

仅供中国内地公众查阅



年度报告 — 2024年9月30日（经审核）

摩根亚洲股息基金

内地与香港互认基金系列

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

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

内容	页
投资组合 - 未经审计	1 - 2
投资组合持有变动表 - 未经审计	2
金融衍生工具详情 - 未经审计	3
金融衍生工具风险敞口信息 - 未经审计	3
财务状况表	4
综合收益表	4
可赎回份额持有人应占净资产变动表	5
现金流量表	5
财务报表之附注	6 - 40
独立核数师报告	41 - 42
管理人及受托人的责任声明	43
受托人对份额持有人的报告	43
业绩纪录 - 未经审计	44 - 45
经营与管理	46

投资组合
于二零二四年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
上市投资 (100.1%)				香港交易及结算所有限公司	497,735	20,902,627	2.0
(I) 股票 (99.6%)				汇丰控股有限公司	1,684,800	15,280,870	1.4
				领展房地产投资信托基金	2,227,400	11,255,288	1.1
澳大利亚 (19.3%)				印度 (12.0%)			
ANZ Banking Group Ltd	850,684	17,988,139	1.7	Embassy Office Parks REIT	1,030,500	4,794,705	0.5
BHP Group Ltd	425,462	13,565,749	1.3	HDFC Bank Limited	1,493,253	30,863,369	2.9
Brambles Ltd	980,352	12,942,668	1.2	ICICI Bank Ltd	1,185,920	18,014,960	1.7
GPT Group	2,007,146	6,934,439	0.7	Infosys Technologies Ltd			
Insurance Australia Group Limited	2,102,646	10,736,110	1.0	Sponsored ADR	1,110,400	24,728,608	2.4
Macquarie Group Ltd	73,584	11,862,233	1.1	ITC Ltd	2,110,297	13,048,139	1.2
Medibank Private Ltd	5,695,870	14,423,011	1.4	Maruti Suzuki India Ltd	115,700	18,277,014	1.7
National Australia Bank Ltd	225,499	5,843,031	0.5	Tata Consultancy Services Ltd	121,834	6,205,736	0.6
QBE Insurance Group Limited	612,072	7,023,297	0.7	Tata Steel Ltd	5,446,279	10,954,136	1.0
RIO Tinto PLC	248,296	17,648,417	1.7	印度尼西亚 (4.4%)			
Santos Ltd	4,400,305	21,430,035	2.0	Bank Central Asia	25,907,600	17,668,162	1.7
Telstra Corporation Limited	10,467,394	28,175,608	2.7	Bank Mandiri Persero	26,389,600	12,070,540	1.2
Transurban Group	1,584,044	14,428,958	1.4	Bank Rakyat Indonesia Persero	7,062,300	2,309,008	0.2
Vicinity Centres REIT	9,998,558	15,329,664	1.5	Telkom Indonesia Persero	71,541,700	14,128,777	1.3
Woodside Energy Group Ltd	249,233	4,357,216	0.4	韩国 (9.2%)			
中国 (22.8%)				BGF Retail Co Ltd	62,526	5,484,233	0.5
阿里巴巴集团控股有限公司	1,720,500	24,364,982	2.3	Hana Financial Holdings	346,694	15,588,902	1.5
中国建设银行股份有限公司 H 股	14,099,000	10,672,948	1.0	Hyundai Motor Co Ltd Pref	41,579	5,576,934	0.5
中国招商银行股份有限公司 H 股	3,006,000	14,918,738	1.4	Samsung Electronics Co Ltd	975,414	45,872,877	4.4
中国太平洋保险 (集团) 股份有限公司 H 股	3,741,000	13,485,420	1.3	Samsung Electronics Co Ltd Preference Shares	393,280	15,307,756	1.5
华润置地有限公司	2,980,700	12,030,247	1.1	Shinhan Financial Group Company Limited	62,550	2,654,680	0.2
中国长江电力股份有限公司 A 股 (C1)	2,541,250	10,911,328	1.0	SK Telecom Company Limited	138,380	5,915,303	0.6
福耀玻璃工业集团股份有限公司 A 股 (C1)	367,060	3,052,430	0.3	新加坡 (5.7%)			
福耀玻璃工业集团股份有限公司 H 股	2,929,200	19,703,985	1.9	DBS Group Holdings Ltd	683,613	20,289,762	1.9
华住集团有限公司 ADR	155,693	5,791,780	0.6	Singapore Exchange Limited	2,620,000	23,338,845	2.2
海尔智家股份有限公司 H 股	3,998,201	16,059,720	1.5	Singapore Telecommunications Ltd	4,365,100	11,031,922	1.1
顾家家居股份有限公司 A 股 (C1)	1,006,499	4,468,279	0.4	United Overseas Bank Ltd	196,700	4,935,912	0.5
美的集团股份有限公司 A 股 (C2)	1,466,264	15,935,079	1.5	台湾 (15.6%)			
美的集团股份有限公司 H 股	99,100	947,303	0.1	智邦科技股份有限公司	723,000	12,154,140	1.2
国电南瑞科技股份有限公司 A 股 (C1)	1,467,540	5,802,095	0.6	研华股份有限公司	339,929	3,453,373	0.3
网易股份有限公司	947,700	18,362,259	1.7	亿丰综合工业股份有限公司	521,000	8,396,189	0.8
腾讯控股有限公司	1,112,000	63,649,205	6.1	谱瑞科技股份有限公司	263,000	6,324,333	0.6
香港 (10.6%)				广达电脑股份有限公司	813,000	6,782,172	0.6
友邦保险控股有限公司	3,664,600	32,859,915	3.1	瑞昱半导体股份有限公司	1,160,000	17,264,468	1.6
长江基建集团有限公司	912,000	6,246,334	0.6	台湾大哥大股份有限公司	1,409,000	5,120,155	0.5
中电控股有限公司	2,217,000	19,651,169	1.9	台湾积体电路制造股份有限公司	3,270,000	98,885,817	9.4
香港电讯信托与香港电讯有限公司	4,335,000	5,553,042	0.5				

金融衍生工具详情
于二零二四年九月三十日 (未经审计)

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

金融衍生工具风险敞口信息
截至二零二四年九月三十日止年度 (未经审计)

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

2024
占资产净值百分比

最低总敞口	-
最高总敞口	-
平均总敞口	-

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

2024
占资产净值百分比

最低净敞口	-
最高净敞口	-
平均净敞口	-

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

财务状况表
于二零二四年九月三十日

	2024 美元	2023 美元
资产		
流动资产		
银行现金	18,303,097	5,886,918
应收经纪款项	1,585,970	5,238,868
分配应收款项	12,106,419	1,592,323
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 11]	5,956,560	3,200,060
投资 [附注 4(l)(a)]	1,047,843,133	1,082,459,138
股息及其他应收款项	2,871,834	1,736,837
总资产	1,088,667,013	1,100,114,144
负债		
流动负债		
短期银行借款 - 无抵押 [附注 9]	1,300,000	3,200,000
应付经纪款项	13,009,495	-
赎回应付款项	15,540,179	4,682,883
应付收益分配 [附注 6]	2,754,282	4,084,324
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 11]	382,648	1,721,638
应付税项 [附注 7]	2,195,267	-
其他应付款项	1,435,726	1,402,251
总负债 (不含可赎回份额持有人 应占净资产)	36,617,597	15,091,096
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	1,052,049,416	1,085,023,048

由受托人及管理人于二零二五年一月二十四日批准

签署人:

汇丰机构信托服务 (亚洲) 有限公司, 受托人

摩根基金 (亚洲) 有限公司, 管理人

综合收益表
截至二零二四年九月三十日止年度

	2024 美元	2023 美元
收入		
投资及衍生性产品净收益 [附注 5]	220,018,513	127,989,738
股息收入 [附注 8(a)]	37,363,408	48,640,703
存款利息 [附注 8(i), 8(j)]	108,112	114,845
汇兑净亏损	(627,707)	(74,864)
其他收入	49,240	28
	256,911,566	176,670,450
支出		
管理费用 [附注 8(e)]	14,619,729	17,869,251
交易成本 [附注 8(i), 8(j)]	1,616,711	1,283,080
托管费用及银行费用 [附注 8(i), 8(j)]	561,472	448,661
受托人费用 [附注 8(g)]	274,466	330,148
基金注册登记机构费用 [附注 8(h)]	249,696	217,288
核数师酬金	61,983	24,737
法律及专业费用	26,327	33,465
估值费用 [附注 8(e)]	17,080	17,010
印刷及出版支出	7,600	7,059
其他经营费用	10,589	8,717
	17,445,653	20,239,416
净经营利润	239,465,913	156,431,034
财务成本		
收益分配 [附注 6]	(34,318,570)	(44,045,533)
利息支出 [附注 8(j)]	(114,290)	(67,333)
	(34,432,860)	(44,112,866)
除税前利润	205,033,053	112,318,168
税项 [附注 7]	(5,927,581)	(4,110,531)
可赎回份额持有人应占净资产 及总综合收益之增加	199,105,472	108,207,637

第六至四十页之附注乃属本财务报表之一部分。

可赎回份额持有人应占净资产变动表
截至二零二四年九月三十日止年度

现金流量表
截至二零二四年九月三十日止年度

	2024 美元	2023 美元		2024 美元	2023 美元
年初可赎回份额持有人应占净资产	1,085,023,048	1,192,541,458	经营业务		
分配可赎回份额 [附注 3]	347,505,730	414,342,223	购入投资及衍生性产品	(577,137,140)	(376,672,137)
赎回可赎回份额 [附注 3]	(579,584,834)	(630,068,270)	出售投资及衍生性产品所得款项	844,337,364	594,937,569
净赎回	(232,079,104)	(215,726,047)	已收股息	37,525,873	48,207,139
	852,943,944	976,815,411	已收利息	107,988	114,843
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加	199,105,472	108,207,637	已付基金注册登记机构费用	(225,051)	(213,722)
			已付受托人费用	(275,599)	(335,066)
年末可赎回份额持有人应占净资产	1,052,049,416	1,085,023,048	已付交易成本	(1,612,496)	(1,283,284)
			已付税项	(3,732,314)	(4,110,531)
			已付管理费用	(14,665,203)	(18,129,767)
			其它	(3,108,174)	(670,037)
			经营业务所产生之现金净额	281,215,248	241,845,007
			融资活动		
			已付利息	(114,290)	(67,333)
			分配可赎回份额所得款项	336,991,634	414,647,743
			赎回可赎回份额付款	(568,727,538)	(634,008,288)
			已付收益分配	(35,648,612)	(45,571,917)
			融资活动所运用之现金净额	(267,498,806)	(264,999,795)
			现金及现金等价物之增加/ (减少)	13,716,442	(23,154,788)
			年初现金及现金等价物余额	2,686,918	25,815,350
			现金及现金等价物之汇兑收益	599,737	26,356
			年末现金及现金等价物	17,003,097	2,686,918
			现金及现金等价物余额分析:		
			银行现金	18,303,097	5,886,918
			短期银行借款 - 无抵押	(1,300,000)	(3,200,000)
				17,003,097	2,686,918

第六至四十页之附注乃属本财务报表之一部分。

财务报表之附注

1 本基金

摩根亚洲股息基金（“本基金”）根据二零一一年五月六日的信托契约（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。

本基金的投资目标为通过主要投资（即至少为资产净值总额的 70%）于亚太区（日本除外）内的、投资管理人预期会派发股息的公司股票，以提供收益及长期资本增长。

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

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

2 重要会计政策

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

(a) 财务报表之编制基础

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

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

于二零二三年十月一日生效的新准则及对现有准则的修订

本基金于二零二三年十月一日开始的财政年度首次采纳以下准则和修订：

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

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

于二零二三年十月一日后生效且并未提早采纳的新准则、对准则的修订和解释

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

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公平值为负数的衍生性产品合约列示为按公平值透过损益列账的负债。

当预期某一借入证券的市值将会下跌时，本基金出售该证券进行卖空，或通过卖空进行套汇交易。卖空被分类为按公平值透过损益列账的金融负债。

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。

确认、取消确认及计量

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

公允价值估计

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

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

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

公允价值级次分层间的转拨

在公允价值级次分层之间的转拨视为于报告期间开始时已发生。

结构性主体

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

(c) 金融工具抵销

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

(d) 收入及支出

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

银行现金及短期存款利息收入乃按实际利息法在综合收益表确认。

支出乃按应计基准在综合收益表确认。

(e) 交易成本

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

(f) 外币交易

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

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

(g) 现金及现金等价物

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

(h) 应收/应付经纪款项

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

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

(i) 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。

(j) 应付可赎回份额持有人的收益分配

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

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

2024

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	18,668,628.267	7,129,849.925	1,876,213.986	5,375,874.707	1,592,778.198
总分配 总赎回	4,081,618.312 (9,662,874.701)	1,064,445.154 (3,951,986.928)	229,104.447 (1,016,519.562)	782,230.007 (2,955,819.855)	116,405.327 (652,045.677)
年末	13,087,371.878	4,242,308.151	1,088,798.871	3,202,284.859	1,057,137.848
	澳元	加元	欧元	英镑	港元
可赎回份额持有人应占净资产	120,369,763	40,955,854	11,017,196	31,775,385	18,142,343
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	9.20	9.65	10.12	9.92	17.16
	港元类别 (每月派息) 份额	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
已发行份额数目:					
年初	210,188,512.688	5,357,054.288	1,179,706.490	2,055,696.020	4,909,576.790
总分配 总赎回	48,136,398.488 (116,184,252.109)	1,724,226.709 (2,515,455.618)	15,600,316.190 (3,432,727.480)	36,573,225.490 (4,977,947.470)	9,428,838.610 (3,184,260.340)
年末	142,140,659.067	4,565,825.379	13,347,295.200	33,650,974.040	11,154,155.060
	港元	纽元	人民币	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占净资产	1,461,539,883	42,961,423	182,312,726	361,177,704	145,006,167
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	10.28	9.41	13.66	10.73	13.00

2024

	PRC 人民币对冲份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	9,791,594.140	1,198,075.420	1,244,852.250	1,556,954.695	139,332,098.316
总分配 总赎回	16,902,847.500 (6,899,355.840)	552,296.790 (629,161.650)	1,138,922.830 (512,033.190)	1,304,281.476 (799,032.314)	11,345,403.577 (49,695,147.453)
年末	19,795,085.800	1,121,210.560	1,871,741.890	2,062,203.857	100,982,354.440
	人民币	美元	美元	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	200,486,668	14,683,349	19,294,877	40,402,462	1,059,588,613
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	10.13	13.10	10.31	19.59	10.49
	新加坡元对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每季派息) 份额	美元 C 类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	767,961.479	524,804.307	32,514,811.126	7,530,185.266	2,982,849.433
总分配 总赎回	86,006.584 (160,922.084)	42,220.916 (159,672.382)	8,668,863.457 (17,681,441.356)	64,611.161 (2,537,537.818)	391,747.362 (459,990.290)
年末	693,045.979	407,352.841	23,502,233.227	5,057,258.609	2,914,606.505
	新加坡元	美元	美元	美元	美元
可赎回份额持有人应占净 资产	6,820,316	7,008,760	241,599,859	61,267,181	32,110,026
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	9.84	17.21	10.28	12.11	11.02

2023

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	18,800,354.440	8,137,233.985	2,073,545.880	6,538,371.597	1,826,163.397
总分配 总赎回	9,714,225.151 (9,845,951.324)	2,571,458.341 (3,578,842.401)	524,844.777 (722,176.671)	1,419,913.634 (2,582,410.524)	225,364.869 (458,750.068)
年末	18,668,628.267	7,129,849.925	1,876,213.986	5,375,874.707	1,592,778.198

	澳元	加元	欧元	英镑	港元
可赎回份额持有人应占净 资产	145,075,588	57,931,310	15,973,298	45,072,406	22,192,592
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	7.77	8.13	8.51	8.38	13.93

	港元类别 (每月派息) 份额	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
已发行份额数目:					
年初	252,217,197.977	6,002,090.910	1,641,903.580	1,619,251.500	4,794,050.670
总分配 总赎回	89,905,894.515 (131,934,579.804)	2,353,461.402 (2,998,498.024)	418,711.260 (880,908.350)	894,724.880 (458,280.360)	1,152,295.970 (1,036,769.850)
年末	210,188,512.688	5,357,054.288	1,179,706.490	2,055,696.020	4,909,576.790

	港元	纽元	人民币	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	1,829,727,869	42,604,365	13,504,313	19,301,686	52,732,738
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	8.71	7.95	11.45	9.39	10.74

