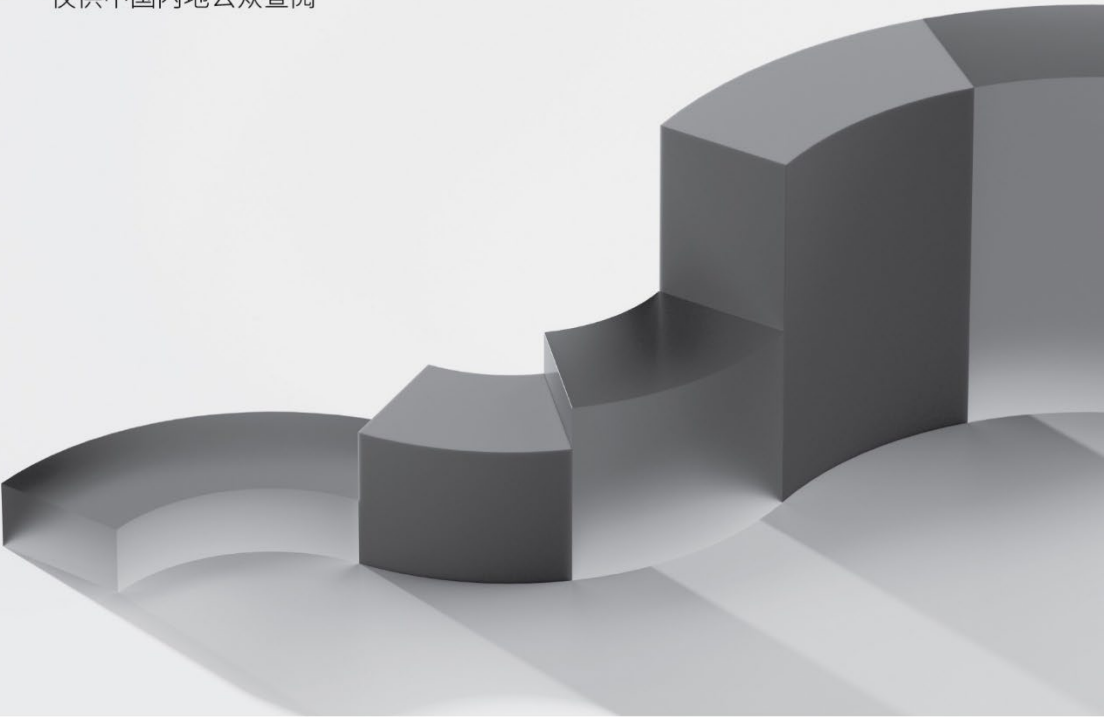


仅供中国内地公众查阅



半年度报告－ 2025年3月31日（未经审核）

摩根亚洲股息基金

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	1 - 2
投资组合持有变动表	2
金融衍生工具详情	3 - 10
财务状况表	11
综合收益表	11
可赎回份额持有人应占净资产变动表	12
现金流量表	12
财务报表之附注	13 - 21
经营与管理	22

投资组合
于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
上市投资 (99.4%)				香港 (9.1%)			
(I) 股票 (99.7%)				友邦保险控股有限公司	3,805,400	28,661,676	3.0
澳大利亚 (18.4%)				中电控股有限公司	1,139,500	9,285,542	1.0
ANZ Banking Group Ltd	833,325	15,106,043	1.6	香港电讯信托与香港电讯有 限公司	1,831,000	2,447,515	0.3
BHP Group Ltd	200,455	4,771,697	0.5	香港交易及结算所有限公司	484,935	21,490,892	2.2
Brambles Ltd	979,002	12,219,604	1.3	汇丰控股有限公司	1,291,200	14,629,163	1.5
Coles Group Ltd	1,038,554	12,639,326	1.3	领展房地产投资信托基金	2,220,000	10,386,232	1.1
GPT Group	3,593,551	9,763,441	1.0	印度 (11.2%)			
Insurance Australia Group Limited	1,850,487	8,890,640	0.9	Embassy Office Parks REIT	2,485,409	10,627,888	1.1
Medibank Private Ltd	5,937,991	16,429,150	1.7	HDFC Bank Limited	1,704,812	36,464,796	3.8
National Australia Bank Ltd	483,500	10,249,989	1.1	ICICI Bank Ltd	489,861	7,727,679	0.8
QBE Insurance Group Limited	820,259	11,194,062	1.2	Infosys Technologies Ltd Sponsored ADR	966,499	17,638,607	1.8
RIO Tinto PLC	196,784	11,649,662	1.2	ITC Ltd	1,668,695	7,999,623	0.8
Santos Ltd	3,789,747	15,728,128	1.6	Maruti Suzuki India Ltd	101,111	13,630,303	1.4
Telstra Corporation Limited	12,182,187	31,959,499	3.3	Power Grid Corp of India Ltd	2,402,821	8,162,381	1.0
Vicinity Centres REIT	11,601,396	15,904,702	1.7	Tata Consultancy Services Ltd	122,719	5,177,608	0.5
中国 (27.7%)				印度尼西亚 (3.6%)			
阿里巴巴集团控股有限公司	2,409,100	39,634,050	4.1	Bank Central Asia	32,395,100	16,627,920	1.7
中国建设银行股份有限公司 H 股	7,055,000	6,238,628	0.7	Bank Mandiri Persero	32,440,700	10,186,693	1.1
中国招商银行股份有限公司 A 股(C1)	1,043,800	6,218,927	0.7	Telkom Indonesia Persero	50,562,000	7,358,359	0.8
中国招商银行股份有限公司 H 股	1,699,000	10,023,277	1.0	韩国 (10.0%)			
中国太平洋保险 (集团) 股 份有限公司 H 股	1,416,400	4,451,111	0.5	BGF Retail Co Ltd	61,600	4,576,597	0.5
华润置地有限公司	2,724,600	8,124,458	0.8	DB Insurance Co Ltd	120,148	7,229,279	0.7
中国长江电力股份有限公司 A 股(C1)	1,112,850	4,259,398	0.4	Hana Financial Holdings	348,500	14,105,671	1.5
宁德时代新能源科技股份有 限公司 A 股(C2)	325,300	11,324,321	1.2	Hyundai Motor Co Ltd Pref	22,836	2,299,884	0.2
新奥能源控股有限公司	754,500	6,225,840	0.7	KT Corporation	160,133	5,393,954	0.5
福耀玻璃工业集团股份有限 公司 A 股(C1)	435,160	3,507,800	0.4	Samsung Electronics Co Ltd	627,056	24,613,811	2.6
福耀玻璃工业集团股份有限 公司 H 股	2,668,400	19,034,767	2.0	Samsung Electronics Co Ltd Preference Shares	180,100	5,772,985	0.6
华住集团有限公司 ADR	138,883	5,140,060	0.5	Shinhan Financial Group Company Limited	351,400	11,228,095	1.2
海尔智家股份有限公司 H 股	2,907,401	9,342,188	1.0	SK Hynix Inc	138,300	17,910,906	1.9
顾家家居股份有限公司 A 股 (C1)	686,299	2,424,654	0.3	SK Telecom Company Limited	76,100	2,868,285	0.3
美的集团股份有限公司 A 股 (C2)	1,170,864	12,649,888	1.3	新加坡 (5.2%)			
国电南瑞科技股份有限公司 A 股(C1)	1,287,640	3,881,049	0.4	Capitaland Integrated Commercial Trust REIT	6,297,700	9,839,424	1.0
网易股份有限公司	1,009,800	20,506,716	2.1	DBS Group Holdings Ltd	591,213	20,440,196	2.1
申洲国际集团控股有限公司	1,154,500	8,665,836	0.9	Singapore Exchange Limited	1,509,600	15,016,258	1.6
腾讯控股有限公司	1,097,100	70,081,963	7.3	United Overseas Bank Ltd	174,100	4,933,762	0.5
信义光能控股有限公司	11,128,000	4,290,837	0.4	台湾 (14.5%)			
紫金矿业集团股份有限公司 A 股(C1)	3,991,993	9,955,396	1.0	智邦科技股份有限公司	172,000	2,983,872	0.3
				研华股份有限公司	322,929	3,647,267	0.4
				日月光投资控股股份有限公 司	504,000	2,170,680	0.2
				亿丰综合工业股份有限公司	479,000	5,684,090	0.6
				谱瑞科技股份有限公司	218,000	3,709,660	0.4
				广达电脑股份有限公司	926,000	6,261,185	0.7

