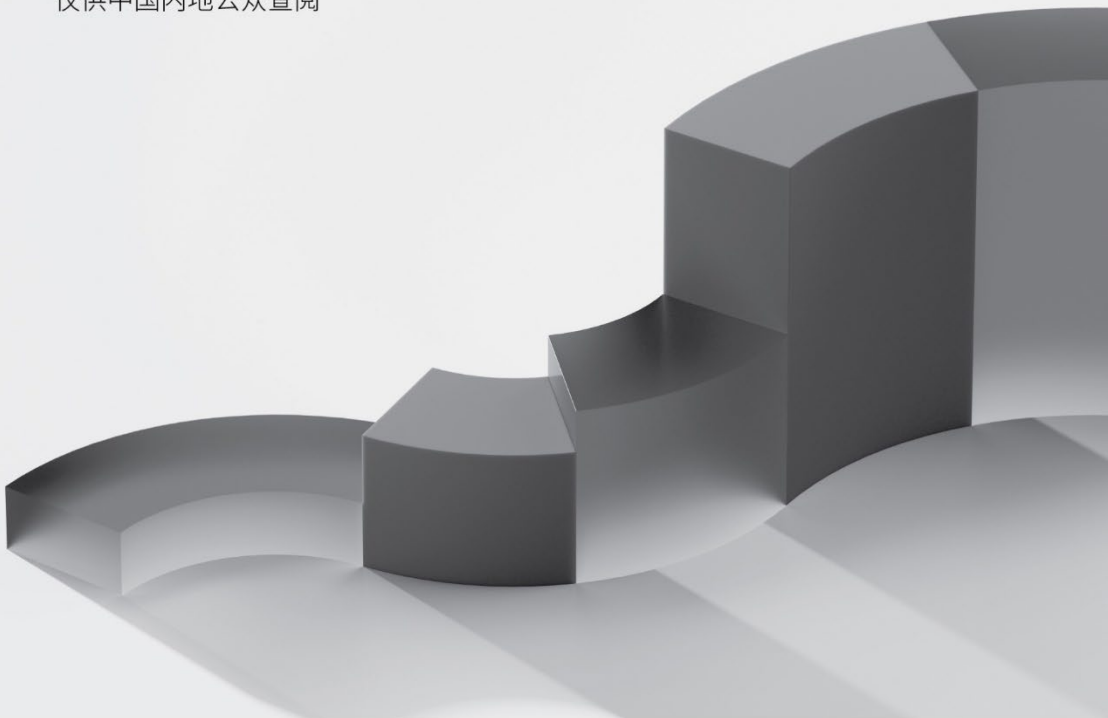


仅供中国内地公众查阅



半年度报告 — 2026年3月31日（未经审核）

摩根国际债券基金

内地与香港互认基金系列

摩根
资产管理

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

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

| 内容 | 页 |
|------------------|---------|
| 投资组合 | 1 - 7 |
| 投资组合持有变动表 | 8 |
| 金融衍生工具详情 | 9 - 18 |
| 抵押品持有情况 | 19 |
| 财务状况表 | 20 |
| 综合收益表 | 20 |
| 可赎回份额持有人应占净资产变动表 | 21 |
| 现金流量表 | 21 |
| 财务报表之附注 | 22 - 29 |
| 经营与管理 | 30 |

