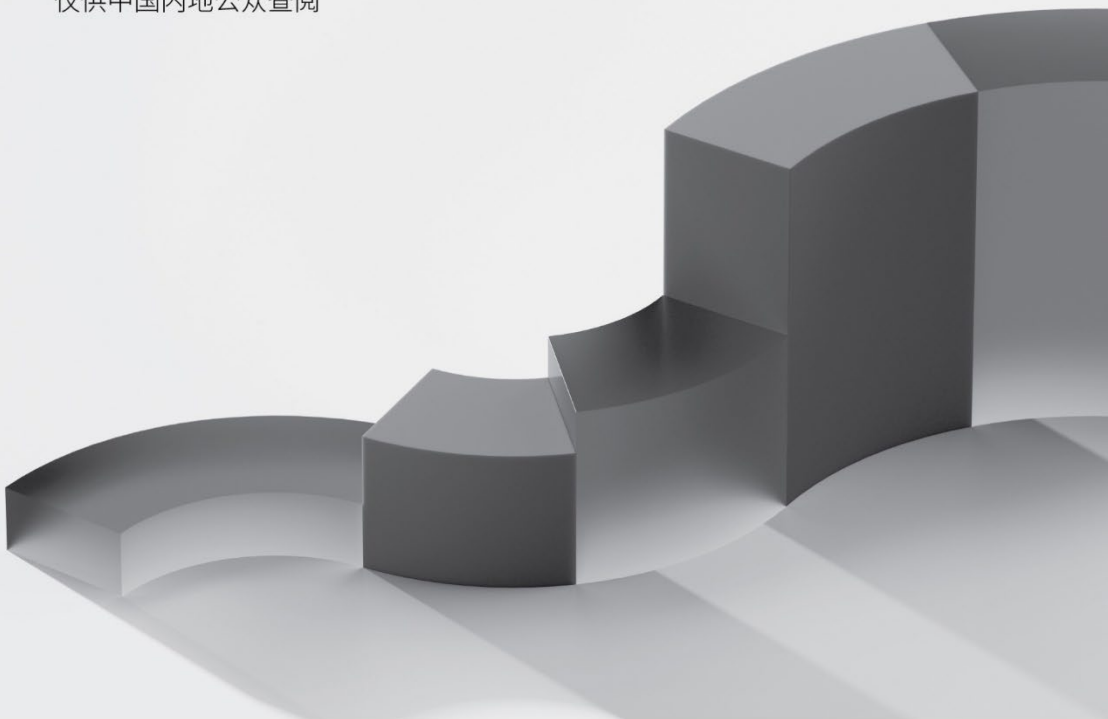


仅供中国内地公众查阅



半年度报告 — 2025年3月31日（未经审核）

# 摩根国际债券基金

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 - 13  |
| 投资组合持有变动表        | 14      |
| 金融衍生工具详情         | 15 - 23 |
| 财务状况表            | 24      |
| 综合收益表            | 24      |
| 可赎回份额持有人应占净资产变动表 | 25      |
| 现金流量表            | 25      |
| 财务报表之附注          | 26 - 33 |
| 经营与管理            | 34      |

投资组合  
于二零二五年三月三十一日(未经审计)

(续)

|                                                                           | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |                                                                         | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |
|---------------------------------------------------------------------------|---------------|------------|------------------|-------------------------------------------------------------------------|---------------|------------|------------------|
| 上市投资 (95.9%)                                                              |               |            |                  | NBN Co Ltd Ser MTN<br>5.35% 06Mar2035                                   | 澳元 19,020,000 | 11,871,809 | 0.2              |
| (I) 债务证券 (87.2%)                                                          |               |            |                  | NBN Co Ltd Ser Regs<br>(Reg S) 5.75%<br>06Oct2028                       | 美元 3,000,000  | 3,201,691  | 0.1              |
| 澳大利亚 (2.1%)                                                               |               |            |                  | NBN Co Ltd Ser Regs<br>4.25% 01Oct2029                                  | 美元 4,950,000  | 5,008,586  | 0.1              |
| Airservices Australia Ser<br>MTN 5.4% 15Nov2028                           | 澳元 7,500,000  | 4,919,161  | 0.1              | NSW Electricity<br>Networks Ser MTN<br>FRN 11Mar2055                    | 澳元 8,300,000  | 5,199,086  | 0.1              |
| APA Infrastructure Ltd<br>Ser EMTN (Reg S) (Br)<br>2% 15Jul2030           | 欧元 1,500,000  | 1,529,189  | 0.0              | Registry Finance Pty<br>Ltd Ser MTN 5.472%<br>19Dec2031                 | 澳元 6,800,000  | 4,371,360  | 0.1              |
| Ausgrid Finance Pty Ltd<br>Ser Mtn 5.408%<br>28Mar2031                    | 澳元 3,970,000  | 2,495,572  | 0.0              | Scentre Group Trst 1<br>Ser MTN 5.2%<br>27Nov2029                       | 澳元 2,000,000  | 1,289,535  | 0.0              |
| Ausnet Services<br>Holdings Ser MTN<br>(Reg) (Reg S) 5.9812%<br>16May2034 | 澳元 2,160,000  | 1,409,826  | 0.0              | SGSP Australia Assets<br>(Reg S) 3.25%<br>29Jul2026                     | 美元 1,950,000  | 1,929,791  | 0.0              |
| Australian Rail Track Ser<br>MTN (Reg S) 5.598%<br>12Jun2031              | 澳元 5,350,000  | 3,469,330  | 0.1              | SGSP Australia Assets<br>Ser EMTN (Reg S)<br>3.5% 07Jul2027             | 美元 1,200,000  | 1,181,747  | 0.0              |
| Bank of Queensland Ltd<br>(Reg S) (Br) 3.3004%<br>30Jul2029               | 欧元 2,712,000  | 3,057,826  | 0.1              | Sydney Airport Finance<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) 4.375%<br>03May2033 | 欧元 954,000    | 1,111,668  | 0.0              |
| Glencore Cap Fin Dac<br>Ser EMTN (Reg S) (Br)<br>1.125% 10Mar2028         | 欧元 6,500,000  | 6,676,390  | 0.1              | Toyota Finance<br>Australia Ser MTN<br>4.65% 17Sep2029                  | 澳元 5,820,000  | 3,626,517  | 0.1              |
| Glencore Cap Fin Dac<br>Ser EMTN 4.154%<br>29Apr2031                      | 欧元 3,000,000  | 3,451,632  | 0.1              | Transurban Finance Co<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) 3.713%<br>12Mar2032  | 欧元 1,186,000  | 1,292,459  | 0.0              |
| Glencore Funding Llc<br>Ser 144A 5.371%<br>04Apr2029                      | 美元 9,504,000  | 9,913,113  | 0.2              | Woolworths Group Ltd<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) 0.375% 15Nov2028      | 欧元 826,000    | 809,779    | 0.0              |
| Glencore Funding Llc<br>Ser 144A 5.634%<br>04Apr2034                      | 美元 3,440,000  | 3,550,054  | 0.1              | Woolworths Group Ltd<br>Ser MTN 5.91%<br>29Nov2034                      | 澳元 4,210,000  | 2,712,963  | 0.0              |
| Glencore Funding Llc<br>Ser 144A 6.375%<br>06Oct2030                      | 美元 848,000    | 925,768    | 0.0              | 巴林 (0.3%)                                                               |               |            |                  |
| Goodman Australia Fin<br>(Reg) (Reg S) 4.25%<br>03May2030                 | 欧元 918,000    | 1,059,493  | 0.0              | Kingdom of Bahrain<br>Ser Regs (Reg S)<br>7.5% 12Feb2036                | 美元 6,080,000  | 6,431,943  | 0.1              |
| Goodman US Fin Three<br>Ser Regs (Reg) 3.7%<br>15Mar2028                  | 美元 2,000,000  | 1,947,303  | 0.0              | Kingdom of Bahrain<br>Ser Regs (Reg) 6.75%<br>20Sep2029                 | 美元 7,730,000  | 7,902,970  | 0.2              |
| Lonsdale Finance Pty<br>Ltd Ser MTN 5.5%<br>19Nov2031                     | 澳元 2,510,000  | 1,615,843  | 0.0              | 比利时 (0.1%)                                                              |               |            |                  |
| National Australia Bank<br>(Reg S) (Br) 2.347%<br>30Aug2029               | 欧元 4,200,000  | 4,524,135  | 0.1              | Dexia Credit Local Ser<br>EMTN (Br) (Reg S)<br>1% 18Oct2027             | 欧元 1,000,000  | 1,047,294  | 0.0              |
| National Australia Bank<br>FRN 14Jan2036                                  | 美元 15,000,000 | 15,419,703 | 0.3              | Kbc Group Nv (Reg S)<br>Var Perp 31Dec2049                              | 欧元 2,000,000  | 2,369,223  | 0.0              |
| NBN Co Ltd Ser 144A<br>2.625% 05May2031                                   | 美元 4,000,000  | 3,615,691  | 0.1              | Kbc Group Nv Ser 144A<br>Var 16Oct2030                                  | 美元 3,260,000  | 3,336,136  | 0.1              |
| NBN Co Ltd Ser EMTN<br>(Reg) (Reg S) 3.5%<br>22Mar2030                    | 欧元 2,106,000  | 2,318,069  | 0.0              | 百慕大 (0.3%)                                                              |               |            |                  |
| NBN Co Ltd Ser GMTN<br>(Reg) (Reg S) 4.125%<br>15Mar2029                  | 欧元 4,000,000  | 4,515,155  | 0.1              | Govt of Bermuda Ser<br>144A (Reg) 3.717%<br>25/01/2027                  | 美元 10,520,000 | 10,424,420 | 0.2              |
| NBN Co Ltd Ser GMTN<br>(Reg) (Reg S) 4.375%<br>15Mar2033                  | 欧元 2,000,000  | 2,299,224  | 0.0              | Govt of Bermuda Ser<br>144A 4.75%<br>15Feb2029                          | 美元 7,472,000  | 7,481,493  | 0.1              |

投资组合 (续)

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|                                                                     | 单位数目               | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |                                                                             | 单位数目                  | 公平值<br>美元   | 占资产<br>净值百<br>分比 |
|---------------------------------------------------------------------|--------------------|------------|------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------|-------------|------------------|
| <b>巴西 (0.2%)</b>                                                    |                    |            |                  |                                                                             |                       |             |                  |
| Braskem Netherlands<br>Ser Regs (Reg S)<br>7.25% 13Feb2033          | 美元 7,400,000       | 6,937,209  | 0.1              | China (Govt of) Ser<br>Inbk (Reg) 2.12%<br>25Jun2031<br>(Interbank)         | 人民币<br>421,000,000    | 60,282,008  | 1.0              |
| Braskem Netherlands<br>Ser Regs (Reg) (Reg S)<br>4.5% 10Jan2028     | 美元 3,000,000       | 2,838,441  | 0.1              | China (Govt of) Ser<br>Inbk (Reg) 2.28%<br>25Mar2031<br>(Interbank)         | 人民币<br>545,000,000    | 77,442,448  | 1.3              |
| Vale Overseas Limited<br>(Reg) 6.4% 28Jun2054                       | 美元 920,000         | 924,041    | 0.0              | China (Govt of) Ser<br>Inbk (Reg) 2.35%<br>25Feb2034<br>(Interbank)         | 人民币<br>434,000,000    | 62,379,733  | 1.1              |
| <b>加拿大 (4.6%)</b>                                                   |                    |            |                  | China (Govt of) Ser<br>Inbk (Reg) 2.47%<br>25Jul2054<br>(Interbank)         | 人民币<br>143,000,000    | 21,287,636  | 0.4              |
| Bank of Montreal Ser<br>EMTN (Reg) (Reg S)<br>0.05% 08Jun2029       | 欧元 2,900,000       | 2,807,098  | 0.0              | China Government<br>Bond Ser Inbk<br>2.04%<br>25Nov2034<br>(Interbank)      | 人民币<br>1,015,000,000  | 143,177,454 | 2.5              |
| Bank of Nova Scotia<br>(Reg) (Reg S) 0.01%<br>14Sep2029             | 欧元 4,850,000       | 4,651,454  | 0.1              | Far East Horizon Ltd<br>Ser EMTN (Reg)<br>(Reg S) 6.625%<br>16Apr2027       | 美元 3,400,000          | 3,549,753   | 0.1              |
| British Columbia Prov of<br>4.15% 18Jun2034                         | 加元 30,000,000      | 21,986,694 | 0.4              | Prosus NV Ser Regs<br>(Reg S) 3.257%<br>19Jan2027                           | 美元 2,500,000          | 2,437,879   | 0.0              |
| Canada (Govt of) (Reg)<br>3.25% 01Dec2034                           | 加元 95,000,000      | 68,116,668 | 1.2              | Prosus Nv Ser Regs<br>(Reg S) 4.987%<br>19Jan2052                           | 美元 5,225,000          | 4,119,596   | 0.1              |
| Enbridge Inc (Reg) 5.3%<br>05Apr2029                                | 美元 2,540,000       | 2,654,302  | 0.0              | Weibo Corp (Reg)<br>3.375% 08Jul2030                                        | 美元 3,000,000          | 2,793,652   | 0.0              |
| Enbridge Inc (Reg) Var<br>15Jan2083                                 | 美元 6,730,000       | 6,965,143  | 0.1              | <b>哥伦比亚 (0.6%)</b>                                                          |                       |             |                  |
| Enbridge Inc (Reg) Var<br>15Jul2077                                 | 美元 2,932,000       | 2,886,704  | 0.0              | Aris Mining Corp Ser<br>Regs 8%<br>31Oct2029                                | 美元 2,800,000          | 2,940,228   | 0.1              |
| Enbridge Inc Var<br>15Jan2084                                       | 美元 1,952,000       | 2,189,844  | 0.0              | Colombia (Rep of)<br>(Reg) 3.25%<br>22Apr2032                               | 美元 24,130,000         | 19,152,082  | 0.3              |
| Hydro-Quebec Ser 19<br>6.5% 15Feb2035                               | 加元 13,700,000      | 11,692,262 | 0.2              | Ecopetrol SA (Reg)<br>8.625%<br>19Jan2029                                   | 美元 2,375,000          | 2,561,891   | 0.0              |
| Ontario (Province of)<br>3.65% 02Jun2033                            | 加元 46,500,000      | 33,202,404 | 0.6              | Ecopetrol SA (Reg)<br>8.875%<br>13Jan2033                                   | 美元 4,600,000          | 4,838,980   | 0.1              |
| Ontario (Province of)<br>4.15% 02Jun2034                            | 加元 30,000,000      | 22,070,366 | 0.4              | Enfragen Energia<br>Sur Sa Ser Regs<br>(Reg) (Reg S)<br>5.375%<br>30Dec2030 | 美元 3,200,000          | 2,830,324   | 0.1              |
| Ontario (Province of)<br>4.65% 02Jun2041                            | 加元 30,000,000      | 22,489,738 | 0.4              | <b>哥斯达黎加 (0.1%)</b>                                                         |                       |             |                  |
| Province of Quebec<br>3.6% 01Sep2033                                | 加元 57,900,000      | 40,704,056 | 0.7              | Costa Rica<br>Government Ser<br>Regs (Reg) (Reg S)<br>6.125%<br>19Feb2031   | 美元 6,190,000          | 6,318,974   | 0.1              |
| Royal Bank of Canada<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) 0.01% 05Oct2028   | 欧元 4,700,000       | 4,641,665  | 0.1              | <b>捷克共和国 (1.3%)</b>                                                         |                       |             |                  |
| Toronto-Dominion Bank<br>(Reg) (Reg S) 3.666%<br>08Sep2031          | 欧元 3,900,000       | 4,473,546  | 0.1              | Czech Republic Ser<br>151 4.9%<br>14Apr2034                                 | 捷克克朗<br>1,294,160,000 | 60,263,409  | 1.1              |
| Toronto-Dominion Bank<br>Ser EMTN (Reg) (Reg<br>S) 3.191% 16Feb2029 | 欧元 6,999,000       | 7,740,106  | 0.1              |                                                                             |                       |             |                  |
| Toronto-Dominion Bank<br>Var 31Oct2082                              | 美元 3,640,000       | 3,824,447  | 0.1              |                                                                             |                       |             |                  |
| Transcanada Trust Var<br>15Sep2079                                  | 美元 4,400,000       | 4,270,844  | 0.1              |                                                                             |                       |             |                  |
| <b>智利 (0.1%)</b>                                                    |                    |            |                  |                                                                             |                       |             |                  |
| ATP Tow/Andean<br>Telecom Ser Regs<br>7.875% 03Feb2030              | 美元 2,800,000       | 2,845,809  | 0.0              |                                                                             |                       |             |                  |
| Republic of Chile 3.75%<br>14Jan2032                                | 欧元 5,000,000       | 5,439,296  | 0.1              |                                                                             |                       |             |                  |
| <b>中国 (6.8%)</b>                                                    |                    |            |                  |                                                                             |                       |             |                  |
| China (Govt of) Ser<br>Inbk (Reg) 2.11%<br>25Aug2034<br>(Interbank) | 人民币<br>120,000,000 | 16,959,489 | 0.3              |                                                                             |                       |             |                  |

投资组合 (续)

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|                                                                       | 单位数目                | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |                                                                            | 单位数目          | 公平值<br>美元   | 占资产<br>净值百<br>分比 |
|-----------------------------------------------------------------------|---------------------|------------|------------------|----------------------------------------------------------------------------|---------------|-------------|------------------|
| <b>捷克共和国 (续)</b>                                                      |                     |            |                  |                                                                            |               |             |                  |
| Czech Republic Ser<br>154 (Br) 4.5%<br>11Nov2032                      | 捷克克朗<br>296,120,000 | 13,382,320 | 0.2              | Electricite De France<br>Sa (Reg S) (Br) Var<br>Perp 31Dec2049             | 欧元 2,200,000  | 2,330,041   | 0.0              |
| <b>丹麦 (0.4%)</b>                                                      |                     |            |                  | Electricite De France<br>Sa Ser 144A 6.9%<br>23May2053                     | 美元 4,360,000  | 4,800,617   | 0.1              |
| Danske Bank A/S Ser<br>144A (Reg) Var<br>11Sep2026                    | 美元 8,260,000        | 8,157,118  | 0.1              | Electricite De France<br>Sa Ser EMTN (Reg S)<br>(Br) Var Perp<br>31Dec2049 | 欧元 2,400,000  | 2,907,268   | 0.1              |
| Danske Bank A/S Ser<br>144A Var<br>01Mar2030                          | 美元 8,580,000        | 8,871,434  | 0.2              | Engie Sa Ser 144A<br>5.625% 10Apr2034                                      | 美元 1,540,000  | 1,607,855   | 0.0              |
| Danske Bank A/S Ser<br>144A Var<br>02Oct2030                          | 美元 2,180,000        | 2,200,934  | 0.0              | France (Govt of) (Reg<br>S) 2.5% 25May2043                                 | 欧元 5,696,728  | 5,211,888   | 0.1              |
| DSV Finance Bv Ser<br>EMTN 3.25%<br>06Nov2030                         | 欧元 3,000,000        | 3,277,577  | 0.1              | France (Govt of) Ser<br>Oat (Reg S) 2.75%<br>25Feb2030                     | 欧元 96,250,000 | 104,384,294 | 1.8              |
| <b>多米尼加 (0.2%)</b>                                                    |                     |            |                  | France (Govt of) Ser<br>Oat 3% 25Nov2034                                   | 欧元 17,000,000 | 17,985,295  | 0.3              |
| Dominican Republic<br>(Reg) (Reg S) (Ser<br>Regs) 4.875%<br>23Sep2032 | 美元 8,900,000        | 8,110,422  | 0.1              | France (Govt of) Ser<br>Oat 3.2%<br>25May2035                              | 欧元 69,140,062 | 75,233,825  | 1.3              |
| Dominican Republic<br>Ser Regs (Reg)<br>5.95% 25Jan2027               | 美元 6,000,000        | 6,099,650  | 0.1              | Societe Generale Ser<br>144A Var 13Apr2033                                 | 美元 9,460,000  | 9,819,765   | 0.2              |
| <b>埃及 (0.1%)</b>                                                      |                     |            |                  | Societe Generale Ser<br>Regs (Regs) 4.25%<br>19Aug2026                     | 美元 2,000,000  | 1,988,356   | 0.0              |
| Arab Republic of<br>Egypt Ser 144A<br>5.875% 16Feb2031                | 美元 10,000,000       | 8,310,438  | 0.1              | Totalenergies Capital<br>Sa (Reg) 5.275%<br>10Sep2054                      | 美元 500,000    | 473,108     | 0.0              |
| <b>法国 (5.4%)</b>                                                      |                     |            |                  | Totalenergies Se (Reg<br>S) (Br) Var Perp<br>31Dec2049                     | 欧元 2,200,000  | 2,390,494   | 0.0              |
| Alstom Sa (Reg S) (Br)<br>Var Perp<br>31Dec2049                       | 欧元 1,000,000        | 1,159,370  | 0.0              | Veolia Environnement<br>Sa Var Perp<br>31Dec2049                           | 欧元 2,500,000  | 2,889,574   | 0.1              |
| BNP Paribas Ser 144A<br>(Reg) Var<br>19Nov2030                        | 美元 7,592,000        | 7,820,136  | 0.1              | <b>德国 (3.0%)</b>                                                           |               |             |                  |
| BNP Paribas Ser 144A<br>(Reg) Var<br>19Nov2035                        | 美元 5,460,000        | 5,514,231  | 0.1              | Bundeschatzanweisin<br>gen (Reg S) (Br) 2%<br>10Dec2026                    | 欧元 90,000,000 | 98,044,187  | 1.7              |
| BNP Paribas Ser 144A<br>Var 13Jan2033                                 | 美元 10,180,000       | 10,539,693 | 0.2              | Bundeschatzanweisin<br>gen Ser 190 (Reg S)<br>(Br) 2.5% 11Oct2029          | 欧元 20,000,000 | 22,208,304  | 0.4              |
| BNP Paribas Ser 144A<br>Var Perp                                      | 美元 4,560,000        | 4,752,402  | 0.1              | Commerzbank AG Ser<br>EMTN (Reg S) Var<br>05Oct2033                        | 欧元 2,500,000  | 3,044,952   | 0.1              |
| BPCE Sa Ser 144A Var<br>18Jan2027                                     | 美元 17,148,000       | 17,512,515 | 0.3              | Commerzbank AG Ser<br>EMTN (Reg S) Var<br>18Jan2030                        | 欧元 5,000,000  | 5,797,015   | 0.1              |
| BPCE Sa Ser 144A Var<br>19Oct2029                                     | 美元 18,372,000       | 19,909,672 | 0.4              | Commerzbank AG Ser<br>EMTN Var Perp<br>31Dec2049                           | 欧元 2,000,000  | 2,477,591   | 0.0              |
| BPCE Sa Ser 144A Var<br>19Oct2034                                     | 美元 1,752,000        | 1,963,979  | 0.0              | Deutsche Bank AG Ser<br>EMTN (Reg S) (Br)<br>Var 12Jul2028                 | 欧元 5,000,000  | 5,671,803   | 0.1              |
| BPCE Sfh - Societe De<br>Fi (Reg S) (Br) 3%<br>15Jan2031              | 欧元 4,100,000        | 4,473,602  | 0.1              | Deutsche Bank NY Var<br>11Sep2030                                          | 美元 2,860,000  | 2,854,246   | 0.1              |
| Credit Agricole Sa Ser<br>144A Var<br>09Jan2036                       | 美元 2,232,000        | 2,313,391  | 0.0              | Deutsche Bank NY Var<br>20Nov2029                                          | 美元 4,098,000  | 4,447,742   | 0.1              |
| Credit Agricole Sa Ser<br>144A Var Perp<br>31Dec2049                  | 美元 5,052,000        | 4,883,965  | 0.1              | Land Nordrhein-<br>Westfalen Ser EMTN<br>(Reg S) (Br) 2.15%<br>21Mar2119   | 欧元 1,200,000  | 813,783     | 0.0              |