投资组合 (续)

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

投资组合持有变动表

截至二零二五年三月三十一日止期间 (未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		持有占资产净值百分比	
					31.3.2025	30.9.2024
台湾 (续)				上市投资		
瑞昱半导体股份有限公司	709,000	11,168,045	1.2	股票		
台湾大哥大股份有限公司	2,150,000	7,543,860	0.8			
台湾积体电路制造股份有限公司	3,261,000	89,376,101	9.3	中国	27.7	22.8
纬颖科技服务股份有限公司	127,000	6,253,897	0.6	澳大利亚	18.4	19.3
				台湾	14.5	15.6
		956,017,748	99.7	印度	11.2	12.0
		-----	-----	韩国	10.0	9.2
				香港	9.1	10.6
				新加坡	5.2	5.7
				印度尼西亚	3.6	4.4
(II) 集体投资计划 (0.0%)				集体投资计划		
卢森堡 (0.0%)				卢森堡	0.0	0.0
JPMLIQ-JPM USD Liquidity						
LVNAV 'X' (dist)*#	10,000	10,000	0.0			
(III) 衍生性产品 (-0.3%)				衍生性产品		
远期外汇合约 (-0.3%)		(2,578,041)	(0.3)	远期外汇合约	(0.3)	0.5
总上市投资		953,449,707	99.4	总上市投资	99.4	100.1
其他净资产		5,376,390	0.6	其他净资产 / (负债)	0.6	(0.1)
于二零二五年三月三十一日可赎回份额持有人应占净资产		958,826,097	100.0	可赎回份额持有人应占净资产	100.0	100.0
总投资, 按成本		873,254,090				

* 由管理人的关联人士发行和管理

在香港未获认可及并非供香港公众投资

金融衍生工具详情
于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

于二零二五年三月三十一日，本基金持有之金融衍生工具汇总如下：

远期外汇合约

以下为于二零二五年三月三十一日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／(亏损) 美元
于 2025 年 3 月 31 日				
未平仓合约：				
澳元 350,831	美元 221,295	2025 年 4 月 1 日	巴克莱银行，伦敦	2,675
离岸人民币 382,030	美元 52,601	2025 年 4 月 1 日	巴克莱银行，伦敦	23
离岸人民币 16,236	美元 2,236	2025 年 4 月 1 日	巴克莱银行，伦敦	1
英镑 18,251	美元 23,630	2025 年 4 月 1 日	巴克莱银行，伦敦	73
美元 64,820	离岸人民币 471,031	2025 年 4 月 1 日	Citibank N.A.，伦敦	8
美元 42,892	离岸人民币 311,685	2025 年 4 月 1 日	Citibank N.A.，伦敦	5
美元 1,250	离岸人民币 9,098	2025 年 4 月 1 日	法国巴黎银行	2
美元 1,098	离岸人民币 7,993	2025 年 4 月 1 日	法国巴黎银行	2
美元 1,095	英镑 850	2025 年 4 月 1 日	巴克莱银行，伦敦	2
美元 1,102	离岸人民币 8,007	2025 年 4 月 1 日	Citibank N.A.，伦敦	0
澳元 100,000	美元 63,052	2025 年 4 月 2 日	巴克莱银行，伦敦	737
加元 14,385	美元 10,093	2025 年 4 月 2 日	巴克莱银行，伦敦	98
美元 77,856	离岸人民币 565,991	2025 年 4 月 2 日	Citibank N.A.，伦敦	41
美元 18,494	离岸人民币 134,445	2025 年 4 月 2 日	Citibank N.A.，伦敦	10
美元 2,209	离岸人民币 16,060	2025 年 4 月 2 日	Citibank N.A.，伦敦	1
美元 4,768	离岸人民币 34,646	2025 年 4 月 2 日	Citibank N.A.，伦敦	0
美元 1,191	离岸人民币 8,652	2025 年 4 月 2 日	Citibank N.A.，伦敦	0
英镑 70,181	美元 90,963	2025 年 4 月 3 日	Citibank N.A.，伦敦	378
美元 1,100	离岸人民币 7,994	2025 年 4 月 3 日	Citibank N.A.，伦敦	1
美元 68,223	离岸人民币 495,669	2025 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	0
美元 66,151	离岸人民币 480,611	2025 年 4 月 3 日	Citibank N.A.，伦敦	0
美元 10,922	离岸人民币 79,353	2025 年 4 月 3 日	Citibank N.A.，伦敦	0
加元 12,441	美元 8,714	2025 年 4 月 7 日	Citibank N.A.，伦敦	67
欧元 2,512	美元 2,714	2025 年 4 月 7 日	法国巴黎银行	-
美元 1,101	离岸人民币 7,997	2025 年 4 月 7 日	Citibank N.A.，伦敦	-
澳元 2,185,804	美元 1,378,549	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	16,245
澳元 1,160,726	美元 729,588	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A.，伦敦	6,165
澳元 769,928	美元 485,907	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行，伦敦	6,048
澳元 929,560	美元 585,195	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A.，伦敦	5,845
澳元 2,862,077	美元 1,788,712	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	4,919
澳元 837,788	美元 526,883	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	4,731
澳元 317,746	美元 202,567	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	4,532
澳元 483,809	美元 305,222	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	3,688
澳元 371,124	美元 234,126	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A.，伦敦	2,822
澳元 185,927	美元 118,175	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行，伦敦	2,296
澳元 128,380	美元 81,561	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A.，伦敦	1,548
澳元 411,613	美元 257,909	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行，伦敦	1,371
澳元 72,997	美元 46,050	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行，伦敦	555
澳元 28,604	美元 18,046	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行，伦敦	218
澳元 20,735	美元 13,130	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	206
澳元 20,858	美元 13,153	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行，伦敦	154
澳元 20,608	美元 12,955	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行，伦敦	111
澳元 6,759	美元 4,294	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A.，伦敦	82
澳元 12,642	美元 7,950	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A.，伦敦	71
澳元 54,073	美元 33,761	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行，伦敦	60
澳元 10,126	美元 6,368	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A.，伦敦	57
澳元 3,898	美元 2,458	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行，伦敦	29
澳元 2,196	美元 1,396	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行，伦敦	27
澳元 1,744	美元 1,108	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A.，伦敦	21
澳元 1,915	美元 1,212	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	19
澳元 1,753	美元 1,107	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行，伦敦	15
澳元 1,752	美元 1,105	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行，伦敦	13
澳元 1,750	美元 1,104	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	13
澳元 1,745	美元 1,101	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A.，伦敦	13
澳元 1,745	美元 1,101	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A.，伦敦	13

