赎回	2,330,744.523 (2,154,365.508)	391,882.324 (686,714.726)	455,098.896 (230,753.131)	294,339.690 -	22,786,383.736 (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 (每月派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲份额 (累计) 份额	PRC 人民币对冲份额 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
期初	6,898,060.544	-	-	281,981,370.720	130,298,367.030
总分配 总赎回	1,674,570.871 (1,288,013.612)	1,155,895,419.470 (76,589,241.030)	29,156,750.760 (25,819.490)	95,926,952.280 (94,724,141.770)	16,391,814.120 (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 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	8,855,711.320	5,990,036.480	2,386,652.658	243,997,365.988	976,461.685
总分配	1,605,533.570	2,879,728.500	387,866.718	6,919,230.173	207,114.462
总赎回	(1,483,073.490)	(828,072.810)	(1,683,171.934)	(34,434,242.727)	(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 (资息月派) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 X 类别 (累计) 份额
已发行份额数目:			
期初	-	35,278,106.631	-
总分配	100.398	3,713,136.306	18,947,592.203
总赎回	-	(10,573,687.520)	-
期末	100.398	28,417,555.417	18,947,592.203

31.3.2026

	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	英镑对冲类别 (每月派息) 英镑	港元类别 (资息月派) 港元	港元类别 (每月派息) 港元
可赎回份额持有人 应占净资产	79,842,414	78,896,568	18,581,054	16,158,544	2,054,652,177

可赎回份额持有人 应占净资产 (每份额)	6.07	6.18	6.44	9.72	6.65
----------------------------	------	------	------	------	------

	纽元对冲类别 (每月派息) 纽元	PRC 人民币份额 (累计) 人民币	PRC 人民币份额 (每月派息) 人民币	PRC 人民币对冲份额 (累计) 人民币	PRC 人民币对冲份额 (每月派息) 人民币
可赎回份额持有人 应占净资产	42,598,589	3,108,748,337	759,182,856	4,455,462,646	678,136,181

可赎回份额持有人 应占净资产 (每份额)	6.05	10.27	9.37	12.56	6.84
----------------------------	------	-------	------	-------	------

31.3.2026

	PRC 美元份额 (累计) 美元	PRC 美元份额 (每月派息) 美元	人民币对冲类别 (累计) 人民币	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	美元类别 (累计) 美元
可赎回份额持有人 应占净资产	117,373,885	83,552,355	28,020,286	1,249,373,466	95,463,205
可赎回份额持有人 应占净资产 (每 份额)	11.94	6.88	13.10	6.33	13.37
	美元类别 (股息月派) 美元	美元类别 (每月派息) 美元	美元 X 类别 (累计) 美元		
可赎回份额持有人 应占净资产	1,836,794	241,633,173	249,934,758		
可赎回份额持有人 应占净资产 (每份额)	9.66	7.56	10.79		

30.9.2025

	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	英镑对冲类别 (每月派息) 英镑	港元类别 (股息月派) 港元	港元类别 (每月派息) 港元
可赎回份额持有人 应占净资产	88,391,555	71,834,145	13,855,426	8,544,838	1,770,065,346
可赎回份额持有人 应占净资产 (每份额)	6.29	6.39	6.67	10.07	6.83
	纽元对冲类别 (每月派息) 纽元	PRC 人民币份额 (累计) 人民币	PRC 人民币份额 (每月派息) 人民币	PRC 人民币对冲份额 (累计) 人民币	PRC 人民币对冲份额 (每月派息) 人民币
可赎回份额持有人 应占净资产	44,064,574	6,418,166,975	975,618,545	3,309,774,435	824,105,349
可赎回份额持有人 应占净资产 (每份额)	6.26	10.61	10.00	12.73	7.07

30.9.2025

	PRC 美元份额 (累计) 美元	PRC 美元份额 (每月派息) 美元	人民币对冲类别 (累计) 人民币	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	美元类别 (累计) 美元
可赎回份额持有人 应占净资产	123,131,391	86,947,116	18,772,637	1,363,050,841	40,830,052
可赎回份额持有人 应占净资产 (每份额)	11.96	7.12	13.29	6.55	13.39
	美元类别 (股息月派) 美元	美元类别 (每月派息) 美元	美元 X 类别 (累计) 美元		
可赎回份额持有人 应占净资产	877,617	258,791,109	245,424,296		
可赎回份额持有人 应占净资产 (每份额)	10.08	7.82	10.75		

4 投资及衍生性产品净收益 / (亏损)

	1.10.2025 至 31.3.2026 美元	1.10.2024 至 31.3.2025 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益 / 亏损之变动	(94,265,864)	(28,110,106)
投资及衍生性产品销售之实现收益	123,625,913	10,491,385
	29,360,049	(17,618,721)