投资组合 (续)

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|                                                                        | 单位数目                   | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |                                                                     | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |
|------------------------------------------------------------------------|------------------------|------------|------------------|---------------------------------------------------------------------|---------------|------------|------------------|
| <b>德国 (续)</b>                                                          |                        |            |                  | <b>JSW Infrastructure</b>                                           |               |            |                  |
| Traton Finance Lux Sa<br>Ser EMTN (Br)<br>3.75% 27Mar2030              | 欧元 5,000,000           | 5,464,879  | 0.1              | Ser Regs (Reg) (Reg<br>S) 4.95%<br>21Jan2029                        | 美元 2,750,000  | 2,676,282  | 0.0              |
| Traton Finance Lux Sa<br>Ser EMTN (Reg S)<br>5.625% 16Jan2029          | 英镑 1,900,000           | 2,476,204  | 0.0              | Muthoot Finance Ltd<br>Ser Regs (Reg S)<br>7.125% 14Feb2028         | 美元 4,000,000  | 4,084,530  | 0.1              |
| Volkswagen Intl Fin<br>Nv Ser 10Y (Br) (Reg<br>S) 1.875%<br>30Mar2027  | 欧元 5,000,000           | 5,299,773  | 0.1              | NTPC Ltd Ser EMTN<br>(Reg) (Reg S) 2.75%<br>01Feb2027               | 欧元 1,500,000  | 1,618,028  | 0.0              |
| Vonovia Se Ser EMTN<br>(Reg S) (Br) 0.25%<br>01Sep2028                 | 欧元 5,000,000           | 4,933,916  | 0.1              | Periama Holdings<br>Llc/De (Reg) (Reg S)<br>5.95% 19Apr2026         | 美元 5,480,000  | 5,621,357  | 0.1              |
| Vonovia Se Ser EMTN<br>(Reg S) (Br) 0.625%<br>14Dec2029                | 欧元 6,000,000           | 5,747,832  | 0.1              | Rec Limited Ser GMTN<br>(Reg) (Reg S) 2.25%<br>01Sep2026            | 美元 5,700,000  | 5,506,921  | 0.1              |
| Vonovia Se Ser<br>EMTN .625%<br>24Mar2031                              | 欧元 3,000,000           | 2,723,864  | 0.0              | Shriram Finance Ltd<br>Ser Regs (Reg S)<br>6.625% 22Apr2027         | 美元 3,400,000  | 3,527,505  | 0.1              |
| <b>危地马拉 (0.0%)</b>                                                     |                        |            |                  | Shriram Finance Ltd<br>Ser Regs (Reg)<br>6.15% 03Apr2028            | 美元 3,271,000  | 3,348,301  | 0.1              |
| Millicom Intl Cellular<br>Ser 144A (Reg)<br>6.25% 25Mar2029            | 美元 3,000,000           | 2,693,144  | 0.0              | Tata Capital Ltd Ser<br>EMTN 5.389%<br>21Jul2028                    | 美元 16,600,000 | 16,924,549 | 0.3              |
| <b>香港 (0.2%)</b>                                                       |                        |            |                  | <b>印度尼西亚 (0.5%)</b>                                                 |               |            |                  |
| CAS Capital No1 Ltd<br>(Reg) (Reg S) Var<br>Perp 31Dec2049             | 美元 4,500,000           | 4,389,144  | 0.1              | Bank Bukopin Pt<br>5.658% 30Oct2027                                 | 美元 2,172,000  | 2,198,202  | 0.0              |
| MTR Corp Ltd Ser<br>EMTN 5.25%<br>01Apr2055                            | 美元 8,583,000           | 8,533,999  | 0.1              | Perusahaan Listrik<br>Negar Ser Regs<br>(Reg S) 1.875%<br>05Nov2031 | 欧元 1,000,000  | 936,022    | 0.0              |
| <b>匈牙利 (0.6%)</b>                                                      |                        |            |                  | Republic of Indonesia<br>3.875% 15Jan2033                           | 欧元 24,880,000 | 26,772,578 | 0.5              |
| Hungary (Govt of) Ser<br>10Y (Reg) (Reg S)<br>4.5% 16Jun2034           | 欧元 11,376,000          | 12,119,601 | 0.2              | <b>国际 (0.6%)</b>                                                    |               |            |                  |
| Hungary (Govt of)<br>Ser 35/A 7%<br>24Oct2035                          | 匈牙利福林<br>6,600,000,000 | 17,951,161 | 0.3              | Africa Finance Corp<br>Ser Regs (Reg S)<br>2.875% 28Apr2028         | 美元 6,000,000  | 5,645,813  | 0.1              |
| Hungary (Govt of) Ser<br>Regs (Reg S) 5.5%<br>26Mar2036                | 美元 5,113,000           | 4,901,610  | 0.1              | Africa Finance Corp<br>Ser Regs 5.55%<br>08Oct2029                  | 美元 2,800,000  | 2,865,031  | 0.1              |
| <b>印度 (1.3%)</b>                                                       |                        |            |                  | African Export-Import<br>Ba Ser 144A (Reg)<br>2.634% 17May2026      | 美元 2,000,000  | 1,956,019  | 0.0              |
| Export-Import Bk<br>India Ser Regs 5.5%<br>13Jan2035                   | 美元 13,500,000          | 13,827,944 | 0.2              | African Export-Import<br>Ba Ser Regs (Reg S)<br>3.798% 17May2031    | 美元 2,000,000  | 1,805,314  | 0.0              |
| GMR Hyderabad<br>Internatio Ser Regs<br>(Regs) 4.25%<br>27Oct2027      | 美元 6,470,000           | 6,304,055  | 0.1              | African Export-Import<br>Ba Ser Regs (Reg S)<br>3.994% 21Sep2029    | 美元 3,000,000  | 2,794,426  | 0.0              |
| Greenko Dutch BV Ser<br>Regs (Reg) (Reg S)<br>3.85% 29Mar2026          | 美元 8,550,000           | 7,307,489  | 0.1              | Banque Ouest<br>Africaine D Ser<br>Regs (Reg S) 2.75%<br>22Jan2033  | 欧元 4,000,000  | 3,709,185  | 0.1              |
| India Clean Energy<br>Hldg Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) 4.5%<br>18Apr2027 | 美元 2,900,000           | 2,817,802  | 0.1              |                                                                     |               |            |                  |
| IRB Infrastructure<br>Deve Ser Regs (Reg<br>S) 7.11%<br>11Mar2032      | 美元 2,350,000           | 2,382,519  | 0.0              |                                                                     |               |            |                  |

投资组合 (续)

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|                                                                   | 单位数目          | 公允价值<br>美元 | 占资产<br>净值百<br>分比 |                                                                         | 单位数目          | 公允价值<br>美元 | 占资产<br>净值百<br>分比 |
|-------------------------------------------------------------------|---------------|------------|------------------|-------------------------------------------------------------------------|---------------|------------|------------------|
| 国际 (续)                                                            |               |            |                  |                                                                         |               |            |                  |
| Banque Ouest<br>Africaine D Ser<br>Regs (Reg S) 4.7%<br>22Oct2031 | 美元 9,200,000  | 8,593,166  | 0.2              | Bank of Ireland Group<br>Ser 144A (Reg) Var<br>16Sep2026                | 美元 2,832,000  | 2,859,152  | 0.1              |
| Banque Ouest<br>Africaine D Ser<br>Regs Var<br>13Feb2055          | 美元 5,750,000  | 5,887,214  | 0.1              | Bank of Ireland Group<br>Ser EMTN (Reg)<br>(Reg S) Var<br>01Mar2033     | 欧元 2,500,000  | 2,928,716  | 0.1              |
| 爱尔兰 (2.0%)                                                        |               |            |                  | 以色列 (1.0%)                                                              |               |            |                  |
| Aercap Ireland<br>Cap/Globa (Reg)<br>3% 29Oct2028                 | 美元 17,700,000 | 16,858,430 | 0.3              | Israel (Govt of) (Reg)<br>5.375% 12Mar2029                              | 美元 11,310,000 | 11,442,658 | 0.2              |
| Aercap Ireland<br>Cap/Globa (Reg)<br>3.3% 30Jan2032               | 美元 1,420,000  | 1,266,617  | 0.0              | Israel (Govt of) (Reg)<br>5.5% 12Mar2034                                | 美元 11,265,000 | 11,252,640 | 0.2              |
| Aercap Ireland<br>Cap/Globa (Reg)<br>5.75% 06Jun2028              | 美元 1,368,000  | 1,432,407  | 0.0              | State of Israel 5.625%<br>19Feb2035                                     | 美元 23,490,000 | 23,517,918 | 0.4              |
| Aercap Ireland<br>Cap/Globa 4.625%<br>10Sep2029                   | 美元 1,072,000  | 1,063,940  | 0.0              | State of Israel Ser<br>EMTN (Reg) 6.5%<br>06Nov2031                     | 美元 13,049,000 | 14,182,998 | 0.2              |
| AIB Group Plc (Reg)<br>(Reg S) Var Perp<br>31Dec2049              | 欧元 2,600,000  | 3,026,892  | 0.1              | 意大利 (8.3%)                                                              |               |            |                  |
| AIB Group Plc Ser<br>144A Var<br>13Sep2029                        | 美元 400,000    | 423,764    | 0.0              | Autostrade Per<br>L'Italia Ser EMTN<br>(Reg S) (Br) 1.875%<br>26Sep2029 | 欧元 8,000,000  | 8,243,773  | 0.1              |
| AIB Group Plc Ser<br>144A Var<br>28Mar2035                        | 美元 640,000    | 652,095    | 0.0              | Autostrade Per<br>L'Italia Ser EMTN<br>(Reg S) (Br) 4.75%<br>24Jan2031  | 欧元 6,000,000  | 6,880,971  | 0.1              |
| AIB Group Plc Ser<br>EMTN (Reg S) (Br)<br>Var 04Apr2028           | 欧元 1,000,000  | 1,089,969  | 0.0              | Banca Monte Dei<br>Paschi S (Reg S)<br>(Br) 3.5%<br>23Apr2029           | 欧元 3,540,000  | 4,058,032  | 0.1              |
| AIB Group Plc Ser<br>EMTN (Reg S) (Br)<br>Var 23Jul2029           | 欧元 5,000,000  | 5,822,070  | 0.1              | Buoni Poliennali Del<br>Tes Ser 10Y 3.65%<br>01Aug2035                  | 欧元 61,475,000 | 65,899,678 | 1.1              |
| Avolon Holdings Fndg<br>Ltd Ser 144A (Reg)<br>3.25% 15Feb2027     | 美元 2,396,000  | 2,333,808  | 0.0              | Buoni Poliennali Del<br>Tes Ser 5Y 3%<br>01Oct2029                      | 欧元 30,000,000 | 33,114,282 | 0.6              |
| Avolon Holdings Fndg<br>Ltd Ser 144A (Reg)<br>4.25% 15Apr2026     | 美元 6,332,000  | 6,422,302  | 0.1              | Credito Emiliano Spa<br>Ser EMTN (Reg S)<br>(Br) 3.25%<br>18Apr2029     | 欧元 300,000    | 339,244    | 0.0              |
| Avolon Holdings Fndg<br>Ltd Ser 144A 4.95%<br>15Jan2028           | 美元 6,720,000  | 6,794,626  | 0.1              | Enel Finance Intl NV<br>Ser 144A 5%<br>15Jun2032                        | 美元 2,132,000  | 2,131,390  | 0.0              |
| Avolon Holdings Fndg<br>Ltd Ser 144A 5.15%<br>15Jan2030           | 美元 13,620,000 | 13,721,422 | 0.2              | Enel Finance Intl NV<br>Ser 144A 5.5%<br>15Jun2052                      | 美元 4,800,000  | 4,509,621  | 0.1              |
| Avolon Holdings Fndg<br>Ltd Ser 144A 5.75%<br>01Mar2029           | 美元 17,068,000 | 17,471,943 | 0.3              | Enel Finance Intl NV<br>Ser EMTN (Reg S)<br>(Br) 0.875%<br>17Jan2031    | 欧元 1,000,000  | 941,762    | 0.0              |
| Avolon Holdings Fndg<br>Ltd Ser 144A 5.75%<br>15Nov2029           | 美元 5,112,000  | 5,324,709  | 0.1              | Enel SpA Ser Emtn<br>(Br) Var Perp<br>31Dec2049 6.375%                  | 欧元 3,500,000  | 4,205,873  | 0.1              |
| Avolon Holdings Fndg<br>Ltd Ser 144A<br>6.375% 04May2028          | 美元 19,180,000 | 20,353,514 | 0.4              | Enel SpA Ser Emtn<br>(Br) Var Perp<br>31Dec2049 6.625%                  | 欧元 3,000,000  | 3,713,894  | 0.1              |
| Bank of Ireland Group<br>(Reg) (Reg S) Var<br>Perp 31Dec2049      | 欧元 6,500,000  | 7,127,147  | 0.1              | Intesa Sanpaolo SpA<br>Ser -* (Br) Var Perp<br>31Dec2049                | 欧元 1,200,000  | 1,330,715  | 0.0              |

投资组合 (续)

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|                                                                    | 单位数目              | 公平值<br>美元   | 占资产<br>净值百<br>分比 |                                                                                                 | 单位数目         | 公平值<br>美元 | 占资产<br>净值百<br>分比 |
|--------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------|------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------|-----------|------------------|
| <b>意大利 (续)</b>                                                     |                   |             |                  |                                                                                                 |              |           |                  |
| Intesa Sanpaolo Spa<br>Ser 144A 6.625%<br>20Jun2033                | 美元 12,768,000     | 13,910,740  | 0.2              | Nippon Life<br>Insurance Ser<br>144A Var<br>16Apr2054                                           | 美元 3,000,000 | 3,100,699 | 0.0              |
| Intesa Sanpaolo SpA<br>Ser EMTN (Reg S)<br>(Br) 5.25%<br>13Jan2030 | 欧元 6,000,000      | 7,136,833   | 0.1              | Rakuten Group Inc<br>Ser Regs (Reg S)<br>11.25% 15Feb2027                                       | 美元 2,633,000 | 2,895,797 | 0.0              |
| Intesa Sanpaolo SpA<br>Ser EMTN (Reg S)<br>(Br) Var<br>16Sep2032   | 欧元 8,000,000      | 8,853,055   | 0.2              | Sumitomo Life Insur<br>Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) Var<br>15Apr2081                               | 美元 3,720,000 | 3,386,768 | 0.1              |
| Intesa Var Perp<br>11Jul2067                                       | 欧元 3,000,000      | 3,477,478   | 0.1              | Toyota Motor<br>Finance Bv Ser<br>EMTN 3.125%<br>11Jan2027                                      | 欧元 5,000,000 | 5,489,786 | 0.1              |
| Italy (Rep of) Ser 11Y<br>(Reg S) (Br) 3.85%<br>01Feb2035          | 欧元 147,000,000    | 161,124,773 | 2.8              | <b>哈萨克斯坦 (0.1%)</b><br>Tengizchevroil Fin<br>Co In Ser Regs<br>(Reg) (Reg S)<br>3.25% 15Aug2030 | 美元 3,300,000 | 2,902,912 | 0.1              |
| Italy (Rep of) Ser 2Y<br>(Reg S) (Br) 3.1%<br>28Aug2026            | 欧元 50,000,000     | 54,829,566  | 0.9              | <b>韩国 (0.2%)</b><br>Korea Housing<br>Finance Co (Reg)<br>(Reg S) 3.124%<br>18Mar2029            | 欧元 4,745,000 | 5,210,560 | 0.1              |
| Italy (Rep of) Ser 30Y<br>(Reg S) 4.3%<br>01Oct2054                | 欧元 4,826,000      | 5,133,077   | 0.1              | Korea Housing<br>Finance Co Ser<br>EMTN (Reg) (Reg<br>S) 4.082%<br>25Sep2027                    | 欧元 4,000,000 | 4,568,160 | 0.1              |
| Italy (Rep of) Ser 7Y<br>(Reg S) 3.5%<br>15Feb2031                 | 欧元 63,125,000     | 69,808,672  | 1.2              | <b>科威特 (0.1%)</b><br>Equate<br>Petrochemical Bv<br>Ser Regs (Reg S)<br>2.625% 28Apr2028         | 美元 2,000,000 | 1,888,478 | 0.0              |
| Unicredit SpA (Reg<br>S) (Br) Var Perp                             | 欧元 4,200,000      | 4,808,087   | 0.1              | Equate<br>Petrochemical BV<br>Ser Regs (Reg)<br>(Regs) 4.25%<br>03Nov2026                       | 美元 3,000,000 | 3,022,690 | 0.1              |
| Unicredit SpA Ser<br>EMTN (Br) Var<br>16Feb2029                    | 欧元 10,000,000     | 11,248,278  | 0.2              | <b>卢森堡 (0.1%)</b><br>Bavarian Sky Sa (Ser<br>8 Cl A) FRN<br>20Nov2031                           | 欧元 1,900,000 | 1,562,265 | 0.0              |
| Unicredit SpA Ser<br>EMTN (Reg S) (Br)<br>Var Perp<br>31Dec2049    | 欧元 2,700,000      | 3,050,672   | 0.1              | Selp Finance Sarl Ser<br>EMTN 3.75%<br>16Jan2032                                                | 欧元 4,900,000 | 5,294,541 | 0.1              |
| <b>日本 (5.2%)</b><br>Chugoku Electric<br>Power 5.742%<br>14Jan2035  | 美元 10,350,000     | 10,797,834  | 0.2              | <b>澳门 (0.4%)</b><br>Champion Path<br>Holdings (Reg)<br>(Reg S) 4.5%<br>27Jan2026                | 美元 8,000,000 | 7,956,652 | 0.1              |
| Dai-ichi Life<br>Holdings Ser Regs<br>Var Perp<br>31Dec2049        | 美元 7,105,000      | 7,236,888   | 0.1              | MGM China Holdings<br>Ltd Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) 7.125%<br>26Jun2031                         | 美元 2,300,000 | 2,392,025 | 0.0              |
| Japan (10 Year<br>Issue) Ser 377<br>1.2% 20Dec2034                 | 日元 7,900,000,000  | 51,682,984  | 0.9              | Sands China Ltd Ser<br>Wi (Reg) 3.1%<br>08Mar2029                                               | 美元 2,700,000 | 2,448,648 | 0.0              |
| Japan (20 Year<br>Issue) Ser 190<br>1.8% 20Sep2044                 | 日元 8,500,000,000  | 53,430,782  | 0.9              |                                                                                                 |              |           |                  |
| Japan (30 Year<br>Issue) Ser 85 2.3%<br>20Dec2054                  | 日元 8,500,000,000  | 55,066,839  | 0.9              |                                                                                                 |              |           |                  |
| Japan (Govt of) 40<br>Year No.5 2Pct<br>20Mar2052                  | 日元 5,710,000,000  | 34,933,840  | 0.6              |                                                                                                 |              |           |                  |
| Japan (Govt of) Ser<br>74 1% 20Mar2052                             | 日元 3,400,000,000  | 16,305,946  | 0.3              |                                                                                                 |              |           |                  |
| Japan (Govt of) Ser<br>79 1.2%<br>20Jun2053                        | 日元 11,250,000,000 | 56,324,898  | 1.0              |                                                                                                 |              |           |                  |
| Meiji Yasuda Life<br>Insura Ser Regs<br>(Reg S) Var<br>11Sep2054   | 美元 3,240,000      | 3,212,101   | 0.1              |                                                                                                 |              |           |                  |

投资组合 (续)