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／(亏损) 美元
澳元 1,744	美元 1,097	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	9
加元 968,707	美元 674,063	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	339
加元 501,536	美元 349,100	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	287
加元 76,962	美元 53,689	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	164
加元 64,108	美元 44,716	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	130
加元 313,792	美元 218,332	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	94
加元 7,220	美元 5,071	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	49
加元 45,010	美元 31,352	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	48
加元 80,234	美元 55,847	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	46
加元 191,346	美元 133,124	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	45
加元 9,901	美元 6,920	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	34
加元 29,951	美元 20,842	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	11
加元 1,961	美元 1,372	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	9
加元 1,582	美元 1,108	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	8
加元 1,568	美元 1,096	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	6
加元 2,301	美元 1,605	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	5
加元 2,249	美元 1,568	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	5
加元 3,173	美元 2,208	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	1
离岸人民币 7,333,556	美元 1,016,898	2025 年 4 月 22 日	加拿大皇家银行	6,034
离岸人民币 6,502,095	美元 899,706	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	3,451
离岸人民币 7,972,031	美元 1,101,400	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	2,528
离岸人民币 2,280,324	美元 315,722	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	1,400
离岸人民币 1,483,206	美元 205,667	2025 年 4 月 22 日	加拿大皇家银行	1,220
离岸人民币 1,471,757	美元 204,079	2025 年 4 月 22 日	加拿大皇家银行	1,211
离岸人民币 1,563,884	美元 216,703	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	1,136
离岸人民币 1,106,093	美元 153,211	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	746
离岸人民币 880,627	美元 122,124	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	737
离岸人民币 798,053	美元 110,733	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	729
离岸人民币 866,134	美元 120,091	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	702
离岸人民币 1,314,856	美元 181,939	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	698
离岸人民币 1,312,063	美元 181,552	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	696
离岸人民币 695,664	美元 96,526	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	635
离岸人民币 849,562	美元 117,669	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	565
离岸人民币 804,631	美元 111,442	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	531
离岸人民币 1,621,086	美元 223,966	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	514
离岸人民币 1,596,441	美元 220,561	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	506
离岸人民币 503,993	美元 69,931	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	460
离岸人民币 697,060	美元 96,511	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	428
离岸人民币 498,407	美元 69,118	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	417
离岸人民币 1,780,975	美元 245,875	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	383
离岸人民币 527,483	美元 73,092	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	383
离岸人民币 1,204,372	美元 166,351	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	339
离岸人民币 396,448	美元 54,973	2025 年 4 月 22 日	加拿大皇家银行	326
离岸人民币 394,999	美元 54,734	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	287
离岸人民币 418,220	美元 57,925	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	277
离岸人民币 2,699,902	美元 372,392	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	235
离岸人民币 302,048	美元 41,854	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	219
离岸人民币 742,677	美元 102,580	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	209
离岸人民币 333,110	美元 46,117	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	201
离岸人民币 247,649	美元 34,337	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	201
离岸人民币 351,320	美元 48,613	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	187
离岸人民币 200,028	美元 27,755	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	183
离岸人民币 2,970,000	美元 409,567	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	179
离岸人民币 291,883	美元 40,409	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	176
离岸人民币 256,560	美元 35,535	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	170
离岸人民币 230,958	美元 31,991	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	156
离岸人民币 549,618	美元 75,915	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	155
离岸人民币 2,480,122	美元 342,012	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	150
离岸人民币 237,580	美元 32,894	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	146
离岸人民币 430,277	美元 59,446	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	136
离岸人民币 565,952	美元 78,133	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	122
离岸人民币 225,501	美元 31,205	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	122
离岸人民币 104,241	美元 14,437	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	69
离岸人民币 77,130	美元 10,696	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	65
离岸人民币 81,635	美元 11,307	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	54
离岸人民币 63,140	美元 8,754	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	51
离岸人民币 165,382	美元 22,843	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	47
离岸人民币 77,099	美元 10,669	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	42