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) 截至二零二六年及二零二五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：

	1.10.2025 至 31.3.2026 美元	1.10.2024 至 31.3.2025 美元
管理费用	13,622,610	11,075,586
基金注册登记机构费用	114,737	69,796
托管费用及银行费用	9,405	11,384
估值费用	8,470	8,540

(b) 截至二零二六年及二零二五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：

	1.10.2025	1.10.2024
	至	至
	31.3.2026	31.3.2025
	美元	美元
受托人费用	381,929	307,424
托管费用及银行费用	278,761	314,667
交易成本	23,764	21,101
利息支出	3,721	85,445

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>1.10.2025 至 31.3.2026</u>					
澳元对冲类别 (每月派息)	2025 年 10 月 31 日	2025 年 11 月 10 日	澳元 0.0313	14,023,927.103	(287,358)
加元对冲类别 (每月派息)	2025 年 10 月 31 日	2025 年 11 月 10 日	加元 0.0250	11,856,415.183	(211,548)
英镑对冲类别 (每月派息)	2025 年 10 月 31 日	2025 年 11 月 10 日	英镑 0.0353	2,207,096.009	(102,363)
港元类别 (利息月派)	2025 年 10 月 31 日	2025 年 11 月 10 日	港元 0.0710	983,521.206	(8,985)
港元类别 (每月派息)	2025 年 10 月 31 日	2025 年 11 月 10 日	港元 0.0371	279,958,989.555	(1,336,363)
纽元对冲类别 (每月派息)	2025 年 10 月 31 日	2025 年 11 月 10 日	纽元 0.0259	6,998,948.152	(103,806)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2025 年 10 月 31 日	2025 年 11 月 10 日	人民币 0.0544	103,192,826.140	(788,190)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2025 年 10 月 31 日	2025 年 11 月 10 日	人民币 0.0225	117,645,056.250	(371,654)
PRC 美元份额 (每月派息)	2025 年 10 月 31 日	2025 年 11 月 10 日	美元 0.0387	12,695,063.820	(491,299)
人民币对冲类别 (每月派息)	2025 年 10 月 31 日	2025 年 11 月 10 日	人民币 0.0207	201,558,591.375	(585,807)
美元类别 (利息月派)	2025 年 10 月 31 日	2025 年 11 月 10 日	美元 0.0711	175,119.612	(12,451)
美元类别 (每月派息)	2025 年 10 月 31 日	2025 年 11 月 10 日	美元 0.0425	35,063,461.360	(1,490,195)
澳元对冲类别 (每月派息)	2025 年 11 月 28 日	2025 年 12 月 8 日	澳元 0.0320	14,640,600.258	(307,242)
加元对冲类别 (每月派息)	2025 年 11 月 28 日	2025 年 12 月 8 日	加元 0.0249	11,700,624.390	(208,992)
英镑对冲类别 (每月派息)	2025 年 11 月 28 日	2025 年 12 月 8 日	英镑 0.0361	2,371,835.277	(113,451)
港元类别 (利息月派)	2025 年 11 月 28 日	2025 年 12 月 8 日	港元 0.0703	934,889.369	(8,442)
港元类别 (每月派息)	2025 年 11 月 28 日	2025 年 12 月 8 日	港元 0.0371	283,982,906.536	(1,353,237)
纽元对冲类别 (每月派息)	2025 年 11 月 28 日	2025 年 12 月 8 日	纽元 0.0259	7,196,373.555	(106,995)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2025 年 11 月 28 日	2025 年 12 月 8 日	人民币 0.0543	111,038,478.120	(852,940)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2025 年 11 月 28 日	2025 年 12 月 8 日	人民币 0.0240	118,076,765.880	(400,886)
PRC 美元份额 (每月派息)	2025 年 11 月 28 日	2025 年 12 月 8 日	美元 0.0387	13,115,145.240	(507,556)
人民币对冲类别 (每月派息)	2025 年 11 月 28 日	2025 年 12 月 8 日	人民币 0.0221	201,700,750.047	(630,588)
美元类别 (利息月派)	2025 年 11 月 28 日	2025 年 12 月 8 日	美元 0.0703	188,874.419	(13,278)
美元类别 (每月派息)	2025 年 11 月 28 日	2025 年 12 月 8 日	美元 0.0425	31,627,586.518	(1,344,170)
澳元对冲类别 (每月派息)	2025 年 12 月 31 日	2026 年 1 月 9 日	澳元 0.0329	14,266,901.729	(313,007)
加元对冲类别 (每月派息)	2025 年 12 月 31 日	2026 年 1 月 9 日	加元 0.0245	11,573,943.760	(206,866)
英镑对冲类别 (每月派息)	2025 年 12 月 31 日	2026 年 1 月 9 日	英镑 0.0364	2,425,710.734	(118,762)
港元类别 (利息月派)	2025 年 12 月 31 日	2026 年 1 月 9 日	港元 0.0690	1,054,395.848	(9,347)
港元类别 (每月派息)	2025 年 12 月 31 日	2026 年 1 月 9 日	港元 0.0371	275,726,326.129	(1,314,248)
纽元对冲类别 (每月派息)	2025 年 12 月 31 日	2026 年 1 月 9 日	纽元 0.0256	6,932,687.538	(102,058)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2025 年 12 月 31 日	2026 年 1 月 9 日	人民币 0.0536	108,723,359.270	(834,902)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2025 年 12 月 31 日	2026 年 1 月 9 日	人民币 0.0238	113,153,596.120	(385,827)