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|                                                                                        | 单位数目                | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |                                                                                                  | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |
|----------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|------------|------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|------------|------------------|
| <b>澳门 (续)</b>                                                                          |                     |            |                  | ING Groep NV Var<br>Perp                                                                         | 美元 3,690,000  | 3,743,617  | 0.1              |
| Sands China Ltd Ser<br>Wi (Reg) 5.4%<br>08Aug2028                                      | 美元 2,500,000        | 2,524,653  | 0.1              | <b>尼日利亚 (0.1%)</b><br>IHS Holding Ltd Ser<br>Regs (Reg S)<br>6.25% 29Nov2028                     | 美元 2,900,000  | 2,866,389  | 0.1              |
| Studio City Co Ltd<br>Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) 7%<br>15Feb2027                        | 美元 2,350,000        | 2,392,651  | 0.0              | <b>挪威 (0.1%)</b><br>Aker BP Asa Ser 144A<br>6% 13Jun2033                                         | 美元 4,470,000  | 4,639,637  | 0.1              |
| Studio City Finance<br>Ltd Ser Regs (Reg)<br>(Regs) 5%<br>15Jan2029                    | 美元 3,100,000        | 2,826,452  | 0.1              | <b>巴拿马 (0.0%)</b><br>Panama (Govt of)<br>(Reg) 8.875%<br>30Sep2027                               | 美元 2,350,000  | 2,539,167  | 0.0              |
| Wynn Macau Ltd Ser<br>Regs (Reg) (Reg S)<br>5.125%<br>15Dec2029                        | 美元 3,000,000        | 2,819,971  | 0.1              | <b>菲律宾 (0.4%)</b><br>Philippines (Rep of)<br>3.625% 04Feb2032                                    | 欧元 20,000,000 | 21,417,921 | 0.4              |
| <b>墨西哥 (2.1%)</b><br>Alpek Sa De Cv Ser<br>Regs (Reg) (Reg S)<br>4.25% 18Sep2029       | 美元 3,000,000        | 2,840,081  | 0.0              | <b>葡萄牙 (0.1%)</b><br>Banco Santander<br>Totta Sa (Reg)<br>(Reg S) 3.25%<br>15Feb2031             | 欧元 1,200,000  | 1,329,464  | 0.0              |
| Banco Mercantil De<br>Norte Ser Regs<br>(Reg) (Reg S) Var<br>Perp 31Dec2049<br>7.5%    | 美元 2,900,000        | 2,852,102  | 0.1              | EDP Sa Ser EMTN<br>(Reg) Var<br>23Apr2083                                                        | 欧元 5,000,000  | 6,006,187  | 0.1              |
| Banco Mercantil De<br>Norte Ser Regs<br>(Reg) (Reg S) Var<br>Perp 31Dec2049<br>8.375%  | 美元 2,400,000        | 2,474,048  | 0.0              | <b>罗马尼亚 (0.3%)</b><br>Romania (Govt of)<br>Ser Regs (Reg)<br>(Reg S) 1.75%<br>13Jul2030          | 欧元 21,150,000 | 19,407,396 | 0.3              |
| BBVA Bancomer Sa<br>Texas Ser Regs<br>(Reg) (Reg S) Var<br>13Sep2034                   | 美元 2,350,000        | 2,270,613  | 0.0              | <b>斯洛伐克 (0.1%)</b><br>Vseobecna Uverova<br>Banka Ser EMTN<br>(Reg S) (Br)<br>3.875%<br>05Sep2028 | 欧元 3,600,000  | 4,109,695  | 0.1              |
| BBVA Bancomer Sa<br>Texas Var<br>18Jan2033                                             | 美元 2,450,000        | 2,356,458  | 0.0              | <b>南非 (0.2%)</b><br>South Africa (Rep of)<br>(Reg) 4.85%<br>30Sep2029                            | 美元 10,000,000 | 9,430,647  | 0.2              |
| Cemex Sab De Cv Ser<br>Regs (Reg) (Reg S)<br>Var Perp<br>31Dec2049                     | 美元 6,000,000        | 5,898,878  | 0.1              | <b>西班牙 (2.9%)</b><br>Banco Bilbao<br>Vizcaya Arg Var<br>Perp 31Dec2049                           | 美元 5,460,000  | 5,959,038  | 0.1              |
| Mexico (Utd States<br>of) 7.75%<br>29May2031                                           | 墨西哥比索<br>12,983,900 | 61,363,536 | 1.1              | Banco De Sabadell<br>Sa Ser DMTN (Reg)<br>(Reg S) 3.5%<br>28Aug2026                              | 欧元 1,900,000  | 2,119,261  | 0.0              |
| Petroleos Mexicanos<br>(Reg) 6.7%<br>16Feb2032                                         | 美元 24,500,000       | 21,751,566 | 0.4              | Banco De Sabadell<br>Sa Ser EMTN (Reg<br>S) (Br) Var<br>08Sep2029                                | 欧元 10,000,000 | 11,934,065 | 0.2              |
| United Mexican<br>States 6.875%<br>13May2037                                           | 美元 20,000,000       | 20,809,917 | 0.4              |                                                                                                  |               |            |                  |
| <b>摩洛哥 (0.0%)</b><br>Kingdom of Morocco<br>Ser Regs (Reg S)<br>2% 30Sep2030            | 欧元 1,150,000        | 1,116,467  | 0.0              |                                                                                                  |               |            |                  |
| <b>荷兰 (0.1%)</b><br>Cooperatieve<br>Rabobank UA (Reg<br>S) (Br) Var Perp 31<br>Dec2049 | 欧元 2,800,000        | 3,026,807  | 0.0              |                                                                                                  |               |            |                  |

投资组合 (续)

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|                       | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |                       | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |
|-----------------------|---------------|------------|------------------|-----------------------|---------------|------------|------------------|
| <b>西班牙 (续)</b>        |               |            |                  | Republic of Turkiye   |               |            |                  |
| Banco Santander Sa    |               |            |                  | 6.5% 03Jan2035        | 美元 8,000,000  | 7,571,639  | 0.1              |
| (Reg S) (Br) Var      |               |            |                  | TAV Havalimanlari     |               |            |                  |
| Perp 31Dec2049        | 欧元 2,800,000  | 3,200,138  | 0.1              | Holdin Ser Regs       |               |            |                  |
| Banco Santander Sa    |               |            |                  | (Reg S) 8.5%          | 美元 2,700,000  | 2,842,524  | 0.1              |
| Ser * Var Perp        |               |            |                  | 07Dec2028             |               |            |                  |
| 31Dec2049             | 美元 5,200,000  | 5,777,447  | 0.1              | Turkcell Iletisim     |               |            |                  |
| Banco Santander Sa    |               |            |                  | Hizmet Ser Regs       |               |            |                  |
| Ser EMTN (Reg S)      |               |            |                  | (Reg S) 5.8%          | 美元 2,800,000  | 2,795,489  | 0.0              |
| (Br) Var 02Apr2029    | 欧元 5,000,000  | 5,514,186  | 0.1              | 11Apr2028             |               |            |                  |
| Bankinter Sa (Reg S)  |               |            |                  | <b>阿联酋 (0.4%)</b>     |               |            |                  |
| Var 03May2030         | 欧元 5,000,000  | 5,829,805  | 0.1              | Fin Dept Govt         |               |            |                  |
| Caixabank Sa (Reg)    |               |            |                  | Sharjah Ser EMTN      |               |            |                  |
| (Reg S) Var Perp      |               |            |                  | 4.625% 13Feb2032      | 欧元 15,584,000 | 16,675,859 | 0.3              |
| 31Dec2049             | 欧元 5,400,000  | 6,366,260  | 0.1              | Galaxy Pipeline       |               |            |                  |
| Caixabank Sa Ser      |               |            |                  | Assets Ser Regs       |               |            |                  |
| 144A Var              |               |            |                  | (Reg S) 2.16%         |               |            |                  |
| 13Sep2034             | 美元 3,832,000  | 4,177,342  | 0.1              | 31Mar2034             | 美元 6,820,000  | 4,432,968  | 0.1              |
| Caixabank Sa Ser      |               |            |                  | <b>英国 (5.1%)</b>      |               |            |                  |
| 144A Var              |               |            |                  | Aviva Plc (Reg S) Var |               |            |                  |
| 15Jun2035             | 美元 4,524,000  | 4,755,727  | 0.1              | 27Nov2053             | 英镑 2,000,000  | 2,712,093  | 0.0              |
| Caixabank Sa Ser      |               |            |                  | Barclays Plc (Reg)    |               |            |                  |
| 144A Var              |               |            |                  | (Reg S) Var           |               |            |                  |
| 15Mar2030             | 美元 8,324,000  | 8,561,661  | 0.1              | 06Nov2029             | 英镑 5,000,000  | 6,990,605  | 0.1              |
| Caixabank Sa Ser      |               |            |                  | BNI Finance Bv (Reg)  |               |            |                  |
| EMTN (Reg S) (Br)     |               |            |                  | (Reg S) 3.875%        |               |            |                  |
| Var 19Jul2029         | 欧元 5,000,000  | 5,915,572  | 0.1              | 01Dec2030             | 欧元 3,000,000  | 3,386,479  | 0.1              |
| Cellnex Telecom SA    |               |            |                  | Hammerson Plc Ser     |               |            |                  |
| Ser EMTN (Reg S)      |               |            |                  | EMTN 5.875%           |               |            |                  |
| (Br) 1.75%            |               |            |                  | 08Oct2036             | 英镑 4,000,000  | 5,079,999  | 0.1              |
| 23Oct2030             | 欧元 2,000,000  | 1,988,848  | 0.0              | Heathrow Funding      |               |            |                  |
| Iberdrola Finanzas    |               |            |                  | Ltd Ser EMTN          |               |            |                  |
| Sau Ser EMTN          |               |            |                  | (Reg) (Reg S) 4.5%    |               |            |                  |
| (Reg S) (Br) Var      |               |            |                  | 11Jul2035             | 欧元 1,000,000  | 1,162,201  | 0.0              |
| Perp 31Dec2049        | 欧元 1,000,000  | 1,150,629  | 0.0              | Heathrow Funding      |               |            |                  |
| Spain (Govt of) (Reg) |               |            |                  | Ltd Ser EMTN 6%       |               |            |                  |
| (Reg S) 3.45%         |               |            |                  | 05Mar2032             | 英镑 5,000,000  | 6,443,252  | 0.1              |
| 31Oct2034             | 欧元 87,500,000 | 96,723,621 | 1.7              | Heathrow Funding      |               |            |                  |
| <b>瑞士 (0.5%)</b>      |               |            |                  | Ltd Ser Regs (Reg)    |               |            |                  |
| Credit Suisse Group   |               |            |                  | (Reg S) 6.45%         |               |            |                  |
| Ag (Reg S) Var        |               |            |                  | 10Dec2031             | 英镑 2,500,000  | 3,453,536  | 0.1              |
| 30Sep2027             | 英镑 2,700,000  | 3,652,244  | 0.0              | HSBC Holdings Plc     |               |            |                  |
| UBS Group Ag Ser      |               |            |                  | (Reg) Var             |               |            |                  |
| 144A (Reg) Var        |               |            |                  | 04Jun2031             | 美元 722,000    | 655,466    | 0.0              |
| Perp 31Dec2049        | 美元 3,336,000  | 3,933,679  | 0.1              | HSBC Holdings Plc     |               |            |                  |
| UBS Group AG Ser      |               |            |                  | (Reg) Var             |               |            |                  |
| 144A (Reg) Var        |               |            |                  | 04Mar2030             | 美元 7,840,000  | 8,044,718  | 0.1              |
| Perp 31Dec2049        |               |            |                  | HSBC Holdings Plc     |               |            |                  |
| 9.25%                 | 美元 4,952,000  | 5,566,040  | 0.1              | Var 18Nov2035         | 美元 8,100,000  | 8,246,385  | 0.1              |
| UBS Group AG Var      |               |            |                  | HSBC Holdings Plc     |               |            |                  |
| 01Mar2029 Ser         |               |            |                  | Var 19Nov2028         | 美元 4,632,000  | 4,757,509  | 0.1              |
| EMTN (Reg S) Var      |               |            |                  | Lloyds Banking        |               |            |                  |
| 02Apr2026             | 欧元 10,000,000 | 12,217,045 | 0.2              | Group Plc (Reg)       |               |            |                  |
| UBS Switzerland Ag    |               |            |                  | Var 07Aug2027         | 美元 1,910,000  | 1,958,934  | 0.0              |
| (Reg S) 3.304%        |               |            |                  | Lloyds Banking        |               |            |                  |
| 05Mar2029             | 欧元 5,000,000  | 5,524,227  | 0.1              | Group Plc Ser *       |               |            |                  |
| <b>土耳其 (0.3%)</b>     |               |            |                  | (Reg) Var Perp        |               |            |                  |
| Mersin Uluslararasi   |               |            |                  | 31Dec2049             | 美元 3,040,000  | 2,899,579  | 0.1              |
| Lima Ser Regs         |               |            |                  |                       |               |            |                  |
| (Reg S) 8.25%         |               |            |                  |                       |               |            |                  |
| 15Nov2028             | 美元 2,700,000  | 2,859,280  | 0.1              |                       |               |            |                  |

投资组合 (续)

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|                       | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |                       | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |
|-----------------------|---------------|------------|------------------|-----------------------|---------------|------------|------------------|
| 英国 (续)                |               |            |                  | UK (Gilts) (Reg) (Reg |               |            |                  |
| Motability            |               |            |                  | S) 4.625%             |               |            |                  |
| Operations Gr Ser     |               |            |                  | 31Jan2034             | 英镑 54,750,000 | 71,379,188 | 1.2              |
| EMTN (Reg S) (Br)     |               |            |                  |                       |               |            |                  |
| 3.625% 24Jul2029      | 欧元 1,928,000  | 2,179,578  | 0.0              | 美国 (28.3%)            |               |            |                  |
| Motability            |               |            |                  | Abbvie Inc (Reg)      |               |            |                  |
| Operations Gr Ser     |               |            |                  | 4.05% 21Nov2039       | 美元 688,000    | 613,356    | 0.0              |
| EMTN 4%               |               |            |                  | Abbvie Inc (Reg)      |               |            |                  |
| 17Jan2030             | 欧元 5,000,000  | 5,629,001  | 0.1              | 4.25% 21Nov2049       | 美元 4,202,000  | 3,546,993  | 0.1              |
| National Grid Plc Ser |               |            |                  | Abbvie Inc 0.75%      |               |            |                  |
| EMTN (Reg S) (Br)     |               |            |                  | 18Nov2027             | 欧元 5,000,000  | 5,174,065  | 0.1              |
| 0.163% 20Jan2028      | 欧元 5,000,000  | 5,028,502  | 0.1              | AES Corp/The (Reg)    |               |            |                  |
| National Grid Plc Ser |               |            |                  | 1.375% 15Jan2026      | 美元 2,332,000  | 2,275,115  | 0.0              |
| EMTN (Reg S) (Br)     |               |            |                  | Ameren Illinois Co    |               |            |                  |
| 0.553%                |               |            |                  | (Reg) 5.9%            |               |            |                  |
| 18Sep2029             | 欧元 1,000,000  | 967,225    | 0.0              | 01Dec2052             | 美元 352,000    | 371,960    | 0.0              |
| Nationwide Bldg       |               |            |                  | American Honda        |               |            |                  |
| Society (Reg) (Reg    |               |            |                  | Finance 0.3%          |               |            |                  |
| S) Var Perp           |               |            |                  | 07Jul2028             | 欧元 1,500,000  | 1,494,315  | 0.0              |
| 31Dec2049 5.75%       | 英镑 2,300,000  | 2,937,828  | 0.1              | Amerisourcebergen     |               |            |                  |
| Nationwide Bldg       |               |            |                  | Corp (Reg) 2.7%       |               |            |                  |
| Society (Reg) (Reg    |               |            |                  | 15Mar2031             | 美元 5,400,000  | 4,811,581  | 0.1              |
| S) Var Perp           |               |            |                  | Amerisourcebergen     |               |            |                  |
| 31Dec2049 7.5%        | 英镑 5,000,000  | 6,553,083  | 0.1              | Corp 2.8%             |               |            |                  |
| Natwest Group Plc     |               |            |                  | 15May2030             | 美元 3,162,000  | 2,931,594  | 0.1              |
| (Reg) Var Perp        |               |            |                  | Amgen Inc 4.875%      |               |            |                  |
| 31Dec2049             | 美元 2,752,000  | 2,896,765  | 0.1              | 01Mar2053             | 美元 1,232,000  | 1,081,578  | 0.0              |
| NatWest Group Plc     |               |            |                  | Amgen Inc 5.75%       |               |            |                  |
| Ser EMTN (Reg S)      |               |            |                  | 02Mar2063             | 美元 4,140,000  | 4,056,906  | 0.1              |
| (Br) Var              |               |            |                  | Bank of America       |               |            |                  |
| 06Sep2028             | 欧元 1,000,000  | 1,134,331  | 0.0              | Corp (Reg) Var        |               |            |                  |
| Royal BK Scotlnd      |               |            |                  | 20Oct2032             | 美元 15,186,000 | 13,280,378 | 0.2              |
| Grp PLC (Reg) Var     |               |            |                  | Baxter International  |               |            |                  |
| Perp 31Dec2049        | 美元 6,916,000  | 6,923,356  | 0.1              | Inc (Reg) 2.539%      |               |            |                  |
| Santander UK Group    |               |            |                  | 01Feb2032             | 美元 6,260,000  | 5,396,966  | 0.1              |
| Hldgs (Reg) Var       |               |            |                  | BP Capital Markets    |               |            |                  |
| 21Nov2026             | 美元 9,266,000  | 9,611,721  | 0.2              | PLC (Reg S) (Br)      |               |            |                  |
| Santander Uk Plc Ser  |               |            |                  | Var Perp              | 欧元 1,500,000  | 1,629,883  | 0.0              |
| EMTN (Reg S) (Br)     |               |            |                  | BP Capital Markets    |               |            |                  |
| 3% 12Mar2029          | 欧元 4,853,000  | 5,320,481  | 0.1              | Plc Var Perp          |               |            |                  |
| SSE Plc Ser EMTN      |               |            |                  | 31Dec2049             | 美元 3,812,000  | 3,919,403  | 0.1              |
| (Reg S) (Br) 1.75%    |               |            |                  | Bristol-Myers Squibb  |               |            |                  |
| 16Apr2030             | 欧元 3,000,000  | 3,088,437  | 0.1              | Co 5.55%              |               |            |                  |
| Standard Chartered    |               |            |                  | 22Feb2054             | 美元 3,112,000  | 3,087,750  | 0.1              |
| Plc Ser 144A (Reg)    |               |            |                  | Broadcom Inc Ser      |               |            |                  |
| Var 08Feb2028         | 美元 8,648,000  | 9,027,500  | 0.2              | 144A (Reg) 3.137%     |               |            |                  |
| Standard Chartered    |               |            |                  | 15Nov2035             | 美元 4,080,000  | 3,431,563  | 0.1              |
| Plc Ser 144A Var      |               |            |                  | Broadcom Inc Ser      |               |            |                  |
| 08Feb2030             | 美元 8,020,000  | 8,655,501  | 0.1              | 144A (Reg) 3.419%     |               |            |                  |
| Standard Chartered    |               |            |                  | 15Apr2033             | 美元 2,860,000  | 2,593,143  | 0.0              |
| Plc Ser 144A Var      |               |            |                  | Cencora Inc 4.85%     |               |            |                  |
| 12Jan2028             | 美元 3,296,000  | 3,194,973  | 0.1              | 15Dec2029             | 美元 6,760,000  | 6,896,822  | 0.1              |
| Standard Chartered    |               |            |                  | CF Industries Inc     |               |            |                  |
| Plc Ser 144A Var      |               |            |                  | (Reg) 4.95%           |               |            |                  |
| 15Oct2030             | 美元 8,072,000  | 8,247,801  | 0.1              | 01Jun2043             | 美元 2,364,000  | 2,105,711  | 0.0              |
| Tsb Bank Plc (Reg S)  |               |            |                  | Charter Comm Opt      |               |            |                  |
| (Br) 3.319%           |               |            |                  | Llc/Cap (Reg)         |               |            |                  |
| 05Mar2029             | 欧元 5,000,000  | 5,543,031  | 0.1              | 2.25% 15Jan2029       | 美元 5,192,000  | 4,702,254  | 0.1              |
| UK (Gilts) (Reg) (Reg |               |            |                  | Charter Comm Opt      |               |            |                  |
| S) 3.75%              |               |            |                  | Llc/Cap (Reg)         |               |            |                  |
| 22Oct2053             | 英镑 64,500,000 | 65,935,552 | 1.1              | 5.25% 01Apr2053       | 美元 1,750,000  | 1,460,859  | 0.0              |
| UK (Gilts) (Reg) (Reg |               |            |                  |                       |               |            |                  |
| S) 4.375%             |               |            |                  |                       |               |            |                  |
| 31Jul2054             | 英镑 15,860,000 | 17,860,210 | 0.3              |                       |               |            |                  |

投资组合 (续)