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 267,072	美元 36,845	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	32
离岸人民币 49,047	美元 6,791	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	30
离岸人民币 45,771	美元 6,339	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	30
离岸人民币 38,535	美元 5,337	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	26
离岸人民币 33,193	美元 4,598	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	22
离岸人民币 30,383	美元 4,210	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	22
离岸人民币 22,600	美元 3,134	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	18
离岸人民币 27,127	美元 3,756	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	16
离岸人民币 18,574	美元 2,576	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	16
离岸人民币 15,035	美元 2,085	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	12
离岸人民币 13,058	美元 1,812	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	12
离岸人民币 34,069	美元 4,706	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	10
离岸人民币 107,574	美元 14,837	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	9
离岸人民币 15,691	美元 2,171	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	8
离岸人民币 7,986	美元 1,108	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	7
离岸人民币 7,965	美元 1,105	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	7
离岸人民币 7,965	美元 1,105	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	7
离岸人民币 7,965	美元 1,105	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	7
离岸人民币 7,965	美元 1,105	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	7
离岸人民币 28,813	美元 3,978	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	6
离岸人民币 22,794	美元 3,148	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	6
离岸人民币 8,723	美元 1,208	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	6
离岸人民币 8,327	美元 1,153	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	6
离岸人民币 7,996	美元 1,108	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	6
离岸人民币 7,951	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	6
离岸人民币 7,951	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	6
离岸人民币 7,951	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	6
离岸人民币 21,534	美元 2,973	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	5
离岸人民币 8,363	美元 1,157	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	5
离岸人民币 7,971	美元 1,104	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	5
离岸人民币 7,971	美元 1,104	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	5
离岸人民币 7,968	美元 1,104	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	5
离岸人民币 7,968	美元 1,104	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	5
离岸人民币 7,968	美元 1,104	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	5
离岸人民币 7,963	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	5
离岸人民币 7,963	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	5
离岸人民币 7,963	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	5
离岸人民币 7,963	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	5
离岸人民币 7,953	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	5
离岸人民币 7,953	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	5
离岸人民币 7,953	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	5
离岸人民币 7,953	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	5
离岸人民币 7,951	美元 1,101	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	5
离岸人民币 7,951	美元 1,101	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	5
离岸人民币 43,539	美元 6,005	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	4
离岸人民币 15,014	美元 2,074	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	4
离岸人民币 7,965	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	4
离岸人民币 7,965	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	4
离岸人民币 7,965	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	4
离岸人民币 56,702	美元 7,819	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	3
离岸人民币 12,027	美元 1,661	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 10,796	美元 1,491	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 20,448	美元 2,820	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	2
离岸人民币 9,585	美元 1,323	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	2
离岸人民币 7,964	美元 1,100	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	2
离岸人民币 7,964	美元 1,100	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	2
离岸人民币 17,738	美元 2,446	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	1
离岸人民币 12,378	美元 1,707	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	1
离岸人民币 10,832	美元 1,494	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	1
离岸人民币 8,027	美元 1,107	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	1
离岸人民币 8,027	美元 1,107	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	1
离岸人民币 8,027	美元 1,107	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	1
离岸人民币 8,027	美元 1,107	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	1
离岸人民币 8,027	美元 1,107	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	1
离岸人民币 8,027	美元 1,107	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	1
离岸人民币 7,983	美元 1,101	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	1
离岸人民币 7,991	美元 1,102	2025 年 4 月 22 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
离岸人民币 7,991	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	0
离岸人民币 7,991	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	0
欧元 91,822	美元 100,455	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	1,162
欧元 80,306	美元 87,816	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	976
欧元 92,207	美元 100,190	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	480
欧元 9,563	美元 10,463	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	122
欧元 25,182	美元 27,303	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	72
欧元 1,007	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	13
欧元 1,017	美元 1,108	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	8
欧元 1,007	美元 1,096	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	7
欧元 1,022	美元 1,108	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	3
欧元 1,019	美元 1,104	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	2
欧元 1,210	美元 1,310	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	1
英镑 211,349	美元 273,924	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	1,138
英镑 241,475	美元 312,607	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	938
英镑 215,041	美元 278,223	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	671
英镑 144,994	美元 187,634	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	492
英镑 94,916	美元 122,885	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	377
英镑 188,748	美元 243,699	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	85
英镑 7,859	美元 10,203	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	60
英镑 12,018	美元 15,554	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	43
英镑 6,390	美元 8,286	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	38
英镑 11,994	美元 15,499	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	18
英镑 847	美元 1,100	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	7
英镑 1,515	美元 1,960	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	5
英镑 854	美元 1,106	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	5
英镑 854	美元 1,106	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	5
英镑 850	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	5
英镑 847	美元 1,098	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	5
英镑 7,552	美元 9,750	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	3
英镑 874	美元 1,131	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	3
英镑 852	美元 1,103	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	3
英镑 1,750	美元 2,260	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	1
纽元 455,312	美元 261,550	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	3,563
纽元 233,683	美元 134,010	2025 年 4 月 22 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,601
纽元 201,009	美元 115,473	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	1,578
纽元 258,292	美元 147,611	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,259
纽元 243,702	美元 139,235	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	1,150
纽元 114,320	美元 65,520	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	744
纽元 104,739	美元 59,929	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	583
纽元 45,699	美元 26,166	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	272
纽元 33,362	美元 19,109	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	206
纽元 3,620	美元 2,105	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	54
纽元 4,282	美元 2,444	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	17
纽元 3,551	美元 2,029	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	16
纽元 1,916	美元 1,102	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	16
纽元 1,923	美元 1,098	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	9
新加坡元 50,297	美元 37,860	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	397
新加坡元 46,941	美元 35,343	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	381
新加坡元 42,280	美元 31,774	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	282
新加坡元 130,361	美元 97,192	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	96
新加坡元 9,010	美元 6,781	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	69
新加坡元 12,764	美元 9,525	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	18
新加坡元 1,463	美元 1,100	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	11
新加坡元 1,470	美元 1,103	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	8
新加坡元 1,465	美元 1,098	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	7
新加坡元 1,484	美元 1,106	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	1
美元 163,106	纽元 289,986	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	1,205
美元 413,621	离岸人民币 3,007,718	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	966
美元 431,893	英镑 335,142	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	673
美元 151,840	离岸人民币 1,104,176	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	360
美元 21,107	英镑 16,621	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	346
美元 207,868	离岸人民币 1,510,469	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	336
美元 131,553	离岸人民币 955,898	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	209
美元 57,794	离岸人民币 420,435	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	159
美元 65,636	离岸人民币 477,283	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	153
美元 72,644	离岸人民币 527,868	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	118
美元 36,089	离岸人民币 262,540	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	100