投资组合 (续)
于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

| | 单位数目 | 公允价值 美元 | 占资产 净值百 分比 | | 单位数目 | 公允价值 美元 | 占资产 净值百 分比 |
|--------------------------------------------------------------|-------------------|------------|------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|------------|------------------|
| 上市投资 (96.8%) | | | | SGSP Australia Assets Ser EMTN 3.375% 08Oct2032 | 欧元 7,269,000 | 8,272,120 | 0.3 |
| (I) 债务证券 (80.0%) | | | | Toyota Finance Australia Ser MTN 4.65% 17Sep2029 | 澳元 3,320,000 | 2,218,330 | 0.1 |
| 阿根廷(0.1%) | | | | Woolworths Group Ltd Ser MTN 5.91% 29Nov2034 | 澳元 4,210,000 | 2,891,361 | 0.1 |
| Tecpetrol S.A. Ser Regs 7.625% 03Nov2030 | 美元 2,200,000 | 2,297,674 | 0.1 | 奥地利(0.1%) Benteler International A Ser Regs 7.25% 15Jun2031 | 欧元 1,770,000 | 2,163,936 | 0.1 |
| 澳大利亚(6.1%) | | | | 比利时(0.2%) KBC Group Nv (Reg S) Var Perp 31Dec2049 | 欧元 2,000,000 | 2,471,109 | 0.1 |
| Agi Finance Pty Ltd Ser MTN 4.832% 25Sep2031 | 澳元 4,790,000 | 3,132,726 | 0.1 | KBC Group Nv Ser 144A Var 16Oct2030 | 美元 3,260,000 | 3,355,713 | 0.1 |
| Airservices Australia 5.35% 15Nov2037 | 澳元 3,870,000 | 2,592,677 | 0.1 | 百慕大(0.3%) Govt of Bermuda Ser 144A 4.75% 15Feb2029 | 美元 7,472,000 | 7,531,660 | 0.3 |
| Airservices Australia Ser MTN 5.45% 15May2035 | 澳元 1,940,000 | 1,328,056 | 0.0 | 加拿大(4.0%) British Columbia Prov of 4.15% 18Jun2034 | 加元 30,000,000 | 22,302,436 | 0.8 |
| Ausgrid Finance Pty Ltd Ser MTN 5.408% 28Mar2031 | 澳元 3,970,000 | 2,669,887 | 0.1 | Canadian Government 2.75% 01Mar2031 | 加元 44,630,000 | 31,571,066 | 1.1 |
| Australia Pacific Airport Ser MTN Var 16Jun2055 | 澳元 4,150,000 | 2,764,517 | 0.1 | Enbridge Inc (Reg) Var 15Jan2083 | 美元 6,730,000 | 6,941,655 | 0.2 |
| Australian Government Ser 172 4.25% 21Mar2036 | 澳元 151,774,000 | 98,232,801 | 3.4 | Ontario (Province of) 3.8% 02Dec2034 | 加元 28,945,000 | 20,996,610 | 0.7 |
| Australian Rail Track Ser MTN (Reg S) 5.598% 12Jun2031 | 澳元 5,350,000 | 3,714,990 | 0.1 | Ontario (Province of) 4.65% 02Jun2041 | 加元 22,302,000 | 16,617,306 | 0.6 |
| Glencore Cap Fin Dac Ser EMTN 3.668% 06Oct2032 | 欧元 5,915,000 | 6,786,433 | 0.2 | Province of Quebec 4% 01Sep2035 | 加元 17,460,000 | 12,594,328 | 0.4 |
| Glencore Cap Fin Dac Ser EMTN 4.154% 29Apr2031 | 欧元 3,000,000 | 3,652,229 | 0.1 | Transcanada Trust Var 15Sep2079 | 美元 4,400,000 | 4,375,412 | 0.2 |
| Glencore Funding Llc Ser 144A 5.371% 04Apr2029 | 美元 6,279,000 | 6,577,186 | 0.2 | 智利(0.1%) ATP Tow/Andean Telecom Ser Regs 7.875% 03Feb2030 | 美元 2,800,000 | 2,876,736 | 0.1 |
| Goodman Australia Fin (Reg) (Reg S) 4.25% 03May2030 | 欧元 918,000 | 1,113,980 | 0.0 | 中国内地(4.2%) China Development Bank Ser 2520 1.87% 05Sep2035 (Interbank) | 人民币 300,210,000 | 43,586,181 | 1.5 |
| Goodman US Fin Three Ser Regs (Reg) 3.7% 15Mar2028 | 美元 2,000,000 | 1,972,111 | 0.1 | | | | |
| NBN Co Ltd Ser 144A 2.625% 05May2031 | 美元 4,000,000 | 3,698,915 | 0.1 | | | | |
| NBN Co Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.5% 22Mar2030 | 欧元 2,106,000 | 2,428,576 | 0.1 | | | | |
| NBN Co Ltd Ser GMTN (Reg) (Reg S) 4.375% 15Mar2033 | 欧元 2,000,000 | 2,408,934 | 0.1 | | | | |
| NBN Co Ltd Ser MTN 5.35% 06Mar2035 | 澳元 2,320,000 | 1,536,532 | 0.1 | | | | |
| NBN Co Ltd Ser Regs 4.25% 01Oct2029 | 美元 4,950,000 | 5,042,794 | 0.2 | | | | |
| NSW Electricity Networks Ser MTN Var 20Nov2055 | 澳元 3,170,000 | 2,132,439 | 0.1 | | | | |
| Registry Finance Pty Ltd Ser MTN 5.472% 19Dec2031 | 澳元 6,800,000 | 4,678,972 | 0.2 | | | | |
| Scentre Mgmt Ltd Ser EMTN 3.45% 07Oct2033 | 欧元 5,269,000 | 5,865,487 | 0.2 | | | | |

投资组合 (续)

(续)