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|                      | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |                      | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |
|----------------------|---------------|------------|------------------|----------------------|---------------|------------|------------------|
| 美国 (续)               |               |            |                  | Energy Transfer LP   |               |            |                  |
| Charter Comm Opt     |               |            |                  | (Reg) 5.55%          |               |            |                  |
| Llc/Cap 6.55%        |               |            |                  | 15May2034            | 美元 3,012,000  | 3,073,677  | 0.1              |
| 01Jun2034            | 美元 2,132,000  | 2,241,425  | 0.0              | Energy Transfer LP   |               |            |                  |
| Cheniere Energy      |               |            |                  | (Reg) 5.6%           |               |            |                  |
| 4.5% 01Oct2029       |               |            |                  | 01Sep2034            | 美元 1,840,000  | 1,851,959  | 0.0              |
| WI                   | 美元 14,900,000 | 14,833,635 | 0.3              | Energy Transfer LP   |               |            |                  |
| Citigroup Inc (Reg)  |               |            |                  | 5.75% 15Feb2033      | 美元 5,432,000  | 5,599,157  | 0.1              |
| Var 13Feb2030        | 美元 2,156,000  | 2,199,362  | 0.0              | Energy Transfer LP   |               |            |                  |
| Citigroup Inc (Reg)  |               |            |                  | Var 01Oct2054        | 美元 6,440,000  | 6,773,412  | 0.1              |
| Var 19Sep2030        | 美元 3,542,000  | 3,500,520  | 0.1              | Entergy Arkansas Llc |               |            |                  |
| Citigroup Inc (Reg)  |               |            |                  | 5.75% 01Jun2054      | 美元 972,000    | 987,657    | 0.0              |
| Var 20Mar2030        | 美元 3,158,000  | 3,066,800  | 0.1              | Entergy Corp Var     |               |            |                  |
| Citigroup Inc (Reg)  |               |            |                  | 01Dec2054            | 美元 2,832,000  | 2,941,007  | 0.1              |
| Var 31Mar2031        | 美元 3,210,000  | 3,129,524  | 0.1              | Entergy Texas Inc    |               |            |                  |
| Citigroup Inc Var    |               |            |                  | (Reg) 5.55%          |               |            |                  |
| 01May2032            | 美元 3,418,000  | 3,006,631  | 0.1              | 15Sep2054            | 美元 620,000    | 596,364    | 0.0              |
| Citigroup Inc Var    |               |            |                  | Enterprise Products  |               |            |                  |
| 11Jun2035            | 美元 278,000    | 284,374    | 0.0              | Ope (Reg) Var        |               |            |                  |
| Citigroup Inc Var    |               |            |                  | 15Feb2078            | 美元 1,536,000  | 1,516,843  | 0.0              |
| 24Jan2036            | 美元 11,500,000 | 11,739,808 | 0.2              | Fannie Mae 2.5%      |               |            |                  |
| Columbia Pipelines   |               |            |                  | 01Aug2051            | 美元 25,010,029 | 15,366,337 | 0.3              |
| Opco Ser 144A        |               |            |                  | Fannie Mae 3%        |               |            |                  |
| 5.927%               |               |            |                  | 01Aug2050            | 美元 50,000,000 | 15,247,377 | 0.3              |
| 15Aug2030            | 美元 976,000    | 1,021,963  | 0.0              | Fannie Mae 3.5%      |               |            |                  |
| Columbia Pipelines   |               |            |                  | 01Jun2052            | 美元 25,452,141 | 19,538,563 | 0.3              |
| Opco Ser 144A        |               |            |                  | Fannie Mae 4%        |               |            |                  |
| 6.036%               |               |            |                  | 01Apr2052            | 美元 19,926,559 | 13,792,416 | 0.2              |
| 15Nov2033            | 美元 3,560,000  | 3,757,890  | 0.1              | Fannie Mae 4.5%      |               |            |                  |
| Comcast Corp (Reg)   |               |            |                  | 01Feb2053            | 美元 15,445,220 | 14,451,758 | 0.3              |
| 2.937%               |               |            |                  | Fannie Mae 5%        |               |            |                  |
| 01Nov2056            | 美元 6,180,000  | 3,709,715  | 0.1              | Fannie Mae 5%        | 美元 20,000,000 | 18,647,754 | 0.3              |
| Comcast Corp (Reg)   |               |            |                  | 01Mar2053            | 美元 13,140,000 | 11,546,063 | 0.2              |
| 4.8% 15May2033       | 美元 4,072,000  | 4,083,741  | 0.1              | Fannie Mae 5.5%      |               |            |                  |
| Conocophillips       |               |            |                  | 01Apr2053            | 美元 18,000,000 | 15,100,792 | 0.3              |
| Company (Reg)        |               |            |                  | Fannie Mae 6%        |               |            |                  |
| 5.55% 15Mar2054      | 美元 1,780,000  | 1,728,689  | 0.0              | 01Jul2053            | 美元 5,500,000  | 4,599,351  | 0.1              |
| Conocophillips       |               |            |                  | Ferrovial Se 3.25%   |               |            |                  |
| Company Ser WI       |               |            |                  | 16Jan2030            | 欧元 2,000,000  | 2,174,773  | 0.0              |
| (Reg) 4.025%         |               |            |                  | Firstenergy          |               |            |                  |
| 15Mar2062            | 美元 1,480,000  | 1,083,887  | 0.0              | Transmission Ser     |               |            |                  |
| Coterra Energy Inc   |               |            |                  | 144A (Reg) 2.866%    |               |            |                  |
| 5.9% 15Feb2055       | 美元 1,700,000  | 1,647,752  | 0.0              | 15Sep2028            | 美元 1,068,000  | 1,006,316  | 0.0              |
| Credit Acceptance    |               |            |                  | Ford Credit Auto     |               |            |                  |
| Auto Loan Tr (Ser    |               |            |                  | Owner Trust (Ser A   |               |            |                  |
| 1A Cl A) 5.68%       |               |            |                  | Cl A3) 5.09%         |               |            |                  |
| 15Mar2034            | 美元 2,337,000  | 2,372,242  | 0.0              | 15Dec2028            | 美元 2,944,000  | 2,982,670  | 0.1              |
| Crh SMW Finance      |               |            |                  | Freddie Mac 3%       |               |            |                  |
| Dac Ser EMTN         |               |            |                  | 01Aug2052            | 美元 25,000,000 | 19,558,836 | 0.3              |
| (Reg S) (Br) 4%      |               |            |                  | Freddie Mac 3%       |               |            |                  |
| 11Jul2031            | 欧元 2,500,000  | 2,869,006  | 0.1              | 01Jun2052            | 美元 23,000,000 | 16,676,360 | 0.3              |
| Diamondback          |               |            |                  | Freddie Mac 5.5%     |               |            |                  |
| Energy Inc 5.75%     |               |            |                  | 01Apr2053            | 美元 7,440,000  | 6,331,591  | 0.1              |
| 18Apr2054            | 美元 1,132,000  | 1,096,937  | 0.0              | Freddie Mac 6%       |               |            |                  |
| Digital Dutch Finco  |               |            |                  | 01Aug2053            | 美元 19,000,000 | 15,849,939 | 0.3              |
| Bv (Reg S) 1.5%      |               |            |                  | Freddie Mac 6%       |               |            |                  |
| 15Mar2030            | 欧元 5,000,000  | 4,922,910  | 0.1              | 01Jul2054            | 美元 38,656,070 | 36,356,182 | 0.6              |
| Edison International |               |            |                  | Freddie Mac 6%       |               |            |                  |
| (Reg) 5.45%          |               |            |                  | 01Jun2054            | 美元 20,442,471 | 20,627,491 | 0.4              |
| 15Jun2029            | 美元 6,620,000  | 6,643,039  | 0.1              |                      |               |            |                  |
| Energy Transfer LP   |               |            |                  |                      |               |            |                  |
| (Reg) 5.55%          |               |            |                  |                      |               |            |                  |
| 15Feb2028            | 美元 2,216,000  | 2,284,644  | 0.0              |                      |               |            |                  |

投资组合 (续)  
于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|                     | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |                        | 单位数目          | 公平值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |
|---------------------|---------------|------------|------------------|------------------------|---------------|------------|------------------|
| 美国 (续)              |               |            |                  | ITC Holdings Corp      |               |            |                  |
| Freddie Mac 6%      |               |            |                  | Ser 144A 5.65%         |               |            |                  |
| 01Sep2053           | 美元 5,500,000  | 4,649,886  | 0.1              | 09May2034              | 美元 2,516,000  | 2,620,677  | 0.0              |
| Global Payments Inc |               |            |                  | Jersey Central Pwr &   |               |            |                  |
| (Reg) 4.875%        |               |            |                  | Lt Ser 144A 2.75%      |               |            |                  |
| 17Mar2031           | 欧元 5,000,000  | 5,655,092  | 0.1              | 01Mar2032              | 美元 5,072,000  | 4,395,619  | 0.1              |
| Global Payments Inc |               |            |                  | Key Bank Na 5%         |               |            |                  |
| (Reg) 5.95%         |               |            |                  | 26Jan2033              | 美元 2,800,000  | 2,753,479  | 0.0              |
| 15Aug2052           | 美元 1,000,000  | 975,814    | 0.0              | Keycorp Var            |               |            |                  |
| Goldman Sachs       |               |            |                  | 06Mar2035              | 美元 2,940,000  | 3,120,405  | 0.1              |
| Group Inc (Reg)     |               |            |                  | M&T Bank               |               |            |                  |
| Var 25Apr2030       | 美元 3,686,000  | 3,895,387  | 0.1              | Corporation Ser        |               |            |                  |
| Goldman Sachs       |               |            |                  | MTN Var                |               |            |                  |
| Group Inc Var       |               |            |                  | 16Jan2029              | 美元 6,536,000  | 6,606,012  | 0.1              |
| 21Oct2032           | 美元 3,200,000  | 2,804,023  | 0.0              | M&T Bank               |               |            |                  |
| Goldman Sachs       |               |            |                  | Corporation Ser        |               |            |                  |
| Group Inc Var       |               |            |                  | MTN Var                |               |            |                  |
| 23Jul2030           | 美元 70,000     | 71,258     | 0.0              | 16Jan2036              | 美元 4,440,000  | 4,406,057  | 0.1              |
| Goldman Sachs       |               |            |                  | Marvell Technology     |               |            |                  |
| Group Inc Var       |               |            |                  | Inc (Reg) 2.95%        |               |            |                  |
| 23Jul2035           | 美元 816,000    | 820,539    | 0.0              | 15Apr2031              | 美元 4,088,000  | 3,706,268  | 0.1              |
| Goldman Sachs       |               |            |                  | Marvell Technology     |               |            |                  |
| Group Inc Var       |               |            |                  | Inc (Reg) 5.75%        |               |            |                  |
| 23Oct2030           | 美元 16,304,000 | 16,541,674 | 0.3              | 15Feb2029              | 美元 1,104,000  | 1,146,090  | 0.0              |
| Goldman Sachs       |               |            |                  | Medtronic Global       |               |            |                  |
| Group Inc Var       |               |            |                  | Hldings (Reg)          |               |            |                  |
| 23Oct2035           | 美元 5,066,000  | 5,039,311  | 0.1              | 1.125%                 |               |            |                  |
| Goldman Sachs       |               |            |                  | 07Mar2027              | 欧元 5,000,000  | 5,262,643  | 0.1              |
| Group Inc Var       |               |            |                  | Merchants Fleet        |               |            |                  |
| 28Jan2036           | 美元 3,790,000  | 3,879,416  | 0.1              | Funding Llc (Ser       |               |            |                  |
| Government          |               |            |                  | 1A Cl A) 5.82%         |               |            |                  |
| National Mortgage   |               |            |                  | 20Apr2037              | 美元 3,668,000  | 3,702,680  | 0.1              |
| A 5% 20Nov2052      | 美元 5,080,000  | 4,173,538  | 0.1              | Morgan Stanley Var     |               |            |                  |
| Government          |               |            |                  | 15Jan2031              | 美元 11,500,000 | 11,808,211 | 0.2              |
| National Mortgage   |               |            |                  | Morgan Stanley Var     |               |            |                  |
| A 5.5% 20Apr2053    | 美元 7,470,000  | 6,032,664  | 0.1              | 18Oct2030              | 美元 12,606,000 | 12,773,462 | 0.2              |
| Government          |               |            |                  | Morgan Stanley Var     |               |            |                  |
| National Mortgage   |               |            |                  | 19Apr2035              | 美元 1,890,000  | 2,009,346  | 0.0              |
| A 5.5% 20Jan2053    | 美元 5,500,000  | 4,216,713  | 0.1              | Morgan Stanley Var     |               |            |                  |
| HCA Inc (Reg) 3.5%  |               |            |                  | 21Jul2034              | 美元 3,760,000  | 3,844,727  | 0.1              |
| 01Sep2030           | 美元 25,520,000 | 23,747,755 | 0.4              | Netflix Inc 4.625%     |               |            |                  |
| HCA Inc (Reg)       |               |            |                  | 15May2029              | 欧元 5,000,000  | 5,851,058  | 0.1              |
| 4.625%              |               |            |                  | Nisource Inc (Reg)     |               |            |                  |
| 15Mar2052           | 美元 3,320,000  | 2,651,238  | 0.0              | Var 30Nov2054          | 美元 2,832,000  | 2,944,560  | 0.1              |
| HCA Inc (Reg) 5.25% |               |            |                  | Occidental             |               |            |                  |
| 15Jun2049           | 美元 232,000    | 207,734    | 0.0              | Petroleum Cor          |               |            |                  |
| HCA Inc (Reg) 5.45% |               |            |                  | (Reg) 4.625%           |               |            |                  |
| 15Sep2034           | 美元 552,000    | 548,551    | 0.0              | 15Jun2045              | 美元 1,416,000  | 1,096,798  | 0.0              |
| HCA Inc (Reg) 5.95% |               |            |                  | Occidental             |               |            |                  |
| 15Sep2054           | 美元 1,700,000  | 1,636,955  | 0.0              | Petroleum Cor          |               |            |                  |
| HCA Inc 3.5%        |               |            |                  | 5.375% 01Jan2032       | 美元 1,132,000  | 1,131,355  | 0.0              |
| 15Jul2051           | 美元 2,664,000  | 1,776,641  | 0.0              | Oracle Corp (Reg)      |               |            |                  |
| Hyundai Capital     |               |            |                  | 3.95% 25Mar2051        | 美元 1,920,000  | 1,412,539  | 0.0              |
| America Ser 144A    |               |            |                  | Pacific Gas & Electric |               |            |                  |
| 4.875%              |               |            |                  | (Reg) 4.6%             |               |            |                  |
| 01Nov2027           | 美元 4,556,000  | 4,659,590  | 0.1              | 15Jun2043              | 美元 2,412,000  | 2,023,621  | 0.0              |
| ITC Holdings Corp   |               |            |                  | Pacific Gas & Electric |               |            |                  |
| Ser 144A 2.95%      |               |            |                  | 5.8% 15May2034         | 美元 8,060,000  | 8,317,474  | 0.1              |
| 14May2030           | 美元 3,128,000  | 2,890,661  | 0.1              | Pacific Gas & Electric |               |            |                  |
| ITC Holdings Corp   |               |            |                  | 6.15% 15Jan2033        | 美元 2,520,000  | 2,628,813  | 0.0              |
| Ser 144A 5.4%       |               |            |                  | PG&E Corp (Reg) Var    |               |            |                  |
| 01Jun2033           | 美元 10,932,000 | 11,202,922 | 0.2              | 15Mar2055              | 美元 692,000    | 684,753    | 0.0              |

投资组合 (续)  
于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|                       | 单位数目           | 公允价值<br>美元  | 占资产<br>净值百<br>分比 |                            | 单位数目       | 公允价值<br>美元    | 占资产<br>净值百<br>分比 |
|-----------------------|----------------|-------------|------------------|----------------------------|------------|---------------|------------------|
| <b>美国 (续)</b>         |                |             |                  | US Treasury N/B            | 美元         |               |                  |
| Pioneer Natural       |                |             |                  | 4.625% 15Nov2044           | 76,000,000 | 77,359,940    | 1.3              |
| Resource 2.15%        |                |             |                  | Wells Fargo &              |            |               |                  |
| 15Jan2031             | 美元 1,210,000   | 1,059,826   | 0.0              | Company Var                | 美元         |               |                  |
| PNC Financial         |                |             |                  | 23Jan2035                  | 4,466,000  | 4,574,702     | 0.1              |
| Services Var          |                |             |                  | Wells Fargo &              |            |               |                  |
| 21Oct2032             | 美元 3,980,000   | 4,023,468   | 0.1              | Company Var                | 美元         |               |                  |
| Prudential Financial  |                |             |                  | 24Jan2031                  | 8,600,000  | 8,829,312     | 0.2              |
| Inc (Reg) Var         |                |             |                  | Wells Fargo &              |            |               |                  |
| 15Mar2054             | 美元 596,000     | 610,200     | 0.0              | Company Var                | 美元 256,000 | 263,194       | 0.0              |
| Realty Income Corp    |                |             |                  | 25Jul2034                  |            |               |                  |
| (Reg) 4.875%          |                |             |                  | WP Carey Inc (Reg)         | 欧元         |               |                  |
| 06Jul2030             | 欧元 5,000,000   | 5,918,146   | 0.1              | 4.25% 23Jul2032            | 2,000,000  | 2,260,630     | 0.0              |
| San Diego G & E       |                |             |                  | WPC Eurobond Bv            |            |               |                  |
| (Reg) 5.35%           |                |             |                  | (Reg) 1.35%                | 欧元         |               |                  |
| 01Apr2053             | 美元 2,200,000   | 2,122,946   | 0.0              | 15Apr2028                  | 5,000,000  | 5,202,417     | 0.1              |
| Solventum Corp        |                |             |                  |                            |            |               |                  |
| 5.45% 13Mar2031       | 美元 11,240,000  | 11,486,263  | 0.2              |                            |            | 5,063,796,958 | 87.2             |
| Southern Cal Edison   |                |             |                  |                            |            |               |                  |
| 5.2% 01Jun2034        | 美元 1,024,000   | 1,017,898   | 0.0              | <b>(II) 集体投资计划 (10.2%)</b> |            |               |                  |
| Southern Cal Edison   |                |             |                  | <b>卢森堡 (10.2%)</b>         |            |               |                  |
| 5.45% 01Mar2035       | 美元 1,024,000   | 1,027,222   | 0.0              | JPMF-JPM Global            |            |               |                  |
| Southern Cal Edison   |                |             |                  | Corporate Bond             |            |               |                  |
| 5.9% 01Mar2055        | 美元 1,212,000   | 1,183,933   | 0.0              | 'X' (dist)-USD**           | 5,834,676  | 589,535,617   | 10.2             |
| Southern Co Gas       |                |             |                  | <b>(III) 衍生性产品 (-1.5%)</b> |            |               |                  |
| Capital 5.75%         |                |             |                  | <b>信用违约掉期 (-0.3%)</b>      |            |               |                  |
| 15Sep2033             | 美元 1,612,000   | 1,668,361   | 0.0              | (D) CREDIT DEFAULT         |            |               |                  |
| Southern Co Gas       |                |             |                  | SWAP INDEX~604~            |            |               |                  |
| Capital Ser 20-A      |                |             |                  | 39 107,000,000.00          |            |               |                  |
| (Reg) 1.75%           |                |             |                  | EUR 24/03/2025             |            |               |                  |
| 15Jan2031             | 美元 6,232,000   | 5,280,548   | 0.1              | 20/06/2030                 |            | (8,637,160)   | (0.1)            |
| Take-Two              |                |             |                  | (D) CREDIT DEFAULT         |            |               |                  |
| Interactive Sof       |                |             |                  | SWAP INDEX~604~            |            |               |                  |
| (Reg) 5.6%            |                |             |                  | 45 174,000,000.00          |            |               |                  |
| 12Jun2034             | 美元 832,000     | 864,694     | 0.0              | USD 28/03/2025             |            |               |                  |
| Tesla Auto Lease      |                |             |                  | 20/06/2030                 |            | (8,966,318)   | (0.2)            |
| Trust (Ser A Cl A3)   |                |             |                  | <b>远期外汇合约 (-1.1%)</b>      |            | (64,042,658)  | (1.1)            |
| 5.3% 21Jun2027        | 美元 986,000     | 993,836     | 0.0              | <b>期货 (-0.1%)</b>          |            |               |                  |
| Trans-Allegheny       |                |             |                  | 3 Month Euro Euribor       |            |               |                  |
| Intersta Ser 144A     |                |             |                  | 13/12/2027                 | (2,595)    | (1,213,348)   | (0.0)            |
| 3.85% 01Jun2025       | 美元 1,266,000   | 1,280,020   | 0.0              | 3 Month Euro Euribor       |            |               |                  |
| Truist Financial Corp |                |             |                  | 14/06/2027                 | (2,712)    | (51,013)      | (0.0)            |
| Ser MTN Var           |                |             |                  | 3 Month Euro Euribor       |            |               |                  |
| 24Jan2035             | 美元 790,000     | 815,065     | 0.0              | 15/12/2025                 | 5,307      | 1,634,950     | 0.0              |
| Uber Technologies     |                |             |                  | Aust 10Y Bond Fut          |            |               |                  |
| Inc (Reg) 5.35%       |                |             |                  | 16/06/2025                 | 365        | 60,675        | 0.0              |
| 15Sep2054             | 美元 640,000     | 600,049     | 0.0              | Can 10Yr Bond Fut          |            |               |                  |
| Uber Technologies     |                |             |                  | 19/06/2025                 | 922        | (192,093)     | (0.0)            |
| Inc 4.8%              |                |             |                  | Euro-BOBL Future           |            |               |                  |
| 15Sep2034             | 美元 4,684,000   | 4,564,058   | 0.1              | 06/06/2025                 | 2,429      | 439,166       | 0.0              |
| US Bancorp Var        |                |             |                  |                            |            |               |                  |
| 23Jan2035             | 美元 1,244,000   | 1,285,188   | 0.0              |                            |            |               |                  |
| US Treasury 4%        |                |             |                  |                            |            |               |                  |
| 31Mar2030             | 美元 110,000,000 | 110,222,562 | 1.9              |                            |            |               |                  |
| US Treasury 4.125%    |                |             |                  |                            |            |               |                  |
| 30Nov2029             | 美元 180,000,000 | 183,877,299 | 3.2              |                            |            |               |                  |
| US Treasury N/B       |                |             |                  |                            |            |               |                  |
| 4.125% 31Jan2027      | 美元 120,000,000 | 121,235,282 | 2.1              |                            |            |               |                  |
| US Treasury N/B       |                |             |                  |                            |            |               |                  |
| 4.25 % 30Nov2026      | 美元 170,894,700 | 174,173,487 | 3.0              |                            |            |               |                  |
| US Treasury N/B       |                |             |                  |                            |            |               |                  |
| 4.5% 15Nov2054        | 美元 171,486,000 | 171,646,663 | 3.0              |                            |            |               |                  |
| US Treasury N/B       |                |             |                  |                            |            |               |                  |
| 4.625% 15Feb2055      | 美元 105,615,700 | 106,767,525 | 1.8              |                            |            |               |                  |