2023

	PRC 人民币对冲份额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	9,381,425.700	1,612,352.910	1,455,296.520	1,476,611.835	174,930,187.137
总分配	2,071,184.340	53,471.510	82,701.240	335,427.522	47,670,846.334
总赎回	(1,661,015.900)	(467,749.000)	(293,145.510)	(255,084.662)	(83,268,935.155)
年末	9,791,594.140	1,198,075.420	1,244,852.250	1,556,954.695	139,332,098.316
	人民币	美元	美元	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	83,344,001	12,650,318	10,784,066	25,214,077	1,228,111,258
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	8.51	10.56	8.66	16.19	8.81
	新加坡元对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每季派息) 份额	美元 C 类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	780,393.257	695,109.240	42,137,386.759	8,698,239.647	2,313,938.405
总分配	152,173.107	192,145.439	13,641,035.234	180,334.278	862,511.028
总赎回	(164,604.885)	(362,450.372)	(23,263,610.867)	(1,348,388.659)	(193,600.000)
年末	767,961.479	524,804.307	32,514,811.126	7,530,185.266	2,982,849.433
	新加坡元	美元	美元	美元	美元
可赎回份额持有人应占净 资产	6,357,122	7,274,089	280,663,732	75,937,626	27,387,343
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	8.28	13.86	8.63	10.08	9.18

4 财务风险管理

(I) 财务风险因素

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

本基金于集体投资计划中持有的单位数目占集体投资计划的净资产值总额的百分比将根据集体投资计划的分配与赎回数量随时变化。本基金有可能会在任何时点持有集体投资计划的大多数已发行的份额。本基金在被投资基金中的权益所面临的最大损失风险敞口等于其对集体投资计划投资的公平值总额。截至二零二四年九月三十日止年度，对集体投资计划的购买总额为93,370,000美元（二零二三年：无）。截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，投资集体投资计划未获得净收益或未产生净亏损。

(a) 市场风险

(i) 市场价格风险

本基金的投资及衍生性产品须面对在所有投资及衍生性产品中所固有的市场价格风险，即持有投资及衍生性产品的价值可升可跌。本基金的市场风险按照特定的投资限制及指南，通过以下方式管理：(i) 审慎的股票选择，及(ii) 分散的投资组合。

本基金的投资管理人主要通过本基金的 Beta 值定期监测本基金的市场价格敏感度。Beta 值计量基金回报与投资管理人选择的相关基准指数之间的统计关系。

于九月三十日，投资及衍生性产品之公平值及其估计市场敏感度如下：

	2024		2023*	
	投资之公平值 美元	占资产净值 百分比	投资之公平值 美元	占资产净值 百分比
上市投资				
资产				
股票				
- 中国	240,155,798	22.8	288,094,535	26.6
- 澳大利亚	202,688,575	19.3	166,254,321	15.3
- 台湾	164,179,235	15.6	163,828,463	15.1
- 印度	126,886,667	12.0	47,887,682	4.4
- 香港	111,749,245	10.6	76,510,391	7.0
- 韩国	96,400,685	9.2	151,261,676	13.9
- 新加坡	59,596,441	5.7	64,958,129	6.0
- 印度尼西亚	46,176,487	4.4	59,049,227	5.5
- 其他	-	-	64,614,714	6.0
	1,047,833,133	99.6	1,082,459,138	99.8
集体投资计划				
- 卢森堡	10,000	0.0	-	-
衍生性产品				
- 远期外汇合约	5,956,560	0.5	3,200,060	0.3
	1,053,799,693	100.1	1,085,659,198	100.1
负债				
衍生性产品				
- 远期外汇合约	(382,648)	(0.0)	(1,721,638)	(0.2)
总上市投资	1,053,417,045	100.1	1,083,937,560	99.9

* 比较数字已更新，以符合本年度之呈列或分类方式。

有关衍生性产品的风险亦请参阅附注 11。

	资产净值 美元	本基金相关基准指数 (注*)	Beta 值 (注**)	占相关基准指数之 合理变动百分比 (注***)	估计对资产净值 的影响 (注****) 美元
于二零二四年九月三十日	1,052,049,416	MSCI AC Asia Pacific ex Japan Net	0.85	+29.4	262,907,149
于二零二三年九月三十日	1,085,023,048	MSCI AC Asia Pacific ex Japan Net	0.90	+11.6	113,276,406

假定所有其他可能影响本基金资产净值的变量保持不变，若相关基准指数收益呈反方向波动，则将导致本基金的资产净值以相同金额呈反向变动。

注：

- * 本基金相关基准指数指投资管理人监测本基金市场价格风险时所使用的有关市场指数。
- ** Beta 值计量了在过去最长三十六个月期间或自组合启动后的数月期间，本基金回报与各基准指数之间的统计关系。对于推出期间少于十二个月内推出的基金，将采用本基金的每周回报计算 Beta 值。
- *** 合理变动百分比取决于过去十二个月的基准指数之实际历史变动，但不包括不大可能出现或“最恶劣”情况或“压力测试”下之变动，亦不代表投资管理人对本基金未来回报的预测。对于推出期间少于十二个月的基金，将采用自经营开始后基准指数之实际历史变动计算合理变动百分比。
- **** 假定所有其他变量保持不变，对本基金资产净值的估计影响按照本基金资产净值乘以相关 Beta 值再乘以相关基准指数之合理变动百分比计算。

(ii) 利率风险

利率风险指金融工具的价值或未来现金流量因市场利率变动而波动不定的风险。

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

	2024 1 个月以内 美元	2023 1 个月以内 美元
银行现金	18,303,097	5,886,918
短期银行借款 - 无抵押	(1,300,000)	(3,200,000)
总利率敏感性缺口	17,003,097	2,686,918

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

(iii) 汇兑风险

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

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

下表概述截至九月三十日本基金的汇兑风险承担、外币合理变动百分比以及对本基金资产净值的估计影响。

汇兑风险承担净值 (注*)	美元等值	与美元比较之合理变动百分比 (注**)	估计对资产净值的影响 美元
<u>2024</u>			
澳元	269,816,909	+7.5	20,236,268
加元	30,528,601	+0.1	30,529
人民币 (离岸)	254,224,051	+4.1	10,423,186
欧元	12,430,541	+5.4	671,249
港元	302,022,043	+0.8	2,416,176
印度卢比	100,235,016	-0.9	(902,115)
印尼盾	46,176,487	+2.1	969,706
韩元	96,522,569	+3.2	3,088,722
纽元	27,742,948	+5.9	1,636,834
新加坡元	65,147,912	+6.5	4,234,614
英镑	60,483,267	+9.9	5,987,843
台币	164,407,414	+2.0	3,288,148
	<u>1,429,737,758</u>		<u>52,081,160</u>
<u>2023</u>			
澳元	260,297,295	+0.4	1,041,189
加元	42,720,372	+1.6	683,526
人民币 (离岸)	303,266,449	-2.1	(6,368,595)
欧元	16,850,880	+8.1	1,364,921
港元	262,446,902	+0.2	524,894
印度卢比	20,118,930	-2.0	(402,379)
印尼盾	59,049,227	-1.5	(885,738)
韩元	151,261,676	+6.0	9,075,701
马来西亚林吉特	6,620,597	-1.2	(79,447)
纽元	25,754,068	+6.2	1,596,752
新加坡元	69,788,722	+5.1	3,559,225
英镑	76,180,837	+9.3	7,084,818
台币	164,909,246	-1.6	(2,638,548)
泰铢	25,397,651	+3.6	914,315
	<u>1,484,662,852</u>		<u>15,470,634</u>

假定影响本基金资产净值的其他变量保持不变，若外币呈反方向波动，则将导致本基金的资产净值以相同金额呈反向变动。

注：

* 资产及负债汇兑风险承担净值包括货币及非货币资产及负债。

** 合理变动百分比基于各货币于过去十二个月较本基金功能货币之实际历史变动，不包括不大可能出现或“最恶劣”情况或“压力测试”下之变动，也不代表投资管理人对本基金未来回报的预测。

(b) 信贷风险

信贷风险指交易对手无法于到期日支付全数金额的风险。

管理人会参考交易对手的违约历史及其信贷评级等因素进行信贷风险监控。由于过去 5 年内，本基金在分配应收款项、应收经纪款项或股息及其他应收款项等应收款项未发生历史违约，故管理人认为该等应收款项不存在重大信贷风险。总体而言，由于该等工具违约风险较低，且本基金交易对手均有足够能力在短期内履行其合同义务，故管理人认为违约概率近乎零。因此，未对十二个月内的预期信贷损失确认损失准备金。

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

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

下表概述本基金于九月三十日存放金融资产的银行／经纪／托管机构的信贷评级。

	2024 交易对手风险承担 美元	2023 交易对手风险承担 美元
银行结余		
标准普尔(AA)／穆迪(Aa)／惠誉(AA)	5,064,482	2,426,958
标准普尔(A)／穆迪(A)／惠誉(A)	13,238,615	3,459,960
经纪发行的衍生性产品		
标准普尔(AA)／穆迪(Aa)／惠誉(AA)	2,019,308	3,085,272
标准普尔(A)／穆迪(A)／惠誉(A)	3,937,252	114,788
托管机构的投资余额		
标准普尔(A)／穆迪(A)／惠誉(A)	1,047,843,133	1,082,459,138

(c) 流动性风险

本基金须面对份额每日赎回的风险，而其大多数投资资产均在活跃市场交易，并可随时出售。管理人亦可将任何一个交易日之赎回份额总数限制为本基金已发行份额的百分之十或更高。

在投资限制和指南的规限下，本基金有能力订立借款安排。

下表概述本基金的金融负债，按九月三十日距约定到期日的尚余期间分为有关期限组别。下表所载金额乃约定未折现现金流量。

	2024		2023	
	1 个月以内 美元	1 至 12 个月 美元	1 个月以内 美元	1 至 12 个月 美元
短期银行借款 - 无抵押	1,300,000	-	3,200,000	-
应付经纪款项	13,009,495	-	-	-
赎回应付款项	15,540,179	-	4,682,883	-
应付收益分配	2,754,282	-	4,084,324	-
衍生性产品	381,090	1,558	1,721,610	28
其他应付款项	1,435,726	-	1,402,251	-
可赎回份额持有人应占净资产	1,052,049,416	-	1,085,023,048	-
总金融负债	1,086,470,188	1,558	1,100,114,116	28

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

(d) 受总净额结算协议及类似协议规限的抵销与金额

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

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

下表按金融工具类型概述于九月三十日本基金受抵销和总净额结算协议及类似协议规限的金融资产及负债。

	财务状况表中 列示的经确认 金融资产总额 美元	受总净额结算协议及类似协议规限 的相关金额 金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	净额 美元
<u>2024</u>				
<u>资产</u>				
衍生性产品	3,562,935	(283,738)	-	3,279,197
<u>负债</u>				
衍生性产品	377,684	(283,738)	-	93,946
<u>2023</u>				
<u>资产</u>				
衍生性产品	3,199,503	(1,637,462)	-	1,562,041
<u>负债</u>				
衍生性产品	1,708,741	(1,637,462)	-	71,279

(II) 资本风险管理

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

为了维持资本结构，本基金的政策执行如下：

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

(III) 公允价值估计

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

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

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

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

	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总额 美元
上市投资				
<u>2024</u>				
<u>资产</u>				
股票	1,047,833,133	-	-	1,047,833,133
集体投资计划	10,000	-	-	10,000
衍生性产品	-	5,956,560	-	5,956,560
按公允价值透过损益列账的总金融资产	<u>1,047,843,133</u>	<u>5,956,560</u>	<u>-</u>	<u>1,053,799,693</u>
<u>负债</u>				
衍生性产品	-	382,648	-	382,648
按公允价值透过损益列账的总金融负债	<u>-</u>	<u>382,648</u>	<u>-</u>	<u>382,648</u>
<u>2023</u>				
<u>资产</u>				
股票	1,082,459,138	-	-	1,082,459,138
衍生性产品	-	3,200,060	-	3,200,060
按公允价值透过损益列账的总金融资产	<u>1,082,459,138</u>	<u>3,200,060</u>	<u>-</u>	<u>1,085,659,198</u>
<u>负债</u>				
衍生性产品	-	1,721,638	-	1,721,638
按公允价值透过损益列账的总金融负债	<u>-</u>	<u>1,721,638</u>	<u>-</u>	<u>1,721,638</u>

由于投资价值是基于活跃市场的报价，因此分类为第一层次，并包括活跃上市股票证券及集体投资计划。本基金没有调整这些工具的报价。

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

被分类为第三层次的投资，由于其交易次数疏落，故此有显著的不可观察输入值。

截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，公平值层次之间并无转拨

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

5 投资及衍生性产品净收益

	2024 美元	2023 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益/亏损之变动	194,153,858	163,673,593
投资及衍生性产品销售之实现收益/（亏损）	25,864,655	(35,683,855)
	220,018,513	127,989,738