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

| | 单位数目 | 公允价值 美元 | 占资产 净值百 分比 | | 单位数目 | 公允价值 美元 | 占资产 净值百 分比 |
|------------------------------------------------------------------------|---------------------------|------------|------------------|----------------------------------------------------------------------------|---------------|------------|------------------|
| 中国内地 (续) | | | | 法国(0.9%) | | | |
| China Government Bond Ser Inbk 2.04% 25Nov2034 (Interbank) | 人民币 371,090,000 | 55,390,504 | 1.9 | BNP Paribas Ser EMTN Var 17Sep2033 | 欧元 5,800,000 | 6,611,898 | 0.2 |
| China Government Bond Ser Inbk 2.15% 25Aug2055 (Interbank) | 人民币 123,510,000 | 17,313,243 | 0.6 | BPCE Sa Ser 144A Var 19Oct2029 | 美元 2,108,000 | 2,269,201 | 0.1 |
| Far East Horizon Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.875% 05Mar2028 | 美元 1,163,000 | 1,168,413 | 0.1 | Electricite De France Sa (Reg S) (Br) Var Perp 31Dec2049 | 欧元 2,200,000 | 2,524,966 | 0.1 |
| Far East Horizon Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 6.625% 16Apr2027 | 美元 3,400,000 | 3,531,033 | 0.1 | Electricite De France Sa Ser 144A 6.9% 23May2053 | 美元 4,360,000 | 4,775,242 | 0.1 |
| Far East Horizon Ltd Ser EMTN 5.25% 13Jan2029 | 美元 601,000 | 595,439 | 0.0 | Electricite De France Sa Ser EMTN (Reg S) (Br) Var Perp 31Dec2049 | 欧元 2,400,000 | 3,023,542 | 0.1 |
| 哥伦比亚(1.9%) | | | | Electricite De France Sa Ser EMTN Var Perp 31Dec2049 | 欧元 1,800,000 | 2,189,246 | 0.1 |
| Aris Mining Corp Ser Regs 8% 31Oct2029 | 美元 2,800,000 | 2,996,324 | 0.1 | Forvia Se Ser Regs (Br) 5.625% 15Jun2030 | 欧元 2,000,000 | 2,368,355 | 0.1 |
| Ecopetrol SA (Reg) 8.625% 19Jan2029 | 美元 2,375,000 | 2,552,733 | 0.1 | Veolia Environnement Sa Var Perp 31Dec2049 | 欧元 2,500,000 | 3,019,318 | 0.1 |
| Enfrancia Energia Sur Sa Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.375% 30Dec2030 | 美元 3,200,000 | 2,917,496 | 0.1 | 德国(3.4%) | | | |
| Titulos De Tesoreria Ser B 11.75% 24Jan2035 | 哥伦比亚比索 181,991,300,000 | 46,399,719 | 1.6 | Aroundtown Sa Ser EMTN 3.25% 02Jan2031 | 欧元 3,700,000 | 4,054,098 | 0.1 |
| 捷克共和国(0.8%) | | | | Bundeschatzanwei- sungen (Reg S) (Br) 2.9% 15Aug2056 | 欧元 5,105,000 | 5,422,693 | 0.2 |
| Czech Republic Ser 151 4.9% 14Apr2034 | 捷克克朗 295,640,000 | 14,628,134 | 0.5 | Bundeschatzanwei- sungen Ser 192 (Reg S) (Br) 2.2% 10Oct2030 | 欧元 25,895,000 | 29,661,292 | 1.0 |
| Czech Republic Ser 154 (Br) 4.5% 11Nov2032 | 捷克克朗 169,600,000 | 8,018,165 | 0.3 | Commerzbank Ag Ser EMTN (Reg S) Var 16Jul2032 | 欧元 7,400,000 | 8,797,472 | 0.3 |
| 丹麦(0.6%) | | | | Deutsche Bank AG Ser EMTN Var 13Feb2031 | 欧元 7,800,000 | 8,864,448 | 0.3 |
| Danske Bank A/S Ser 144A Var 01Mar2030 | 美元 8,580,000 | 8,867,247 | 0.3 | Land Nordrhein- Westfalen Ser EMTN (Reg S) (Br) 2.15% 21Mar2119 | 欧元 1,200,000 | 865,918 | 0.0 |
| Danske Bank A/S Ser 144A Var 02Oct2030 | 美元 2,180,000 | 2,224,346 | 0.1 | Volkswagen Bank GmbH Ser EMTN 3.5% 19Jun2031 | 欧元 7,900,000 | 9,172,920 | 0.3 |
| Danske Bank A/S Ser EMTN Var 02Dec2033 | 欧元 4,910,000 | 5,544,042 | 0.2 | Volkswagen Bank GmbH Ser EMTN 3.625% 02Oct2032 | 欧元 5,100,000 | 5,812,610 | 0.2 |
| 厄瓜多尔(0.1%) | | | | Volkswagen Intl Fin Nv Var Perp 31Dec2049 | 欧元 3,600,000 | 4,228,503 | 0.2 |
| Republic of Ecuador Ser Regs 8.75 % 29Jan2034 | 美元 3,149,000 | 3,141,346 | 0.1 | Vonovia Se Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.625% 14Dec2029 | 欧元 6,000,000 | 6,220,541 | 0.2 |
| Republic of Ecuador Ser Regs 9.25 % 29Jan2039 | 美元 733,000 | 731,850 | 0.0 | | | | |
| 埃及(0.1%) | | | | | | | |
| Arab Republic of Egypt Ser Regs (Reg) (Reg S) 8.5% 31Jan2047 | 美元 4,000,000 | 3,516,139 | 0.1 | | | | |