投资组合 (续)

于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

(续)

|                      | 单位数目    | 公平值<br>美元   | 占资产<br>净值百<br>分比 |                          | 单位数目          | 公平值<br>美元 | 占资产<br>净值百<br>分比 |
|----------------------|---------|-------------|------------------|--------------------------|---------------|-----------|------------------|
| <b>期货 (续)</b>        |         |             |                  | <b>(D) INTEREST RATE</b> |               |           |                  |
| Euro-Bund Future     |         |             |                  | SWAP~619~ 44             |               |           |                  |
| 06/06/2025           | (2,789) | (4,455,425) | (0.1)            | 2,750,000,000.00 THB     |               |           |                  |
| Euro-BUXL 30Y Bnd    |         |             |                  | 26/03/2025 18/06/2028    | 329,159       | 0.0       |                  |
| 06/06/2025           | (210)   | (136,105)   | (0.0)            |                          |               |           |                  |
| Jpn 10Y Bond (OSE)   |         |             |                  |                          | (85,792,709)  | (1.5)     |                  |
| 13/06/2025           | 82      | 81,249      | 0.0              |                          |               |           |                  |
| Long Gilt Future     |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 26/06/2025           | 828     | (354,466)   | (0.0)            | <b>总上市投资</b>             | 5,567,539,866 | 95.9      |                  |
| Short Euro-BTP       |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| Future 06/06/2025    | 1,367   | (59,066)    | (0.0)            | <b>其他净资产</b>             | 235,892,775   | 4.1       |                  |
| US 10Yr Ultra Fut    |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 18/06/2025           | (1,008) | 388,703     | 0.0              |                          |               |           |                  |
| US 5Yr Note (CBT)    |         |             |                  | <b>于二零二五年三月三十一日可赎回份额</b> |               |           |                  |
| 30/06/2025           | 6,251   | 185,469     | 0.0              | <b>持有人应占净资产</b>          | 5,803,432,641 | 100.0     |                  |
|                      |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| <b>利率掉期 (0.0%)</b>   |         |             |                  | <b>总投资, 按成本</b>          | 5,494,902,534 |           |                  |
| (D) INTEREST RATE    |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| SWAP~619~ 17         |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 230,000,000.00 CNY   |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 27/09/2024           |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 18/12/2029           |         | 75,468      | 0.0              |                          |               |           |                  |
| (D) INTEREST RATE    |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| SWAP~619~ 28         |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 142,000,000.00 USD   |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 27/02/2025           |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 15/11/2052           |         | (397,654)   | (0.0)            |                          |               |           |                  |
| (D) INTEREST RATE    |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| SWAP~619~ 29         |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 738,000,000.00 CNY   |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 27/02/2025           |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 18/06/2030           |         | 118,254     | 0.0              |                          |               |           |                  |
| (D) INTEREST RATE    |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| SWAP~619~ 30         |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 11,656,329,000.00    |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| HUF 27/02/2025       |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 18/06/2030           |         | (557,309)   | (0.0)            |                          |               |           |                  |
| (D) INTEREST RATE    |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| SWAP~619~ 31         |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 14,843,671,000.00    |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| HUF 28/02/2025       |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 18/06/2030           |         | (685,363)   | (0.0)            |                          |               |           |                  |
| (D) INTEREST RATE    |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| SWAP~619~ 36         |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 375,000,000.00 CNY   |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 19/03/2025           |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 18/06/2030           |         | 157,200     | 0.0              |                          |               |           |                  |
| (D) INTEREST RATE    |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| SWAP~619~ 37         |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 127,000,000,000.00   |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| KRW 19/03/2025       |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 18/06/2030           |         | 51,848      | 0.0              |                          |               |           |                  |
| (D) INTEREST RATE    |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| SWAP~619~ 38         |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 46,500,000,000.00    |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| KRW 19/03/2025       |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 18/06/2035           |         | 67,005      | 0.0              |                          |               |           |                  |
| (D) INTEREST RATE    |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| SWAP~619~ 43         |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 1,080,000,000.00 THB |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 26/03/2025           |         |             |                  |                          |               |           |                  |
| 18/06/2035           |         | 366,123     | 0.0              |                          |               |           |                  |

\* 由管理人的关联人士发行和管理

# 在香港未获认可及并非供香港公众投资

投资组合持有变动表

(续)

截至二零二五年三月三十一日止期间(未经审计)

|                      | 持有占资产净值百分比 |           | 持有占资产净值百分比 |           |
|----------------------|------------|-----------|------------|-----------|
|                      | 31.3.2025  | 30.9.2024 | 31.3.2025  | 30.9.2024 |
| <b>上市投资</b>          |            |           |            |           |
| <b>债务证券</b>          |            |           |            |           |
| 美国                   | 28.3       | 27.2      |            |           |
| 意大利                  | 8.3        | 4.3       |            |           |
| 中国                   | 6.8        | 3.1       |            |           |
| 法国                   | 5.4        | 2.9       |            |           |
| 日本                   | 5.2        | 6.2       |            |           |
| 英国                   | 5.1        | 4.8       |            |           |
| 加拿大                  | 4.6        | 4.8       |            |           |
| 德国                   | 3.0        | 4.8       |            |           |
| 西班牙                  | 2.9        | 3.3       |            |           |
| 澳大利亚                 | 2.1        | 3.7       |            |           |
| 墨西哥                  | 2.1        | 2.3       |            |           |
| 爱尔兰                  | 2.0        | 0.3       |            |           |
| 印度                   | 1.3        | 1.9       |            |           |
| 捷克共和国                | 1.3        | -         |            |           |
| 以色列                  | 1.0        | 0.7       |            |           |
| 国际                   | 0.6        | 0.7       |            |           |
| 匈牙利                  | 0.6        | 0.7       |            |           |
| 哥伦比亚                 | 0.6        | 0.3       |            |           |
| 瑞士                   | 0.5        | 0.7       |            |           |
| 印度尼西亚                | 0.5        | 0.2       |            |           |
| 阿联酋                  | 0.4        | 0.2       |            |           |
| 澳门                   | 0.4        | 0.1       |            |           |
| 丹麦                   | 0.4        | -         |            |           |
| 菲律宾                  | 0.4        | -         |            |           |
| 百慕大                  | 0.3        | 0.2       |            |           |
| 巴林                   | 0.3        | -         |            |           |
| 土耳其                  | 0.3        | -         |            |           |
| 罗马尼亚                 | 0.3        | -         |            |           |
| 韩国                   | 0.2        | 1.0       |            |           |
| 巴西                   | 0.2        | 0.4       |            |           |
| 多米尼加                 | 0.2        | 0.3       |            |           |
| 香港                   | 0.2        | 0.2       |            |           |
| 南非                   | 0.2        | -         |            |           |
| 哥斯达黎加                | 0.1        | 0.3       |            |           |
| 科威特                  | 0.1        | 0.2       |            |           |
| 荷兰                   | 0.1        | 0.2       |            |           |
| 斯洛伐克                 | 0.1        | 0.2       |            |           |
| 比利时                  | 0.1        | 0.1       |            |           |
| 卢森堡                  | 0.1        | 0.1       |            |           |
| 葡萄牙                  | 0.1        | 0.1       |            |           |
| 智利                   | 0.1        | -         |            |           |
| 埃及                   | 0.1        | -         |            |           |
| 哈萨克斯坦                | 0.1        | -         |            |           |
| 尼日利亚                 | 0.1        | -         |            |           |
| 挪威                   | 0.1        | -         |            |           |
| 摩洛哥                  | 0.0        | 0.1       |            |           |
| 巴拿马                  | 0.0        | 0.1       |            |           |
| 危地马拉                 | 0.0        | -         |            |           |
| 新西兰                  | -          | 0.4       |            |           |
| 沙特阿拉伯                | -          | 0.3       |            |           |
| 泰国                   | -          | 0.3       |            |           |
| 新加坡                  | -          | 0.2       |            |           |
| <b>集体投资计划</b>        |            |           |            |           |
| 卢森堡                  |            |           | 10.2       | 19.0      |
| <b>衍生性产品</b>         |            |           |            |           |
| 利率掉期                 |            |           | (0.0)      | 0.0       |
| 期货                   |            |           | (0.1)      | (0.0)     |
| 信用违约掉期               |            |           | (0.3)      | -         |
| 远期外汇合约               |            |           | (1.1)      | 0.1       |
| <b>总上市投资</b>         |            |           | 95.9       | 97.0      |
| <b>其他净资产</b>         |            |           | 4.1        | 3.0       |
| <b>可赎回份额持有人应占净资产</b> |            |           | 100.0      | 100.0     |

金融衍生工具详情  
于二零二五年三月三十一日 (未经审计)

于二零二五年三月三十一日，本基金持有之金融衍生工具概述如下：

(a) 信用违约掉期

以下为于二零二五年三月三十一日未平仓之信用违约掉期合约：

|                                                                                      | 标的资产                                           | 交易对手                         | 公平值<br>美元    |
|--------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|------------------------------|--------------|
| 于 2025 年 3 月 31 日                                                                    |                                                |                              |              |
| (D) CREDIT DEFAULT SWAP INDEX~604~<br>39 107,000,000.00 EUR 24/03/2025<br>20/06/2030 | iTraxx Europe Crossover<br>Series 43 Version 1 | Citigroup Global Markets Ltd | (8,637,160)  |
| (D) CREDIT DEFAULT SWAP INDEX~604~<br>45 174,000,000.00 USD 28/03/2025<br>20/06/2030 | CDX.NA.HY.44                                   | Citigroup Global Markets Ltd | (8,966,318)  |
|                                                                                      |                                                | 总金融负债                        | (17,603,478) |

(b) 远期外汇合约

以下为于二零二五年三月三十一日未平仓之远期外汇合约：

| 交付合约                | 折算额             | 交割日期           | 交易对手             | 未实现收益／（亏损）<br>美元 |
|---------------------|-----------------|----------------|------------------|------------------|
| 于 2025 年 3 月 31 日   |                 |                |                  |                  |
| 未平仓合约：              |                 |                |                  |                  |
| 澳元 120,340          | 美元 75,908       | 2025 年 4 月 1 日 | 巴克莱银行，伦敦         | 918              |
| 加元 20,253           | 美元 14,158       | 2025 年 4 月 1 日 | 巴克莱银行，伦敦         | 86               |
| 离岸人民币 2,144,864     | 美元 295,323      | 2025 年 4 月 1 日 | 巴克莱银行，伦敦         | 127              |
| 美元 81,006           | 离岸人民币 588,656   | 2025 年 4 月 1 日 | Citibank N.A.，伦敦 | 10               |
| 美元 78,054           | 离岸人民币 567,199   | 2025 年 4 月 1 日 | Citibank N.A.，伦敦 | 9                |
| 美元 1,500            | 离岸人民币 10,915    | 2025 年 4 月 1 日 | 法国巴黎银行           | 2                |
| 纽元 982,663          | 美元 564,256      | 2025 年 4 月 2 日 | 巴克莱银行，伦敦         | 7,725            |
| 美元 533,993          | 离岸人民币 3,881,961 | 2025 年 4 月 2 日 | Citibank N.A.，伦敦 | 279              |
| 美元 171,963          | 离岸人民币 1,250,115 | 2025 年 4 月 2 日 | Citibank N.A.，伦敦 | 90               |
| 美元 5,065            | 离岸人民币 36,822    | 2025 年 4 月 2 日 | 法国巴黎银行           | 3                |
| 加元 1,923            | 美元 1,346        | 2025 年 4 月 3 日 | 法国巴黎银行           | 10               |
| 离岸人民币 9,491         | 美元 1,306        | 2025 年 4 月 3 日 | 法国巴黎银行           | 0                |
| 纽元 111,264          | 美元 63,942       | 2025 年 4 月 3 日 | Citibank N.A.，伦敦 | 926              |
| 美元 376,934          | 离岸人民币 2,738,577 | 2025 年 4 月 3 日 | Citibank N.A.，伦敦 | 2                |
| 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 69,464           | 离岸人民币 504,686   | 2025 年 4 月 3 日 | Citibank N.A.，伦敦 | 0                |
| 澳元 3,194            | 美元 2,012        | 2025 年 4 月 7 日 | 法国巴黎银行           | 21               |
| 澳元 514,944          | 美元 320,900      | 2025 年 4 月 7 日 | Citibank N.A.，伦敦 | 0                |
| 加元 1,936,804        | 美元 1,346,094    | 2025 年 4 月 7 日 | 法国巴黎银行           | 65               |
| 美元 1,101            | 离岸人民币 7,997     | 2025 年 4 月 7 日 | 法国巴黎银行           | 0                |
| 澳元 20,515,908       | 美元 12,885,705   | 2025 年 4 月 8 日 | Citibank N.A.，伦敦 | 100,602          |
| 离岸人民币 1,146,475,043 | 美元 158,803,951  | 2025 年 4 月 8 日 | 法国巴黎银行           | 946,617          |
| 离岸人民币 812,000,000   | 美元 112,280,935  | 2025 年 4 月 8 日 | 法国巴黎银行           | 477,231          |
| 离岸人民币 286,621,647   | 美元 39,657,089   | 2025 年 4 月 8 日 | HSBC Bank Plc，伦敦 | 192,357          |
| 离岸人民币 44,050,359    | 美元 6,097,806    | 2025 年 4 月 8 日 | HSBC Bank Plc，伦敦 | 32,543           |
| 离岸人民币 22,810,015    | 美元 3,159,820    | 2025 年 4 月 8 日 | 法国巴黎银行           | 19,125           |
| 离岸人民币 18,368,424    | 美元 2,536,046    | 2025 年 4 月 8 日 | HSBC Bank Plc，伦敦 | 6,910            |
| 捷克克朗 315,983,425    | 美元 13,701,250   | 2025 年 4 月 8 日 | 法国巴黎银行           | 40,876           |
| 欧元 7,000,000        | 美元 7,623,224    | 2025 年 4 月 8 日 | HSBC Bank Plc，伦敦 | 59,451           |
| 匈牙利福林 470,180,919   | 美元 1,276,373    | 2025 年 4 月 8 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司    | 16,634           |
| 匈牙利福林 163,766,985   | 美元 444,604      | 2025 年 4 月 8 日 | Citibank N.A.，伦敦 | 5,829            |
| 日元 4,976,733,715    | 美元 33,531,743   | 2025 年 4 月 8 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司    | 229,479          |
| 日元 2,842,452,591    | 美元 19,096,603   | 2025 年 4 月 8 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司    | 76,074           |
| 美元 17,859,263       | 欧元 16,676,038   | 2025 年 4 月 8 日 | 巴克莱银行，伦敦         | 159,846          |
| 美元 1,656,719        | 欧元 1,580,053    | 2025 年 4 月 8 日 | 法国巴黎银行           | 50,590           |

| 交付合约             | 折算额          | 交割日期            | 交易对手              | 未实现收益／(亏损)<br>美元 |
|------------------|--------------|-----------------|-------------------|------------------|
| 澳元 2,258,187     | 美元 1,426,863 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 19,445           |
| 澳元 649,311       | 美元 411,656   | 2025 年 4 月 22 日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 6,972            |
| 澳元 702,506       | 美元 443,678   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 5,841            |
| 澳元 1,583,012     | 美元 991,886   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 5,271            |
| 澳元 338,401       | 美元 213,669   | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | 2,760            |
| 澳元 283,423       | 美元 178,540   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 1,896            |
| 澳元 146,804       | 美元 92,332    | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | 836              |
| 澳元 63,022        | 美元 39,906    | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 628              |
| 澳元 80,300        | 美元 50,659    | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 612              |
| 澳元 49,237        | 美元 31,062    | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 374              |
| 澳元 59,693        | 美元 37,489    | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 285              |
| 澳元 21,555        | 美元 13,555    | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 121              |
| 澳元 6,456         | 美元 4,102     | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 78               |
| 澳元 22,471        | 美元 14,030    | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 25               |
| 澳元 1,741         | 美元 1,110     | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 25               |
| 澳元 1,741         | 美元 1,110     | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 25               |
| 澳元 1,731         | 美元 1,096     | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 17               |
| 澳元 1,750         | 美元 1,106     | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 15               |
| 澳元 1,772         | 美元 1,118     | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 14               |
| 澳元 1,744         | 美元 1,100     | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 13               |
| 澳元 1,738         | 美元 1,095     | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 12               |
| 澳元 2,307         | 美元 1,449     | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 11               |
| 澳元 1,744         | 美元 1,097     | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 9                |
| 澳元 1,746         | 美元 1,094     | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 6                |
| 加元 758,614       | 美元 530,388   | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 2,782            |
| 加元 565,966       | 美元 396,371   | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | 2,748            |
| 加元 307,424       | 美元 214,883   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 1,073            |
| 加元 260,635       | 美元 182,156   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 887              |
| 加元 250,419       | 美元 175,047   | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | 883              |
| 加元 285,439       | 美元 199,374   | 2025 年 4 月 22 日 | 高盛国际, 伦敦          | 855              |
| 加元 329,997       | 美元 229,698   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 189              |
| 加元 87,447        | 美元 61,004    | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 186              |
| 加元 53,132        | 美元 37,133    | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 181              |
| 加元 478,634       | 美元 332,996   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 112              |
| 加元 9,901         | 美元 6,921     | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 35               |
| 加元 1,584         | 美元 1,112     | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 11               |
| 加元 2,059         | 美元 1,442     | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 10               |
| 加元 1,572         | 美元 1,100     | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 7                |
| 加元 1,576         | 美元 1,099     | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 3                |
| 加元 6,569         | 美元 4,571     | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 2                |
| 加元 2,557         | 美元 1,779     | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 1                |
| 离岸人民币 27,625,148 | 美元 3,827,965 | 2025 年 4 月 22 日 | 美林国际, 伦敦          | 20,089           |
| 离岸人民币 28,639,355 | 美元 3,966,566 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 18,891           |
| 离岸人民币 13,840,463 | 美元 1,918,032 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 10,250           |
| 离岸人民币 13,247,452 | 美元 1,835,662 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 9,620            |
| 离岸人民币 8,737,064  | 美元 1,209,095 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 4,770            |
| 离岸人民币 6,131,829  | 美元 848,487   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 3,270            |
| 离岸人民币 10,588,983 | 美元 1,462,625 | 2025 年 4 月 22 日 | 美林国际, 伦敦          | 3,030            |
| 离岸人民币 3,717,081  | 美元 515,065   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 2,699            |
| 离岸人民币 21,417,580 | 美元 2,954,759 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 2,539            |
| 离岸人民币 3,655,735  | 美元 506,374   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 2,464            |
| 离岸人民币 3,238,229  | 美元 448,712   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 2,352            |
| 离岸人民币 2,746,417  | 美元 380,868   | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 2,299            |
| 离岸人民币 3,082,690  | 美元 427,204   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 2,283            |
| 离岸人民币 7,417,661  | 美元 1,024,560 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 2,102            |
| 离岸人民币 2,825,128  | 美元 391,291   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 1,873            |
| 离岸人民币 6,628,495  | 美元 915,544   | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 1,866            |
| 离岸人民币 2,605,864  | 美元 360,922   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 1,728            |
| 离岸人民币 2,315,759  | 美元 320,726   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 1,519            |
| 离岸人民币 2,455,374  | 美元 339,927   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 1,476            |
| 离岸人民币 2,479,997  | 美元 343,185   | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 1,340            |
| 离岸人民币 1,941,593  | 美元 268,691   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 1,060            |
| 离岸人民币 1,694,317  | 美元 234,587   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 1,040            |
| 离岸人民币 1,889,280  | 美元 261,428   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 1,007            |
| 离岸人民币 2,991,489  | 美元 413,197   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 848              |
| 离岸人民币 1,280,984  | 美元 177,359   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 787              |
| 离岸人民币 1,432,569  | 美元 198,238   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 771              |