6 收益分配

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

本年末未结转未分配收入（二零二三年：无）。

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
<u>2024</u>					
澳元对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	澳元 0.0201	17,866,955.532	(227,380)
加元对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	加元 0.0266	6,742,702.890	(129,196)
欧元对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	欧元 0.0207	1,799,288.084	(39,368)
英镑对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	英镑 0.0296	5,003,766.484	(179,726)
港元类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	港元 0.0323	205,670,064.609	(849,007)
纽元对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	纽元 0.0292	5,125,591.456	(87,054)
PRC 人民币份额（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	人民币 0.0351	2,117,091.230	(10,121)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	人民币 0.0232	9,674,826.360	(30,571)
PRC 美元份额（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	美元 0.0321	1,252,630.900	(40,209)
人民币对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	人民币 0.0240	137,287,229.554	(448,770)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	新加坡元 0.0194	700,673.447	(9,922)
美元类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	美元 0.0320	31,601,227.623	(1,011,238)
美元 C 类别（每月派息）	2023年10月31日	2023年11月8日	美元 0.0341	3,038,755.395	(103,622)
澳元对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	澳元 0.0210	17,801,833.560	(247,873)
加元对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	加元 0.0268	6,716,868.994	(132,767)
欧元对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	欧元 0.0207	1,751,744.541	(39,564)
英镑对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	英镑 0.0295	4,866,457.074	(181,740)
港元类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	港元 0.0321	201,712,079.136	(829,028)
纽元对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	纽元 0.0290	4,864,529.789	(87,133)
PRC 人民币份额（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	人民币 0.0341	2,241,068.230	(10,702)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	人民币 0.0147	9,449,025.570	(19,451)
PRC 美元份额（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	美元 0.0321	1,254,705.450	(40,276)
人民币对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	人民币 0.0152	132,890,222.356	(282,864)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	新加坡元 0.0192	706,356.040	(10,162)
美元类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	美元 0.0320	30,978,916.828	(991,324)
美元 C 类别（每月派息）	2023年11月30日	2023年12月8日	美元 0.0341	3,109,536.516	(106,035)
澳元对冲类别（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	澳元 0.0203	17,382,771.713	(240,781)
加元对冲类别（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	加元 0.0262	6,590,187.624	(130,944)
欧元对冲类别（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	欧元 0.0193	1,756,197.812	(37,441)
英镑对冲类别（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	英镑 0.0287	4,768,030.017	(174,446)
港元类别（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	港元 0.0321	193,886,844.692	(797,045)
纽元对冲类别（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	纽元 0.0284	4,915,885.993	(88,395)
PRC 人民币份额（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	人民币 0.0341	2,255,995.060	(10,804)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023年12月29日	2024年1月9日	人民币 0.0121	9,340,739.750	(15,873)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	美元 0.0321	1,232,844.530	(39,574)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	人民币 0.0125	131,010,555.887	(229,985)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	新加坡元 0.0193	702,552.275	(10,279)
美元类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	美元 0.0320	30,077,283.805	(962,472)
美元 C 类别 (每季派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	美元 0.1132	7,086,990.325	(802,247)
美元 C 类别 (每月派息)	2023 年 12 月 29 日	2024 年 1 月 9 日	美元 0.0341	3,149,528.610	(107,399)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	澳元 0.0206	16,575,627.545	(225,721)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	加元 0.0264	6,288,048.939	(124,250)
欧元对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	欧元 0.0204	1,621,318.073	(35,927)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	英镑 0.0294	4,573,033.220	(171,211)
港元类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	港元 0.0322	188,612,393.906	(776,912)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 14 日	纽元 0.0285	4,394,824.446	(77,099)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	人民币 0.0344	2,608,247.470	(12,507)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	人民币 0.0120	9,716,832.460	(16,254)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	美元 0.0321	1,243,996.080	(39,932)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	人民币 0.0124	126,711,455.342	(219,025)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	新加坡元 0.0191	697,980.540	(9,976)
美元类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	美元 0.0320	29,028,117.296	(928,899)
美元 C 类别 (每月派息)	2024 年 1 月 31 日	2024 年 2 月 8 日	美元 0.0341	3,066,336.593	(104,562)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	澳元 0.0212	16,252,760.841	(224,359)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	加元 0.0268	6,160,022.060	(121,715)
欧元对冲类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	欧元 0.0208	1,618,894.770	(36,439)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	英镑 0.0294	4,385,889.641	(163,109)
港元类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	港元 0.0322	180,376,943.828	(741,894)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	纽元 0.0293	4,340,276.720	(77,478)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	人民币 0.0344	2,660,484.970	(12,702)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	人民币 0.0154	9,860,761.130	(21,076)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	美元 0.0321	1,246,598.580	(40,016)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	人民币 0.0160	123,176,202.170	(273,525)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	新加坡元 0.0191	694,133.317	(9,860)
美元类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	美元 0.0320	27,903,689.110	(892,917)
美元 C 类别 (每月派息)	2024 年 2 月 29 日	2024 年 3 月 8 日	美元 0.0341	3,039,227.068	(103,638)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	澳元 0.0209	15,835,706.554	(215,922)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	加元 0.0262	6,080,302.122	(117,719)
欧元对冲类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	欧元 0.0202	1,549,270.627	(33,799)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	英镑 0.0292	4,293,007.739	(158,355)
港元类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	港元 0.0322	173,694,757.909	(714,624)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	纽元 0.0293	4,260,265.245	(74,664)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	人民币 0.0344	3,070,100.730	(14,546)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	人民币 0.0117	10,884,686.340	(17,540)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	美元 0.0321	1,256,901.760	(40,347)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	人民币 0.0121	120,841,141.705	(201,391)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 11 日	新加坡元 0.0184	694,196.643	(9,464)
美元类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	美元 0.0320	27,395,549.741	(876,656)
美元 C 类别 (每季派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	美元 0.1134	6,305,416.330	(715,034)
美元 C 类别 (每月派息)	2024 年 3 月 28 日	2024 年 4 月 10 日	美元 0.0342	3,039,414.437	(103,948)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	澳元 0.0216	16,036,473.241	(224,927)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	加元 0.0263	6,103,982.505	(116,850)
欧元对冲类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	欧元 0.0208	1,508,880.964	(33,558)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	英镑 0.0295	3,735,671.068	(137,989)
港元类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	港元 0.0323	169,592,150.850	(700,382)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	纽元 0.0292	3,992,187.759	(68,981)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	人民币 0.0346	4,487,780.270	(21,409)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	人民币 0.0218	11,972,500.070	(35,985)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	美元 0.0321	1,322,037.930	(42,437)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	人民币 0.0226	118,361,721.249	(368,812)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	新加坡元 0.0185	688,102.267	(9,334)
美元类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	美元 0.0320	26,799,857.074	(857,594)
美元 C 类别 (每月派息)	2024 年 4 月 30 日	2024 年 5 月 9 日	美元 0.0342	3,055,259.784	(104,490)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	澳元 0.0206	15,635,472.370	(214,206)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	加元 0.0257	5,613,516.931	(105,834)
欧元对冲类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	欧元 0.0195	1,316,537.942	(27,870)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	英镑 0.0294	3,678,803.598	(137,705)
港元类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	港元 0.0322	161,783,762.266	(665,883)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	纽元 0.0294	4,140,013.450	(74,783)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	人民币 0.0346	9,408,434.210	(44,790)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	人民币 0.0139	13,833,179.830	(26,456)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	美元 0.0321	1,505,184.070	(48,316)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	人民币 0.0144	114,475,822.771	(226,811)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2024 年 5 月 31 日	2024 年 6 月 11 日	新加坡元 0.0172	654,542.994	(8,329)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
美元类别 (每月派息)	2024年5月31日	2024年6月11日	美元 0.0320	26,964,034.120	(862,848)
美元 C 类别 (每月派息)	2024年5月31日	2024年6月11日	美元 0.0342	3,023,501.380	(103,404)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	澳元 0.0211	15,362,974.656	(216,489)
加元对冲类别 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	加元 0.0247	5,306,034.340	(95,779)
欧元对冲类别 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	欧元 0.0186	1,300,945.966	(25,934)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	英镑 0.0294	3,652,051.213	(135,727)
港元类别 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	港元 0.0322	161,388,085.913	(665,611)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	纽元 0.0293	4,118,316.631	(73,528)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	人民币 0.0347	14,979,469.890	(71,196)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	人民币 0.0075	15,402,907.010	(15,823)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	美元 0.0321	1,586,678.790	(50,932)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	人民币 0.0077	113,621,052.656	(119,833)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	新加坡元 0.0176	651,374.537	(8,459)
美元类别 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	美元 0.0320	26,869,398.038	(859,820)
美元 C 类别 (每季派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	美元 0.1135	5,548,301.775	(629,732)
美元 C 类别 (每月派息)	2024年6月28日	2024年7月9日	美元 0.0342	2,826,052.306	(96,651)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	澳元 0.0214	13,775,098.677	(192,496)
加元对冲类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	加元 0.0234	4,359,724.385	(73,848)
欧元对冲类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	欧元 0.0177	1,196,123.235	(22,909)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	英镑 0.0291	3,374,147.089	(126,117)
港元类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	港元 0.0322	156,570,614.380	(645,363)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	纽元 0.0293	4,797,805.309	(83,495)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	人民币 0.0348	22,772,897.630	(109,649)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	人民币 0.0111	16,689,080.930	(25,631)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	美元 0.0321	1,701,077.860	(54,605)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	人民币 0.0115	108,834,063.733	(173,168)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	新加坡元 0.0170	716,726.868	(9,109)
美元类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	美元 0.0320	25,870,493.715	(827,855)
美元 C 类别 (每月派息)	2024年7月31日	2024年8月8日	美元 0.0342	2,760,284.889	(94,402)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	澳元 0.0212	13,452,704.393	(193,506)
加元对冲类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	加元 0.0216	4,278,231.306	(68,566)
欧元对冲类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	欧元 0.0174	1,125,126.754	(21,670)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	英镑 0.0277	3,253,496.335	(118,442)
港元类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	港元 0.0321	150,026,312.709	(617,384)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	纽元 0.0285	4,757,058.151	(84,823)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	人民币 0.0340	27,454,532.710	(131,714)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	人民币 0.0038	17,348,978.350	(9,302)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	美元 0.0321	1,749,707.720	(56,166)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	人民币 0.0039	104,493,844.385	(57,503)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	新加坡元 0.0160	717,754.745	(8,810)
美元类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	美元 0.0320	24,298,627.426	(777,555)
美元 C 类别 (每月派息)	2024年8月30日	2024年9月9日	美元 0.0343	2,825,150.442	(96,903)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月10日	澳元 0.0225	13,137,642.179	(205,070)
加元对冲类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	加元 0.0217	4,249,227.936	(68,254)
欧元对冲类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	欧元 0.0179	1,097,686.610	(21,929)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	英镑 0.0288	3,215,382.876	(124,213)
港元类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	港元 0.0321	142,210,169.539	(587,698)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	纽元 0.0287	4,556,787.515	(83,208)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	人民币 0.0338	33,903,266.120	(163,736)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	人民币 0.0000	19,722,007.740	-
PRC 美元份额 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	美元 0.0321	1,854,720.970	(59,536)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	人民币 0.0000	101,312,561.631	-
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	新加坡元 0.0145	693,045.979	(7,839)
美元类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	美元 0.0320	23,681,839.166	(757,818)
美元 C 类别 (每季派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	美元 0.1137	5,057,258.609	(575,010)
美元 C 类别 (每月派息)	2024年9月30日	2024年10月9日	美元 0.0343	2,914,606.505	(99,971)
可赎回份额持有人的总收益分配					(34,318,570)

2023

澳元对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	澳元 0.0251	18,463,318.725	(296,340)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	加元 0.0306	7,909,448.549	(177,434)
欧元对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	欧元 0.0145	2,045,962.862	(29,321)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	英镑 0.0261	6,445,600.026	(193,692)
港元类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	港元 0.0323	246,653,513.371	(1,014,912)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	纽元 0.0287	6,214,253.895	(103,612)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	人民币 0.0346	1,623,749.510	(7,665)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年10月31日	2022年11月8日	人民币 0.0244	9,370,844.370	(31,193)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
PRC 美元份额 (每月派息)	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	美元 0.0321	1,438,435.520	(46,174)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	人民币 0.0252	170,345,100.135	(585,626)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	新加坡元 0.0297	780,715.619	(16,386)
美元类别 (每月派息)	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	美元 0.0320	40,946,758.048	(1,310,295)
美元 C 类别 (每月派息)	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	美元 0.0338	2,379,308.636	(80,421)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	澳元 0.0224	18,483,541.738	(277,277)
加元对冲类别 (每月派息)	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	加元 0.0292	8,056,147.650	(173,519)
欧元对冲类别 (每月派息)	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	欧元 0.0137	1,959,379.693	(27,639)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	英镑 0.0247	6,443,175.493	(189,527)
港元类别 (每月派息)	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	港元 0.0321	241,978,015.296	(995,131)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	纽元 0.0267	6,085,798.659	(100,923)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	人民币 0.0344	1,623,947.540	(7,886)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	人民币 0.0157	9,272,053.980	(20,551)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	美元 0.0321	1,398,710.940	(44,899)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	人民币 0.0163	168,553,207.795	(387,859)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	新加坡元 0.0289	781,414.011	(16,480)
美元类别 (每月派息)	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	美元 0.0320	39,472,909.470	(1,263,132)
美元 C 类别 (每月派息)	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	美元 0.0338	2,453,127.736	(82,916)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	澳元 0.0190	17,856,810.407	(230,082)
加元对冲类别 (每月派息)	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	加元 0.0268	8,048,955.657	(159,203)
欧元对冲类别 (每月派息)	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	欧元 0.0089	1,856,812.939	(17,637)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	英镑 0.0218	6,388,908.054	(167,537)
港元类别 (每月派息)	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	港元 0.0320	237,177,197.041	(972,417)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	纽元 0.0257	5,670,514.347	(92,168)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	人民币 0.0335	1,494,184.670	(7,235)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	人民币 0.0098	9,194,309.780	(13,023)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	美元 0.0321	1,397,712.620	(44,867)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	人民币 0.0101	166,176,360.639	(242,581)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	新加坡元 0.0288	795,783.669	(17,088)
美元类别 (每月派息)	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	美元 0.0320	38,560,803.380	(1,233,944)
美元 C 类别 (每季派息)	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	美元 0.1123	8,400,326.942	(943,357)
美元 C 类别 (每月派息)	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	美元 0.0338	2,496,320.356	(84,376)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	澳元 0.0182	18,825,377.350	(241,428)
加元对冲类别 (每月派息)	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	加元 0.0287	8,032,527.262	(172,768)
欧元对冲类别 (每月派息)	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	欧元 0.0101	1,880,844.683	(20,631)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	英镑 0.0234	6,123,449.039	(176,402)
港元类别 (每月派息)	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	港元 0.0322	227,787,413.295	(935,728)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 9 日	纽元 0.0253	5,910,318.043	(96,634)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	人民币 0.0325	1,518,139.550	(7,302)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	人民币 0.0107	9,065,479.690	(14,356)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	美元 0.0321	1,389,415.160	(44,600)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	人民币 0.0112	166,728,396.873	(276,367)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	新加坡元 0.0261	871,606.015	(17,308)
美元类别 (每月派息)	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	美元 0.0320	38,885,544.414	(1,244,336)
美元 C 类别 (每月派息)	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	美元 0.0339	2,628,882.328	(89,119)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	澳元 0.0197	18,316,089.728	(243,323)
加元对冲类别 (每月派息)	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	加元 0.0288	8,170,764.765	(172,843)
欧元对冲类别 (每月派息)	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	欧元 0.0150	1,908,855.872	(30,365)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	英镑 0.0257	6,113,488.893	(190,213)
港元类别 (每月派息)	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	港元 0.0323	229,659,223.704	(945,027)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	纽元 0.0272	5,706,853.692	(96,170)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	人民币 0.0329	1,564,331.220	(7,403)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	人民币 0.0158	9,039,866.180	(20,546)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	美元 0.0321	1,370,556.470	(43,995)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	人民币 0.0164	162,080,410.511	(382,369)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	新加坡元 0.0252	802,682.656	(15,026)
美元类别 (每月派息)	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	美元 0.0320	39,873,192.735	(1,275,941)
美元 C 类别 (每月派息)	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	美元 0.0339	2,578,314.336	(87,405)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	澳元 0.0198	18,707,081.462	(248,075)
加元对冲类别 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	加元 0.0275	8,075,773.669	(164,099)
欧元对冲类别 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	欧元 0.0150	1,938,664.515	(31,594)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	英镑 0.0254	6,145,505.923	(193,005)
港元类别 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	港元 0.0324	235,120,202.036	(970,439)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	纽元 0.0297	5,623,114.744	(104,488)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	人民币 0.0330	1,573,277.230	(7,560)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	人民币 0.0125	8,831,241.740	(16,075)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	美元 0.0321	1,370,981.850	(44,009)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	人民币 0.0131	160,415,439.926	(306,007)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	新加坡元 0.0237	802,431.265	(14,304)
美元类别 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	美元 0.0320	39,882,889.994	(1,276,251)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
美元 C 类别 (每季派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	美元 0.1126	8,083,953.632	(910,253)
美元 C 类别 (每月派息)	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	美元 0.0339	2,699,834.310	(91,523)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023 年 4 月 28 日	2023 年 5 月 9 日	澳元 0.0194	19,251,407.401	(246,812)
加元对冲类别 (每月派息)	2023 年 4 月 28 日	2023 年 5 月 9 日	加元 0.0262	7,934,754.126	(153,278)
欧元对冲类别 (每月派息)	2023 年 4 月 28 日	2023 年 5 月 9 日	欧元 0.0160	2,043,671.473	(36,099)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023 年 4 月 28 日	2023 年 5 月 9 日	英镑 0.0252	6,073,055.570	(192,357)
港元类别 (每月派息)	2023 年 4 月 28 日	2023 年 5 月 9 日	港元 0.0324	236,860,863.102	(977,629)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023 年 4 月 28 日	2023 年 5 月 9 日	纽元 0.0301	5,297,343.053	(98,484)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023 年 4 月 28 日	2023 年 5 月 9 日	人民币 0.0330	1,562,020.520	(7,445)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023 年 4 月 28 日	2023 年 5 月 9 日	人民币 0.0089	8,740,373.030	(11,236)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 4 月 28 日	2023 年 5 月 9 日	美元 0.0321	1,354,567.130	(43,482)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023 年 4 月 28 日	2023 年 5 月 9 日	人民币 0.0092	168,341,988.466	(223,702)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023 年 4 月 28 日	2023 年 5 月 9 日	新加坡元 0.0219	826,218.328	(13,562)
美元类别 (每月派息)	2023 年 4 月 28 日	2023 年 5 月 9 日	美元 0.0320	39,906,242.629	(1,276,998)
美元 C 类别 (每月派息)	2023 年 4 月 28 日	2023 年 5 月 9 日	美元 0.0339	2,705,640.496	(91,721)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023 年 5 月 31 日	2023 年 6 月 8 日	澳元 0.0190	19,469,623.545	(239,395)
加元对冲类别 (每月派息)	2023 年 5 月 31 日	2023 年 6 月 8 日	加元 0.0248	7,773,630.867	(141,827)
欧元对冲类别 (每月派息)	2023 年 5 月 31 日	2023 年 6 月 8 日	欧元 0.0157	2,053,737.549	(34,375)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023 年 5 月 31 日	2023 年 6 月 8 日	英镑 0.0250	5,828,530.815	(180,597)
港元类别 (每月派息)	2023 年 5 月 31 日	2023 年 6 月 8 日	港元 0.0322	235,817,345.965	(969,989)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023 年 5 月 31 日	2023 年 6 月 8 日	纽元 0.0306	5,239,280.656	(96,089)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023 年 5 月 31 日	2023 年 6 月 8 日	人民币 0.0337	1,581,302.730	(7,478)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023 年 5 月 31 日	2023 年 6 月 8 日	人民币 0.0096	8,630,148.360	(11,627)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 5 月 31 日	2023 年 6 月 8 日	美元 0.0321	1,332,672.140	(42,779)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023 年 5 月 31 日	2023 年 6 月 8 日	人民币 0.0099	167,383,030.109	(232,548)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023 年 5 月 31 日	2023 年 6 月 8 日	新加坡元 0.0208	827,727.856	(12,707)
美元类别 (每月派息)	2023 年 5 月 31 日	2023 年 6 月 8 日	美元 0.0320	38,819,950.299	(1,241,949)
美元 C 类别 (每月派息)	2023 年 5 月 31 日	2023 年 6 月 8 日	美元 0.0340	2,699,702.471	(91,790)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023 年 6 月 30 日	2023 年 7 月 10 日	澳元 0.0203	18,211,391.765	(246,085)
加元对冲类别 (每月派息)	2023 年 6 月 30 日	2023 年 7 月 10 日	加元 0.0247	8,066,488.001	(150,570)
欧元对冲类别 (每月派息)	2023 年 6 月 30 日	2023 年 7 月 10 日	欧元 0.0158	1,977,375.975	(34,085)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023 年 6 月 30 日	2023 年 7 月 10 日	英镑 0.0257	5,771,738.716	(188,584)
港元类别 (每月派息)	2023 年 6 月 30 日	2023 年 7 月 10 日	港元 0.0322	226,099,775.793	(929,027)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023 年 6 月 30 日	2023 年 7 月 10 日	纽元 0.0309	5,680,655.136	(107,540)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023 年 6 月 30 日	2023 年 7 月 10 日	人民币 0.0344	1,653,156.060	(7,817)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023 年 6 月 30 日	2023 年 7 月 10 日	人民币 0.0096	8,496,196.290	(11,212)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 6 月 30 日	2023 年 7 月 10 日	美元 0.0321	1,279,881.710	(41,084)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023 年 6 月 30 日	2023 年 7 月 10 日	人民币 0.0099	168,466,583.226	(229,260)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023 年 6 月 30 日	2023 年 7 月 10 日	新加坡元 0.0214	817,977.594	(12,934)
美元类别 (每月派息)	2023 年 6 月 30 日	2023 年 7 月 10 日	美元 0.0320	36,488,220.705	(1,167,622)
美元 C 类别 (每季派息)	2023 年 6 月 30 日	2023 年 7 月 10 日	美元 0.1128	7,879,850.472	(888,847)
美元 C 类别 (每月派息)	2023 年 6 月 30 日	2023 年 7 月 10 日	美元 0.0340	2,638,102.471	(89,695)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023 年 7 月 31 日	2023 年 8 月 8 日	澳元 0.0208	18,911,257.240	(265,061)
加元对冲类别 (每月派息)	2023 年 7 月 31 日	2023 年 8 月 8 日	加元 0.0265	7,868,014.117	(158,406)
欧元对冲类别 (每月派息)	2023 年 7 月 31 日	2023 年 8 月 8 日	欧元 0.0175	1,861,111.180	(35,909)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023 年 7 月 31 日	2023 年 8 月 8 日	英镑 0.0291	5,692,061.963	(213,119)
港元类别 (每月派息)	2023 年 7 月 31 日	2023 年 8 月 8 日	港元 0.0322	221,143,028.633	(913,076)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023 年 7 月 31 日	2023 年 8 月 8 日	纽元 0.0305	5,601,676.972	(106,329)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023 年 7 月 31 日	2023 年 8 月 8 日	人民币 0.0344	1,693,834.790	(8,157)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023 年 7 月 31 日	2023 年 8 月 8 日	人民币 0.0081	9,413,551.180	(10,674)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 7 月 31 日	2023 年 8 月 8 日	美元 0.0321	1,254,422.610	(40,267)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023 年 7 月 31 日	2023 年 8 月 8 日	人民币 0.0083	157,258,512.080	(182,717)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023 年 7 月 31 日	2023 年 8 月 8 日	新加坡元 0.0206	797,979.896	(12,380)
美元类别 (每月派息)	2023 年 7 月 31 日	2023 年 8 月 8 日	美元 0.0320	35,617,115.681	(1,139,746)
美元 C 类别 (每月派息)	2023 年 7 月 31 日	2023 年 8 月 8 日	美元 0.0340	2,685,628.755	(91,311)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023 年 8 月 31 日	2023 年 9 月 8 日	澳元 0.0202	18,818,676.148	(246,196)
加元对冲类别 (每月派息)	2023 年 8 月 31 日	2023 年 9 月 8 日	加元 0.0267	7,264,412.666	(143,361)
欧元对冲类别 (每月派息)	2023 年 8 月 31 日	2023 年 9 月 8 日	欧元 0.0186	1,867,947.456	(37,709)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023 年 8 月 31 日	2023 年 9 月 8 日	英镑 0.0295	5,295,238.454	(197,941)
港元类别 (每月派息)	2023 年 8 月 31 日	2023 年 9 月 8 日	港元 0.0323	218,770,739.434	(901,112)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023 年 8 月 31 日	2023 年 9 月 8 日	纽元 0.0294	5,424,593.681	(94,964)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023 年 8 月 31 日	2023 年 9 月 8 日	人民币 0.0350	1,960,126.450	(9,426)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023 年 8 月 31 日	2023 年 9 月 8 日	人民币 0.0103	9,739,484.770	(13,783)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023 年 8 月 31 日	2023 年 9 月 8 日	美元 0.0321	1,252,199.560	(40,196)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023 年 8 月 31 日	2023 年 9 月 8 日	人民币 0.0107	145,369,043.866	(213,704)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023 年 8 月 31 日	2023 年 9 月 8 日	新加坡元 0.0190	787,104.385	(11,074)
美元类别 (每月派息)	2023 年 8 月 31 日	2023 年 9 月 8 日	美元 0.0320	33,371,672.898	(1,067,892)
美元 C 类别 (每月派息)	2023 年 8 月 31 日	2023 年 9 月 8 日	美元 0.0340	2,787,342.981	(94,770)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023 年 9 月 29 日	2023 年 10 月 10 日	澳元 0.0201	18,644,948.327	(241,872)
加元对冲类别 (每月派息)	2023 年 9 月 29 日	2023 年 10 月 11 日	加元 0.0265	7,142,235.804	(139,992)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
欧元对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	欧元 0.0193	1,876,213.986	(38,338)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	英镑 0.0302	5,374,028.544	(198,090)
港元类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	港元 0.0322	210,496,375.120	(865,438)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	纽元 0.0293	5,355,816.235	(94,288)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年9月28日	2023年10月11日	人民币 0.0348	2,055,285.260	(9,817)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年9月28日	2023年10月11日	人民币 0.0214	9,791,522.140	(28,760)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年9月28日	2023年10月11日	美元 0.0321	1,244,800.060	(39,958)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月11日	人民币 0.0222	139,370,659.925	(424,668)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	新加坡元 0.0196	767,961.479	(11,028)
美元类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月11日	美元 0.0320	32,492,123.363	(1,039,747)
美元 C 类别 (每季派息)	2023年9月29日	2023年10月11日	美元 0.1130	7,530,185.266	(850,911)
美元 C 类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月11日	美元 0.0340	2,982,849.433	(101,417)
可赎回份额持有人的总收益分配					(44,045,533)