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 34,933	离岸人民币 254,127	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	96
美元 14,863	新加坡元 20,000	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	33
美元 13,625	英镑 10,574	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	22
美元 3,768	离岸人民币 27,413	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	10
美元 1,382	加元 2,000	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	9
美元 4,789	加元 6,898	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	8
美元 1,167	纽元 2,072	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	7
美元 1,071	加元 1,550	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	7
美元 17,376	英镑 13,468	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	6
美元 2,191	离岸人民币 15,939	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	6
美元 1,285	加元 1,855	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	5
美元 14,942	离岸人民币 108,422	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	3
美元 1,656	离岸人民币 12,020	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	1
美元 964	离岸人民币 6,999	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	1
美元 1,216	欧元 1,125	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	0
美元 138,087	离岸人民币 1,000,000	2025 年 5 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	32
美元 52,547	离岸人民币 380,569	2025 年 5 月 21 日	法国巴黎银行	17
美元 23,391	离岸人民币 169,391	2025 年 5 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	5
美元 13,895	英镑 10,766	2025 年 5 月 21 日	法国巴黎银行	0
美元 2,721	欧元 2,512	2025 年 5 月 21 日	法国巴黎银行	0
未实现总收益				122,377
美元 2,458	澳元 3,898	2025 年 4 月 1 日	巴克莱银行, 伦敦	(29)
美元 273,938	英镑 211,349	2025 年 4 月 1 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,139)
美元 234,089	澳元 371,124	2025 年 4 月 1 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,823)
离岸人民币 527,868	美元 72,545	2025 年 4 月 2 日	法国巴黎银行	(105)
离岸人民币 955,898	美元 131,367	2025 年 4 月 2 日	巴克莱银行, 伦敦	(193)
离岸人民币 1,510,469	美元 207,583	2025 年 4 月 2 日	法国巴黎银行	(302)
英镑 10,574	美元 13,626	2025 年 4 月 2 日	巴克莱银行, 伦敦	(22)
美元 1,106	英镑 854	2025 年 4 月 2 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
美元 1,095	加元 1,568	2025 年 4 月 2 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
美元 1,100	澳元 1,745	2025 年 4 月 2 日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
美元 187,643	英镑 144,994	2025 年 4 月 2 日	法国巴黎银行	(493)
美元 65,489	纽元 114,320	2025 年 4 月 2 日	Citibank N.A., 伦敦	(744)
离岸人民币 6,999	美元 963	2025 年 4 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
离岸人民币 108,422	美元 14,922	2025 年 4 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
欧元 1,125	美元 1,215	2025 年 4 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
美元 20,039	纽元 35,381	2025 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	(0)
美元 7,817	澳元 12,544	2025 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	(0)
美元 1,103	欧元 1,019	2025 年 4 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
美元 1,131	英镑 874	2025 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	(3)
离岸人民币 12,020	美元 1,654	2025 年 4 月 7 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
英镑 10,766	美元 13,896	2025 年 4 月 7 日	法国巴黎银行	(0)
美元 1,092	加元 1,571	2025 年 4 月 7 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 380,569	美元 52,400	2025 年 4 月 8 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 169,391	美元 23,323	2025 年 4 月 8 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
离岸人民币 1,000,000	美元 137,689	2025 年 4 月 8 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
澳元 2,230	美元 1,387	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(3)
澳元 1,980	美元 1,229	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(5)
澳元 356,926	美元 221,607	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(847)
加元 1,580	美元 1,097	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
加元 1,587	美元 1,100	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(4)
加元 1,584	美元 1,095	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(7)
加元 2,133	美元 1,474	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(9)
加元 48,037	美元 33,351	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(58)
加元 313,682	美元 217,966	2025 年 4 月 22 日	加拿大皇家银行	(196)
加元 282,756	美元 196,269	2025 年 4 月 22 日	高盛国际, 伦敦	(384)
离岸人民币 8,652	美元 1,192	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
离岸人民币 8,007	美元 1,103	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
离岸人民币 8,007	美元 1,103	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
离岸人民币 8,007	美元 1,103	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
离岸人民币 8,007	美元 1,103	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
离岸人民币 34,646	美元 4,774	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 7,994	美元 1,101	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／（亏损） 美元
离岸人民币 16,060	美元 2,212	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 9,098	美元 1,252	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 7,993	美元 1,100	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 8,029	美元 1,104	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(3)
离岸人民币 8,029	美元 1,104	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 8,029	美元 1,104	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 11,553	美元 1,588	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
离岸人民币 15,873	美元 2,183	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 25,744	美元 3,539	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(10)
离岸人民币 311,685	美元 42,952	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(11)
离岸人民币 134,445	美元 18,519	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
离岸人民币 471,031	美元 64,910	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(17)
离岸人民币 113,920	美元 15,677	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(26)
离岸人民币 80,829	美元 11,110	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(31)
离岸人民币 119,137	美元 16,380	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(42)
离岸人民币 565,991	美元 77,960	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(57)
离岸人民币 386,161	美元 53,141	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(88)
离岸人民币 276,929	美元 38,065	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(108)
离岸人民币 421,092	美元 57,880	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(164)
离岸人民币 897,039	美元 123,410	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(239)
离岸人民币 896,600	美元 123,349	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(239)
离岸人民币 696,249	美元 95,724	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(248)
离岸人民币 774,756	美元 106,491	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(302)
离岸人民币 1,432,010	美元 197,064	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(326)
离岸人民币 1,249,883	美元 171,861	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(424)
离岸人民币 1,218,689	美元 167,553	2025 年 4 月 22 日	美林国际, 伦敦	(432)
离岸人民币 4,512,421	美元 620,794	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(1,202)
离岸人民币 3,606,269	美元 495,836	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(1,255)
离岸人民币 3,627,890	美元 498,786	2025 年 4 月 22 日	美林国际, 伦敦	(1,286)
离岸人民币 18,246,688	美元 2,508,790	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(6,351)
欧元 1,018	美元 1,100	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(0)
欧元 1,018	美元 1,100	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
欧元 21,055	美元 22,717	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(51)
欧元 30,478	美元 32,884	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(74)
欧元 281,184	美元 295,879	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(8,183)
英镑 850	美元 1,095	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
英镑 11,979	美元 15,455	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
英镑 29,200	美元 37,675	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
英镑 866	美元 1,101	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(17)
英镑 13,067	美元 16,838	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(28)
英镑 1,747	美元 2,200	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(55)
英镑 14,059	美元 17,875	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(271)
英镑 96,576	美元 124,227	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(423)
英镑 701,387	美元 904,436	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(837)
英镑 144,346	美元 181,971	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(4,336)
英镑 585,227	美元 743,604	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(11,744)
纽元 1,948	美元 1,093	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(11)
纽元 13,340	美元 7,482	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(77)
纽元 93,734	美元 52,718	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(393)
纽元 163,043	美元 91,430	2025 年 4 月 22 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(952)
纽元 655,105	美元 369,354	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,839)
新加坡元 31,659	美元 23,525	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(56)
新加坡元 560,660	美元 416,643	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(951)
美元 2,239	离岸人民币 16,236	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
美元 2,198	离岸人民币 15,936	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
美元 1,572	离岸人民币 11,400	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(1)
美元 7,610	英镑 5,894	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
美元 3,020	加元 4,339	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
美元 3,257	离岸人民币 23,609	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(3)
美元 1,199	离岸人民币 8,662	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
美元 1,088	离岸人民币 7,858	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
美元 9,330	新加坡元 12,518	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(6)
美元 4,270	离岸人民币 30,910	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(9)
美元 2,223	离岸人民币 16,060	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(9)
美元 1,385	离岸人民币 9,978	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(9)
美元 3,488	加元 5,000	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(11)
美元 2,487	欧元 2,290	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(11)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／(亏损) 美元
美元 1,390	新加坡元 1,847	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(14)
美元 2,054	澳元 3,270	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(16)
美元 4,290	离岸人民币 31,000	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(17)
美元 21,650	欧元 20,000	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(23)
美元 52,686	离岸人民币 382,030	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(26)
美元 3,763	新加坡元 5,000	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(39)
美元 27,860	离岸人民币 201,796	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(44)
美元 21,532	离岸人民币 155,878	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(45)
美元 138,153	欧元 127,715	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(46)
美元 7,637	离岸人民币 55,033	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(51)
美元 7,427	新加坡元 9,903	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(51)
美元 83,311	离岸人民币 604,012	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(53)
美元 150,966	加元 216,986	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(55)
美元 4,832	新加坡元 6,412	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(57)
美元 14,232	离岸人民币 102,794	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(63)
美元 5,848	纽元 10,209	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(63)
美元 8,720	加元 12,441	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(67)
美元 125,056	加元 179,710	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(70)
美元 23,629	英镑 18,251	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(73)
美元 15,142	离岸人民币 109,200	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(89)
美元 10,103	加元 14,385	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(98)
美元 22,741	离岸人民币 164,240	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(102)
美元 71,508	离岸人民币 517,950	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(113)
美元 144,168	离岸人民币 1,044,905	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(138)
美元 16,515	澳元 26,269	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(142)
美元 30,475	离岸人民币 220,010	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(149)
美元 28,409	离岸人民币 205,010	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(151)
美元 92,137	离岸人民币 667,026	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(194)
美元 43,627	离岸人民币 314,958	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(213)
美元 124,877	澳元 200,000	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(227)
美元 32,425	澳元 51,629	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(247)
美元 124,979	离岸人民币 904,805	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(260)
美元 60,453	离岸人民币 436,638	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(267)
美元 510,111	英镑 395,005	2025 年 4 月 22 日	高盛国际, 伦敦	(282)
美元 61,726	离岸人民币 445,659	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(296)
美元 69,811	离岸人民币 504,029	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(335)
美元 69,085	加元 98,838	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(344)
美元 79,267	离岸人民币 572,556	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(345)
美元 69,288	离岸人民币 500,000	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(367)
美元 55,228	离岸人民币 398,000	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(367)
美元 90,959	英镑 70,181	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(378)
美元 63,531	离岸人民币 458,099	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(386)
美元 198,576	离岸人民币 1,437,620	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(413)
美元 90,142	离岸人民币 650,516	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(475)
美元 100,731	离岸人民币 727,264	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(484)
美元 84,291	离岸人民币 607,958	2025 年 4 月 22 日	美国道富银行	(489)
美元 70,876	加元 101,182	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(505)
美元 55,020	新加坡元 73,191	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(505)
美元 52,893	新加坡元 70,323	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(514)
美元 88,228	离岸人民币 636,289	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(521)
美元 43,194	澳元 68,466	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(522)
美元 101,508	离岸人民币 732,060	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(600)
美元 242,449	英镑 187,321	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(676)
美元 59,466	新加坡元 78,923	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(682)
美元 63,062	澳元 100,000	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(737)
美元 61,009	澳元 96,705	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(738)
美元 167,637	离岸人民币 1,210,794	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(740)
美元 139,532	离岸人民币 1,006,897	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(740)
美元 187,813	英镑 144,851	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(855)
美元 165,660	欧元 152,396	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(864)
美元 154,313	离岸人民币 1,112,697	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(938)
美元 635,383	离岸人民币 4,602,251	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(1,004)
美元 106,012	加元 150,958	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,023)
美元 278,593	离岸人民币 2,013,142	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,100)
美元 290,509	离岸人民币 2,099,444	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(1,120)
美元 964,010	英镑 746,010	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(1,141)