投资组合 (续)
于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

| | 单位数目 | 公平值 美元 | 占资产 净值百 分比 | | 单位数目 | 公平值 美元 | 占资产 净值百 分比 |
|---------------------------------------------------------------------|------------------------|------------|------------------|-------------------------------------------------------------------|--------------|-----------|------------------|
| 德国 (续) | | | | 国际 (0.4%) | | | |
| Vonovia Se Ser EMTN .625% 24Mar2031 | 欧元 3,000,000 | 2,974,378 | 0.1 | Africa Finance Corp Ser Regs 5.55% 08Oct2029 | 美元 2,800,000 | 2,897,481 | 0.1 |
| Vonovia Se Ser EMTN 3.5% 12Nov2032 | 欧元 4,200,000 | 4,738,967 | 0.2 | African Export-Import Ba Ser 144A (Reg) 2.634% 17May2026 | 美元 2,000,000 | 2,018,237 | 0.1 |
| Wintershall Dea Finance (Reg S) (Br) 1.332% 25Sep2028 | 欧元 5,000,000 | 5,451,270 | 0.2 | African Export-Import Ba Ser Regs (Reg S) 3.798% 17May2031 | 美元 2,000,000 | 1,810,623 | 0.1 |
| ZF Europe Finance 7% 12Jun2030 | 欧元 1,900,000 | 2,361,580 | 0.1 | African Export-Import Ba Ser Regs (Reg S) 3.994% 21Sep2029 | 美元 1,805,000 | 1,685,248 | 0.0 |
| 加纳 (0.1%) | | | | Banque Ouest Africaine D Ser Regs (Reg S) 4.7% 22Oct2031 | 美元 2,545,000 | 2,389,916 | 0.1 |
| Republic of Ghana Ser Regs (Reg) (Reg S) STP 03Jul2035 | 美元 4,600,000 | 3,991,186 | 0.1 | 爱尔兰 (1.5%) | | | |
| 危地马拉 (0.1%) | | | | Aercap Ireland Cap/Globa (Reg) 3% 29Oct2028 | 美元 6,130,000 | 5,979,840 | 0.2 |
| Enequate Trust 2 0 Ser Regs 6.35% 15Sep2035 | 美元 2,200,000 | 2,164,092 | 0.1 | Aercap Ireland Cap/Global Var 31Jan2056 | 美元 4,264,000 | 4,318,873 | 0.2 |
| 香港特别行政区 (0.1%) | | | | AIB Group Plc (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049 | 欧元 2,600,000 | 3,218,624 | 0.1 |
| CAS Capital No2 Ltd Var Perp (Reg) (Reg S) 31Dec2049 | 美元 745,000 | 744,350 | 0.0 | Avolond Holdings Fndg Ltd Ser 144A 4.95% 15Jan2028 | 美元 3,720,000 | 3,772,817 | 0.1 |
| FWD Group Holdings (Reg) (Reg S) 5.836% 22Sep2035 | 美元 1,769,000 | 1,760,606 | 0.1 | Avolond Holdings Fndg Ltd Ser 144A 5.15% 15Jan2030 | 美元 3,800,000 | 3,856,721 | 0.1 |
| 匈牙利 (1.3%) | | | | Avolond Holdings Fndg Ltd Ser 144A 5.75% 01Mar2029 | 美元 7,273,000 | 7,474,003 | 0.3 |
| Hungary (Govt of) Ser 10Y (Reg) (Reg S) 4.5% 16Jun2034 | 欧元 11,376,000 | 13,485,021 | 0.5 | Avolond Holdings Fndg Ltd Ser 144A 6.375% 04May2028 | 美元 9,180,000 | 9,691,033 | 0.3 |
| Hungary (Govt of) Ser 35/A 7% 24Oct2035 | 匈牙利福林 6,600,000,000 | 20,089,741 | 0.7 | 意大利 (2.6%) | | | |
| Hungary (Govt of) Ser Regs (Reg S) 5.5% 26Mar2036 | 美元 3,000,000 | 2,929,772 | 0.1 | Banco Bpm SpA Ser EMTN Var 01Jan2036 | 欧元 5,950,000 | 6,782,845 | 0.2 |
| 印度 (1.0%) | | | | Enel SpA Ser EMTN (Br) Var Perp 31Dec2049 6.375% | 欧元 3,500,000 | 4,370,988 | 0.2 |
| GMR Hyderabad Internatio Ser Regs (Regs) 4.25% 27Oct2027 | 美元 7,360,000 | 7,343,795 | 0.3 | Intesa Sanpaolo SpA Ser (Br) Var Perp 31Dec2049 | 欧元 1,200,000 | 1,411,636 | 0.1 |
| India Clean Energy Hldg Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.5% 18Apr2027 | 美元 2,900,000 | 2,869,938 | 0.1 | | | | |
| IRB Infrastructure Deve Ser Regs (Reg S) 7.11% 11Mar2032 | 美元 2,000,000 | 2,016,958 | 0.1 | | | | |
| JSW Infrastructure Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.95% 21Jan2029 | 美元 2,750,000 | 2,707,084 | 0.1 | | | | |
| Muthoot Finance Ltd Ser Regs 6.375% 02Mar2030 | 美元 4,346,000 | 4,317,843 | 0.1 | | | | |
| Periama Holdings Llc/De (Reg) (Reg S) 5.95% 19Apr2026 | 美元 3,000,000 | 3,079,923 | 0.1 | | | | |
| Renew Treas Ifsc Pvt Ltd Ser Regs 6.5% 02Feb2031 | 美元 2,737,000 | 2,689,473 | 0.1 | | | | |
| Shriram Finance Ltd Ser Regs (Reg S) 6.625% 22Apr2027 | 美元 3,400,000 | 3,527,275 | 0.1 | | | | |

投资组合 (续)

(续)