7 税项

澳大利亚税项

本基金对澳大利亚证券交易所上市的证券进行投资。处置澳大利亚境内投资所得的收益可能需要缴纳百分之三十的澳大利亚所得税。二零一二年九月，澳大利亚政府出台法规，豁免境外基金就二零一一年六月三十日或之前实现的收益缴纳所得税，前提是必须满足若干所有权条件和其他标准。二零一五年六月，澳大利亚政府进一步出台被称为“投资管理入制度”的法规（“法规”），豁免受境外管理的基金就二零一一年七月一日或之后实现的收益缴纳所得税，前提是必须满足若干所有权条件和其他标准。

管理人认为，于二零二四年及二零二三年九月三十日，在该等财务报表批准之日，本基金所投资的澳大利亚境内投资不太可能被征收资本收益税。此外，管理人认为本基金应符合法规相关标准并获得免税资格。因此，于二零二四年及二零二三年九月三十日并无税项拨备。该评估为管理人的最佳估计。

中国税项

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

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

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

A 股股息收入和资本收益

本基金通过沪港通和深港通（统称“中华通”）对中国境内上市的 A 股进行投资，并对股票所得的股息收入缴纳百分之十的预提所得税。截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，已就股票所得的股息收入缴纳预提所得税。

根据财税二零一四年第八十一号和财税二零一六年第一百二十七号，境外投资者通过中华通交易中国境内 A 股所得的资本收益暂时获豁免缴纳中国境内企业所得税。根据三十六号通知及其他现行增值税法规，通过中华通交易有价证券（包括 A 股和其他中国境内上市证券）所得的资本收益可获豁免缴纳中国境内增值税。

H 股股息收入和资本收益

本基金对香港联交所上市的中国境内公司股份（“H 股”）进行投资。根据《中华人民共和国企业所得税法》的一般税务规定，除非根据相关双重税收协定获得豁免或减免，否则严格来说，基金须就来自中国境内的资本收益缴纳百分之十的预提所得税。然而，中国境内税务机关实际上可能难以对此类资本收益征收预提所得税。地方税务局并未严格执行对中国境内非税收居民企业从 H 股交易所获得的资本收益收取百分之十的预提所得税。如果资本收益来自 H 股交易，一般不征收增值税，因为购买和出售通常均在中国境外完成。

由于管理人认为，在当前的执法环境下，对 H 股所得的资本收益征税的可能性不大，因此未对财务报表中的此等收益作出税项拨备。

香港税项

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

其他司法管辖区

截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，已就若干收到的股息收入和利息收入预扣或缴付海外税项。

8 与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之交易

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

(a) 以下为受托人及管理人之关联人士之投资交易：

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

截至二零二四年九月三十日止年度，综合收益表中的股息收入为 22,620 美元（二零二三年：无），为管理人之关联人士发行和管理的集体投资计划的投资分配。

公司名称	投资买卖总价值 美元	占本基金本年度 之总交易价值 百分比	支付佣金 美元	占本基金本年度 支付之总佣金 百分比	平均佣金率 百分比
<u>2024</u>					
HSBC Securities & Capital Markets (India) Private Limited	804,811	0.06	805	0.14	0.10
J.P. Morgan India Private Limited	5,769,761	0.41	5,348	0.90	0.09
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	20,370,914	1.43	11,351	1.92	0.06
JPMorgan Chase Bank, N.A.	186,730,000	13.14	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司	15,522,761	1.09	11,336	1.91	0.07
香港上海汇丰银行有限公司，首尔	534,201	0.04	481	0.08	0.09
<u>2023</u>					
J.P. Morgan Securities Plc	510,936	0.05	128	0.03	0.03
J.P. Morgan Securities Australia Limited	19,453,757	1.96	11,087	2.29	0.06
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	52,261,058	5.26	53,214	11.00	0.10
香港上海汇丰银行有限公司	20,662,496	2.08	12,230	2.53	0.06

(b) 与管理人及其关联人士之年末结余：

	2024 美元	2023 美元
银行现金	5,064,482	2,426,958
应收款项	169	288,913
应付款项	(1,311,482)	(1,331,062)

于二零二四年九月三十日，本基金的投资结余 10,000 美元（二零二三年：无），为管理人之关联人士发行和管理的集体投资计划的投资。

(c) 截至二零二四年九月三十日止年度，本基金与受托人之关联人士签订了远期外汇合约，实现亏损 704,437 美元（二零二三年：实现亏损 11,353,210 美元）。

(d) 截至二零二四年九月三十日止年度，扣除支付给代理机构的佣金后，管理人取得本基金分配及赎回收益为 8,921 美元（二零二三年：15,528 美元）。

(e) 支付给摩根基金（亚洲）有限公司美元 C 类别（每季派息）及美元 C 类别（每月派息）之管理费和其他基金份额类别之管理费分别按各类别资产净值的年率百分之零点七五和百分之一点五计算。此管理费于每个交易日累计，并于每月月底支付。如果本基金投资管理或其关联人士管理的集体投资计划，在考虑针对该集体投资计划中归属于本基金的利益已征收的管理费以后，相应减少支付给管理人的管理费用。

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

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

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

	年初	总分配	总赎回	年末	交易利润 美元
<u>2024</u>					
<u>摩根资产管理（亚太）有限公司</u>					
- 美元类别（累计）	58,959.634	7,650.312	(19,475.150)	47,134.796	-
- 美元 C 类别（每月派息）	-	25,377.666	-	25,377.666	6,865
<u>JPMorgan Asset Management (S) Limited</u>					
- 美元类别（累计）	3,770.483	252.322	(3,770.483)	252.322	-
<u>摩根基金（亚洲）有限公司</u>					
- 美元类别（累计）	-	287.734	-	287.734	-
<u>2023</u>					
<u>摩根资产管理（亚太）有限公司</u>					
- 美元类别（累计）	42,099.949	26,659.773	(9,800.088)	58,959.634	-
<u>JPMorgan Asset Management (S) Limited</u>					
- 美元类别（累计）	13,686.096	-	(9,915.613)	3,770.483	-

(g) 受托人费用按本基金资产净值的首 4,000 万美元，以本基金资产净值的年率百分之零点零六计算；资产净值介乎 4,000 万美元至 7,000 万美元，按年率百分之零点零四计算；超过 7,000 万美元时，按年率百分之零点零二五计算。受托人费用于每个交易日累计，并于每月月底支付。

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

(i) 截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，除附注 8(e)和 8(h)披露的管理费用、估值费用及基金注册登记机构费用外，已收／（已付）管理人摩根基金（亚洲）有限公司及其关联人士的金额列示如下：

	2024 美元	2023 美元
存款利息	29,802	28,906
交易费用	(16,699)	(64,429)
托管费用及银行费用	(36,146)	(34,834)

(j) 截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，除附注 8(g)披露的受托人费用外，已收／（已付）受托人汇丰机构信托服务（亚洲）有限公司及其关联人士的金额列示如下：

	2024 美元	2023 美元
存款利息	49,401	21,935
交易费用	(50,732)	(38,103)
利息支出	(114,290)	(67,333)
托管费用及银行费用	(402,024)	(328,748)

9 借款

截至二零二四年及二零二三年九月三十日止年度，本基金从香港上海汇丰银行有限公司（受托人的关联人士）借入无抵押短期借款。所有银行借款的久期均在 7 天内。所有交易均为按一般商业条款下进行的正常业务流程。

10 非金钱收益／佣金共享安排

投资管理人与经纪签署了非金钱收益／佣金共享安排，从而收取若干产品和服务以协助作出投资决策。由本基金支付的部分交易佣金会由经纪保留，作为产品和服务的补偿。

该等产品和服务必须对本基金具有明显的利益，并仅限于研究和咨询服务。

截至二零二四年九月三十日止年度，投资管理人经非金钱收益／佣金共享安排而获得的服务交易金额为 722,947,330 美元（二零二三年：988,826,529 美元）。本基金就该等交易支付佣金 14,608 美元（二零二三年：41,906 美元）。

11 衍生性产品

以下为截至九月三十日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／（亏损） 美元
<u>2024</u>				
未平仓合约：				
加元 242,742	美元 179,889	2024 年 10 月 2 日	Citibank N.A., 伦敦	206
加元 97,821	美元 72,600	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	192
美元 155,714	纽元 246,520	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	1,135
美元 177,303	新加坡元 227,645	2024 年 10 月 2 日	法国巴黎银行	267
美元 12,013	英镑 8,967	2024 年 10 月 2 日	巴克莱银行, 伦敦	14
美元 1,101	英镑 821	2024 年 10 月 2 日	Citibank N.A., 伦敦	1
加元 19,688	美元 14,632	2024 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	58
美元 248,393	澳元 358,392	2024 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	246
美元 35,019	英镑 26,119	2024 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	16
美元 1,101	英镑 820	2024 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	0
美元 1,099	纽元 1,728	2024 年 10 月 3 日	巴克莱银行, 伦敦	0
欧元 12,005	美元 13,422	2024 年 10 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	23
美元 43,266	纽元 68,003	2024 年 10 月 4 日	巴克莱银行, 伦敦	0
加元 289,000	美元 213,950	2024 年 10 月 7 日	巴克莱银行, 伦敦	4