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 288,399	离岸人民币 2,083,151	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(1,255)
美元 366,607	加元 524,866	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,569)
美元 151,533	欧元 138,662	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(1,589)
美元 271,579	离岸人民币 1,957,148	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(1,804)
美元 343,354	离岸人民币 2,477,834	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(1,807)
美元 311,739	离岸人民币 2,248,459	2025 年 4 月 22 日	美国道富银行	(1,810)
美元 346,860	离岸人民币 2,503,130	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(1,826)
美元 319,600	离岸人民币 2,305,156	2025 年 4 月 22 日	美国道富银行	(1,855)
美元 480,001	英镑 370,413	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,912)
美元 439,037	离岸人民币 3,169,804	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(2,108)
美元 306,892	加元 438,202	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(2,128)
美元 251,825	纽元 440,477	2025 年 4 月 22 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2,244)
美元 416,496	英镑 320,788	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(2,458)
美元 333,596	加元 476,060	2025 年 4 月 22 日	高盛国际, 伦敦	(2,503)
美元 221,333	澳元 350,831	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(2,677)
美元 213,731	纽元 371,889	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(3,012)
美元 699,845	加元 1,000,000	2025 年 4 月 22 日	巴克莱银行, 伦敦	(4,358)
美元 1,448,831	离岸人民币 10,470,380	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(5,584)
美元 230,127	纽元 395,951	2025 年 4 月 22 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(5,775)
美元 739,556	澳元 1,172,619	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(8,721)
美元 1,550,039	离岸人民币 11,179,847	2025 年 4 月 22 日	美国道富银行	(8,999)
美元 1,711,672	离岸人民币 12,352,366	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(9,010)
美元 711,625	澳元 1,124,093	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(11,033)
美元 974,303	澳元 1,544,468	2025 年 4 月 22 日	高盛国际, 伦敦	(11,712)
美元 827,275	澳元 1,304,875	2025 年 4 月 22 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(14,010)
美元 887,431	澳元 1,395,274	2025 年 4 月 22 日	Citibank N.A., 伦敦	(17,825)
美元 37,422,604	英镑 28,974,595	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(25,356)
美元 6,740,503	离岸人民币 48,623,632	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(38,177)
美元 4,771,216	新加坡元 6,329,028	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(57,197)
美元 12,231,208	欧元 11,248,877	2025 年 4 月 22 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(67,077)
美元 27,141,428	加元 38,847,119	2025 年 4 月 22 日	TD 道明银行	(123,754)
美元 24,723,690	离岸人民币 178,348,049	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(140,029)
美元 24,881,556	离岸人民币 179,486,835	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(140,923)
美元 18,586,726	纽元 32,426,334	2025 年 4 月 22 日	渣打银行, 伦敦	(213,446)
美元 125,091,481	离岸人民币 902,366,164	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(708,486)
美元 72,378,936	澳元 114,555,843	2025 年 4 月 22 日	法国巴黎银行	(981,893)
澳元 12,544	美元 7,820	2025 年 5 月 21 日	法国巴黎银行	(0)
加元 1,571	美元 1,094	2025 年 5 月 21 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 7,997	美元 1,104	2025 年 5 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
离岸人民币 79,353	美元 10,956	2025 年 5 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
离岸人民币 495,669	美元 68,437	2025 年 5 月 21 日	法国巴黎银行	(24)
离岸人民币 480,611	美元 66,354	2025 年 5 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(27)
纽元 35,381	美元 20,062	2025 年 5 月 21 日	法国巴黎银行	(1)
未实现总亏损				(2,700,418)
未实现净亏损				(2,578,041)

财务状况表

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

	31.3.2025 美元	30.9.2024 美元
资产		
流动资产		
银行现金	10,103,483	18,303,097
应收经纪款项	10,155,472	1,585,970
分配应收款项	4,783,352	12,106,419
衍生性产品	122,377	5,956,560
投资	956,027,748	1,047,843,133
股息及其他应收款项	3,708,876	2,871,834
总资产	984,901,308	1,088,667,013
负债		
流动负债		
短期银行借款 - 无抵押	2,820,000	1,300,000
应付经纪款项	11,439,853	13,009,495
赎回应付款项	4,438,682	15,540,179
应付税项	627,130	2,195,267
应付收益分配 [附注 6]	2,784,396	2,754,282
衍生性产品	2,700,418	382,648
其他应付款项	1,264,732	1,435,726
总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)	26,075,211	36,617,597
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	958,826,097	1,052,049,416

综合收益表

截至二零二五年三月三十一日止期间 (未经审计)

	1.10.2024 至 31.3.2025 美元	1.10.2023 至 31.3.2024 美元
收入		
投资及衍生性产品净 (亏损) / 收益 [附注 4]	(83,927,190)	89,617,139
股息收入	11,794,949	14,648,897
存款利息	19,069	73,255
汇兑净亏损	(914,992)	(421,324)
其他收入	717	-
	(73,027,447)	103,917,967
支出		
管理费用 [附注 5(a)]	7,033,604	7,342,205
交易成本 [附注 5(a), 5(b)]	659,191	820,279
托管费用及银行费用 [附注 5(a), 5(b)]	190,862	255,912
受托人费用 [附注 5(b)]	132,280	137,786
基金注册登记机构费用 [附注 5(a)]	87,077	50,914
核数师酬金	23,605	40,123
法律及专业费用	13,769	16,760
估值费用 [附注 5(a)]	8,470	8,470
印刷及出版支出	1,868	4,357
其他经营费用	4,725	7,180
	8,155,451	8,683,986
净经营 (亏损) / 利润	(81,182,898)	95,233,981
财务成本		
收益分配 [附注 6]	(15,479,852)	(18,547,805)
利息支出 [附注 5(b)]	(88,192)	(38,033)
	(15,568,044)	(18,585,838)
除税前 (亏损) / 利润	(96,750,942)	76,648,143
税项	290,806	(1,703,104)
可赎回份额持有人应占净资产及总综合 (亏损) / 收益之 (减少) / 增加	(96,460,136)	74,945,039

第十三至二十一页之附注乃属本财务报表之一部分。

可赎回份额持有人应占净资产变动表
截至二零二五年三月三十一日止期间 (未经审计)

	1.10.2024 至 31.3.2025 美元	1.10.2023 至 31.3.2024 美元
期初可赎回份额持有人应占净资产	1,052,049,416	1,085,023,048
分配可赎回份额 [附注 3]	243,197,551	98,163,363
赎回可赎回份额 [附注 3]	(239,960,734)	(260,515,476)
净分配 / (赎回)	3,236,817	(162,352,113)
	1,055,286,233	922,670,935
可赎回份额持有人应占净资产及 总综合 (亏损) / 收益之 (减少) / 增加	(96,460,136)	74,945,039
期末可赎回份额持有人应占净资产	958,826,097	997,615,974

现金流量表
截至二零二五年三月三十一日止期间 (未经审计)