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

| | 单位数目 | 公允价值 美元 | 占资产 净值百 分比 | | 单位数目 | 公允价值 美元 | 占资产 净值百 分比 |
|-------------------------------------------------------------------------|----------------------|------------|------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|------------|------------------|
| 意大利 (续) | | | | 墨西哥 (3.8%) | | | |
| Italy (Rep of) Ser 30Y (Reg S) 4.3% 01Oct2054 | 欧元 41,588,000 | 46,810,867 | 1.6 | Alpek Sa De Cv Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.25% 18Sep2029 | 美元 3,000,000 | 2,780,142 | 0.1 |
| Unicredit SpA Ser EMTN (Br) Var 16Feb2029 | 欧元 4,000,000 | 4,716,132 | 0.2 | Banco Mercantil De Norte Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049 7.5% | 美元 1,500,000 | 1,502,095 | 0.0 |
| Unicredit SpA Ser EMTN Var 22Sep2031 | 欧元 8,727,000 | 9,969,923 | 0.3 | BBVA Bancomer Sa Texas Var 18Jan2033 | 美元 2,450,000 | 2,408,594 | 0.1 |
| 象牙海岸 (0.1%) | | | | CFE Fibr E 5.875% 23Sep2040 | | | |
| Ivory Coast Ser Regs 6.75% 25Feb2041 | 美元 2,851,000 | 2,529,916 | 0.1 | Comision Federal De Elec Ser Regs 6.045% 28Jan2034 | 美元 2,150,000 | 2,066,726 | 0.1 |
| 牙买加 (0.1%) | | | | Corporacion Inmobiliaria Ser Regs 5.5% 30Jan2033 | | | |
| DIG Intl Fin/Difl Us Llc Ser Regs 8.625% 01Aug2032 | 美元 2,748,000 | 2,837,725 | 0.1 | Eagle Funding Luxco Sarl Ser Regs 5.5% 17Aug2030 | 美元 2,200,000 | 2,151,753 | 0.1 |
| 日本 (2.4%) | | | | Mex Bonos Desarr 7.75% 23Nov2034 | | | |
| Japan (30 Year Issue) Ser 85 2.3% 20Dec2054 | 日元 10,354,650,000 | 49,836,246 | 1.7 | Mexico (Utd States of) 7.75% 29May2031 | 墨西哥比索 8,645,400 | 45,089,630 | 1.6 |
| Japan (Govt of) Ser 186 1.5% 20Sep2043 | 日元 1,108,500,000 | 5,459,227 | 0.2 | Mexico (Utd States of) Ser M 7.5% 26May2033 | 墨西哥比索 11,300 | 61,324 | 0.0 |
| Jera Co Inc 4.544% 02Sep2030 | 美元 4,003,000 | 3,976,822 | 0.2 | United Mexican States Ser 10 5.625% 22Sep2035 | 墨西哥比索 7,414,500 | 38,692,446 | 1.3 |
| Meiji Yasuda Life Insura Ser Regs (Reg S) Var 11Sep2054 | 美元 3,240,000 | 3,225,648 | 0.1 | | 美元 4,937,000 | 4,790,896 | 0.2 |
| Nomura Holdings Inc Var 10Jun2036 | 美元 2,570,000 | 2,534,255 | 0.1 | 荷兰 (0.2%) | | | |
| Rakuten Group Inc Ser Regs (Reg S) 11.25% 15Feb2027 | 美元 2,633,000 | 2,766,107 | 0.1 | Cooperatieve Rabobank UA (Reg S) (Br) Var Perp 31 Dec2049 | 欧元 2,800,000 | 3,276,925 | 0.1 |
| 科威特 (0.1%) | | | | ING Groep NV Var Perp 31Dec2049 | | | |
| Equate Petrochemical Bv Ser Regs (Reg S) 2.625% 28Apr2028 | 美元 2,000,000 | 1,900,846 | 0.1 | | 美元 1,690,000 | 1,725,280 | 0.1 |
| 卢森堡 (0.2%) | | | | 尼日利亚 (0.1%) | | | |
| Bavarian Sky Sa (Ser 8 Cl A) FRN 20Nov2031 | 欧元 1,900,000 | 441,034 | 0.0 | IHS Holding Ltd Ser Regs (Reg S) 6.25% 29Nov2028 | 美元 2,900,000 | 2,939,818 | 0.1 |
| Herens Holdco Sarl Ser 144A (Reg) 4.75% 15May2028 | 美元 825,000 | 709,054 | 0.0 | 巴基斯坦 (0.0%) | | | |
| Maxam Prill Sarl Ser Regs 6% 15Jul2030 | 欧元 1,910,000 | 2,220,151 | 0.1 | Pakistan Water & Power (Reg) (Reg S) 7.5% 04Jun2031 | 美元 577,000 | 529,554 | 0.0 |
| Selp Finance Sarl Ser EMTN 3.75% 16Jan2032 | 欧元 3,310,000 | 3,755,681 | 0.1 | 巴拿马 (0.1%) | | | |
| 澳门特别行政区 (0.5%) | | | | Panama (Govt of) (Reg) 3.87% 23Jul2060 | | | |
| MGM China Holdings Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 7.125% 26Jun2031 | 美元 1,150,000 | 1,195,480 | 0.0 | | 美元 6,920,000 | 4,571,352 | 0.1 |
| SJM International Ltd 6.5% 15Jan2031 | 美元 2,000,000 | 1,938,751 | 0.1 | 波兰 (0.8%) | | | |
| Studio City Co Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 7% 15Feb2025 | 美元 2,350,000 | 2,370,329 | 0.1 | Poland Government Bond Ser 1035 5% 25Oct2035 | 波兰兹罗提 87,201,000 | 22,322,176 | 0.8 |
| Studio City Finance Ltd Ser Regs (Reg) (Regs) 5% 15Jan2029 | 美元 7,110,000 | 6,748,307 | 0.2 | | | | |
| Wynn Macau Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.125% 15Dec2029 | 美元 2,000,000 | 1,949,523 | 0.1 | | | | |