| 交付合约            | 折算额        | 交割日期            | 交易对手              | 未实现收益／(亏损)<br>美元 |
|-----------------|------------|-----------------|-------------------|------------------|
| 离岸人民币 1,011,751 | 美元 140,195 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 735              |
| 离岸人民币 950,683   | 美元 131,747 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 704              |
| 离岸人民币 2,345,166 | 美元 323,931 | 2025 年 4 月 22 日 | 美林国际, 伦敦          | 671              |
| 离岸人民币 790,826   | 美元 109,649 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 641              |
| 离岸人民币 2,971,318 | 美元 410,202 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 633              |
| 离岸人民币 702,550   | 美元 97,410  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 569              |
| 离岸人民币 6,621,995 | 美元 913,347 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 565              |
| 离岸人民币 896,458   | 美元 124,108 | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 540              |
| 离岸人民币 575,002   | 美元 79,784  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 525              |
| 离岸人民币 594,795   | 美元 82,419  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 432              |
| 离岸人民币 645,917   | 美元 89,463  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 429              |
| 离岸人民币 502,276   | 美元 69,655  | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 420              |
| 离岸人民币 578,987   | 美元 80,188  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 380              |
| 离岸人民币 415,926   | 美元 57,712  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 380              |
| 离岸人民币 406,141   | 美元 56,354  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 371              |
| 离岸人民币 540,848   | 美元 74,908  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 357              |
| 离岸人民币 527,211   | 美元 73,021  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 350              |
| 离岸人民币 600,300   | 美元 83,074  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 328              |
| 离岸人民币 1,388,596 | 美元 191,701 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 296              |
| 离岸人民币 805,467   | 美元 111,255 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 228              |
| 离岸人民币 293,037   | 美元 40,605  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 213              |
| 离岸人民币 732,626   | 美元 101,195 | 2025 年 4 月 22 日 | 美林国际, 伦敦          | 210              |
| 离岸人民币 310,388   | 美元 42,990  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 206              |
| 离岸人民币 288,202   | 美元 39,916  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 190              |
| 离岸人民币 213,756   | 美元 29,638  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 173              |
| 离岸人民币 1,921,177 | 美元 264,977 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 160              |
| 离岸人民币 1,165,004 | 美元 160,723 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 138              |
| 离岸人民币 182,740   | 美元 25,322  | 2025 年 4 月 22 日 | 美林国际, 伦敦          | 133              |
| 离岸人民币 180,901   | 美元 25,055  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 120              |
| 离岸人民币 187,730   | 美元 25,992  | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 115              |
| 离岸人民币 1,793,701 | 美元 247,354 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 108              |
| 离岸人民币 147,001   | 美元 20,360  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 98               |
| 离岸人民币 287,868   | 美元 39,761  | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 81               |
| 离岸人民币 284,463   | 美元 39,291  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 81               |
| 离岸人民币 824,785   | 美元 113,758 | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 69               |
| 离岸人民币 100,373   | 美元 13,902  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 67               |
| 离岸人民币 84,371    | 美元 11,692  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 62               |
| 离岸人民币 185,121   | 美元 25,557  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 39               |
| 离岸人民币 133,365   | 美元 18,421  | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 38               |
| 离岸人民币 134,389   | 美元 18,561  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 37               |
| 离岸人民币 64,585    | 美元 8,937   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 35               |
| 离岸人民币 567,086   | 美元 78,202  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 34               |
| 离岸人民币 62,167    | 美元 8,603   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 33               |
| 离岸人民币 200,146   | 美元 27,612  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 24               |
| 离岸人民币 44,885    | 美元 6,211   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 24               |
| 离岸人民币 66,534    | 美元 9,190   | 2025 年 4 月 22 日 | 美林国际, 伦敦          | 19               |
| 离岸人民币 19,443    | 美元 2,693   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 13               |
| 离岸人民币 13,879    | 美元 1,926   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 13               |
| 离岸人民币 36,894    | 美元 5,096   | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 10               |
| 离岸人民币 14,481    | 美元 2,006   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 10               |
| 离岸人民币 15,775    | 美元 2,184   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 9                |
| 离岸人民币 7,986     | 美元 1,108   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 7                |
| 离岸人民币 7,986     | 美元 1,108   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 7                |
| 离岸人民币 7,986     | 美元 1,108   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 7                |
| 离岸人民币 7,965     | 美元 1,105   | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 7                |
| 离岸人民币 8,777     | 美元 1,216   | 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 75,765    | 美元 10,448  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 5                |
| 离岸人民币 7,971     | 美元 1,104   | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 5                |
| 离岸人民币 7,971     | 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 7,953     | 美元 1,102   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 5                |
| 离岸人民币 25,281    | 美元 3,486   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 2                |
| 离岸人民币 7,980     | 美元 1,102   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 2                |

| 交付合约                   | 折算额              | 交割日期            | 交易对手              | 未实现收益／(亏损)<br>美元 |
|------------------------|------------------|-----------------|-------------------|------------------|
| 离岸人民币 7,980            | 美元 1,102         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 2                |
| 离岸人民币 7,980            | 美元 1,102         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 2                |
| 离岸人民币 7,961            | 美元 1,100         | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 2                |
| 离岸人民币 7,961            | 美元 1,100         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 2                |
| 离岸人民币 7,961            | 美元 1,100         | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 2                |
| 离岸人民币 8,501            | 美元 1,172         | 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                |
| 纽元 981,440             | 美元 562,488       | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 6,388            |
| 纽元 338,243             | 美元 194,394       | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 2,740            |
| 纽元 170,464             | 美元 97,578        | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | 990              |
| 纽元 154,222             | 美元 88,277        | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | 892              |
| 纽元 91,032              | 美元 52,005        | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | 425              |
| 纽元 32,104              | 美元 18,575        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 385              |
| 纽元 46,704              | 美元 26,774        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 311              |
| 纽元 68,488              | 美元 39,082        | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 275              |
| 纽元 18,384              | 美元 10,521        | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 104              |
| 纽元 13,403              | 美元 7,674         | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 80               |
| 纽元 6,693               | 美元 3,845         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 53               |
| 纽元 5,983               | 美元 3,419         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 28               |
| 纽元 1,929               | 美元 1,110         | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 17               |
| 纽元 1,927               | 美元 1,107         | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 15               |
| 纽元 1,913               | 美元 1,097         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 13               |
| 纽元 1,924               | 美元 1,102         | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 12               |
| 纽元 1,914               | 美元 1,097         | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 12               |
| 纽元 1,927               | 美元 1,103         | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 11               |
| 纽元 1,923               | 美元 1,098         | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 9                |
| 纽元 1,922               | 美元 1,098         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 9                |
| 纽元 1,957               | 美元 1,117         | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 8                |
| 美元 509,590             | 离岸人民币 3,705,710  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 1,209            |
| 美元 84,323              | 纽元 149,706       | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 503              |
| 美元 95,609              | 离岸人民币 695,531    | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 264              |
| 美元 24,550              | 纽元 43,648        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 181              |
| 美元 138,616             | 离岸人民币 1,006,226  | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 83               |
| 美元 19,799              | 澳元 31,887        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 75               |
| 美元 16,590              | 加元 23,950        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | 67               |
| 美元 6,529               | 加元 9,404         | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | 11               |
| 美元 13,782              | 离岸人民币 100,000    | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 3                |
| 澳元 68,925,338          | 美元 43,140,128    | 2025 年 5 月 8 日  | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 176,759          |
| 加元 215,183,013         | 美元 150,193,870   | 2025 年 5 月 8 日  | 摩根士丹利国际股份有限公司     | 416,839          |
| 离岸人民币<br>4,229,214,354 | 美元 583,987,291   | 2025 年 5 月 8 日  | 高盛国际, 伦敦          | 342,275          |
| 欧元 1,304,739,266       | 美元 1,415,417,688 | 2025 年 5 月 8 日  | 渣打银行, 伦敦          | 3,244,887        |
| 英镑 157,931,519         | 美元 204,391,687   | 2025 年 5 月 8 日  | 渣打银行, 伦敦          | 555,319          |
| 匈牙利福林<br>7,546,963,104 | 美元 20,295,648    | 2025 年 5 月 8 日  | 巴克莱银行, 伦敦         | 109,315          |
| 日元 42,358,472,209      | 美元 285,137,840   | 2025 年 5 月 8 日  | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 726,143          |
| 墨西哥比索<br>1,174,339,606 | 美元 57,272,273    | 2025 年 5 月 8 日  | 高盛国际, 伦敦          | 151,615          |
| 捷克克朗 1,342,896,011     | 美元 58,318,474    | 2025 年 5 月 9 日  | 法国巴黎银行            | 226,473          |
| 捷克克朗 355,294,411       | 美元 15,439,092    | 2025 年 5 月 9 日  | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 69,500           |
| 美元 67,901              | 离岸人民币 491,771    | 2025 年 5 月 21 日 | 法国巴黎银行            | 22               |
| 美元 321,004             | 澳元 514,944       | 2025 年 5 月 21 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 11               |
| 美元 1,348,997           | 加元 1,936,804     | 2025 年 5 月 21 日 | 法国巴黎银行            | 5                |
| 美元 1,311               | 离岸人民币 9,491      | 2025 年 5 月 21 日 | 法国巴黎银行            | 0                |
| 未实现总收益                 |                  |                 |                   | 8,628,218        |
| 美元 1,100               | 澳元 1,744         | 2025 年 4 月 1 日  | 法国巴黎银行            | (13)             |
| 美元 31,057              | 澳元 49,237        | 2025 年 4 月 1 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (375)            |
| 美元 529,848             | 加元 758,614       | 2025 年 4 月 1 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (2,758)          |
| 美元 562,229             | 纽元 981,440       | 2025 年 4 月 2 日  | 法国巴黎银行            | (6,391)          |
| 离岸人民币 100,000          | 美元 13,763        | 2025 年 4 月 3 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (1)              |
| 美元 1,097               | 纽元 1,914         | 2025 年 4 月 3 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (12)             |
| 离岸人民币 1,006,226        | 美元 138,466       | 2025 年 4 月 7 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (70)             |
| 澳元 48,409,430          | 美元 30,089,307    | 2025 年 4 月 8 日  | 摩根士丹利国际股份有限公司     | (78,481)         |
| 加元 215,183,013         | 美元 149,493,971   | 2025 年 4 月 8 日  | 渣打银行, 伦敦          | (59,877)         |
| 离岸人民币 491,771          | 美元 67,711        | 2025 年 4 月 8 日  | 法国巴黎银行            | (0)              |
| 离岸人民币 59,875,185       | 美元 8,224,579     | 2025 年 4 月 8 日  | 法国巴黎银行            | (19,592)         |

| 交付合约                | 折算额                 | 交割日期            | 交易对手              | 未实现收益／（亏损）<br>美元 |
|---------------------|---------------------|-----------------|-------------------|------------------|
| 离岸人民币 1,916,989,707 | 美元 263,598,237      | 2025 年 4 月 8 日  | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (350,715)        |
| 捷克克朗 1,713,215,286  | 美元 71,230,972       | 2025 年 4 月 8 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (2,833,547)      |
| 欧元 10,285,006       | 离岸人民币 77,976,027    | 2025 年 4 月 8 日  | Citibank N.A., 伦敦 | (376,762)        |
| 欧元 1,321,590,108    | 美元 1,377,452,797    | 2025 年 4 月 8 日  | 美国道富银行            | (50,576,857)     |
| 英镑 157,931,519      | 美元 198,945,339      | 2025 年 4 月 8 日  | 巴克莱银行, 伦敦         | (4,901,768)      |
| 匈牙利福林 6,913,015,200 | 美元 17,937,587       | 2025 年 4 月 8 日  | 巴克莱银行, 伦敦         | (584,201)        |
| 日元 42,197,690,692   | 美元 281,476,034      | 2025 年 4 月 8 日  | 渣打银行, 伦敦          | (893,637)        |
| 墨西哥比索 1,174,339,606 | 美元 57,321,047       | 2025 年 4 月 8 日  | 巴克莱银行, 伦敦         | (34,337)         |
| 美元 7,739,897        | 捷克克朗 178,035,355    | 2025 年 4 月 8 日  | 摩根士丹利国际股份有限公司     | (43,198)         |
| 美元 5,347,492        | 欧元 4,900,000        | 2025 年 4 月 8 日  | 法国巴黎银行            | (52,851)         |
| 美元 11,933,525       | 欧元 10,979,757       | 2025 年 4 月 8 日  | 高盛国际, 伦敦          | (69,469)         |
| 美元 22,069,314       | 捷克克朗 508,267,344    | 2025 年 4 月 8 日  | 法国巴黎银行            | (96,258)         |
| 美元 51,349,250       | 日元 7,658,404,789    | 2025 年 4 月 8 日  | 巴克莱银行, 伦敦         | (102,340)        |
| 美元 20,327,348       | 匈牙利福林 7,546,963,104 | 2025 年 4 月 8 日  | 巴克莱银行, 伦敦         | (107,046)        |
| 美元 57,507,731       | 墨西哥比索 1,174,339,606 | 2025 年 4 月 8 日  | 高盛国际, 伦敦          | (152,347)        |
| 美元 43,129,941       | 澳元 68,925,338       | 2025 年 4 月 8 日  | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (177,049)        |
| 美元 58,282,356       | 捷克克朗 1,342,896,011  | 2025 年 4 月 8 日  | 法国巴黎银行            | (227,220)        |
| 美元 149,970,688      | 加元 215,183,013      | 2025 年 4 月 8 日  | 摩根士丹利国际股份有限公司     | (416,840)        |
| 美元 582,820,357      | 离岸人民币 4,229,214,354 | 2025 年 4 月 8 日  | 高盛国际, 伦敦          | (502,835)        |
| 美元 204,404,290      | 英镑 157,931,519      | 2025 年 4 月 8 日  | 渣打银行, 伦敦          | (557,182)        |
| 美元 284,171,342      | 日元 42,358,472,209   | 2025 年 4 月 8 日  | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (725,787)        |
| 美元 1,413,058,850    | 欧元 1,304,739,266    | 2025 年 4 月 8 日  | 渣打银行, 伦敦          | (3,237,189)      |
| 澳元 230,372          | 美元 143,033          | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (547)            |
| 澳元 484,672          | 美元 300,922          | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (1,151)          |
| 加元 1,580            | 美元 1,097            | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (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 1,587            | 美元 1,100            | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (4)              |
| 加元 1,587            | 美元 1,100            | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (4)              |
| 加元 167,190          | 美元 116,205          | 2025 年 4 月 22 日 | 高盛国际, 伦敦          | (73)             |
| 加元 47,536           | 美元 32,856           | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (205)            |
| 加元 181,103          | 美元 125,717          | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (238)            |
| 加元 591,043          | 美元 410,346          | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (717)            |
| 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 7,994         | 美元 1,101            | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (1)              |
| 离岸人民币 10,915        | 美元 1,502            | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (2)              |
| 离岸人民币 8,240         | 美元 1,134            | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (2)              |
| 离岸人民币 36,822        | 美元 5,072            | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (3)              |
| 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 8,022         | 美元 1,103            | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (3)              |
| 离岸人民币 18,717        | 美元 2,573            | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (7)              |
| 离岸人民币 56,182        | 美元 7,735            | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (9)              |
| 离岸人民币 36,596        | 美元 5,032            | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (12)             |
| 离岸人民币 38,942        | 美元 5,353            | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (15)             |
| 离岸人民币 588,656       | 美元 81,119           | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (21)             |
| 离岸人民币 567,199       | 美元 78,163           | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (21)             |
| 离岸人民币 1,250,115     | 美元 172,192          | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (125)            |
| 离岸人民币 848,145       | 美元 116,779          | 2025 年 4 月 22 日 | 美林国际, 伦敦          | (130)            |
| 离岸人民币 645,967       | 美元 88,894           | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (147)            |
| 离岸人民币 536,458       | 美元 73,737           | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (208)            |
| 离岸人民币 808,906       | 美元 111,226          | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (275)            |
| 离岸人民币 2,099,450     | 美元 289,055          | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (336)            |
| 离岸人民币 3,881,961     | 美元 534,705          | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (388)            |
| 离岸人民币 1,717,717     | 美元 236,381          | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (390)            |
| 离岸人民币 1,183,387     | 美元 162,717          | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (402)            |
| 离岸人民币 1,652,247     | 美元 227,104          | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (644)            |
| 离岸人民币 3,629,726     | 美元 498,911          | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (1,414)          |
| 离岸人民币 9,297,966     | 美元 1,280,154        | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (1,486)          |
| 离岸人民币 10,119,209    | 美元 1,391,406        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (3,435)          |
| 纽元 1,955            | 美元 1,099            | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (8)              |
| 纽元 236,573          | 美元 133,053          | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (993)            |
| 美元 2,211            | 离岸人民币 16,034        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (1)              |
| 美元 1,277            | 离岸人民币 9,222         | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (6)              |
| 美元 1,348            | 加元 1,923            | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (10)             |
| 美元 12,829           | 离岸人民币 92,984        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (12)             |

| 交付合约          | 折算额               | 交割日期            | 交易对手              | 未实现收益／(亏损)<br>美元 |
|---------------|-------------------|-----------------|-------------------|------------------|
| 美元 2,738      | 离岸人民币 19,758      | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (15)             |
| 美元 88,111     | 加元 126,665        | 2025 年 4 月 22 日 | 高盛国际, 伦敦          | (17)             |
| 美元 3,843      | 离岸人民币 27,759      | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (17)             |
| 美元 2,468      | 澳元 3,929          | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (19)             |
| 美元 2,012      | 澳元 3,194          | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (21)             |
| 美元 7,415      | 离岸人民币 53,583      | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (29)             |
| 美元 9,835      | 离岸人民币 71,125      | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | (31)             |
| 美元 6,290      | 离岸人民币 45,370      | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | (36)             |
| 美元 1,599      | 澳元 2,509          | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (36)             |
| 美元 12,557     | 加元 18,000         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (39)             |
| 美元 55,089     | 离岸人民币 399,273     | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (53)             |
| 美元 15,242     | 离岸人民币 110,090     | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (67)             |
| 美元 187,976    | 加元 270,179        | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (70)             |
| 美元 85,166     | 加元 122,353        | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (70)             |
| 美元 5,945      | 澳元 9,423          | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (72)             |
| 美元 7,502      | 纽元 13,110         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (74)             |
| 美元 10,508     | 加元 15,000         | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (75)             |
| 美元 14,172     | 加元 20,253         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (86)             |
| 美元 13,086     | 澳元 20,837         | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (100)            |
| 美元 306,736    | 加元 440,877        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (112)            |
| 美元 16,210     | 纽元 28,379         | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (130)            |
| 美元 12,643     | 纽元 22,080         | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (132)            |
| 美元 13,136     | 纽元 22,932         | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (142)            |
| 美元 295,798    | 离岸人民币 2,144,864   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (148)            |
| 美元 235,562    | 离岸人民币 1,707,805   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (157)            |
| 美元 38,769     | 离岸人民币 280,000     | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (173)            |
| 美元 174,362    | 加元 250,453        | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (175)            |
| 美元 74,073     | 加元 106,195        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (216)            |
| 美元 138,062    | 离岸人民币 1,000,000   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (221)            |
| 美元 47,596     | 离岸人民币 343,000     | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (316)            |
| 美元 57,486     | 离岸人民币 414,650     | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | (331)            |
| 美元 108,868    | 离岸人民币 787,314     | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | (344)            |
| 美元 91,313     | 澳元 145,730        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (487)            |
| 美元 35,816     | 纽元 62,256         | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (541)            |
| 美元 50,431     | 澳元 80,036         | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (548)            |
| 美元 61,503     | 澳元 97,800         | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (549)            |
| 美元 320,240    | 离岸人民币 2,318,443   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (663)            |
| 美元 45,970     | 澳元 72,598         | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (723)            |
| 美元 359,127    | 离岸人民币 2,600,000   | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (740)            |
| 美元 40,397     | 澳元 63,555         | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (786)            |
| 美元 139,054    | 离岸人民币 1,002,667   | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (845)            |
| 美元 119,861    | 纽元 210,047        | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (845)            |
| 美元 62,428     | 澳元 98,799         | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (851)            |
| 美元 103,370    | 纽元 180,901        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (869)            |
| 美元 75,921     | 澳元 120,340        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (918)            |
| 美元 63,971     | 纽元 111,264        | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (927)            |
| 美元 183,308    | 离岸人民币 1,322,201   | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | (1,055)          |
| 美元 87,696     | 纽元 152,710        | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | (1,167)          |
| 美元 371,656    | 离岸人民币 2,687,749   | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | (1,174)          |
| 美元 230,973    | 离岸人民币 1,666,764   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (1,225)          |
| 美元 305,788    | 离岸人民币 2,208,725   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (1,336)          |
| 美元 185,619    | 澳元 295,160        | 2025 年 4 月 22 日 | Citibank N.A., 伦敦 | (1,660)          |
| 美元 496,110    | 离岸人民币 3,581,866   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (2,382)          |
| 美元 698,892    | 加元 1,000,000      | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (3,405)          |
| 美元 942,094    | 离岸人民币 6,801,810   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (4,526)          |
| 美元 836,997    | 离岸人民币 6,037,257   | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | (4,815)          |
| 美元 1,654,446  | 离岸人民币 11,964,654  | 2025 年 4 月 22 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司     | (5,226)          |
| 美元 564,527    | 纽元 982,663        | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (7,735)          |
| 美元 743,276    | 澳元 1,178,161      | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (8,986)          |
| 美元 2,031,086  | 离岸人民币 14,664,208  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (9,758)          |
| 美元 2,257,633  | 离岸人民币 16,281,775  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (13,338)         |
| 美元 3,310,305  | 离岸人民币 23,879,380  | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (18,749)         |
| 美元 6,017,341  | 离岸人民币 43,396,332  | 2025 年 4 月 22 日 | 巴克莱银行, 伦敦         | (35,550)         |
| 美元 36,236,946 | 离岸人民币 261,400,645 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行            | (205,237)        |

| 交付合约            | 折算额                 | 交割日期            | 交易对手             | 未实现收益／（亏损）<br>美元 |
|-----------------|---------------------|-----------------|------------------|------------------|
| 美元 55,004,049   | 加元 78,726,470       | 2025 年 4 月 22 日 | 多伦多道明银行          | (250,797)        |
| 美元 27,014,465   | 纽元 47,129,337       | 2025 年 4 月 22 日 | 渣打银行，伦敦          | (310,229)        |
| 美元 116,138,781  | 离岸人民币 837,784,520   | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行           | (657,781)        |
| 美元 58,415,349   | 澳元 92,455,345       | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行           | (792,463)        |
| 美元 527,166,320  | 离岸人民币 3,802,793,327 | 2025 年 4 月 22 日 | 法国巴黎银行           | (2,985,736)      |
| 美元 14,682,617   | 日元 2,186,710,037    | 2025 年 5 月 8 日  | HSBC Bank Plc，伦敦 | (173)            |
| 美元 31,140,078   | 欧元 28,770,696       | 2025 年 5 月 8 日  | 高盛国际，伦敦          | (374)            |
| 美元 283,925      | 日元 42,209,700       | 2025 年 5 月 8 日  | HSBC Bank Plc，伦敦 | (512)            |
| 美元 35,359,595   | 离岸人民币 256,049,435   | 2025 年 5 月 8 日  | 法国巴黎银行           | (23,960)         |
| 美元 151,254,037  | 离岸人民币 1,095,262,625 | 2025 年 5 月 8 日  | Citibank N.A.，伦敦 | (104,316)        |
| 离岸人民币 7,997     | 美元 1,104            | 2025 年 5 月 21 日 | 法国巴黎银行           | (0)              |
| 离岸人民币 7,997     | 美元 1,104            | 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 | 法国巴黎银行           | (0)              |
| 离岸人民币 18,211    | 美元 2,514            | 2025 年 5 月 21 日 | Citibank N.A.，伦敦 | (1)              |
| 离岸人民币 504,686   | 美元 69,678           | 2025 年 5 月 21 日 | Citibank N.A.，伦敦 | (28)             |
| 离岸人民币 2,738,577 | 美元 378,094          | 2025 年 5 月 21 日 | Citibank N.A.，伦敦 | (154)            |
| 纽元 3,671        | 美元 2,082            | 2025 年 5 月 21 日 | Citibank N.A.，伦敦 | (0)              |
| 美元 9,175        | 离岸人民币 66,399        | 2025 年 5 月 21 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司    | (4)              |
| 美元 147,661      | 离岸人民币 1,068,667     | 2025 年 5 月 21 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司    | (58)             |
| 美元 372,054      | 离岸人民币 2,692,672     | 2025 年 5 月 21 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司    | (147)            |
| 美元 110,225      | 纽元 193,476          | 2025 年 5 月 21 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司    | (518)            |
| 美元 214,346      | 加元 306,921          | 2025 年 5 月 21 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司    | (573)            |
| 美元 1,672,231    | 离岸人民币 12,102,447    | 2025 年 5 月 21 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司    | (661)            |
| 美元 219,586      | 澳元 350,971          | 2025 年 5 月 21 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司    | (792)            |
| 未实现总亏损          |                     |                 |                  | (72,670,876)     |
| 未实现净亏损          |                     |                 |                  | (64,042,658)     |