	1.10.2024 至 31.3.2025 美元	1.10.2023 至 31.3.2024 美元
经营业务		
购入投资及衍生性产品	(313,958,645)	(262,832,368)
出售投资及衍生性产品所得款项	319,850,451	447,575,735
已收股息	9,658,193	12,344,714
已收利息	19,182	73,250
已付受托人费用	(132,763)	(140,877)
已付基金注册登记机构费用	(165,324)	(104,516)
已付交易成本	(653,011)	(821,937)
已付税项	(1,277,331)	(1,703,104)
已付管理费用	(7,074,081)	(7,514,610)
其他	642,139	(785,539)
经营业务所产生之现金净额	6,908,810	186,090,748
融资活动		
已付利息	(88,192)	(38,033)
分配可赎回份额所得款项	250,520,618	98,116,812
赎回可赎回份额付款	(251,062,231)	(261,191,431)
已付收益分配	(15,449,738)	(19,338,115)
融资活动所运用之现金净额	(16,079,543)	(182,450,767)
现金及现金等价物之 (减少) / 增加	(9,170,733)	3,639,981
期初现金及现金等价物	17,003,097	2,686,918
现金及现金等价物之汇兑 (亏损) / 收益	(548,881)	6,098
期末现金及现金等价物	7,283,483	6,332,997
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	10,103,483	7,332,997
短期银行借款 - 无抵押	(2,820,000)	(1,000,000)
	7,283,483	6,332,997

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

(a) 中期财务报表之会计政策

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

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公允价值为负数的衍生性产品合约列示为按公允价值透过损益列账的负债。

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。卖空被分类为按公允价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额净资产价值得出的公允价值而计算，或如集体投资计划为上市或在交易所买卖，则以最后交易价计算。

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

结构性主体

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

(c) 外币交易

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

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

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

(d) 分配份额所得款项及赎回份额支付款项

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

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

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

1.10.2024 至 31.3.2025

	澳元对冲类别 (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：					
期初	13,087,371.878	4,242,308.151	1,088,798.871	3,202,284.859	1,057,137.848
总分配 总赎回	1,604,676.362 (2,025,330.370)	662,557.353 (640,081.358)	274,684.601 (214,499.727)	581,558.795 (726,918.819)	127,708.953 (262,889.350)
期末	12,666,717.870	4,264,784.146	1,148,983.745	3,056,924.835	921,957.451
	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：					
期初	142,140,659.067	4,565,825.379	13,347,295.200	33,650,974.040	11,154,155.060
总分配 总赎回	23,878,942.593 (37,301,997.499)	406,913.839 (1,475,082.545)	19,676,640.530 (8,396,393.840)	33,252,069.030 (13,728,764.660)	7,320,469.460 (3,639,082.250)
期末	128,717,604.161	3,497,656.673	24,627,541.890	53,174,278.410	14,835,542.270

1.10.2024 至 31.3.2025

	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:					
期初	19,795,085.800	1,121,210.560	1,871,741.890	2,062,203.857	100,982,354.440
总分配 总赎回	6,629,801.870 (7,651,929.330)	806,094.780 (363,901.830)	1,326,354.180 (487,546.510)	588,792.243 (104,719.574)	6,263,636.880 (18,923,181.314)
期末	18,772,958.340	1,563,403.510	2,710,549.560	2,546,276.526	88,322,810.006

	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:					
期初	693,045.979	407,352.841	23,502,233.227	5,057,258.609	2,914,606.505
总分配 总赎回	38,241.069 (119,391.380)	83,425.298 (45,535.298)	4,144,958.070 (5,899,527.913)	211,086.385 (940,122.545)	134,495.163 -
期末	611,895.668	445,242.841	21,747,663.384	4,328,222.449	3,049,101.668

1.10.2023 至 31.3.2024

	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:					
期初	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	2,417,767.940 (5,257,136.159)	534,829.982 (1,584,377.785)	127,301.794 (449,468.440)	325,825.665 (1,408,692.633)	28,953.101 (631,028.705)
期末	15,829,260.048	6,080,302.122	1,554,047.340	4,293,007.739	990,702.594

	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:					
期初	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	22,217,465.695 (58,472,374.817)	401,994.351 (1,502,406.955)	1,227,138.540 (301,004.000)	1,299,511.880 (331,856.540)	1,315,544.080 (923,733.770)
期末	173,933,603.566	4,256,641.684	2,105,841.030	3,023,351.360	5,301,387.100

1.10.2023 至 31.3.2024

	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:					
期初	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	2,722,629.930 (1,629,470.720)	132,511.810 (263,420.620)	136,795.060 (124,743.440)	344,516.723 (117,565.109)	5,219,129.595 (23,722,874.707)
期末	10,884,753.350	1,067,166.610	1,256,903.870	1,783,906.309	120,828,353.204

	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:					
期初	767,961.479	524,804.307	32,514,811.126	7,530,185.266	2,982,849.433
总分配 总赎回	13,682.838 (87,447.674)	19,803.794 (67,193.694)	3,143,261.064 (8,317,554.306)	8,122.848 (1,232,891.784)	220,865.004 (164,300.000)
期末	694,196.643	477,414.407	27,340,517.884	6,305,416.330	3,039,414.437

31.3.2025

	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	欧元对冲类别 (每月派息) 欧元	英镑对冲类别 (每月派息) 英镑	港元类别 (累计) 港元
可赎回份额持有人应占净 资产	107,936,369	38,196,454	10,799,821	28,121,167	15,011,246
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	8.52	8.96	9.40	9.20	16.28
	港元类别 (每月派息) 港元	纽元对冲类别 (每月派息) 纽元	PRC 人民币份额 (累计) 人民币	PRC 人民币份额 (每月派息) 人民币	PRC 人民币对冲份额 (累计) 人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	1,230,993,249	30,494,674	330,580,433	549,826,691	181,011,275
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	9.56	8.72	13.42	10.34	12.20

31.3.2025

	PRC 人民币对冲份额 (每月派息) 人民币	PRC 美元份额 (累计) 美元	PRC 美元份额 (每月派息) 美元	人民币对冲类别 (累计) 人民币	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币
可赎回份额持有人应占净资产	176,528,749	19,384,605	25,933,999	46,820,579	860,132,919
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.40	12.40	9.57	18.39	9.74
	新加坡元对冲类别 (每月派息) 新加坡元	美元类别 (累计) 美元	美元类别 (每月派息) 美元	美元 C 类别 (每季派息) 美元	美元 C 类别 (每月派息) 美元
可赎回份额持有人应占净资产	5,586,101	7,256,251	207,551,972	48,854,820	31,305,124
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.13	16.30	9.54	11.29	10.27

30.9.2024

	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	欧元对冲类别 (每月派息) 欧元	英镑对冲类别 (每月派息) 英镑	港元类别 (累计) 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) 港元	纽元对冲类别 (每月派息) 纽元	PRC 人民币份额 (累计) 人民币	PRC 人民币份额 (每月派息) 人民币	PRC 人民币对冲份额 (累计) 人民币
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

30.9.2024

	PRC 人民币对冲份额 (每月派息) 人民币	PRC 美元份额 (累计) 美元	PRC 美元份额 (每月派息) 美元	人民币对冲类别 (累计) 人民币	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币
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) 新加坡元	美元类别 (累计) 美元	美元类别 (每月派息) 美元	美元 C 类别 (每季派息) 美元	美元 C 类别 (每月派息) 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

4 投资及衍生性产品净（亏损）／收益

	1.10.2024 至 31.3.2025 美元	1.10.2023 至 31.3.2024 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益／亏损之变动	(90,770,430)	78,907,723
投资及衍生性产品销售之实现收益	6,843,240	10,709,416
	(83,927,190)	89,617,139