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
欧元 24,016	美元 26,808	2024年10月7日	巴克莱银行, 伦敦	0
英镑 27,719	美元 37,180	2024年10月7日	法国巴黎银行	0
美元 12,142	离岸人民币 85,265	2024年10月8日	法国巴黎银行	46
美元 4,411	离岸人民币 30,973	2024年10月8日	法国巴黎银行	17
离岸人民币 3,278,574	美元 469,956	2024年10月10日	巴克莱银行, 伦敦	1,216
离岸人民币 1,590,510	美元 227,986	2024年10月10日	法国巴黎银行	590
离岸人民币 10,404,998	美元 1,490,446	2024年10月15日	美林国际, 伦敦	2,117
离岸人民币 4,365,346	美元 625,258	2024年10月15日	美林国际, 伦敦	840
加元 719,904	美元 533,431	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	302
加元 336,052	美元 249,036	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	171
加元 22,151	美元 16,434	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	30
加元 9,487	美元 7,044	2024年10月21日	法国巴黎银行	18
加元 1,482	美元 1,102	2024年10月21日	法国巴黎银行	4
加元 1,485	美元 1,102	2024年10月21日	法国巴黎银行	3
加元 1,480	美元 1,100	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	3
加元 2,404	美元 1,782	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 8,379,430	美元 1,202,158	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	2,869
离岸人民币 1,476,535	美元 211,850	2024年10月21日	法国巴黎银行	524
离岸人民币 986,995	美元 141,524	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	262
离岸人民币 674,937	美元 96,839	2024年10月21日	法国巴黎银行	240
离岸人民币 603,274	美元 86,456	2024年10月21日	美国道富银行	114
离岸人民币 321,829	美元 46,175	2024年10月21日	法国巴黎银行	114
离岸人民币 532,407	美元 76,293	2024年10月21日	美国道富银行	93
离岸人民币 156,462	美元 22,449	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	55
离岸人民币 91,971	美元 13,188	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	24
离岸人民币 69,032	美元 9,904	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	24
离岸人民币 47,606	美元 6,830	2024年10月21日	法国巴黎银行	17
离岸人民币 64,235	美元 9,206	2024年10月21日	法国巴黎银行	12
离岸人民币 37,166	美元 5,326	2024年10月21日	法国巴黎银行	7
离岸人民币 7,733	美元 1,109	2024年10月21日	法国巴黎银行	3
离岸人民币 7,733	美元 1,109	2024年10月21日	法国巴黎银行	3
欧元 109,161	美元 122,126	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	194
纽元 191,986	美元 122,211	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	54
纽元 4,831	美元 3,075	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1
新加坡元 4,499	美元 3,518	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	5
美元 79,027,261	澳元 117,304,177	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	2,378,671
美元 146,825,788	离岸人民币 1,035,707,638	2024年10月21日	法国巴黎银行	1,407,780
美元 40,350,631	英镑 30,622,237	2024年10月21日	渣打银行, 伦敦	723,925
美元 26,445,572	纽元 42,484,621	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	586,415
美元 23,536,486	离岸人民币 166,026,134	2024年10月21日	法国巴黎银行	225,670
美元 13,990,067	离岸人民币 98,685,794	2024年10月21日	法国巴黎银行	134,138
美元 6,536,561	离岸人民币 46,108,836	2024年10月21日	法国巴黎银行	62,673
美元 5,159,138	新加坡元 6,685,268	2024年10月21日	高盛国际, 伦敦	60,938
美元 11,997,312	欧元 10,775,498	2024年10月21日	法国巴黎银行	38,854
美元 784,394	澳元 1,168,705	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	26,656
美元 1,235,320	澳元 1,806,905	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	18,623
美元 1,468,721	离岸人民币 10,389,339	2024年10月21日	法国巴黎银行	18,232
美元 2,240,086	离岸人民币 15,770,813	2024年10月21日	法国巴黎银行	17,079
美元 1,350,784	澳元 1,966,431	2024年10月21日	高盛国际, 伦敦	13,865
美元 412,704	澳元 612,177	2024年10月21日	高盛国际, 伦敦	12,130
美元 1,907,498	澳元 2,765,443	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	11,645
美元 474,103	澳元 696,489	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	9,242
美元 747,413	离岸人民币 5,286,221	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	9,167
美元 2,468,851	离岸人民币 17,310,395	2024年10月21日	加拿大皇家银行	8,664
美元 401,538	英镑 305,757	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	8,583
美元 868,657	离岸人民币 6,128,145	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	8,422
美元 613,455	离岸人民币 4,344,537	2024年10月21日	法国巴黎银行	8,348
美元 261,833	纽元 423,761	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	7,796
美元 402,489	纽元 642,887	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	6,565
美元 147,609	澳元 221,690	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	6,238
美元 393,445	离岸人民币 2,788,281	2024年10月21日	法国巴黎银行	5,623
美元 392,757	离岸人民币 2,783,411	2024年10月21日	法国巴黎银行	5,613
美元 626,351	英镑 470,353	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	4,548
美元 305,583	离岸人民币 2,165,400	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	4,336
美元 278,822	离岸人民币 1,978,193	2024年10月21日	法国巴黎银行	4,303

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 309,507	离岸人民币 2,191,954	2024年10月21日	法国巴黎银行	4,212
美元 549,465	离岸人民币 3,868,383	2024年10月21日	法国巴黎银行	4,189
美元 627,152	纽元 992,155	2024年10月21日	高盛国际, 伦敦	4,133
美元 439,493	纽元 697,020	2024年10月21日	法国巴黎银行	4,004
美元 130,178	英镑 100,000	2024年10月21日	法国巴黎银行	3,955
美元 133,700	纽元 216,015	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3,745
美元 209,334	英镑 158,717	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	3,558
美元 275,057	离岸人民币 1,946,200	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	3,489
美元 211,495	离岸人民币 1,500,520	2024年10月21日	法国巴黎银行	3,264
美元 261,374	离岸人民币 1,848,886	2024年10月21日	法国巴黎银行	3,245
美元 154,784	纽元 248,280	2024年10月21日	高盛国际, 伦敦	3,191
美元 244,856	英镑 184,753	2024年10月21日	法国巴黎银行	2,959
美元 329,027	离岸人民币 2,316,441	2024年10月21日	法国巴黎银行	2,509
美元 259,312	离岸人民币 1,828,983	2024年10月21日	法国巴黎银行	2,458
美元 212,597	离岸人民币 1,501,173	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	2,255
美元 49,903	澳元 75,000	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,145
美元 305,279	离岸人民币 2,146,899	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,992
美元 77,473	澳元 114,482	2024年10月21日	法国巴黎银行	1,975
美元 153,348	离岸人民币 1,084,745	2024年10月21日	法国巴黎银行	1,904
美元 974,126	英镑 727,612	2024年10月21日	法国巴黎银行	1,843
美元 259,097	离岸人民币 1,822,927	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,806
美元 106,533	离岸人民币 756,725	2024年10月21日	法国巴黎银行	1,772
美元 134,430	离岸人民币 950,782	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	1,649
美元 430,004	离岸人民币 3,015,808	2024年10月21日	法国巴黎银行	1,627
美元 114,131	离岸人民币 808,744	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,619
美元 438,089	离岸人民币 3,071,668	2024年10月21日	加拿大皇家银行	1,537
美元 119,724	离岸人民币 847,122	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,519
美元 156,282	离岸人民币 1,102,290	2024年10月21日	法国巴黎银行	1,481
美元 204,616	离岸人民币 1,439,618	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,426
美元 290,096	加元 393,530	2024年10月21日	法国巴黎银行	1,335
美元 692,348	英镑 517,101	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,255
美元 567,843	离岸人民币 3,975,970	2024年10月21日	法国巴黎银行	1,210
美元 78,861	离岸人民币 558,820	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,119
美元 110,274	欧元 99,724	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,117
美元 293,098	离岸人民币 2,055,622	2024年10月21日	法国巴黎银行	1,109
美元 79,111	离岸人民币 559,840	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,015
美元 78,024	离岸人民币 551,842	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	957
美元 66,680	离岸人民币 472,550	2024年10月21日	法国巴黎银行	953
美元 98,272	离岸人民币 693,257	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	949
美元 264,986	离岸人民币 1,857,956	2024年10月21日	加拿大皇家银行	930
美元 71,306	离岸人民币 504,533	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	905
美元 66,563	离岸人民币 470,851	2024年10月21日	法国巴黎银行	826
美元 172,483	加元 234,010	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	815
美元 102,199	离岸人民币 719,512	2024年10月21日	法国巴黎银行	779
美元 70,681	离岸人民币 499,088	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	750
美元 150,898	加元 204,736	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	720
美元 178,002	离岸人民币 1,248,406	2024年10月21日	法国巴黎银行	674
美元 39,378	离岸人民币 279,820	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	671
美元 51,469	离岸人民币 364,224	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	660
美元 68,034	离岸人民币 479,943	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	657
美元 119,317	欧元 107,389	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	636
美元 52,043	新加坡元 67,454	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	627
美元 445,555	加元 602,475	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	612
美元 182,844	欧元 164,233	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	603
美元 80,894	新加坡元 104,349	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	585
美元 18,812	纽元 30,381	2024年10月21日	法国巴黎银行	518
美元 73,093	离岸人民币 514,033	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	477
美元 216,172	离岸人民币 1,513,567	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	454
美元 26,595	离岸人民币 188,942	2024年10月21日	美国道富银行	447
美元 34,061	离岸人民币 240,905	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	418
美元 112,677	离岸人民币 790,036	2024年10月21日	加拿大皇家银行	395
美元 17,220	纽元 27,683	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	395
美元 30,788	欧元 27,914	2024年10月21日	法国巴黎银行	392
美元 82,667	英镑 61,922	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	391
美元 40,079	离岸人民币 282,749	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	389

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 20,603	离岸人民币 146,407	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	351
美元 16,635	英镑 12,640	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	319
美元 27,184	新加坡元 35,155	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	267
美元 31,335	新加坡元 40,466	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	262
美元 89,087	新加坡元 114,391	2024年10月21日	加拿大皇家银行	233
美元 39,350	加元 53,444	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	228
美元 6,108	纽元 9,941	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	217
美元 7,917	英镑 6,052	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	201
美元 73,932	欧元 66,355	2024年10月21日	高盛国际, 伦敦	186
美元 62,280	欧元 55,912	2024年10月21日	高盛国际, 伦敦	173
美元 147,374	英镑 110,000	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	172
美元 19,123	加元 26,000	2024年10月21日	法国巴黎银行	132
美元 7,470	英镑 5,664	2024年10月21日	法国巴黎银行	128
美元 14,835	离岸人民币 104,372	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	103
美元 7,141	离岸人民币 50,572	2024年10月21日	法国巴黎银行	97
美元 45,177	离岸人民币 316,315	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	95
美元 2,691	澳元 4,000	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	85
美元 3,967	英镑 3,018	2024年10月21日	法国巴黎银行	80
美元 2,726	英镑 2,088	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	74
美元 7,375	离岸人民币 52,030	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	71
美元 6,664	离岸人民币 47,056	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	71
美元 1,385	澳元 2,082	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	60
美元 8,007	离岸人民币 56,334	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	56
美元 1,182	澳元 1,759	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	39
美元 1,189	澳元 1,767	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	37
美元 3,503	离岸人民币 24,722	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	36
美元 1,248	纽元 2,018	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	36
美元 1,532	新加坡元 2,000	2024年10月21日	法国巴黎银行	30
美元 1,625	离岸人民币 11,540	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	27
美元 2,686	欧元 2,428	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	26
美元 1,743	离岸人民币 12,350	2024年10月21日	法国巴黎银行	25
美元 4,315	加元 5,846	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	14
美元 1,404	离岸人民币 9,902	2024年10月21日	法国巴黎银行	13
美元 6,959	欧元 6,238	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	9
美元 252	离岸人民币 1,785	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	3
澳元 579,406	美元 402,221	2024年11月21日	法国巴黎银行	2
澳元 2,731	美元 1,896	2024年11月21日	法国巴黎银行	0
英镑 157,820	美元 211,677	2024年11月21日	法国巴黎银行	2
英镑 820	美元 1,100	2024年11月21日	法国巴黎银行	0
美元 2,015,595	离岸人民币 14,056,902	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,423
美元 292,809	英镑 218,809	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	667
美元 569,264	澳元 820,658	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	430
美元 1,039,903	离岸人民币 7,249,610	2024年11月21日	法国巴黎银行	340
美元 434,346	离岸人民币 3,029,157	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	306
美元 185,120	纽元 291,298	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	230
美元 193,227	离岸人民币 1,347,068	2024年11月21日	法国巴黎银行	63
美元 122,454	离岸人民币 853,678	2024年11月21日	法国巴黎银行	40
美元 49,332	离岸人民币 343,915	2024年11月21日	法国巴黎银行	16
美元 26,858	欧元 24,016	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	1
			未实现总收益	5,956,560
美元 3,075	纽元 4,831	2024年10月2日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
美元 3,515	新加坡元 4,499	2024年10月2日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
英镑 110,000	美元 147,377	2024年10月3日	巴克莱银行, 伦敦	(171)
美元 1,895	澳元 2,731	2024年10月3日	法国巴黎银行	(0)
美元 1,098	欧元 984	2024年10月3日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
美元 1,098	加元 1,483	2024年10月3日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
美元 1,099	加元 1,480	2024年10月3日	巴克莱银行, 伦敦	(3)
美元 16,428	加元 22,151	2024年10月3日	Citibank N.A., 伦敦	(31)
美元 122,208	纽元 191,986	2024年10月3日	Citibank N.A., 伦敦	(57)
美元 122,040	欧元 109,161	2024年10月3日	Citibank N.A., 伦敦	(207)
美元 211,691	英镑 157,820	2024年10月4日	法国巴黎银行	(0)
美元 127,379	欧元 114,125	2024年10月4日	巴克莱银行, 伦敦	(0)