PRC 美元份额 (每月派息)	2025 年 12 月 31 日	2026 年 1 月 9 日	美元 0.0387	12,923,218.110	(500,129)
人民币对冲类别 (每月派息)	2025 年 12 月 31 日	2026 年 1 月 9 日	人民币 0.0220	201,051,844.422	(633,692)
美元类别 (利息月派)	2025 年 12 月 31 日	2026 年 1 月 9 日	美元 0.0691	188,743.588	(13,042)
美元类别 (每月派息)	2025 年 12 月 31 日	2026 年 1 月 9 日	美元 0.0425	29,569,635.892	(1,256,707)
澳元对冲类别 (每月派息)	2026 年 1 月 30 日	2026 年 2 月 9 日	澳元 0.0335	13,738,477.294	(322,420)
加元对冲类别 (每月派息)	2026 年 1 月 30 日	2026 年 2 月 9 日	加元 0.0257	12,166,144.878	(230,897)
英镑对冲类别 (每月派息)	2026 年 1 月 30 日	2026 年 2 月 9 日	英镑 0.0365	2,488,186.419	(124,626)
港元类别 (利息月派)	2026 年 1 月 30 日	2026 年 2 月 9 日	港元 0.0692	1,313,000.035	(11,634)
港元类别 (每月派息)	2026 年 1 月 30 日	2026 年 2 月 9 日	港元 0.0371	291,626,313.705	(1,385,371)
纽元对冲类别 (每月派息)	2026 年 1 月 30 日	2026 年 2 月 9 日	纽元 0.0262	7,139,050.742	(113,133)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2026 年 1 月 30 日	2026 年 2 月 9 日	人民币 0.0530	97,816,460.300	(745,799)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2026 年 1 月 30 日	2026 年 2 月 9 日	人民币 0.0252	106,694,265.240	(386,790)
PRC 美元份额 (每月派息)	2026 年 1 月 30 日	2026 年 2 月 9 日	美元 0.0387	12,828,873.830	(496,477)
人民币对冲类别 (每月派息)	2026 年 1 月 30 日	2026 年 2 月 9 日	人民币 0.0233	196,404,163.131	(658,325)
美元类别 (利息月派)	2026 年 1 月 30 日	2026 年 2 月 9 日	美元 0.0690	189,638.039	(13,085)
美元类别 (每月派息)	2026 年 1 月 30 日	2026 年 2 月 9 日	美元 0.0425	29,503,200.303	(1,253,884)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
澳元对冲类别 (每月派息)	2026年2月27日	2026年3月9日	澳元 0.0346	13,725,446.182	(338,438)
加元对冲类别 (每月派息)	2026年2月27日	2026年3月9日	加元 0.0269	12,348,594.926	(243,558)
英镑对冲类别 (每月派息)	2026年2月27日	2026年3月9日	英镑 0.0365	2,754,960.112	(135,192)
港元类别 (资息月派)	2026年2月27日	2026年3月9日	港元 0.0687	1,518,939.781	(13,340)
港元类别 (每月派息)	2026年2月27日	2026年3月9日	港元 0.0373	294,720,040.584	(1,405,375)
纽元对冲类别 (每月派息)	2026年2月27日	2026年3月9日	纽元 0.0272	6,876,876.663	(112,240)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2026年2月27日	2026年3月9日	人民币 0.0527	91,097,639.520	(699,740)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2026年2月27日	2026年3月9日	人民币 0.0262	104,319,412.690	(398,369)
PRC 美元份额 (每月派息)	2026年2月27日	2026年3月9日	美元 0.0387	12,791,493.240	(495,031)
人民币对冲类别 (每月派息)	2026年2月27日	2026年3月9日	人民币 0.0242	194,734,318.349	(686,873)
美元类别 (资息月派)	2026年2月27日	2026年3月9日	美元 0.0685	199,608.945	(13,673)
美元类别 (每月派息)	2026年2月27日	2026年3月9日	美元 0.0425	30,693,760.998	(1,304,483)
澳元对冲类别 (每月派息)	2026年3月31日	2026年4月13日	澳元 0.0353	13,152,750.788	(317,994)
加元对冲类别 (每月派息)	2026年3月31日	2026年4月13日	加元 0.0265	12,767,736.483	(242,446)
英镑对冲类别 (每月派息)	2026年3月31日	2026年4月13日	英镑 0.0361	2,883,080.226	(137,249)
港元类别 (资息月派)	2026年3月31日	2026年4月13日	港元 0.0670	1,661,638.426	(14,200)
港元类别 (每月派息)	2026年3月31日	2026年4月13日	港元 0.0373	309,242,176.655	(1,471,229)
纽元对冲类别 (每月派息)	2026年3月31日	2026年4月13日	纽元 0.0269	7,060,729.112	(108,347)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2026年3月31日	2026年4月13日	人民币 0.0526	81,154,533.400	(618,056)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2026年3月31日	2026年4月13日	人民币 0.0245	99,366,466.160	(352,481)
PRC 美元份额 (每月派息)	2026年3月31日	2026年4月13日	美元 0.0387	12,159,208.630	(470,561)
人民币对冲类别 (每月派息)	2026年3月31日	2026年4月13日	人民币 0.0226	197,236,418.249	(645,394)
美元类别 (资息月派)	2026年3月31日	2026年4月13日	美元 0.0666	190,221.749	(12,669)
美元类别 (每月派息)	2026年3月31日	2026年4月13日	美元 0.0425	32,054,254.462	(1,362,306)
可赎回份额持有人之总收益分配					(34,668,068)