5 与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之交易

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

	1.10.2024 至 31.3.2025 美元	1.10.2023 至 31.3.2024 美元
管理费用	7,033,604	7,342,205
基金注册登记机构费用	87,077	50,914
托管费用及银行费用	13,697	12,541
估值费用	8,470	8,470
交易成本	1,515	9,179

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

	1.10.2024 至 31.3.2025 美元	1.10.2023 至 31.3.2024 美元
托管费用及银行费用	137,096	207,137
受托人费用	132,280	137,786
利息支出	88,192	38,033
交易成本	30,660	17,006

6 收益分配

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

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
<u>1.10.2024 至 31.3.2025</u>					
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	澳元 0.0245	13,132,198.889	(210,739)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	加元 0.0222	4,162,788.090	(66,296)
欧元对冲类别 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	欧元 0.0183	1,144,328.967	(22,735)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	英镑 0.0312	3,171,972.833	(127,235)
港元类别 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	港元 0.0320	139,907,517.441	(575,869)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	纽元 0.0280	4,529,308.166	(75,477)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	人民币 0.0340	39,766,026.970	(189,685)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	人民币 0.0065	21,724,458.940	(19,811)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	美元 0.0321	2,197,173.730	(70,529)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	人民币 0.0067	98,164,964.340	(92,273)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	新加坡元 0.0159	693,111.181	(8,330)
美元类别 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	美元 0.0320	23,999,752.037	(767,991)
美元 C 类别 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	美元 0.0343	2,914,836.006	(99,979)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	澳元 0.0261	13,086,203.023	(222,502)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	加元 0.0216	4,193,440.587	(64,692)
欧元对冲类别 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	欧元 0.0197	1,186,186.337	(24,681)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	英镑 0.0314	3,067,676.236	(122,434)
港元类别 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	港元 0.0321	138,056,828.558	(569,504)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	纽元 0.0273	3,810,752.501	(61,541)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	人民币 0.0346	42,573,661.080	(203,162)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	人民币 0.0160	21,716,918.210	(47,923)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	美元 0.0321	2,350,862.320	(75,463)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	人民币 0.0166	95,793,422.086	(219,316)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	新加坡元 0.0181	693,164.706	(9,358)
美元类别 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	美元 0.0320	23,571,312.838	(754,281)
美元 C 类别 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	美元 0.0343	3,040,738.426	(104,297)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	澳元 0.0267	12,977,743.418	(214,539)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	加元 0.0191	4,141,302.276	(54,998)
欧元对冲类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	欧元 0.0186	1,221,154.908	(23,520)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	英镑 0.0317	3,060,221.408	(121,494)
港元类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	港元 0.0320	135,184,653.097	(556,892)
纽元对冲类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	纽元 0.0260	3,763,386.930	(54,819)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	人民币 0.0348	41,967,457.260	(198,933)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	人民币 0.0181	20,961,682.860	(51,680)
PRC 美元份额 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	美元 0.0321	2,332,275.030	(74,866)
人民币对冲类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	人民币 0.0187	93,529,900.778	(238,236)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	新加坡元 0.0182	693,205.595	(9,248)
美元类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	美元 0.0320	22,770,668.290	(728,660)
美元 C 类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	美元 0.1141	4,520,745.969	(515,817)
美元 C 类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	美元 0.0343	3,048,043.852	(104,548)
澳元对冲类别 (每月派息)	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	澳元 0.0284	12,877,599.178	(228,376)
加元对冲类别 (每月派息)	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	加元 0.0198	4,171,222.158	(57,382)
欧元对冲类别 (每月派息)	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	欧元 0.0193	1,180,625.576	(23,753)
英镑对冲类别 (每月派息)	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	英镑 0.0331	3,078,745.871	(126,700)
港元类别 (每月派息)	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	港元 0.0321	137,983,269.260	(568,532)
纽元对冲类别 (每月派息)	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 11 日	纽元 0.0277	3,700,233.556	(57,998)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2025 年 1 月 24 日	2025 年 2 月 10 日	人民币 0.0350	43,126,052.520	(208,462)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2025 年 1 月 24 日	2025 年 2 月 10 日	人民币 0.0239	20,762,607.840	(68,533)
PRC 美元份额 (每月派息)	2025 年 1 月 24 日	2025 年 2 月 10 日	美元 0.0321	2,450,493.260	(78,661)
人民币对冲类别 (每月派息)	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	人民币 0.0248	90,532,131.475	(308,455)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	新加坡元 0.0193	667,152.898	(9,522)
美元类别 (每月派息)	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	美元 0.0320	22,307,634.421	(713,843)
美元 C 类别 (每月派息)	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	美元 0.0344	3,048,314.117	(104,862)
澳元对冲类别 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	澳元 0.0276	12,929,845.965	(221,916)
加元对冲类别 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	加元 0.0192	4,178,844.501	(55,696)
欧元对冲类别 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	欧元 0.0187	1,153,902.824	(22,441)
英镑对冲类别 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	英镑 0.0319	3,028,896.766	(121,661)
港元类别 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	港元 0.0321	131,876,497.845	(544,362)
纽元对冲类别 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	纽元 0.0262	3,577,645.804	(52,524)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	人民币 0.0348	44,336,050.020	(211,571)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	人民币 0.0169	18,301,478.500	(42,412)

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)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	美元 0.0321	2,525,216.870	(81,059)
人民币对冲类别 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	人民币 0.0175	89,412,618.452	(214,564)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	新加坡元 0.0191	668,291.483	(9,463)
美元类别 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	美元 0.0320	21,983,613.832	(703,475)
美元 C 类别 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	美元 0.0344	3,048,836.807	(104,880)
澳元对冲类别 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	澳元 0.0264	12,668,195.934	(208,406)
加元对冲类别 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	加元 0.0171	4,264,784.146	(50,671)
欧元对冲类别 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	欧元 0.0160	1,148,825.562	(19,855)
英镑对冲类别 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	英镑 0.0316	3,055,848.639	(124,641)
港元类别 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	港元 0.0320	129,793,330.361	(533,834)
纽元对冲类别 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	纽元 0.0241	3,501,686.044	(47,795)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	人民币 0.0346	52,934,209.980	(252,071)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	人民币 0.0105	18,783,498.290	(27,144)
PRC 美元份额 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	美元 0.0321	2,700,821.500	(86,696)
人民币对冲类别 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	人民币 0.0108	88,271,036.210	(131,206)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	新加坡元 0.0161	611,895.668	(7,329)
美元类别 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	美元 0.0320	21,723,255.825	(695,143)
美元 C 类别 (每季派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	美元 0.1143	4,328,222.449	(494,716)
美元 C 类别 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	美元 0.0344	3,049,101.668	(104,889)
可赎回份额持有人之总收益分配					(15,479,852)

1.10.2023 至 31.3.2024

澳元对冲类别 (每月派息)	2023 年 10 月 31 日	2023 年 11 月 8 日	澳元 0.0201	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)
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)

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)	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	(171,212)
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	(741,893)
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	(117,720)
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	(158,356)
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	(74,665)
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	(876,658)
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)
可赎回份额持有人之总收益分配					(18,547,805)

经营与管理

管理人及服务提供者

摩根基金（亚洲）有限公司
香港
中环干诺道中 8 号
遮打大厦 19 楼

投资管理人

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

管理人董事

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