投资组合 (续)
于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

| | 单位数目 | 公平值 美元 | 占资产 净值百 分比 | | 单位数目 | 公平值 美元 | 占资产 净值百 分比 |
|----------------------------------------------------------------------------|---------------------|------------|------------------|-------------------------------------------------------------------------|---------------|------------|------------------|
| 罗马尼亚 (0.1%) | | | | 泰国(0.1%) | | | |
| Romania (Govt of) Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.375% 28Jan2050 | 欧元 5,285,000 | 3,748,872 | 0.1 | Muangthai Capital PCL (Reg) 6.875% 30Sep2028 | 美元 2,500,000 | 2,484,246 | 0.1 |
| 沙特阿拉伯(0.4%) | | | | Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049 | 美元 718,000 | 702,369 | 0.0 |
| Greensaif Pipelines Bidc Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.8528% 23Feb2036 | 美元 6,885,000 | 6,959,812 | 0.3 | 特立尼达和多巴哥(0.0%) | | | |
| SNB Funding Ltd Ser EMTN (Reg) Var 24Jun2035 | 美元 4,024,000 | 4,060,718 | 0.1 | Trinidad Gen Ultd Ser Regs 7.75% 16Jun2033 | 美元 1,412,000 | 1,507,316 | 0.0 |
| 南非(1.1%) | | | | 土耳其(0.5%) | | | |
| Republic of South Africa Ser 2040 (Reg) 9% 31Jan2040 | 南非兰特 160,950,000 | 8,989,204 | 0.3 | Turkey (Govt of) (Reg) 5.15% 10Mar2034 | 欧元 5,065,000 | 5,683,359 | 0.2 |
| Republic of South Africa Ser Regs 7.25% 11Dec2055 | 美元 5,797,000 | 5,439,185 | 0.2 | Turkiye Varlik Fonu 7.75% 10Sep2035 | 美元 8,785,000 | 8,682,310 | 0.3 |
| South Africa (Rep of) (Reg) 5.75% 30Sep2049 | 美元 3,685,000 | 2,854,388 | 0.1 | 阿联酋(0.1%) | | | |
| South Africa (Rep of) Ser 2030 (Reg) 8% 31Jan2030 | 南非兰特 234,748,800 | 13,757,393 | 0.5 | Aldar Properties pjsc Var 14Apr2056 | 美元 2,500,000 | 2,331,489 | 0.1 |
| 西班牙(3.1%) | | | | Fin Dept Govt Sharjah Ser EMTN 4.625% 13Feb2032 | 欧元 1,516,000 | 1,690,634 | 0.0 |
| Banco Santander SA Ser Var Perp 31Dec2049 | 美元 4,200,000 | 4,571,218 | 0.2 | 英国(9.1%) | | | |
| Bankinter Sa (Reg S) Var 03May2030 | 欧元 3,000,000 | 3,660,481 | 0.1 | CK Hutchison Group (Reg S) (Br) 1.5% 17Oct2031 | 欧元 2,800,000 | 2,861,668 | 0.1 |
| Bonos Y Oblig Del Estado 3.95% 31Oct2056 | 欧元 5,099,000 | 5,651,407 | 0.2 | Heathrow Funding Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4.5% 11Jul2035 | 欧元 1,000,000 | 1,213,164 | 0.0 |
| Caixabank SA Ser 144A Var 03Jul2029 | 美元 26,425,000 | 26,773,161 | 0.9 | Heathrow Funding Ltd Ser EMTN 6% 05Mar2032 | 英镑 5,000,000 | 6,645,357 | 0.2 |
| Caixabank Sa Ser 144A Var 15Mar2030 | 美元 8,324,000 | 8,575,255 | 0.3 | Heathrow Funding Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.45% 10Dec2031 | 英镑 2,500,000 | 3,507,993 | 0.1 |
| Caixabank SA Ser EMTN Var 20Jan2037 | 欧元 1,400,000 | 1,579,442 | 0.1 | HSBC Holdings Plc (Reg) Var 19Jun2029 | 美元 14,443,000 | 14,622,829 | 0.5 |
| Cellnex Telecom SA Ser EMTN (Reg S) (Br) 1.75% 23Oct2030 | 欧元 2,000,000 | 2,128,553 | 0.1 | IHG Finance Llc Ser EMTN 3.375% 10Sep2030 | 欧元 2,376,000 | 2,724,234 | 0.1 |
| Inmobiliaria Colonial So Ser EMTN 3.125% 23Sep2031 | 欧元 4,400,000 | 4,938,766 | 0.2 | Ineos Quattro Finance 2 Ser Regs (Reg S) 8.5% 15Mar2029 | 欧元 1,995,000 | 1,982,883 | 0.1 |
| Spain (Govt of) (Reg S) 4% 31Oct2054 | 欧元 19,927,000 | 22,721,166 | 0.8 | Motability Operations Gr Ser EMTN 4% 17Jan2030 | 欧元 3,000,000 | 3,515,653 | 0.1 |
| Telefonica Europe Bv Ser (Reg S) (Br) Var Perp 31Dec2049 | 欧元 5,700,000 | 7,272,900 | 0.2 | Nationwide Bldg Society (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049 | 英镑 2,500,000 | 3,376,747 | 0.1 |
| 苏里南(0.1%) | | | | 台湾地区(0.1%) | | | |
| Republic of Suriname Int Ser Regs 8.5% 06Nov2035 | 美元 2,834,000 | 3,021,302 | 0.1 | Foxconn Singapor 3.125% 04Nov2031 | 欧元 2,105,000 | 2,376,801 | 0.1 |