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 401,977	澳元 579,406	2024年10月4日	法国巴黎银行	(1)
美元 260,614	加元 352,055	2024年10月4日	巴克莱银行, 伦敦	(5)
纽元 154,650	美元 98,394	2024年10月7日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
澳元 115,413	美元 80,075	2024年10月8日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 316,315	美元 45,117	2024年10月8日	Citibank N.A., 伦敦	(99)
离岸人民币 1,513,567	美元 215,883	2024年10月8日	Citibank N.A., 伦敦	(476)
离岸人民币 1,248,406	美元 177,777	2024年10月8日	法国巴黎银行	(678)
离岸人民币 3,975,970	美元 567,100	2024年10月8日	法国巴黎银行	(1,250)
美元 1,108	离岸人民币 7,733	2024年10月8日	法国巴黎银行	(3)
美元 46,124	离岸人民币 321,829	2024年10月8日	法国巴黎银行	(120)
离岸人民币 2,055,622	美元 292,755	2024年10月9日	法国巴黎银行	(1,110)
离岸人民币 3,015,808	美元 429,502	2024年10月9日	法国巴黎银行	(1,628)
美元 6,823	离岸人民币 47,606	2024年10月9日	法国巴黎银行	(18)
美元 9,894	离岸人民币 69,032	2024年10月9日	巴克莱银行, 伦敦	(26)
美元 5,321	离岸人民币 37,166	2024年10月10日	法国巴黎银行	(8)
美元 9,198	离岸人民币 64,235	2024年10月10日	法国巴黎银行	(14)
离岸人民币 3,029,157	美元 433,006	2024年10月15日	巴克莱银行, 伦敦	(284)
离岸人民币 14,056,902	美元 2,009,376	2024年10月15日	Citibank N.A., 伦敦	(1,321)
澳元 1,603	美元 1,104	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	(8)
澳元 1,606	美元 1,103	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(11)
澳元 1,602	美元 1,100	2024年10月21日	法国巴黎银行	(12)
澳元 1,619	美元 1,110	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
澳元 1,633	美元 1,105	2024年10月21日	法国巴黎银行	(28)
澳元 1,633	美元 1,099	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(35)
澳元 1,644	美元 1,105	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(36)
澳元 3,039	美元 2,066	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(44)
澳元 1,655	美元 1,098	2024年10月21日	法国巴黎银行	(50)
澳元 1,929	美元 1,285	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(54)
澳元 2,040	美元 1,357	2024年10月21日	高盛国际, 伦敦	(58)
澳元 5,773	美元 3,923	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(83)
澳元 3,706	美元 2,481	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(90)
澳元 7,223	美元 4,870	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(143)
澳元 358,392	美元 248,461	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(253)
澳元 51,486	美元 35,374	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(356)
澳元 96,348	美元 66,028	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(835)
澳元 437,095	美元 300,070	2024年10月21日	法国巴黎银行	(3,262)
澳元 108,936	美元 72,326	2024年10月21日	法国巴黎银行	(3,273)
澳元 143,033	美元 95,178	2024年10月21日	高盛国际, 伦敦	(4,082)
澳元 257,471	美元 173,083	2024年10月21日	法国巴黎银行	(5,595)
澳元 459,365	美元 312,740	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(6,046)
澳元 255,543	美元 170,149	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(7,191)
澳元 437,368	美元 294,716	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(8,805)
澳元 550,536	美元 370,407	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(11,650)
澳元 638,567	美元 426,079	2024年10月21日	高盛国际, 伦敦	(17,069)
澳元 2,176,126	美元 1,466,914	2024年10月21日	美国道富银行	(43,259)
加元 1,494	美元 1,101	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
加元 1,497	美元 1,102	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
加元 1,495	美元 1,101	2024年10月21日	法国巴黎银行	(6)
加元 2,487	美元 1,834	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(9)
加元 5,983	美元 4,409	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(22)
加元 144,225	美元 106,191	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(616)
加元 222,219	美元 163,893	2024年10月21日	法国巴黎银行	(673)
加元 170,297	美元 125,386	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(728)
离岸人民币 7,760	美元 1,108	2024年10月21日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 7,760	美元 1,108	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 7,760	美元 1,108	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 7,760	美元 1,108	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 7,722	美元 1,101	2024年10月21日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 7,722	美元 1,101	2024年10月21日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 22,951	美元 3,278	2024年10月21日	法国巴黎银行	(7)
离岸人民币 13,232	美元 1,887	2024年10月21日	法国巴黎银行	(7)
离岸人民币 7,780	美元 1,106	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
离岸人民币 7,780	美元 1,106	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
离岸人民币 7,780	美元 1,106	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
离岸人民币 7,780	美元 1,106	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(7)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
离岸人民币 7,780	美元 1,106	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
离岸人民币 7,757	美元 1,102	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
离岸人民币 7,757	美元 1,102	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
离岸人民币 7,757	美元 1,102	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
离岸人民币 7,757	美元 1,102	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
离岸人民币 7,981	美元 1,132	2024年10月21日	法国巴黎银行	(11)
离岸人民币 7,792	美元 1,104	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(11)
离岸人民币 11,947	美元 1,698	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(12)
离岸人民币 7,821	美元 1,108	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(12)
离岸人民币 43,930	美元 6,274	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
离岸人民币 14,257	美元 2,026	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,843	美元 1,108	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,843	美元 1,108	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,834	美元 1,107	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,834	美元 1,107	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,808	美元 1,104	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,808	美元 1,104	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,808	美元 1,104	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,808	美元 1,104	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 7,808	美元 1,103	2024年10月21日	法国巴黎银行	(14)
离岸人民币 16,294	美元 2,317	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(15)
离岸人民币 9,864	美元 1,397	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(15)
离岸人民币 7,796	美元 1,101	2024年10月21日	法国巴黎银行	(15)
离岸人民币 7,796	美元 1,101	2024年10月21日	法国巴黎银行	(15)
离岸人民币 7,796	美元 1,101	2024年10月21日	法国巴黎银行	(15)
离岸人民币 7,796	美元 1,101	2024年10月21日	法国巴黎银行	(15)
离岸人民币 8,058	美元 1,137	2024年10月21日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 7,806	美元 1,102	2024年10月21日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 7,806	美元 1,102	2024年10月21日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 7,796	美元 1,100	2024年10月21日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 7,792	美元 1,100	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
离岸人民币 7,792	美元 1,100	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
离岸人民币 30,973	美元 4,416	2024年10月21日	法国巴黎银行	(17)
离岸人民币 7,848	美元 1,106	2024年10月21日	法国巴黎银行	(17)
离岸人民币 7,848	美元 1,106	2024年10月21日	法国巴黎银行	(17)
离岸人民币 7,848	美元 1,106	2024年10月21日	法国巴黎银行	(17)
离岸人民币 7,921	美元 1,115	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(19)
离岸人民币 7,837	美元 1,103	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(19)
离岸人民币 7,829	美元 1,102	2024年10月21日	美国道富银行	(19)
离岸人民币 7,829	美元 1,102	2024年10月21日	美国道富银行	(19)
离岸人民币 42,045	美元 5,995	2024年10月21日	法国巴黎银行	(23)
离岸人民币 15,134	美元 2,139	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(27)
离岸人民币 16,049	美元 2,269	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(28)
离岸人民币 22,193	美元 3,146	2024年10月21日	法国巴黎银行	(30)
离岸人民币 21,966	美元 3,114	2024年10月21日	法国巴黎银行	(30)
离岸人民币 15,035	美元 2,122	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(30)
离岸人民币 14,695	美元 2,071	2024年10月21日	法国巴黎银行	(32)
离岸人民币 22,315	美元 3,160	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(34)
离岸人民币 19,585	美元 2,765	2024年10月21日	法国巴黎银行	(38)
离岸人民币 22,772	美元 3,218	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(41)
离岸人民币 139,190	美元 19,879	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(43)
离岸人民币 85,265	美元 12,157	2024年10月21日	法国巴黎银行	(46)
离岸人民币 198,729	美元 28,382	2024年10月21日	法国巴黎银行	(61)
离岸人民币 68,531	美元 9,744	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(64)
离岸人民币 119,943	美元 17,102	2024年10月21日	法国巴黎银行	(65)
离岸人民币 32,567	美元 4,595	2024年10月21日	法国巴黎银行	(66)
离岸人民币 28,848	美元 4,059	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(69)
离岸人民币 47,354	美元 6,706	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(71)
离岸人民币 53,287	美元 7,553	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(73)
离岸人民币 42,424	美元 5,990	2024年10月21日	法国巴黎银行	(82)
离岸人民币 47,823	美元 6,759	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(86)
离岸人民币 46,524	美元 6,547	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(112)
离岸人民币 52,175	美元 7,345	2024年10月21日	法国巴黎银行	(122)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
离岸人民币 101,408	美元 14,377	2024年10月21日	法国巴黎银行	(137)
离岸人民币 93,929	美元 13,274	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(169)
离岸人民币 88,162	美元 12,441	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(177)
离岸人民币 111,543	美元 15,765	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(199)
离岸人民币 147,105	美元 20,852	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(202)
离岸人民币 117,888	美元 16,601	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(272)
离岸人民币 948,272	美元 135,428	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(291)
离岸人民币 329,874	美元 46,883	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(329)
离岸人民币 197,484	美元 27,868	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(397)
离岸人民币 310,704	美元 44,042	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(427)
离岸人民币 243,850	美元 34,408	2024年10月21日	法国巴黎银行	(493)
离岸人民币 538,198	美元 76,525	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(503)
离岸人民币 240,025	美元 33,776	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(577)
离岸人民币 357,931	美元 50,582	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(646)
离岸人民币 454,212	美元 64,323	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(685)
离岸人民币 372,415	美元 52,467	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	(834)
离岸人民币 463,238	美元 65,292	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,008)
离岸人民币 744,141	美元 105,440	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,064)
离岸人民币 532,637	美元 75,074	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,159)
离岸人民币 1,191,698	美元 169,371	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,189)
离岸人民币 1,219,342	美元 172,874	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,642)
离岸人民币 826,942	美元 116,503	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	(1,852)
离岸人民币 3,626,315	美元 517,043	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,966)
离岸人民币 980,248	美元 138,321	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,975)
离岸人民币 1,706,668	美元 241,824	2024年10月21日	法国巴黎银行	(2,439)
离岸人民币 1,253,827	美元 176,932	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2,519)
离岸人民币 1,404,353	美元 197,851	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	(3,144)
离岸人民币 2,929,159	美元 415,043	2024年10月21日	法国巴黎银行	(4,187)
离岸人民币 1,890,867	美元 266,188	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(4,439)
离岸人民币 3,036,205	美元 429,071	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(5,480)
离岸人民币 3,524,703	美元 497,344	2024年10月21日	法国巴黎银行	(7,122)
离岸人民币 4,896,476	美元 693,409	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(7,389)
离岸人民币 3,266,432	美元 459,979	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(7,523)
离岸人民币 4,647,653	美元 656,215	2024年10月21日	法国巴黎银行	(8,971)
离岸人民币 5,056,171	美元 714,549	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(9,105)
离岸人民币 8,228,258	美元 1,159,230	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	(18,423)
离岸人民币 16,799,198	美元 2,380,339	2024年10月21日	法国巴黎银行	(24,012)
欧元 989	美元 1,102	2024年10月21日	法国巴黎银行	(3)
欧元 987	美元 1,100	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
欧元 996	美元 1,107	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
欧元 994	美元 1,102	2024年10月21日	法国巴黎银行	(8)
欧元 2,560	美元 2,843	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
欧元 15,302	美元 16,975	2024年10月21日	法国巴黎银行	(118)
欧元 96,244	美元 107,216	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(288)
欧元 45,880	美元 50,734	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(514)
欧元 68,390	美元 75,595	2024年10月21日	法国巴黎银行	(796)
欧元 189,931	美元 211,134	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,018)
欧元 140,015	美元 154,429	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,967)
英镑 823	美元 1,102	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
英镑 821	美元 1,101	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
英镑 824	美元 1,103	2024年10月21日	法国巴黎银行	(2)
英镑 824	美元 1,103	2024年10月21日	法国巴黎银行	(2)
英镑 828	美元 1,106	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
英镑 830	美元 1,102	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(11)
英镑 8,967	美元 12,013	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	(14)
英镑 26,119	美元 35,018	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
英镑 833	美元 1,099	2024年10月21日	法国巴黎银行	(19)
英镑 837	美元 1,101	2024年10月21日	法国巴黎银行	(21)
英镑 835	美元 1,092	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(28)
英镑 990	美元 1,295	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(33)
英镑 15,560	美元 20,773	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(98)
英镑 4,999	美元 6,572	2024年10月21日	法国巴黎银行	(133)
英镑 48,519	美元 64,885	2024年10月21日	法国巴黎银行	(195)
英镑 18,259	美元 24,196	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(296)
英镑 110,524	美元 146,777	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,473)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
英镑 170,556	美元 224,472	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(4,300)
英镑 153,812	美元 201,429	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(4,884)
英镑 241,617	美元 316,085	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(8,003)
英镑 578,334	美元 761,667	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(14,070)
纽元 1,755	美元 1,109	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	(7)
纽元 1,740	美元 1,097	2024年10月21日	法国巴黎银行	(11)
纽元 1,768	美元 1,109	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(17)
纽元 1,768	美元 1,109	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(17)
纽元 1,772	美元 1,105	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(23)
纽元 1,758	美元 1,088	2024年10月21日	法国巴黎银行	(31)
纽元 1,784	美元 1,103	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(32)
纽元 1,791	美元 1,101	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(38)
纽元 1,770	美元 1,088	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(39)
纽元 36,697	美元 23,197	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	(152)
纽元 11,813	美元 7,285	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(231)
纽元 33,850	美元 21,220	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(318)
纽元 16,075	美元 9,832	2024年10月21日	法国巴黎银行	(396)
纽元 25,531	美元 15,842	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(403)
纽元 33,257	美元 20,726	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(434)
纽元 29,146	美元 18,036	2024年10月21日	法国巴黎银行	(509)
纽元 33,134	美元 20,517	2024年10月21日	法国巴黎银行	(565)
纽元 67,685	美元 42,101	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(965)
纽元 246,520	美元 155,714	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,142)
纽元 84,017	美元 51,678	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,780)
纽元 182,813	美元 114,392	2024年10月21日	法国巴黎银行	(1,928)
纽元 208,478	美元 128,364	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(4,286)
纽元 819,937	美元 510,000	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(11,707)
纽元 854,429	美元 525,487	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(18,167)
新加坡元 1,440	美元 1,107	2024年10月21日	法国巴黎银行	(17)
新加坡元 10,513	美元 8,070	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(140)
新加坡元 227,645	美元 177,469	2024年10月21日	法国巴黎银行	(284)
新加坡元 44,878	美元 34,463	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	(579)
新加坡元 117,672	美元 90,700	2024年10月21日	加拿大皇家银行	(1,182)
美元 3,824	加元 5,162	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
美元 125,236	新加坡元 160,365	2024年10月21日	摩根士丹利国际股份有限公司	(18)
美元 13,431	欧元 12,005	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(21)
美元 285,595	欧元 255,648	2024年10月21日	高盛国际, 伦敦	(38)
美元 14,637	加元 19,688	2024年10月21日	法国巴黎银行	(58)
美元 72,630	加元 97,821	2024年10月21日	法国巴黎银行	(188)
美元 179,961	加元 242,742	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(196)
美元 158,665	离岸人民币 1,106,961	2024年10月21日	法国巴黎银行	(234)
美元 205,431	欧元 183,532	2024年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(427)
美元 228,209	离岸人民币 1,590,510	2024年10月21日	法国巴黎银行	(570)
美元 399,823	离岸人民币 2,789,450	2024年10月21日	法国巴黎银行	(589)
美元 625,546	离岸人民币 4,365,346	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	(765)
美元 632,814	离岸人民币 4,414,961	2024年10月21日	法国巴黎银行	(932)
美元 470,429	离岸人民币 3,278,574	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	(1,190)
美元 698,480	加元 940,912	2024年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,681)
美元 1,491,124	离岸人民币 10,404,998	2024年10月21日	美林国际, 伦敦	(1,929)
美元 492,487	加元 662,022	2024年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	(2,221)
美元 3,467,260	离岸人民币 24,190,068	2024年10月21日	法国巴黎银行	(5,105)
美元 29,011,764	加元 39,129,147	2024年10月21日	法国巴黎银行	(34,402)
加元 1,483	美元 1,099	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
加元 352,055	美元 260,916	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	(4)
离岸人民币 7,678	美元 1,101	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
离岸人民币 40,347	美元 5,785	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 2,325,588	美元 333,419	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	(278)
离岸人民币 3,487,472	美元 500,030	2024年11月21日	法国巴黎银行	(386)
离岸人民币 5,233,851	美元 750,392	2024年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(611)
欧元 984	美元 1,100	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
欧元 114,125	美元 127,627	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	(7)
纽元 1,728	美元 1,100	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
纽元 68,003	美元 43,268	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
美元 37,178	英镑 27,719	2024年11月21日	法国巴黎银行	(0)
美元 80,120	澳元 115,413	2024年11月21日	法国巴黎银行	(1)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 98,405	纽元 154,650	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
美元 214,193	加元 289,000	2024年11月21日	巴克莱银行, 伦敦	(5)
美元 36,302	新加坡元 46,398	2024年11月21日	高盛国际, 伦敦	(16)
美元 207,634	加元 280,061	2024年11月21日	高盛国际, 伦敦	(71)
美元 84,598	欧元 75,492	2024年11月21日	法国巴黎银行	(170)
			未实现总亏损	(382,648)
			未实现净收益	5,573,912

2023

未平仓合约:

加元 64,372	美元 47,736	2023年10月3日	法国巴黎银行	123
美元 242,752	澳元 380,611	2023年10月3日	Citibank N.A., 伦敦	2,903
美元 13,962	英镑 11,505	2023年10月3日	法国巴黎银行	81
美元 5,603	纽元 9,435	2023年10月3日	法国巴黎银行	66
美元 74,051	加元 100,115	2023年10月5日	Citibank N.A., 伦敦	1
美元 28,844	英镑 23,632	2023年10月5日	Citibank N.A., 伦敦	0
美元 106,014	离岸人民币 775,082	2023年10月10日	法国巴黎银行	391
澳元 824,013	美元 533,463	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,283
澳元 1,820,585	美元 1,176,209	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	402
澳元 92,907	美元 60,269	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	266
澳元 129,171	美元 83,520	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	97
澳元 62,258	美元 40,306	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	97
澳元 8,724	美元 5,676	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	42
澳元 8,549	美元 5,535	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	13
加元 1,063,508	美元 790,263	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	3,443
加元 731,736	美元 544,463	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3,100
加元 131,445	美元 98,056	2023年10月20日	法国巴黎银行	808
加元 325,775	美元 241,666	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	646
加元 177,061	美元 131,290	2023年10月20日	法国巴黎银行	294
加元 668,477	美元 494,773	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	211
加元 44,425	美元 32,940	2023年10月20日	法国巴黎银行	73
加元 34,821	美元 25,768	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	6
加元 18,156	美元 13,438	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	6
加元 1,810	美元 1,342	2023年10月20日	法国巴黎银行	3
加元 1,488	美元 1,103	2023年10月20日	法国巴黎银行	2
离岸人民币 10,523,236	美元 1,447,867	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	2,670
离岸人民币 625,718	美元 86,214	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	282
离岸人民币 255,382	美元 35,162	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	89
离岸人民币 129,505	美元 17,835	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	49
离岸人民币 1,835,804	美元 252,153	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	35
离岸人民币 110,679	美元 15,228	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	28
离岸人民币 434,186	美元 59,637	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	8
离岸人民币 7,996	美元 1,102	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	4
离岸人民币 97,453	美元 13,386	2023年10月20日	法国巴黎银行	3
离岸人民币 8,027	美元 1,105	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 8,097	美元 1,114	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 8,039	美元 1,106	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 21,300	美元 2,926	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	0
离岸人民币 8,017	美元 1,101	2023年10月20日	法国巴黎银行	0
离岸人民币 8,017	美元 1,101	2023年10月20日	法国巴黎银行	0
欧元 225,174	美元 241,971	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	3,387
欧元 189,510	美元 203,809	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	3,014
欧元 199,439	美元 213,443	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,127
欧元 82,585	美元 89,390	2023年10月20日	法国巴黎银行	1,888
欧元 293,169	美元 312,429	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	1,801
欧元 20,923	美元 22,469	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	300
欧元 13,292	美元 14,264	2023年10月20日	法国巴黎银行	181
欧元 18,807	美元 20,087	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	160
欧元 89,651	美元 95,110	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	120