(c) 期货

以下为于二零二五年三月三十一日未平仓之期货合约：

|                                     | 标的资产                                                                   | 交易对手                         | 未实现收益／<br>(亏损)<br>美元 |
|-------------------------------------|------------------------------------------------------------------------|------------------------------|----------------------|
| 于 2025 年 3 月 31 日                   |                                                                        |                              |                      |
| 3 Month Euro Euribor<br>15/12/2025  | 3 个月欧元银行同业拆借利率                                                         | Citigroup Global Markets Ltd | 1,634,950            |
| Aust 10Y Bond Fut 16/06/2025        | 10 年期澳大利亚国债<br>由联邦德国、意大利共和国、法兰西共和<br>国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 5 年期债<br>务工具      | Citigroup Global Markets Ltd | 60,675               |
| Euro-BOBL Future 06/06/2025         |                                                                        | Citigroup Global Markets Ltd | 439,166              |
| Jpn 10Y Bond (OSE)<br>13/06/2025    | 10 年期日本国债                                                              | Citigroup Global Markets Ltd | 81,249               |
| US 10Yr Ultra Fut 18/06/2025        | 10 年期超长期美国国债期货                                                         | Citigroup Global Markets Ltd | 388,703              |
| US 5Yr Note (CBT) 30/06/2025        | 5 年期美国国债                                                               | Citigroup Global Markets Ltd | 185,469              |
|                                     |                                                                        | 未实现总收益                       | 2,790,212            |
|                                     |                                                                        |                              |                      |
| 3 Month Euro Euribor<br>14/06/2027  | 3 个月欧元银行同业拆借利率                                                         | Citigroup Global Markets Ltd | (51,013)             |
| 3 Month Euro Euribor<br>13/12/2027  | 3 个月欧元银行同业拆借利率                                                         | Citigroup Global Markets Ltd | (1,213,348)          |
| Can 10Yr Bond Fut 19/06/2025        | 10 年期超长期加拿大国债期货<br>由联邦德国、意大利共和国、法兰西共和<br>国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 10 年期<br>债务工具 | Citigroup Global Markets Ltd | (192,093)            |
| Euro-Bund Future 06/06/2025         |                                                                        | Citigroup Global Markets Ltd | (4,455,425)          |
| Euro-BUXL 30Y Bnd<br>06/06/2025     | 由联邦德国、意大利共和国、法兰西共和<br>国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 30 年期<br>债务工具                    | Citigroup Global Markets Ltd | (136,105)            |
| Long Gilt Future 26/06/2025         | 10 年期英国国债                                                              | Citigroup Global Markets Ltd | (354,466)            |
| Short Euro-BTP Future<br>06/06/2025 | 由联邦德国、意大利共和国、法兰西共和<br>国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 10 年期<br>债务工具                    | Citigroup Global Markets Ltd | (59,066)             |
|                                     |                                                                        | 未实现总亏损                       | (6,461,516)          |
|                                     |                                                                        |                              |                      |
|                                     |                                                                        | 未实现净亏损                       | (3,671,304)          |

(d) 利率掉期

以下为于二零二五年三月三十一日未平仓之利率掉期合约：

|                                                                                   | 标的资产                 | 交易对手                         | 公平值<br>美元   |
|-----------------------------------------------------------------------------------|----------------------|------------------------------|-------------|
| 于 2025 年 3 月 31 日                                                                 |                      |                              |             |
| (D) INTEREST RATE SWAP~619~ 17<br>230,000,000.00 CNY 27/09/2024<br>18/12/2029     | CNY/REPO7/1W/Reuters | Citigroup Global Markets Ltd | 75,468      |
| (D) INTEREST RATE SWAP~619~ 29<br>738,000,000.00 CNY 27/02/2025<br>18/06/2030     | CNY/REPO7/1W/Reuters | Citigroup Global Markets Ltd | 118,254     |
| (D) INTEREST RATE SWAP~619~ 36<br>375,000,000.00 CNY 19/03/2025<br>18/06/2030     | CNY/REPO7/1W/Reuters | Citigroup Global Markets Ltd | 157,200     |
| (D) INTEREST RATE SWAP~619~ 37<br>127,000,000,000.00 KRW<br>19/03/2025 18/06/2030 | KRW/CD/91D/Reuters   | Citigroup Global Markets Ltd | 51,848      |
| (D) INTEREST RATE SWAP~619~ 38<br>46,500,000,000.00 KRW<br>19/03/2025 18/06/2035  | KRW/CD/91D/Reuters   | Citigroup Global Markets Ltd | 67,005      |
| (D) INTEREST RATE SWAP~619~ 43<br>1,080,000,000.00 THB<br>26/03/2025 18/06/2035   | THB/THOR/1D/BBA      | Citigroup Global Markets Ltd | 366,123     |
| (D) INTEREST RATE SWAP~619~ 44<br>2,750,000,000.00 THB<br>26/03/2025 18/06/2028   | THB/THOR/1D/BBA      | Citigroup Global Markets Ltd | 329,159     |
|                                                                                   |                      | 未实现总收益                       | 1,165,057   |
| (D) INTEREST RATE SWAP~619~ 28<br>142,000,000.00 USD 27/02/2025<br>15/11/2052     | USD/SOFR/1D/Reuters  | Citigroup Global Markets Ltd | (397,654)   |
| (D) INTEREST RATE SWAP~619~ 30<br>11,656,329,000.00 HUF 27/02/2025<br>18/06/2030  | HUF/BUBOR/6M/MNB     | Citigroup Global Markets Ltd | (557,309)   |
| (D) INTEREST RATE SWAP~619~ 31<br>14,843,671,000.00 HUF 28/02/2025<br>18/06/2030  | HUF/BUBOR/6M/MNB     | Citigroup Global Markets Ltd | (685,363)   |
|                                                                                   |                      | 未实现总亏损                       | (1,640,326) |
|                                                                                   |                      | 未实现净亏损                       | (475,269)   |

财务状况表

于二零二五年三月三十一日(未经审计)

|                              | 31.3.2025<br>美元      | 30.9.2024<br>美元      |
|------------------------------|----------------------|----------------------|
| <b>资产</b>                    |                      |                      |
| <b>流动资产</b>                  |                      |                      |
| 银行现金                         | 111,652,275          | 24,708,480           |
| 应收经纪款项                       | 253,236,078          | 79,763,889           |
| 分配应收款项                       | 6,578,383            | 13,979,132           |
| 保证金                          | 75,910,521           | 11,657,126           |
| 衍生性产品                        | 12,583,487           | 18,243,466           |
| 投资                           | 5,653,332,575        | 1,918,981,912        |
| 股息、利息及其他应收款项                 | 327,820              | 38,817               |
| <b>总资产</b>                   | <b>6,113,621,139</b> | <b>2,067,372,822</b> |
| <b>负债</b>                    |                      |                      |
| <b>流动负债</b>                  |                      |                      |
| 应付经纪款项                       | 187,036,114          | 45,130,988           |
| 赎回应付款项                       | 13,370,591           | 18,399,384           |
| 应付收益分配 [附注 6]                | 7,438,259            | 6,342,478            |
| 衍生性产品                        | 98,376,196           | 15,370,135           |
| 其他应付款项                       | 3,967,338            | 1,656,684            |
| <b>总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)</b> | <b>310,188,498</b>   | <b>86,899,669</b>    |
| <b>可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]</b>  | <b>5,803,432,641</b> | <b>1,980,473,153</b> |

综合收益表

截至二零二五年三月三十一日止期间(未经审计)

|                                               | 1.10.2024<br>至<br>31.3.2025<br>美元 | 1.10.2023<br>至<br>31.3.2024<br>美元 |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>收入</b>                                     |                                   |                                   |
| 投资及衍生性产品净 (亏损) / 收益 [附注 4]                    | (8,080,873)                       | 103,444,936                       |
| 存款利息                                          | 1,093,903                         | 396,972                           |
| 汇兑净亏损                                         | (328,298)                         | (9,280,231)                       |
| 其他收入                                          | 17,709                            | 8,521                             |
|                                               | <b>(7,297,559)</b>                | <b>94,570,198</b>                 |
| <b>支出</b>                                     |                                   |                                   |
| 管理费用 [附注 5(a)]                                | 14,626,775                        | 5,937,120                         |
| 托管费用及银行费用 [附注 5(a)]                           | 727,842                           | 225,672                           |
| 受托人费用 [附注 5(b)]                               | 342,454                           | 148,476                           |
| 交易成本 [附注 5(a)]                                | 288,786                           | 58,601                            |
| 基金注册登记机构费用 [附注 5(a)]                          | 87,250                            | 67,483                            |
| 核数师酬金                                         | 40,738                            | 36,961                            |
| 法律及专业费用                                       | 5,327                             | 3,688                             |
| 印刷及出版支出                                       | 2,699                             | 5,390                             |
| 其他经营费用                                        | 6,805                             | 3,674                             |
|                                               | <b>16,128,676</b>                 | <b>6,487,065</b>                  |
| <b>净经营 (亏损) / 利润</b>                          | <b>(23,426,235)</b>               | <b>88,083,133</b>                 |
| <b>财务成本</b>                                   |                                   |                                   |
| 收益分配 [附注 6]                                   | (40,058,804)                      | (19,832,665)                      |
| <b>除税前 (亏损) / 利润</b>                          | <b>(63,485,039)</b>               | <b>68,250,468</b>                 |
| 税项                                            | (247,802)                         | (188,244)                         |
| <b>可赎回份额持有人应占净资产及总综合 (亏损) / 收益之 (减少) / 增加</b> | <b>(63,732,841)</b>               | <b>68,062,224</b>                 |

第二十六至三十三页之附注乃属本财务报表之一部分。

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

|                                  | 1.10.2024<br>至<br>31.3.2025<br>美元 | 1.10.2023<br>至<br>31.3.2024<br>美元 |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 期初可赎回份额持有人应占净资产                  | 1,980,473,153                     | 1,454,860,952                     |
| 分配可赎回份额 [附注 3]                   | 4,615,897,704                     | 846,502,539                       |
| 赎回可赎回份额 [附注 3]                   | (729,205,375)                     | (573,035,572)                     |
| 净分配                              | 3,886,692,329                     | 273,466,967                       |
| 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 | 5,867,165,482                     | 1,728,327,919                     |
|                                  | (63,732,841)                      | 68,062,224                        |
| 期末可赎回份额持有人应占净资产                  | 5,803,432,641                     | 1,796,390,143                     |

现金流量表  
截至二零二五年三月三十一日止期间(未经审计)

|                      | 1.10.2024<br>至<br>31.3.2025<br>美元 | 1.10.2023<br>至<br>31.3.2024<br>美元 |
|----------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>经营业务</b>          |                                   |                                   |
| 购入投资及衍生性产品           | (6,957,905,231)                   | (1,516,690,123)                   |
| 出售投资及衍生性产品所得款项       | 3,272,388,909                     | 1,271,444,780                     |
| 已收利息                 | 1,093,891                         | 397,123                           |
| 已收股息                 | -                                 | 6,960,396                         |
| 透支经纪款项之减少            | -                                 | (2,469,355)                       |
| 已付基金注册登记机构费用         | (162,090)                         | (121,918)                         |
| 已付税项                 | (247,802)                         | (188,244)                         |
| 已付受托人费用              | (285,252)                         | (144,361)                         |
| 已付交易成本               | (289,146)                         | (58,759)                          |
| 已付管理费用               | (12,102,958)                      | (5,760,872)                       |
| 保证金之增加               | (64,253,395)                      | (6,253,665)                       |
| 其他                   | (538,666)                         | (8,198,135)                       |
| 经营业务所运用之现金净额         | (3,762,301,740)                   | (261,083,133)                     |
| <b>融资活动</b>          |                                   |                                   |
| 分配可赎回份额所得款项          | 4,623,298,453                     | 851,669,781                       |
| 赎回可赎回份额付款            | (734,234,168)                     | (569,754,419)                     |
| 已付收益分配               | (38,963,023)                      | (18,635,134)                      |
| 融资活动所产生之现金净额         | 3,850,101,262                     | 263,280,228                       |
| <b>现金及现金等价物之增加</b>   | 87,799,522                        | 2,197,095                         |
| 期初现金及现金等价物           | 24,708,480                        | 20,966,262                        |
| 现金及现金等价物之汇兑(亏损)/收益   | (855,727)                         | 21,483                            |
| 期末现金及现金等价物           | 111,652,275                       | 23,184,840                        |
| <b>现金及现金等价物余额分析:</b> |                                   |                                   |
| 银行现金                 | 111,652,275                       | 23,184,840                        |

第二十六至三十三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

摩根国际债券基金（“本基金”）根据一九七九年四月三十日的信托契约（经修订）（“信托契约”）成立，受香港法律监管。本基金已获香港证券及期货事务监察委员会（“证监会”）认可。

本基金的投资目标是透过主要（即将其资产净值至少 80%）投资于环球投资级别债务证券，以取得比环球债券市场更高的回报。

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。

债务证券的公允价值按包括应计利息的报价计算。

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

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

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

结构性主体

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

(c) 外币交易

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

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

与现金及现金等价物有关的汇兑盈亏在综合收益表内的“汇兑净收益／亏损”中呈列。与按公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<br>(每月派息)<br>份额 | 加元对冲类别<br>(每月派息)<br>份额 | 港元类别<br>(每月派息)<br>份额 | 纽元对冲类别<br>(每月派息)<br>份额 | PRC 人民币份额<br>(累计)<br>份额 |
|----------|------------------------|------------------------|----------------------|------------------------|-------------------------|
| 已发行份额数目： |                        |                        |                      |                        |                         |
| 期初       | 11,171,300.565         | 9,561,122.710          | 233,101,516.323      | 5,527,484.033          | 126,674,090.650         |
| 总分配      | 3,271,909.116          | 2,665,147.833          | 94,263,305.016       | 2,337,108.891          | 2,419,399,071.030       |
| 总赎回      | (3,441,960.607)        | (2,436,281.808)        | (50,042,930.383)     | (2,011,767.601)        | (124,825,462.170)       |
| 期末       | 11,001,249.074         | 9,789,988.735          | 277,321,890.956      | 5,852,825.323          | 2,421,247,699.510       |

1.10.2024 至 31.3.2025

|            | PRC 人民币份额<br>(每月派息)<br>份额           | PRC 人民币<br>对冲份额<br>(累计)<br>份额       | PRC 人民币<br>对冲份额<br>(每月派息)<br>份额    | PRC 美元份额<br>(累计)<br>份额           | PRC 美元份额<br>(每月派息)<br>份额         |
|------------|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 已发行份额数目:   |                                     |                                     |                                    |                                  |                                  |
| 期初         | 60,299,604.650                      | 199,676,409.690                     | 39,895,681.450                     | 2,270,008.760                    | 4,793,515.620                    |
| 总分配<br>总赎回 | 147,376,987.060<br>(30,338,186.760) | 225,757,935.300<br>(79,228,440.270) | 5,135,947.120<br>(12,729,856.940)  | 1,445,432.850<br>(602,791.350)   | 1,108,902.990<br>(1,094,029.650) |
| 期末         | 177,338,404.950                     | 346,205,904.720                     | 32,301,771.630                     | 3,112,650.260                    | 4,808,388.960                    |
|            | 人民币对冲类别<br>(累计)<br>份额               | 人民币对冲类别<br>(每月派息)<br>份额             | 美元类别<br>(每月派息)<br>份额               | 美元类别<br>(每半年派息)<br>份额            | 美元 X 类别<br>(累计)<br>份额            |
| 已发行份额数目:   |                                     |                                     |                                    |                                  |                                  |
| 期初         | 2,738,482.588                       | 129,147,123.852                     | 67,274,004.680                     | 589,881.975                      | 13,212,114.951                   |
| 总分配<br>总赎回 | 308,957.233<br>(1,459,839.311)      | 9,623,914.075<br>(35,137,935.434)   | 18,232,938.642<br>(23,211,224.005) | 1,501,881.689<br>(1,093,549.346) | 1,503,496.057<br>(490,588.000)   |
| 期末         | 1,587,600.510                       | 103,633,102.493                     | 62,295,719.317                     | 998,214.318                      | 14,225,023.008                   |

1.10.2023 至 31.3.2024

|            | 澳元对冲类别<br>(每月派息)<br>份额            | 加元对冲类别<br>(每月派息)<br>份额              | 港元类别<br>(每月派息)<br>份额               | 纽元对冲类别<br>(每月派息)<br>份额           | PRC 人民币份额<br>(累计)<br>份额            |
|------------|-----------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|
| 已发行份额数目:   |                                   |                                     |                                    |                                  |                                    |
| 期初         | 10,250,082.410                    | 8,156,098.967                       | 141,354,598.971                    | 3,970,675.479                    | 139,899,405.190                    |
| 总分配<br>总赎回 | 3,540,124.702<br>(2,952,544.371)  | 3,505,479.057<br>(3,702,928.023)    | 39,913,696.158<br>(31,497,229.658) | 2,545,719.383<br>(1,148,729.073) | 88,200,847.910<br>(81,541,358.370) |
| 期末         | 10,837,662.741                    | 7,958,650.001                       | 149,771,065.471                    | 5,367,665.789                    | 146,558,894.730                    |
|            | PRC 人民币份额<br>(每月派息)<br>份额         | PRC 人民币<br>对冲份额<br>(累计)<br>份额       | PRC 人民币<br>对冲份额<br>(每月派息)<br>份额    | PRC 美元份额<br>(累计)<br>份额           | PRC 美元份额<br>(每月派息)<br>份额           |
| 已发行份额数目:   |                                   |                                     |                                    |                                  |                                    |
| 期初         | 14,001,444.780                    | 280,562,546.870                     | 15,135,518.530                     | 1,955,285.800                    | 2,379,751.280                      |
| 总分配<br>总赎回 | 58,164,438.120<br>(5,025,274.540) | 95,482,737.810<br>(115,848,976.490) | 37,327,835.290<br>(3,386,822.240)  | 1,002,261.720<br>(306,861.030)   | 2,961,627.440<br>(203,114.860)     |
| 期末         | 67,140,608.360                    | 260,196,308.190                     | 49,076,531.580                     | 2,650,686.490                    | 5,138,263.860                      |

1.10.2023 至 31.3.2024

|            | 人民币对冲类别<br>(累计)<br>份额            | 人民币对冲类别<br>(每月派息)<br>份额            | 美元类别<br>(每月派息)<br>份额               | 美元类别<br>(每半年派息)<br>份额            | 美元 X 类别<br>(累计)<br>份额            |
|------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 已发行份额数目:   |                                  |                                    |                                    |                                  |                                  |
| 期初         | 1,249,185.846                    | 89,613,254.027                     | 34,024,836.348                     | 438,038.285                      | 14,570,259.405                   |
| 总分配<br>总赎回 | 4,432,111.253<br>(1,212,847.041) | 44,459,269.249<br>(21,928,544.095) | 24,226,620.837<br>(11,014,178.434) | 1,288,989.319<br>(1,195,923.975) | 5,045,496.225<br>(5,271,841.000) |
| 期末         | 4,468,450.058                    | 112,143,979.181                    | 47,237,278.751                     | 531,103.629                      | 14,343,914.630                   |