投资组合 (续)

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

(续)

| | 单位数目 | 公平值 美元 | 占资产 净值百 分比 | | 单位数目 | 公平值 美元 | 占资产 净值百 分比 |
|-------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------|------------------|--------------------------------------------------------------------|----------------|-------------|------------------|
| 英国 (续) | | | | Goldman Sachs Group Inc Var 23Oct2030 | 美元 6,304,000 | 6,439,981 | 0.2 |
| Nationwide Bldg Society (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049 5.75% | 英镑 2,300,000 | 3,062,924 | 0.1 | GS Mortgage-Backed Securities Ser Rpl3 Cl A1 STP 25Jul2065 | 美元 2,331,124 | 2,135,701 | 0.1 |
| Santander Uk Group Hldgs Var 22Sep2029 | 美元 3,017,000 | 2,992,497 | 0.1 | Las Vegas Sands Corp 5.625% 15Jun2028 | 美元 13,590,000 | 13,994,753 | 0.5 |
| Synthomer Plc Ser Regs 7.375% 02May2029 | 欧元 2,025,000 | 1,582,810 | 0.1 | Lendmark Funding Trust Ser 2A Cl A 4.78% 20Oct2034 | 美元 11,166,000 | 11,170,074 | 0.4 |
| TSB Bank Plc 2.704% 18Feb2030 | 欧元 4,027,000 | 4,574,171 | 0.2 | Mattel Inc Ser 144A 3.75% 01Apr2029 | 美元 8,047,000 | 7,935,801 | 0.3 |
| United Kingdom Gilt 4.5% 07Mar2035 | 英镑 161,445,594 | 208,006,368 | 7.3 | Merchants Fleet Funding Llc (Ser 1A Cl A) 5.82% 20Apr2037 | 美元 3,668,000 | 2,343,140 | 0.1 |
| 美国 (26.9%) | | | | Morgan Stanley Ser GMTN Var 23Jan2032 | 欧元 8,950,000 | 10,193,353 | 0.4 |
| American Credit Accept 4.55% 12Jan2033 | 美元 7,162,000 | 7,161,740 | 0.2 | Morgan Stanley Var 18Oct2030 | 美元 6,446,000 | 6,580,331 | 0.2 |
| American Credit Accept 5.1% 12Jan2033 | 美元 6,606,000 | 6,581,714 | 0.2 | Morgan Stanley Var 30Jan2037 | 美元 1,664,000 | 1,644,711 | 0.1 |
| American Express Co Var 10Feb2032 | 美元 4,505,000 | 4,487,752 | 0.2 | Nextera Energy Capital Ser 3.624% 10Feb2034 | 欧元 1,955,000 | 2,214,060 | 0.1 |
| Aqua Finance Trust Ser B Cl A 4.79% 17May2051 | 美元 6,128,000 | 4,788,778 | 0.2 | Oracle Corp 5.7% 04Feb2036 | 美元 617,000 | 599,074 | 0.0 |
| Bank of America Corp Var 06Feb2037 | 美元 6,980,000 | 6,943,745 | 0.2 | Oracle Corp 6.7% 04Feb2056 | 美元 4,195,000 | 3,940,934 | 0.1 |
| Charter Comm Opt Llc/Cap (Reg) 2.25% 15Jan2029 | 美元 5,192,000 | 4,878,238 | 0.2 | Progress Residential Trust Ser Sfr3 Cl A 3.39% 17Jul2030 | 美元 11,365,000 | 10,787,138 | 0.4 |
| Citigroup Inc (Reg) Var 19Sep2030 | 美元 3,542,000 | 3,535,812 | 0.1 | Realty Income Corp (Reg) 4.875% 06Jul2030 | 欧元 3,530,000 | 4,375,154 | 0.2 |
| Citigroup Inc (Reg) Var 20Mar2030 | 美元 2,128,000 | 2,096,760 | 0.1 | Roper Technologies Inc 4.45% 15Sep2030 | 美元 1,516,000 | 1,496,506 | 0.1 |
| Columbia Pipelines Opco Ser 144A 5.927% 15Aug2030 | 美元 976,000 | 1,029,315 | 0.0 | Santander Drive Auto Receivables Ser 3 Cl C 4.68% 15Sep2031 | 美元 2,545,000 | 2,555,994 | 0.1 |
| Credit Acceptance Auto Loan Tr (Ser 1A Cl A) 5.68% 15Mar2034 | 美元 2,337,000 | 2,353,273 | 0.1 | Sierra Receivables Funding Co Ser 2A Cl A 4.72% 20Apr2044 | 美元 2,229,000 | 1,458,564 | 0.0 |
| Crh SMW Finance Dac Ser EMTN (Reg S) (Br) 4% 11Jul2031 | 欧元 2,500,000 | 3,000,284 | 0.1 | Southern Co Gas Capital 5.75% 15Sep2033 | 美元 412,000 | 429,356 | 0.0 |
| Digital Dutch Finco Bv (Reg S) 1.5% 15Mar2030 | 欧元 3,310,000 | 3,496,760 | 0.1 | Tesla Auto Lease Trust (Ser A Cl A3) 5.3% 21Jun2027 | 美元 986,000 | 294,960 | 0.0 |
| Digital Euro Finco (Reg S) 3.75% 15Jan2033 | 欧元 3,142,000 | 3,513,222 | 0.1 | US Treasury 4.25% 28Feb2031 | 美元 47,505,000 | 48,303,137 | 1.7 |
| Edison International (Reg) 5.45% 15Jun2029 | 美元 5,835,000 | 5,985,347 | 0.2 | US Treasury Bills 0% 23Jun2026 | 美元 57,240,000 | 56,768,803 | 2.0 |
| Energy Transfer LP Var 01Oct2054 | 美元 5,730,000 | 6,027,805 | 0.2 | US Treasury N/B (Reg) 3.375% 29Feb2028 | 美元 135,507,000 | 134,846,035 | 4.7 |
| Ford Credit Auto Owner Trust (Ser A Cl A3) 5.09% 15Dec2028 | 美元 2,944,000 | 2,302,857 | 0.1 | US Treasury N/B 3% 15Nov2045 | 美元 34,170,000 | 26,227,680 | 0.9 |
| General Motors Finl Co 5.8% 23Jun2028 | 美元 14,220,000 | 14,793,197 | 0.5 | US Treasury N/B 3.5% 31Oct2027 | 美元 40,520,700 | 40,905,680 | 1.4 |
| Global Payments Inc 4.5% 15Nov2028 | 美元 3,150,000 | 3,174,160 | 0.1 | | | | |