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
欧元 12,440	美元 13,281	2023年10月20日	美国道富银行	100
欧元 2,072	美元 2,226	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	30
欧元 1,031	美元 1,102	2023年10月20日	法国巴黎银行	10
欧元 1,031	美元 1,102	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	9
欧元 1,032	美元 1,101	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	8
英镑 574,099	美元 719,172	2023年10月20日	法国巴黎银行	18,377
英镑 525,247	美元 659,472	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	18,309
英镑 289,500	美元 365,733	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	12,344
英镑 565,084	美元 699,686	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	9,895
英镑 824,225	美元 1,009,971	2023年10月20日	加拿大皇家银行	3,850
英镑 131,985	美元 164,885	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	3,773
英镑 78,979	美元 99,661	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	3,252
英镑 84,098	美元 104,295	2023年10月20日	法国巴黎银行	1,638
英镑 84,889	美元 104,133	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	510
英镑 14,685	美元 18,235	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	310
英镑 2,516	美元 3,139	2023年10月20日	法国巴黎银行	68
英镑 1,748	美元 2,195	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	61
英镑 1,485	美元 1,865	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	52
英镑 1,479	美元 1,857	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	52
英镑 1,745	美元 2,180	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	50
英镑 2,250	美元 2,789	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	43
英镑 882	美元 1,102	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	25
英镑 881	美元 1,094	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	19
英镑 886	美元 1,098	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	17
英镑 887	美元 1,099	2023年10月20日	法国巴黎银行	15
新加坡元 166,752	美元 123,292	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	1,021
新加坡元 89,609	美元 65,956	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	250
新加坡元 34,370	美元 25,434	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	232
新加坡元 75,671	美元 55,670	2023年10月20日	法国巴黎银行	184
新加坡元 80,103	美元 58,803	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	68
新加坡元 2,947	美元 2,168	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	8
新加坡元 1,501	美元 1,104	2023年10月20日	美国道富银行	3
美元 95,594,784	澳元 149,593,695	2023年10月20日	法国巴黎银行	1,018,808
美元 178,918,651	离岸人民币 1,309,539,599	2023年10月20日	法国巴黎银行	925,563
美元 25,995,876	美元 44,202,554	2023年10月20日	加拿大皇家银行	563,450
美元 44,328,161	加元 60,437,861	2023年10月20日	法国巴黎银行	385,842
美元 11,578,188	离岸人民币 84,742,955	2023年10月20日	法国巴黎银行	59,895
美元 7,254,672	离岸人民币 53,098,324	2023年10月20日	法国巴黎银行	37,529
美元 1,795,469	澳元 2,815,346	2023年10月20日	美国道富银行	22,794
美元 3,576,603	离岸人民币 26,177,838	2023年10月20日	法国巴黎银行	18,502
美元 486,946	美元 829,495	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	11,460
美元 836,891	加元 1,141,914	2023年10月20日	美林国际, 伦敦	7,937
美元 1,498,557	离岸人民币 10,956,668	2023年10月20日	美国道富银行	6,165
美元 827,870	澳元 1,289,406	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	4,880
美元 296,331	美元 500,803	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,579
美元 851,634	澳元 1,324,574	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	3,829
美元 2,633,722	离岸人民币 19,203,425	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	3,560
美元 148,527	美元 251,731	2023年10月20日	美国道富银行	2,727
美元 225,190	美元 378,610	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,300
美元 177,942	澳元 278,712	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	2,061
美元 178,867	美元 300,793	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,866
美元 539,924	澳元 838,495	2023年10月20日	法国巴黎银行	1,610
美元 987,409	离岸人民币 7,201,420	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	1,590
美元 317,276	离岸人民币 2,319,874	2023年10月20日	法国巴黎银行	1,321
美元 271,738	澳元 422,158	2023年10月20日	法国巴黎银行	909
美元 269,281	澳元 417,885	2023年10月20日	法国巴黎银行	606
美元 30,788	美元 52,120	2023年10月20日	法国巴黎银行	528
美元 306,113	加元 414,425	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	493
美元 164,944	离岸人民币 1,204,498	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	474
美元 55,463	美元 93,031	2023年10月20日	法国巴黎银行	435
美元 102,083	离岸人民币 746,335	2023年10月20日	美林国际, 伦敦	414
美元 28,081	美元 47,423	2023年10月20日	法国巴黎银行	414
美元 70,045	加元 95,142	2023年10月20日	法国巴黎银行	344
美元 62,781	离岸人民币 458,994	2023年10月20日	美林国际, 伦敦	254
美元 1,259,182	离岸人民币 9,170,421	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	228
美元 168,645	离岸人民币 1,229,529	2023年10月20日	法国巴黎银行	211

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 27,343	离岸人民币 200,340	2023年10月20日	法国巴黎银行	170
美元 106,556	离岸人民币 777,051	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	160
美元 115,380	离岸人民币 841,193	2023年10月20日	法国巴黎银行	145
美元 30,657	离岸人民币 224,144	2023年10月20日	美国道富银行	126
美元 52,860	离岸人民币 385,499	2023年10月20日	法国巴黎银行	82
美元 58,007	离岸人民币 422,952	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	78
美元 65,909	离岸人民币 480,434	2023年10月20日	法国巴黎银行	71
美元 41,239	新加坡元 56,324	2023年10月20日	法国巴黎银行	60
美元 5,268	澳元 8,250	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	60
美元 17,756	离岸人民币 129,661	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	51
美元 42,116	离岸人民币 306,995	2023年10月20日	法国巴黎银行	45
美元 13,889	离岸人民币 101,430	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	41
美元 12,323	离岸人民币 89,988	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	35
美元 5,251	离岸人民币 38,472	2023年10月20日	法国巴黎银行	33
美元 19,799	离岸人民币 144,402	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	32
美元 48,039	离岸人民币 350,000	2023年10月20日	美林国际, 伦敦	28
美元 15,002	离岸人民币 109,405	2023年10月20日	法国巴黎银行	23
美元 4,816	离岸人民币 35,201	2023年10月20日	法国巴黎银行	18
美元 7,544	澳元 11,708	2023年10月20日	法国巴黎银行	17
美元 2,487	离岸人民币 18,225	2023年10月20日	法国巴黎银行	16
美元 6,886	离岸人民币 50,232	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	13
美元 28,641	离岸人民币 208,625	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	11
美元 7,951	离岸人民币 57,973	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	11
美元 5,984	离岸人民币 43,644	2023年10月20日	法国巴黎银行	9
美元 3,124	离岸人民币 22,811	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	9
美元 12,381	英镑 10,149	2023年10月20日	法国巴黎银行	8
美元 24,877	离岸人民币 181,176	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	5
美元 1,910	离岸人民币 13,937	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	4
美元 1,242	离岸人民币 9,070	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	4
美元 2,097	离岸人民币 15,289	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	3
美元 1,300	离岸人民币 9,482	2023年10月20日	法国巴黎银行	2
美元 1,279	离岸人民币 9,330	2023年10月20日	美林国际, 伦敦	2
美元 2,520	离岸人民币 18,358	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	1
美元 1,152	离岸人民币 8,396	2023年10月20日	美国道富银行	1
美元 120,453	澳元 186,326	2023年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	14
美元 48,835	英镑 40,000	2023年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	1
			未实现总收益	3,200,060
纽元 93,031	美元 55,460	2023年10月3日	法国巴黎银行	(437)
美元 1,342	加元 1,810	2023年10月3日	法国巴黎银行	(3)
美元 25,762	加元 34,821	2023年10月3日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
英镑 10,149	美元 12,380	2023年10月5日	法国巴黎银行	(8)
英镑 40,000	美元 48,823	2023年10月6日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
纽元 10,012	美元 6,016	2023年10月6日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
澳元 186,326	美元 120,280	2023年10月10日	Citibank N.A., 伦敦	(9)
离岸人民币 9,330	美元 1,279	2023年10月10日	美林国际, 伦敦	(2)
离岸人民币 35,201	美元 4,815	2023年10月10日	法国巴黎银行	(18)
离岸人民币 777,051	美元 106,523	2023年10月10日	Citibank N.A., 伦敦	(152)
澳元 2,136	美元 1,377	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
澳元 1,708	美元 1,100	2023年10月20日	法国巴黎银行	(4)
澳元 12,205	美元 7,877	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
澳元 1,703	美元 1,092	2023年10月20日	法国巴黎银行	(8)
澳元 4,129	美元 2,653	2023年10月20日	渣打银行, 伦敦	(14)
澳元 2,206	美元 1,409	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
澳元 5,928	美元 3,809	2023年10月20日	渣打银行, 伦敦	(20)
澳元 10,559	美元 6,784	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(35)
澳元 282,700	美元 182,449	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(130)
澳元 64,953	美元 41,733	2023年10月20日	渣打银行, 伦敦	(217)
澳元 182,342	美元 117,529	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(234)
澳元 80,171	美元 51,510	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(268)
澳元 136,979	美元 88,169	2023年10月20日	法国巴黎银行	(298)
澳元 89,402	美元 57,410	2023年10月20日	法国巴黎银行	(330)
澳元 127,497	美元 81,409	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(934)
澳元 1,090,160	美元 702,466	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1,603)
澳元 380,611	美元 242,897	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2,917)
澳元 2,008,193	美元 1,293,567	2023年10月20日	加拿大皇家银行	(3,404)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
澳元 816,050	美元 523,539	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3,499)
澳元 2,682,787	美元 1,728,609	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(4,042)
澳元 742,928	美元 474,315	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5,498)
澳元 1,335,895	美元 853,023	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(9,752)
澳元 1,722,644	美元 1,102,527	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(10,025)
澳元 1,661,027	美元 1,060,766	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(11,992)
加元 1,487	美元 1,100	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
加元 1,500	美元 1,106	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(3)
加元 1,500	美元 1,106	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(3)
加元 43,581	美元 32,236	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
加元 92,253	美元 68,233	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(19)
加元 76,891	美元 56,863	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(24)
加元 36,729	美元 26,888	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(285)
加元 336,367	美元 247,633	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(1,223)
加元 371,991	美元 273,902	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	(1,310)
加元 177,526	美元 129,993	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,347)
加元 776,019	美元 571,028	2023 年 10 月 20 日	加拿大皇家银行	(3,098)
加元 702,387	美元 514,629	2023 年 10 月 20 日	加拿大皇家银行	(5,021)
离岸人民币 11,704	美元 1,606	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 8,097	美元 1,111	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 8,039	美元 1,103	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 8,011	美元 1,099	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 8,011	美元 1,099	2023 年 10 月 20 日	美林国际, 伦敦	(1)
离岸人民币 8,011	美元 1,099	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 8,011	美元 1,099	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 11,788	美元 1,617	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 10,109	美元 1,387	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 8,097	美元 1,110	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 8,097	美元 1,110	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 8,011	美元 1,098	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 7,996	美元 1,096	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 21,960	美元 3,013	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(3)
离岸人民币 8,097	美元 1,109	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 8,097	美元 1,109	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 8,097	美元 1,109	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 8,097	美元 1,109	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 8,041	美元 1,101	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 8,041	美元 1,101	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 27,991	美元 3,840	2023 年 10 月 20 日	美林国际, 伦敦	(4)
离岸人民币 9,565	美元 1,310	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(4)
离岸人民币 10,194	美元 1,395	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
离岸人民币 8,026	美元 1,097	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(5)
离岸人民币 8,026	美元 1,097	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
离岸人民币 7,996	美元 1,091	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(7)
离岸人民币 30,485	美元 4,178	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
离岸人民币 16,861	美元 2,305	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(10)
离岸人民币 10,965	美元 1,496	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(10)
离岸人民币 211,569	美元 29,037	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(18)
离岸人民币 78,880	美元 10,814	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(19)
离岸人民币 28,027	美元 3,825	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(25)
离岸人民币 60,371	美元 8,255	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(36)
离岸人民币 91,480	美元 12,519	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(44)
离岸人民币 305,349	美元 41,873	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(61)
离岸人民币 80,200	美元 10,944	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(70)
离岸人民币 139,866	美元 19,137	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(71)
离岸人民币 1,050,164	美元 144,143	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(80)
离岸人民币 153,446	美元 20,993	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(81)
离岸人民币 168,870	美元 23,107	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(85)
离岸人民币 178,524	美元 24,428	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(90)
离岸人民币 320,828	美元 43,954	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(107)
离岸人民币 628,558	美元 86,186	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(136)
离岸人民币 461,586	美元 63,252	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	(140)
离岸人民币 368,995	美元 50,514	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	(162)
离岸人民币 288,965	美元 39,512	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(173)
离岸人民币 663,900	美元 90,992	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	(184)
离岸人民币 2,741,658	美元 376,311	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(211)
离岸人民币 628,537	美元 86,098	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(221)
离岸人民币 467,461	美元 63,941	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(257)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
离岸人民币 751,980	美元 102,984	2023年10月20日	美国道富银行	(288)
离岸人民币 1,056,942	美元 144,861	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(293)
离岸人民币 1,091,004	美元 149,504	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(328)
离岸人民币 956,126	美元 130,977	2023年10月20日	法国巴黎银行	(332)
离岸人民币 987,833	美元 135,316	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(347)
离岸人民币 775,082	美元 106,037	2023年10月20日	法国巴黎银行	(408)
离岸人民币 895,164	美元 122,492	2023年10月20日	美国道富银行	(445)
离岸人民币 1,195,404	美元 163,711	2023年10月20日	美国道富银行	(458)
离岸人民币 956,970	美元 130,949	2023年10月20日	美国道富银行	(476)
离岸人民币 1,537,333	美元 210,595	2023年10月20日	法国巴黎银行	(533)
离岸人民币 982,192	美元 134,293	2023年10月20日	法国巴黎银行	(596)
离岸人民币 2,851,545	美元 390,970	2023年10月20日	法国巴黎银行	(644)
离岸人民币 1,838,333	美元 251,738	2023年10月20日	美国道富银行	(727)
离岸人民币 1,814,984	美元 248,522	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(737)
离岸人民币 4,169,292	美元 571,839	2023年10月20日	法国巴黎银行	(746)
离岸人民币 3,313,579	美元 454,163	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(904)
离岸人民币 8,287,909	美元 1,136,535	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,676)
离岸人民币 3,984,637	美元 545,129	2023年10月20日	法国巴黎银行	(2,097)
离岸人民币 15,226,954	美元 2,088,112	2023年10月20日	法国巴黎银行	(3,065)
离岸人民币 6,887,678	美元 942,411	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3,501)
离岸人民币 15,646,624	美元 2,143,614	2023年10月20日	法国巴黎银行	(5,198)
离岸人民币 22,568,940	美元 3,092,642	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(6,839)
离岸人民币 18,309,057	美元 2,506,440	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(8,014)
离岸人民币 14,116,831	美元 1,930,267	2023年10月20日	法国巴黎银行	(8,453)
离岸人民币 12,391,372	美元 1,690,926	2023年10月20日	法国巴黎银行	(10,830)
欧元 182,883	美元 193,360	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(414)
英镑 897	美元 1,094	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1)
英镑 50,494	美元 61,602	2023年10月20日	法国巴黎银行	(36)
英镑 11,505	美元 13,963	2023年10月20日	法国巴黎银行	(81)
英镑 251,244	美元 306,286	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(403)
英镑 517,371	美元 628,627	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(2,920)
纽元 1,865	美元 1,104	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(17)
纽元 2,592	美元 1,539	2023年10月20日	法国巴黎银行	(18)
纽元 1,864	美元 1,100	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(20)
纽元 1,864	美元 1,100	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(20)
纽元 1,859	美元 1,097	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(20)
纽元 1,847	美元 1,086	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(24)
纽元 9,435	美元 5,603	2023年10月20日	法国巴黎银行	(66)
纽元 10,475	美元 6,203	2023年10月20日	法国巴黎银行	(92)
纽元 8,187	美元 4,811	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(108)
纽元 24,267	美元 14,324	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(258)
纽元 77,239	美元 46,137	2023年10月20日	法国巴黎银行	(273)
纽元 43,089	美元 25,487	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(403)
纽元 107,303	美元 63,970	2023年10月20日	法国巴黎银行	(504)
纽元 90,944	美元 53,974	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(670)
纽元 108,251	美元 64,063	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(980)
纽元 238,110	美元 141,941	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(1,129)
纽元 287,454	美元 170,895	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,823)
纽元 263,457	美元 156,423	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1,876)
纽元 488,817	美元 290,190	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(3,518)
纽元 542,118	美元 321,894	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(3,840)
纽元 780,423	美元 464,759	2023年10月20日	美林国际, 伦敦	(4,162)
纽元 548,528	美元 324,848	2023年10月20日	加拿大皇家银行	(4,738)
纽元 507,190	美元 298,648	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(6,099)
新加坡元 116,205	美元 85,193	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(14)
新加坡元 35,592	美元 26,055	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(43)
新加坡元 72,988	美元 53,337	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(181)
美元 50,136	离岸人民币 365,053	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
美元 1,795	澳元 2,776	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
美元 1,124	离岸人民币 8,168	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
美元 80,983	离岸人民币 589,656	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
美元 1,222	离岸人民币 8,869	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
美元 3,032	离岸人民币 22,035	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
美元 1,580	加元 2,118	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
美元 3,233	新加坡元 4,391	2023年10月20日	法国巴黎银行	(14)
美元 27,133	新加坡元 36,982	2023年10月20日	美国道富银行	(15)
美元 41,284	离岸人民币 300,473	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(19)
美元 124,063	离岸人民币 903,147	2023年10月20日	法国巴黎银行	(30)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 14,942	离岸人民币 108,506	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(41)
美元 13,037	欧元 12,217	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(92)
美元 6,198	英镑 5,000	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(95)
美元 47,749	加元 64,372	2023年10月20日	法国巴黎银行	(124)
美元 251,500	加元 339,773	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(125)
美元 55,224	新加坡元 75,133	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(132)
美元 6,236	英镑 5,000	2023年10月20日	渣打银行, 伦敦	(133)
美元 66,762	离岸人民币 485,149	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(135)
美元 84,750	离岸人民币 616,081	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(141)
美元 133,771	离岸人民币 972,436	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(223)
美元 9,938	英镑 7,931	2023年10月20日	法国巴黎银行	(256)
美元 92,759	新加坡元 126,051	2023年10月20日	美国道富银行	(332)
美元 33,847	新加坡元 45,663	2023年10月20日	美国道富银行	(365)
美元 483,068	英镑 395,426	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(377)
美元 151,480	欧元 142,428	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(570)
美元 501,460	加元 676,979	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(608)
美元 280,878	澳元 433,850	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(680)
美元 1,087,128	澳元 1,682,126	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(744)
美元 99,036	欧元 92,764	2023年10月20日	美林国际, 伦敦	(748)
美元 2,012,109	离岸人民币 14,644,501	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(922)
美元 381,739	加元 514,506	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,090)
美元 199,562	欧元 186,834	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1,602)
美元 660,128	澳元 1,018,872	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(2,100)
美元 138,984	欧元 129,126	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2,168)
美元 453,071	英镑 369,342	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2,220)
美元 380,279	澳元 584,502	2023年10月20日	渣打银行, 伦敦	(2,785)
美元 119,634	欧元 109,818	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(3,276)
美元 4,888,068	新加坡元 6,661,522	2023年10月20日	美国道富银行	(3,516)
美元 142,469	英镑 113,468	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(3,961)
美元 322,083	英镑 260,292	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(4,348)
美元 330,558	欧元 307,150	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(5,116)
美元 230,277	英镑 184,348	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(5,246)
美元 189,280	英镑 150,000	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(6,177)
美元 379,000	英镑 305,202	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(6,444)
美元 649,749	英镑 522,366	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(12,104)
美元 388,124	英镑 305,946	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(14,660)
美元 1,071,578	英镑 853,372	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(29,878)
美元 17,446,619	欧元 16,258,017	2023年10月20日	法国巴黎银行	(220,405)
美元 56,608,789	英镑 45,371,589	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1,224,280)
加元 100,115	美元 74,098	2023年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 8,028	美元 1,103	2023年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 338,185	美元 46,483	2023年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(23)
英镑 23,632	美元 28,851	2023年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
美元 6,016	纽元 10,012	2023年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
			未实现总亏损	(1,721,638)
			未实现净收益	1,478,422