1.10.2024 至 31.3.2025

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

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
澳元对冲类别 (每月派息)	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 (资息月派)	2025年2月28日	2025年3月10日	港元 0.0706	775.663	(7)
港元类别 (每月派息)	2025年2月28日	2025年3月10日	港元 0.0383	207,129,538.861	(1,020,132)
纽元对冲类别 (每月派息)	2025年2月28日	2025年3月10日	纽元 0.0331	7,156,723.544	(132,740)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2025年2月28日	2025年3月10日	人民币 0.0575	9,551,871.710	(75,314)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2025年2月28日	2025年3月10日	人民币 0.0292	116,214,708.500	(465,334)
PRC 美元份额 (每月派息)	2025年2月28日	2025年3月10日	美元 0.0400	6,639,783.900	(265,591)
人民币对冲类别 (每月派息)	2025年2月28日	2025年3月10日	人民币 0.0270	220,852,441.390	(817,686)
美元类别 (资息月派)	2025年2月28日	2025年3月10日	美元 0.0707	99.701	(7)
美元类别 (每月派息)	2025年2月28日	2025年3月10日	美元 0.0440	28,731,892.413	(1,264,201)
澳元对冲类别 (每月派息)	2025年3月31日	2025年4月9日	澳元 0.0339	13,618,006.571	(287,677)
加元对冲类别 (每月派息)	2025年3月31日	2025年4月9日	加元 0.0271	10,722,844.471	(201,903)
英镑对冲类别 (每月派息)	2025年3月31日	2025年4月9日	英镑 0.0380	1,518,947.147	(74,502)
港元类别 (资息月派)	2025年3月31日	2025年4月9日	港元 0.0706	294,339.690	(2,671)
港元类别 (每月派息)	2025年3月31日	2025年4月9日	港元 0.0383	207,666,514.460	(1,022,278)
纽元对冲类别 (每月派息)	2025年3月31日	2025年4月9日	纽元 0.0317	7,222,540.548	(129,668)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2025年3月31日	2025年4月9日	人民币 0.0574	28,060,836.570	(221,678)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2025年3月31日	2025年4月9日	人民币 0.0245	114,281,731.770	(385,348)
PRC 美元份额 (每月派息)	2025年3月31日	2025年4月9日	美元 0.0401	7,960,786.420	(319,228)
人民币对冲类别 (每月派息)	2025年3月31日	2025年4月9日	人民币 0.0227	216,895,418.959	(677,621)
美元类别 (资息月派)	2025年3月31日	2025年4月9日	美元 0.0708	100.398	(7)
美元类别 (每月派息)	2025年3月31日	2025年4月9日	美元 0.0440	28,751,102.829	(1,265,047)
可赎回份额持有人之总收益分配					(28,117,360)

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  
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**

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