31.3.2025

|                        | 澳元对冲类别<br>(每月派息)<br>澳元     | 加元对冲类别<br>(每月派息)<br>加元         | 港元类别<br>(每月派息)<br>港元             | 纽元对冲类别<br>(每月派息)<br>纽元 | PRC 人民币份额<br>(累计)<br>人民币 |
|------------------------|----------------------------|--------------------------------|----------------------------------|------------------------|--------------------------|
| 可赎回份额持有人应占净资产          | 88,259,419                 | 78,838,054                     | 2,248,357,189                    | 46,996,400             | 27,225,403,935           |
| 可赎回份额持有人应占净资产<br>(每份额) | 8.02                       | 8.05                           | 8.11                             | 8.03                   | 11.24                    |
|                        | PRC 人民币份额<br>(每月派息)<br>人民币 | PRC 人民币<br>对冲份额<br>(累计)<br>人民币 | PRC 人民币<br>对冲份额<br>(每月派息)<br>人民币 | PRC 美元份额<br>(累计)<br>美元 | PRC 美元份额<br>(每月派息)<br>美元 |
| 可赎回份额持有人应占净资产          | 1,579,580,120              | 3,712,267,312                  | 266,257,502                      | 33,221,073             | 39,705,750               |
| 可赎回份额持有人应占净资产<br>(每份额) | 8.91                       | 10.72                          | 8.24                             | 10.67                  | 8.26                     |
|                        | 人民币对冲类别<br>(累计)<br>人民币     | 人民币对冲类别<br>(每月派息)<br>人民币       | 美元类别<br>(每月派息)<br>美元             | 美元类别<br>(每半年派息)<br>美元  | 美元 X 类别<br>(累计)<br>美元    |
| 可赎回份额持有人应占净资产          | 20,356,250                 | 823,465,332                    | 503,236,261                      | 18,171,306             | 155,622,453              |
| 可赎回份额持有人应占净资产<br>(每份额) | 12.82                      | 7.95                           | 8.08                             | 18.20                  | 10.94                    |

30.9.2024

|                         | 澳元对冲类别<br>(每月派息)<br>澳元     | 加元对冲类别<br>(每月派息)<br>加元         | 港元类别<br>(每月派息)<br>港元             | 纽元对冲类别<br>(每月派息)<br>纽元 | PRC 人民币份额<br>(累计)<br>人民币 |
|-------------------------|----------------------------|--------------------------------|----------------------------------|------------------------|--------------------------|
| 可赎回份额持有人应占净<br>资产       | 92,929,710                 | 79,825,260                     | 1,957,676,239                    | 45,998,058             | 1,380,651,140            |
| 可赎回份额持有人应占净<br>资产 (每份额) | 8.32                       | 8.35                           | 8.40                             | 8.32                   | 10.90                    |
|                         | PRC 人民币份额<br>(每月派息)<br>人民币 | PRC 人民币<br>对冲份额<br>(累计)<br>人民币 | PRC 人民币<br>对冲份额<br>(每月派息)<br>人民币 | PRC 美元份额<br>(累计)<br>美元 | PRC 美元份额<br>(每月派息)<br>美元 |
| 可赎回份额持有人应占净<br>资产       | 537,625,559                | 2,172,533,788                  | 341,260,761                      | 24,343,504             | 41,077,325               |
| 可赎回份额持有人应占净<br>资产 (每份额) | 8.92                       | 10.88                          | 8.55                             | 10.72                  | 8.57                     |
|                         | 人民币对冲类别<br>(累计)<br>人民币     | 人民币对冲类别<br>(每月派息)<br>人民币       | 美元类别<br>(每月派息)<br>美元             | 美元类别<br>(每半年派息)<br>美元  | 美元 X 类别<br>(累计)<br>美元    |
| 可赎回份额持有人应占净<br>资产       | 35,643,177                 | 1,064,869,277                  | 563,879,497                      | 11,144,682             | 144,647,818              |
| 可赎回份额持有人应占净<br>资产 (每份额) | 13.02                      | 8.25                           | 8.38                             | 18.89                  | 10.95                    |

#### 4 投资及衍生性产品净（亏损）／收益

|                       | 1.10.2024<br>至<br>31.3.2025<br>美元 | 1.10.2023<br>至<br>31.3.2024<br>美元 |
|-----------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 投资及衍生性产品价值未实现收益／亏损之变动 | 2,272,936                         | 68,938,211                        |
| 投资及衍生性产品销售之实现（亏损）／收益  | (10,353,809)                      | 34,506,725                        |
|                       | (8,080,873)                       | 103,444,936                       |

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<br>至<br>31.3.2025<br>美元 | 1.10.2023<br>至<br>31.3.2024<br>美元 |
|------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 管理费用       | 14,626,775                        | 5,937,120                         |
| 托管费用及银行费用  | 562,696                           | 175,181                           |
| 基金注册登记机构费用 | 87,250                            | 67,483                            |
| 交易成本       | 18,482                            | 2,926                             |

(b) 截至二零二五年及二零二四年三月三十一日止期间，已付受托人东亚银行（信托）有限公司及其关联人士的金额列示如下：

|       | 1.10.2024<br>至<br>31.3.2025<br>美元 | 1.10.2023<br>至<br>31.3.2024<br>美元 |
|-------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 受托人费用 | 342,454                           | 148,476                           |

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 0.0399  | 12,574,241.582  | (328,621)   |
| 加元对冲类别（每月派息）                 | 2024 年 10 月 31 日 | 2024 年 11 月 8 日 | 加元 0.0370  | 9,885,024.558   | (262,381)   |
| 港元类别（每月派息）                   | 2024 年 10 月 31 日 | 2024 年 11 月 8 日 | 港元 0.0441  | 248,700,132.195 | (1,410,742) |
| 纽元对冲类别（每月派息）                 | 2024 年 10 月 31 日 | 2024 年 11 月 8 日 | 纽元 0.0425  | 6,105,719.944   | (154,437)   |
| 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 0.0477 | 59,489,846.940  | (398,110)   |
| 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 0.0236 | 38,476,798.740  | (127,395)   |
| PRC 美元份额（每月派息）               | 2024 年 10 月 31 日 | 2024 年 11 月 8 日 | 美元 0.0450  | 4,678,959.640   | (210,553)   |
| 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 0.0227 | 122,590,186.929 | (390,412)   |
| 美元类别（每月派息）                   | 2024 年 10 月 31 日 | 2024 年 11 月 8 日 | 美元 0.0440  | 66,208,743.325  | (2,913,184) |
| 澳元对冲类别（每月派息）                 | 2024 年 11 月 29 日 | 2024 年 12 月 9 日 | 澳元 0.0414  | 12,800,069.356  | (345,218)   |
| 加元对冲类别（每月派息）                 | 2024 年 11 月 29 日 | 2024 年 12 月 9 日 | 加元 0.0362  | 10,201,678.150  | (263,758)   |
| 港元类别（每月派息）                   | 2024 年 11 月 29 日 | 2024 年 12 月 9 日 | 港元 0.0442  | 255,987,882.433 | (1,454,037) |
| 纽元对冲类别（每月派息）                 | 2024 年 11 月 29 日 | 2024 年 12 月 9 日 | 纽元 0.0419  | 6,549,929.927   | (162,346)   |
| 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 0.0486 | 61,227,941.670  | (410,404)   |
| 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 0.0312 | 35,881,825.530  | (154,403)   |
| PRC 美元份额（每月派息）               | 2024 年 11 月 29 日 | 2024 年 12 月 9 日 | 美元 0.0450  | 4,602,149.500   | (207,097)   |
| 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 0.0301 | 118,381,430.919 | (491,446)   |
| 美元类别（每月派息）                   | 2024 年 11 月 29 日 | 2024 年 12 月 9 日 | 美元 0.0440  | 64,723,767.920  | (2,847,845) |
| 澳元对冲类别（每月派息）                 | 2024 年 12 月 31 日 | 2025 年 1 月 9 日  | 澳元 0.0418  | 12,580,614.253  | (325,592)   |
| 加元对冲类别（每月派息）                 | 2024 年 12 月 31 日 | 2025 年 1 月 9 日  | 加元 0.0339  | 10,148,561.679  | (239,213)   |
| 港元类别（每月派息）                   | 2024 年 12 月 31 日 | 2025 年 1 月 9 日  | 港元 0.0441  | 265,305,110.845 | (1,506,183) |
| 纽元对冲类别（每月派息）                 | 2024 年 12 月 31 日 | 2025 年 1 月 9 日  | 纽元 0.0406  | 6,521,756.462   | (148,345)   |
| 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 0.0487 | 59,548,108.500  | (395,014)   |
| 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 0.0329 | 32,031,338.870  | (143,544)   |
| PRC 美元份额（每月派息）               | 2024 年 12 月 31 日 | 2025 年 1 月 9 日  | 美元 0.0450  | 4,309,771.670   | (193,940)   |
| 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 0.0317 | 113,099,888.971 | (488,356)   |
| 美元类别（每月派息）                   | 2024 年 12 月 31 日 | 2025 年 1 月 9 日  | 美元 0.0440  | 62,399,458.309  | (2,745,575) |
| PRC 人民币份额（每月派息）              | 2025 年 1 月 27 日  | 2025 年 2 月 10 日 | 人民币 0.0491 | 164,911,994.140 | (1,117,184) |
| PRC 人民币对冲份额（每月派息）            | 2025 年 1 月 27 日  | 2025 年 2 月 10 日 | 人民币 0.0381 | 32,267,702.520  | (169,623)   |

| 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 1 月 27 日 | 2025 年 2 月 10 日 | 美元 0.0450  | 4,548,872.850   | (204,699)    |
| 澳元对冲类别 (每月派息)      | 2025 年 1 月 28 日 | 2025 年 2 月 10 日 | 澳元 0.0435  | 11,814,235.875  | (320,917)    |
| 加元对冲类别 (每月派息)      | 2025 年 1 月 28 日 | 2025 年 2 月 10 日 | 加元 0.0344  | 9,626,047.442   | (230,067)    |
| 港元类别 (每月派息)        | 2025 年 1 月 28 日 | 2025 年 2 月 10 日 | 港元 0.0442  | 268,752,497.240 | (1,524,749)  |
| 纽元对冲类别 (每月派息)      | 2025 年 1 月 28 日 | 2025 年 2 月 11 日 | 纽元 0.0422  | 6,291,475.503   | (150,233)    |
| 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 0.0367 | 106,374,229.327 | (536,339)    |
| 美元类别 (每月派息)        | 2025 年 1 月 28 日 | 2025 年 2 月 10 日 | 美元 0.0440  | 65,111,305.151  | (2,864,897)  |
| 澳元对冲类别 (每月派息)      | 2025 年 2 月 28 日 | 2025 年 3 月 10 日 | 澳元 0.0428  | 11,324,805.791  | (301,412)    |
| 加元对冲类别 (每月派息)      | 2025 年 2 月 28 日 | 2025 年 3 月 10 日 | 加元 0.0343  | 9,620,906.689   | (229,077)    |
| 港元类别 (每月派息)        | 2025 年 2 月 28 日 | 2025 年 3 月 10 日 | 港元 0.0442  | 272,544,728.730 | (1,549,087)  |
| 纽元对冲类别 (每月派息)      | 2025 年 2 月 28 日 | 2025 年 3 月 10 日 | 纽元 0.0410  | 5,770,081.525   | (132,564)    |
| 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 0.0487 | 141,411,739.650 | (944,355)    |
| 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 0.0324 | 31,234,259.730  | (138,770)    |
| PRC 美元份额 (每月派息)    | 2025 年 2 月 28 日 | 2025 年 3 月 10 日 | 美元 0.0450  | 4,438,797.550   | (199,746)    |
| 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 0.0312 | 103,835,727.200 | (444,245)    |
| 美元类别 (每月派息)        | 2025 年 2 月 28 日 | 2025 年 3 月 10 日 | 美元 0.0440  | 64,646,158.395  | (2,844,430)  |
| 澳元对冲类别 (每月派息)      | 2025 年 3 月 31 日 | 2025 年 4 月 9 日  | 澳元 0.0417  | 10,937,670.396  | (284,219)    |
| 加元对冲类别 (每月派息)      | 2025 年 3 月 31 日 | 2025 年 4 月 9 日  | 加元 0.0326  | 9,554,323.675   | (216,412)    |
| 港元类别 (每月派息)        | 2025 年 3 月 31 日 | 2025 年 4 月 9 日  | 港元 0.0441  | 277,825,916.910 | (1,574,762)  |
| 纽元对冲类别 (每月派息)      | 2025 年 3 月 31 日 | 2025 年 4 月 9 日  | 纽元 0.0392  | 5,852,825.323   | (129,938)    |
| 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 0.0485 | 177,349,378.260 | (1,183,810)  |
| 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 0.0270 | 32,362,872.890  | (120,260)    |
| PRC 美元份额 (每月派息)    | 2025 年 3 月 31 日 | 2025 年 4 月 9 日  | 美元 0.0450  | 4,815,761.590   | (216,709)    |
| 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 0.0259 | 103,571,467.273 | (369,191)    |
| 美元类别 (每月派息)        | 2025 年 3 月 31 日 | 2025 年 4 月 9 日  | 美元 0.0440  | 62,243,595.664  | (2,738,717)  |
| 美元类别 (每半年派息)       | 2025 年 3 月 31 日 | 2025 年 4 月 9 日  | 美元 0.6056  | 997,757.750     | (604,241)    |
| 可赎回份额持有人之总收益分配     |                 |                 |            |                 | (40,058,804) |

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 0.0248  | 9,900,944.749   | (155,466)   |
| 加元对冲类别 (每月派息)      | 2023 年 10 月 31 日 | 2023 年 11 月 8 日 | 加元 0.0304  | 8,940,487.801   | (195,779)   |
| 港元类别 (每月派息)        | 2023 年 10 月 31 日 | 2023 年 11 月 8 日 | 港元 0.0343  | 143,882,254.493 | (630,724)   |
| 纽元对冲类别 (每月派息)      | 2023 年 10 月 31 日 | 2023 年 11 月 8 日 | 纽元 0.0335  | 4,180,375.436   | (81,456)    |
| 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 0.0379 | 23,623,609.250  | (121,946)   |
| 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 0.0267 | 18,139,888.280  | (65,967)    |
| PRC 美元份额 (每月派息)    | 2023 年 10 月 31 日 | 2023 年 11 月 8 日 | 美元 0.0348  | 2,646,529.610   | (92,099)    |
| 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 0.0257 | 87,367,703.826  | (305,821)   |
| 美元类别 (每月派息)        | 2023 年 10 月 31 日 | 2023 年 11 月 8 日 | 美元 0.0340  | 33,464,963.745  | (1,137,808) |
| 澳元对冲类别 (每月派息)      | 2023 年 11 月 30 日 | 2023 年 12 月 8 日 | 澳元 0.0259  | 10,187,850.421  | (174,956)   |
| 加元对冲类别 (每月派息)      | 2023 年 11 月 30 日 | 2023 年 12 月 8 日 | 加元 0.0307  | 8,683,971.014   | (196,628)   |
| 港元类别 (每月派息)        | 2023 年 11 月 30 日 | 2023 年 12 月 8 日 | 港元 0.0342  | 140,511,075.691 | (615,274)   |
| 纽元对冲类别 (每月派息)      | 2023 年 11 月 30 日 | 2023 年 12 月 8 日 | 纽元 0.0333  | 4,416,489.851   | (90,837)    |
| 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 0.0369 | 36,250,654.340  | (187,320)   |
| 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 0.0187 | 26,033,122.410  | (68,172)    |
| PRC 美元份额 (每月派息)    | 2023 年 11 月 30 日 | 2023 年 12 月 8 日 | 美元 0.0348  | 3,287,856.100   | (114,417)   |
| 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 0.0181 | 93,890,985.997  | (237,982)   |
| 美元类别 (每月派息)        | 2023 年 11 月 30 日 | 2023 年 12 月 8 日 | 美元 0.0340  | 34,386,437.136  | (1,169,138) |
| 澳元对冲类别 (每月派息)      | 2023 年 12 月 29 日 | 2024 年 1 月 9 日  | 澳元 0.0250  | 9,726,513.059   | (165,922)   |
| 加元对冲类别 (每月派息)      | 2023 年 12 月 29 日 | 2024 年 1 月 9 日  | 加元 0.0300  | 8,103,499.748   | (184,366)   |
| 港元类别 (每月派息)        | 2023 年 12 月 29 日 | 2024 年 1 月 9 日  | 港元 0.0342  | 140,711,767.553 | (616,291)   |
| 纽元对冲类别 (每月派息)      | 2023 年 12 月 29 日 | 2024 年 1 月 9 日  | 纽元 0.0328  | 4,273,496.024   | (88,749)    |
| 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 0.0370 | 37,357,602.590  | (194,117)   |
| 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 0.0156 | 32,791,542.960  | (71,841)    |
| PRC 美元份额 (每月派息)    | 2023 年 12 月 29 日 | 2024 年 1 月 9 日  | 美元 0.0348  | 3,690,765.350   | (128,439)   |
| 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 0.0151 | 98,133,580.464  | (208,103)   |
| 美元类别 (每月派息)        | 2023 年 12 月 29 日 | 2024 年 1 月 9 日  | 美元 0.0340  | 35,825,392.168  | (1,218,063) |
| 澳元对冲类别 (每月派息)      | 2024 年 1 月 31 日  | 2024 年 2 月 8 日  | 澳元 0.0251  | 10,023,697.502  | (166,317)   |
| 加元对冲类别 (每月派息)      | 2024 年 1 月 31 日  | 2024 年 2 月 8 日  | 加元 0.0302  | 7,953,905.102   | (179,790)   |
| 港元类别 (每月派息)        | 2024 年 1 月 31 日  | 2024 年 2 月 8 日  | 港元 0.0343  | 141,530,642.364 | (620,999)   |
| 纽元对冲类别 (每月派息)      | 2024 年 1 月 31 日  | 2024 年 2 月 9 日  | 纽元 0.0329  | 5,079,358.766   | (102,865)   |
| 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 0.0372 | 69,691,782.560  | (361,394)   |
| 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 0.0153 | 49,973,634.220  | (106,583)   |
| PRC 美元份额 (每月派息)    | 2024 年 1 月 31 日  | 2024 年 2 月 8 日  | 美元 0.0348  | 5,221,655.000   | (181,714)   |
| 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 0.0147 | 105,691,669.369 | (216,578)   |
| 美元类别 (每月派息)        | 2024 年 1 月 31 日  | 2024 年 2 月 8 日  | 美元 0.0340  | 41,402,602.104  | (1,407,688) |

| 收益分配类别            | 除息日             | 支付日             | 比率         | 份额              | 美元           |
|-------------------|-----------------|-----------------|------------|-----------------|--------------|
| 澳元对冲类别（每月派息）      | 2024 年 2 月 29 日 | 2024 年 3 月 8 日  | 澳元 0.0282  | 10,176,245.954  | (186,860)    |
| 加元对冲类别（每月派息）      | 2024 年 2 月 29 日 | 2024 年 3 月 8 日  | 加元 0.0329  | 8,156,048.537   | (197,835)    |
| 港元类别（每月派息）        | 2024 年 2 月 29 日 | 2024 年 3 月 8 日  | 港元 0.0364  | 147,422,620.045 | (685,441)    |
| 纽元对冲类别（每月派息）      | 2024 年 2 月 29 日 | 2024 年 3 月 8 日  | 纽元 0.0358  | 5,102,148.407   | (111,284)    |
| 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 0.0395 | 69,168,865.510  | (379,192)    |
| 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 0.0217 | 49,588,491.450  | (149,345)    |
| PRC 美元份额（每月派息）    | 2024 年 2 月 29 日 | 2024 年 3 月 8 日  | 美元 0.0369  | 5,186,907.120   | (191,397)    |
| 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 0.0209 | 110,968,843.062 | (321,883)    |
| 美元类别（每月派息）        | 2024 年 2 月 29 日 | 2024 年 3 月 8 日  | 美元 0.0361  | 45,478,086.288  | (1,641,758)  |
| 澳元对冲类别（每月派息）      | 2024 年 3 月 28 日 | 2024 年 4 月 10 日 | 澳元 0.0280  | 10,998,553.773  | (200,913)    |
| 加元对冲类别（每月派息）      | 2024 年 3 月 28 日 | 2024 年 4 月 10 日 | 加元 0.0322  | 7,924,882.435   | (188,569)    |
| 港元类别（每月派息）        | 2024 年 3 月 28 日 | 2024 年 4 月 10 日 | 港元 0.0364  | 149,666,896.016 | (696,085)    |
| 纽元对冲类别（每月派息）      | 2024 年 3 月 28 日 | 2024 年 4 月 10 日 | 纽元 0.0357  | 5,214,173.857   | (111,343)    |
| 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 0.0396 | 67,144,898.920  | (366,225)    |
| 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 0.0182 | 49,091,254.920  | (123,059)    |
| PRC 美元份额（每月派息）    | 2024 年 3 月 28 日 | 2024 年 4 月 10 日 | 美元 0.0369  | 5,138,263.860   | (189,602)    |
| 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 0.0175 | 112,226,828.101 | (270,504)    |
| 美元类别（每月派息）        | 2024 年 3 月 28 日 | 2024 年 4 月 10 日 | 美元 0.0361  | 47,176,731.982  | (1,703,079)  |
| 美元类别（每半年派息）       | 2024 年 3 月 28 日 | 2024 年 4 月 10 日 | 美元 0.4833  | 531,104.637     | (256,682)    |
| 可赎回份额持有人之总收益分配    |                 |                 |            |                 | (19,832,665) |

经营与管理

管理人及服务提供者

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

投资管理

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

助理管理人

于二零二五年五月十四日生效  
JPMorgan Asset Management  
(UK) Limited  
60 Victoria Embankment  
London  
EC4Y 0JP  
United Kingdom

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

东亚银行（信托）有限公司  
香港  
九龙观塘  
观塘道 418 号  
创纪之城五期  
东亚银行中心 32 楼

基金注册登记机构

East Asia International  
Trustees Limited  
East Asia Chambers  
P.O. Box 901  
Road Town, Tortola  
British Virgin 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