独立核数师报告

致摩根亚洲股息基金（“贵基金”）份额持有人

就财务报表审计作出的报告

意见

我们已审计的内容

摩根亚洲股息基金列载于第四页至第四十页的财务报表，包括：

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

我们的意见

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

意见的基础

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

我们相信，我们所获得的审计凭证能充足及适当地为我们的审计意见提供基础。

独立性

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

其他信息

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

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

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

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

管理层就财务报表需承担的责任

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

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

此外，贵基金管理层负责确保财务报表已遵照二零一一年五月六日订立的信托契约（经修订）（“信托契约”）以及香港证券及期货事务监察委员会颁布的单位信托及互惠基金守则（“证监会守则”）附录E的相关披露条文适当地拟备。

核数师就审计财务报表承担的责任

我们的目标，是对财务报表整体是否不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述取得合理保证，并出具包括我们意见的核数师报告。我们仅向阁下（作为整体）报告我们的意见，除此之外本报告别无其他目的。我们不会就本报告的内容向任何其他人士负上或承担任何责任。合理保证是高水平的保证，但不能保证按照《香港审计准则》进行的审计，在某一重大错误陈述存在时总能发现。错误陈述可以由欺诈或错误所引起，如果合理预期它们单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依赖财务报表所作出的经济决定，则有关的错误陈述可以被视为重大。此外，我们必须评估贵基金的财务报表在所有重大方面是否已根据信托契约及证监会守则附录E的相关披露条文适当地拟备。

在根据《香港审计准则》进行审计的过程中，我们运用了专业判断，保持了专业怀疑态度。我们亦：

- 识别和评估由于欺诈或错误而导致财务报表存在重大错误陈述的风险，设计及执行审计程序以应对这些风险，以及获取充足和适当的审计凭证，作为我们意见的基础。由于欺诈可能涉及串谋、伪造、蓄意遗漏、虚假陈述，或凌驾于内部控制之上，因此未能发现因欺诈而导致的重大错误陈述的风险高于未能发现因错误而导致的重大错误陈述的风险。
- 了解与审计相关的内部控制，以设计适当的审计程序，但目的并非对贵基金内部控制的有效性发表意见。
- 评价管理层所采用会计政策的恰当性及作出会计估计及相关披露的合理性。

独立核数师报告 (续)

致摩根亚洲股息基金 (“贵基金”) 份额持有人

核数师就审计财务报表承担的责任 (续)

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

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

根据信托契约与证监会守则附录E的相关披露条文就相关事项作出的报告

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

罗兵咸永道会计师事务所
执业会计师

香港，二零二五年一月二十四日

管理人及受托人的责任声明

管理人的责任

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

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

管理人亦务必遵照信托契约，采取合理措施预防和监测欺诈及其他不法行为。

受托人的责任

基金受托人务必：

- 确保管理人遵照信托契约管理本基金且确保投资及借款能力符合要求；
- 确保已保留充分的会计记录及其他记录；
- （在合理可行的情况下）保护本基金的财产及附带权利；及
- 就每一个会计年度，若管理人未按照信托契约管理本基金，则须向份额持有人报告。

受托人对份额持有人的报告

本受托人谨确认管理人于截至二零二四年九月三十日止财政年度在各个重要方面均依照二零一一年五月六日所订立之信托契约（经修订）之条款管理本基金。

汇丰机构信托服务（亚洲）有限公司，受托人

二零二五年一月二十四日

业绩记录 (未经审计)

资产净值

(续)

最高卖出价/最低买入价

财务期结算日	本基金资产净值	每份额资产净值
30/9/24		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 120,369,763	澳元 9.20
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 40,955,854	加元 9.65
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11,017,196	欧元 10.12
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 31,775,385	英镑 9.92
- 港元类别 (累计)	港元 18,142,343	港元 17.16
- 港元类别 (每月派息)	港元 1,461,539,883	港元 10.28
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 42,961,423	纽元 9.41
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 182,312,726	人民币 13.66
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 361,177,704	人民币 10.73
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 145,006,167	人民币 13.00
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 200,486,668	人民币 10.13
- PRC 美元份额 (累计)	美元 14,683,349	美元 13.10
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 19,294,877	美元 10.31
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 40,402,462	人民币 19.59
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 1,059,588,613	人民币 10.49
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 6,820,316	新加坡元 9.84
- 美元类别 (累计)	美元 7,008,760	美元 17.21
- 美元类别 (每月派息)	美元 241,599,859	美元 10.28
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 61,267,181	美元 12.11
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 32,110,026	美元 11.02
30/9/23		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 145,075,558	澳元 7.77
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 57,931,310	加元 8.13
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 15,973,298	欧元 8.51
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 45,072,406	英镑 8.38
- 港元类别 (累计)	港元 22,192,592	港元 13.93
- 港元类别 (每月派息)	港元 1,829,727,869	港元 8.71
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 42,604,365	纽元 7.95
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 13,504,313	人民币 11.45
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 19,301,686	人民币 9.39
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 52,732,738	人民币 10.74
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 83,344,001	人民币 8.51
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12,650,318	美元 10.56
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10,784,066	美元 8.66
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 25,214,077	人民币 16.19
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 1,228,111,258	人民币 8.81
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 6,357,122	新加坡元 8.28
- 美元类别 (累计)	美元 7,274,089	美元 13.86
- 美元类别 (每月派息)	美元 280,663,732	美元 8.63
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 75,937,626	美元 10.08
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 27,387,343	美元 9.18
30/9/22		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 136,342,047	澳元 7.25
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 61,318,511	加元 7.54
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 16,395,953	欧元 7.91
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 50,842,961	英镑 7.78
- 港元类别 (累计)	港元 22,555,210	港元 12.35
- 港元类别 (每月派息)	港元 2,032,712,595	港元 8.06
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 44,500,103	纽元 7.41
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 16,266,496	人民币 9.91
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 13,778,756	人民币 8.51
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 46,975,544	人民币 9.80
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 74,167,080	人民币 7.91
- PRC 美元份额 (累计)	美元 15,063,976	美元 9.34
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 11,651,113	美元 8.01
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 21,813,168	人民币 14.77
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 1,431,961,989	人民币 8.19
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 5,996,821	新加坡元 7.68
- 美元类别 (累计)	美元 8,520,838	美元 12.26
- 美元类别 (每月派息)	美元 335,998,871	美元 7.97
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 80,422,237	美元 9.25
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 19,480,421	美元 8.42

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
30/9/24		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.26	澳元 7.51
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.71	加元 7.85
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.18	欧元 8.22
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.99	英镑 8.08
- 港元类别 (累计)	港元 17.24	港元 13.48
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.36	港元 8.40
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.47	纽元 7.68
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 13.68	人民币 11.15
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.78	人民币 9.14
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 13.05	人民币 10.40
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.17	人民币 8.23
- PRC 美元份额 (累计)	美元 13.15	美元 10.23
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.38	美元 8.37
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 19.67	人民币 15.68
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.53	人民币 8.52
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.90	新加坡元 8.00
- 美元类别 (累计)	美元 17.27	美元 13.43
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.35	美元 8.34
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 12.27	美元 9.78
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 11.09	美元 8.88
30/9/23		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.66	澳元 6.88
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.05	加元 7.15
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 9.46	欧元 7.50
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.30	英镑 7.37
- 港元类别 (累计)	港元 15.00	港元 11.77
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.68	港元 7.65
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.88	纽元 7.04
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 12.12	人民币 9.63
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.05	人民币 8.28
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.81	人民币 9.33
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.47	人民币 7.51
- PRC 美元份额 (累计)	美元 11.39	美元 8.90
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 9.63	美元 7.60
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 17.80	人民币 14.06
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.80	人民币 7.77
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.21	新加坡元 7.28
- 美元类别 (累计)	美元 14.95	美元 11.68
- 美元类别 (每月派息)	美元 9.60	美元 7.57
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 11.16	美元 8.82
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 10.16	美元 7.99
30/9/22		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.08	澳元 7.25
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.45	加元 7.53
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.95	欧元 7.91
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.75	英镑 7.77
- 港元类别 (累计)	港元 16.42	港元 12.35
- 港元类别 (每月派息)	港元 11.04	港元 8.06
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.28	纽元 7.41
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 11.86	人民币 9.91
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.47	人民币 8.51
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 13.06	人民币 9.80
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.95	人民币 7.90
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12.52	美元 9.34
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 11.05	美元 8.00
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 19.68	人民币 14.77
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 11.33	人民币 8.18
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.64	新加坡元 7.68
- 美元类别 (累计)	美元 16.42	美元 12.26
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.00	美元 7.97
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 12.76	美元 9.24
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 11.56	美元 8.42

业绩记录 (未经审计) (续)

(续)

最高卖出价/最低买入价

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价	财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
30/9/21			30/9/18		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.26	澳元 7.77	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.73	澳元 9.08
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.62	加元 8.04	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.90	加元 9.23
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.12	欧元 8.41	- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.15	欧元 9.46
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.92	英镑 8.26	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 11.11	英镑 9.44
- 港元类别 (累计)	港元 16.14	港元 11.93	- 港元类别 (累计)	港元 13.96	港元 12.27
- 港元类别 (每月派息)	港元 11.14	港元 8.41	- 港元类别 (每月派息)	港元 11.22	港元 9.57
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.46	纽元 7.92	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.84	纽元 9.18
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 11.81	人民币 9.14	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 15.82	人民币 13.95
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.69	人民币 8.45	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 11.62	人民币 9.86
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 12.70	人民币 9.26	- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.94	新加坡元 9.26
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 11.13	人民币 8.41	- 美元类别 (累计)	美元 13.87	美元 12.19
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12.37	美元 9.15	- 美元类别 (每月派息)	美元 11.15	美元 9.47
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 11.21	美元 8.47			
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 19.10	人民币 13.93	30/9/17		
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 11.51	人民币 8.69	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.86	澳元 8.64
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.80	新加坡元 8.16	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.99	加元 8.76
- 美元类别 (累计)	美元 16.21	美元 11.99	- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.23	欧元 8.96
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.15	美元 8.42	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.20	英镑 8.93
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 12.90	美元 9.66	- 港元类别 (累计)	港元 12.53	港元 10.56
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 11.64	美元 8.75	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.28	港元 8.93
			- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.97	纽元 8.74
			- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 14.09	人民币 11.61
			- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.68	人民币 9.32
			- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.04	新加坡元 8.78
			- 美元类别 (累计)	美元 12.46	美元 10.57
			- 美元类别 (每月派息)	美元 10.23	美元 8.94
30/9/20			30/9/16		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.50	澳元 5.86	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.79	澳元 7.71
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.68	加元 6.09	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.93	加元 7.77
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 9.96	欧元 6.39	- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.15	欧元 7.91
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.90	英镑 6.22	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.14	英镑 7.85
- 港元类别 (累计)	港元 13.63	港元 8.83	- 港元类别 (累计)	港元 11.81	港元 9.01
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.99	港元 6.42	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.10	港元 7.94
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.61	纽元 5.99	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.90	纽元 7.75
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 10.69	人民币 7.20	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.94	人民币 9.65
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.28	人民币 6.87	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.62	人民币 8.32
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 10.43	人民币 6.77	- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.96	新加坡元 7.79
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.00	人民币 6.42	- 美元类别 (累计)	美元 11.82	美元 8.94
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.45	美元 6.78	- 美元类别 (每月派息)	美元 10.12	美元 7.88
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.05	美元 6.47			
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 15.72	人民币 10.19	30/9/15		
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.34	人民币 6.63	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 11.36	澳元 8.56
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.72	新加坡元 6.19	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 11.45	加元 8.63
- 美元类别 (累计)	美元 13.68	美元 8.88	- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.48	欧元 8.72
- 美元类别 (每月派息)	美元 9.99	美元 6.43	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 11.48	英镑 8.70
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 10.15	美元 9.62	- 港元类别 (累计)	港元 12.54	港元 9.68
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 10.32	美元 6.65	- 港元类别 (每月派息)	港元 11.45	港元 8.67
			- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 11.43	纽元 8.60
			- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.35	人民币 10.00
			- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 12.29	人民币 9.23
			- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 11.41	新加坡元 8.61
			- 美元类别 (累计)	美元 12.56	美元 9.69
			- 美元类别 (每月派息)	美元 11.47	美元 8.69
30/9/19					
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.77	澳元 8.53			
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.95	加元 8.69			
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.20	欧元 8.88			
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.17	英镑 8.88			
- 港元类别 (累计)	港元 13.61	港元 11.60			
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.33	港元 9.00			
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.88	纽元 8.63			
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 10.55	人民币 9.75			
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.39	人民币 9.57			
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 10.32	人民币 9.21			
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.28	人民币 9.04			
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.33	美元 9.26			
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.29	美元 9.08			
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 15.53	人民币 13.24			
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.62	人民币 9.29			
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.98	新加坡元 8.72			
- 美元类别 (累计)	美元 13.52	美元 11.53			
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.22	美元 8.92			
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 10.00	美元 9.29			

经营与管理

管理人及服务提供者

摩根基金（亚洲）有限公司
香港
中环干诺道中 8 号
遮打大厦 19 楼

投资管理人

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

助理管理人

二零二三年十一月三十日之前
JPMorgan Asset Management
(UK) Limited
60 Victoria Embankment
London
EC4Y 0JP
United Kingdom

管理人董事

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

受托人

汇丰机构信托服务
（亚洲）有限公司
香港
中环皇后大道中 1 号

基金注册登记机构

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

核数师

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