投资组合 (续)

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

(续)

| | 单位数目 | 公允价值 美元 | 占资产 净值百 分比 | | 单位数目 | 公允价值 美元 | 占资产 净值百 分比 |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|---------------|------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|--------------|------------------|
| 美国 (续) | | | | | | | |
| US Treasury N/B 3.625% 31Oct2030 | 美元 103,907,800 | 104,160,091 | 3.6 | ICE 3 Month Sonia Future 16/03/2027 | 398 | (1,102,169) | (0.0) |
| US Treasury N/B 3.75% 28Feb2033 | 美元 5,220,000 | 5,118,348 | 0.2 | ICE 3 Month Sonia Future 14/09/2027 | 513 | (1,080,015) | (0.0) |
| US Treasury N/B 4.625% 15Feb2055 | 美元 89,777,900 | 86,166,382 | 3.0 | ICE 3 Month Sonia Future 14/12/2027 | 655 | 802,792 | 0.0 |
| US Treasury N/B 4.75% 15Aug2055 | 美元 6,375,500 | 6,251,766 | 0.2 | Jpn 10Y Bond (OSE) 15/06/2026 | 55 | (525,490) | (0.0) |
| US Treasury N/B 4.75% 15May2055 | 美元 18,190,000 | 18,044,479 | 0.6 | Long Gilt Future 26/06/2026 | 144 | (686,383) | (0.0) |
| US Treasury Notes 4.5% 15May2038 | 美元 26,210,000 | 26,856,013 | 0.9 | Short Euro-BTP Future 08/06/2026 | 1,289 | (1,179,157) | (0.0) |
| US Treasury Notes 4.5% 15Feb2036 | 美元 24,807,900 | 25,451,553 | 0.9 | US 2Yr Note (CBT) 30/06/2026 | (649) | 284,078 | 0.0 |
| Wells Fargo & Company Var 24Jan2031 | 美元 6,385,000 | 6,572,606 | 0.2 | US 5Yr Note (CBT) 30/06/2026 | (1,412) | 1,265,937 | 0.0 |
| Wharf Commercial Mortgage Trus Ser Dc Cl A Var 15Jul2040 | 美元 1,537,000 | 1,579,054 | 0.1 | US 10Yr Note (CBT) 18/06/2026 | 443 | 46,188 | 0.0 |
| WP Carey Inc (Reg) 4.25% 23Jul2032 | 欧元 2,000,000 | 2,372,020 | 0.1 | US 10Yr Ultra Fut 18/06/2026 | (483) | 977,531 | 0.0 |
| WPC Eurobond Bv (Reg) 1.35% 15Apr2028 | 欧元 4,250,000 | 4,748,907 | 0.2 | US Long Bond (CBT) 18/06/2026 | (4) | 14,031 | 0.0 |
| | | 2,297,355,290 | 80.0 | 利率掉期 (-0.1%) (D) Interest Rate Swap ~619~ 73 58,809,650,000.00 KRW 17/06/2026 17/06/2036 | | (1,308,373) | (0.1) |
| (II) 集体投资计划 (17.2%) | | | | | | (11,964,807) | (0.4) |
| 卢森堡 (17.2%) JPMF-JPM Global Corporate Bond 'X' (dist)-USD** | 4,886,842 | 493,375,579 | 17.2 | 总上市投资 | 2,778,766,062 | 96.8 | |
| | | | | 其他净资产 | 91,111,063 | 3.2 | |
| (III) 衍生性产品 (-0.4%) | | | | | | | |
| 信贷违约掉期 (-0.3%) (D) Credit Default Swap Index ~604~ 75 121,519,000.00 EUR 23/03/2026 20/06/2031 | | (8,846,755) | (0.3) | 于二零二六年三月三十一日可赎回份额 持有人应占净资产 | 2,869,877,125 | 100.0 | |
| 远期外汇合约 (0.1%) | | 1,771,639 | 0.1 | 总投资, 按成本 | 2,758,635,651 | | |
| 期货 (-0.1%) | | | | | | | |
| 3 Month Euro Euribor 16/03/2026 | (595) | 101,725 | 0.0 | | | | |
| 3 Month Euro Euribor 19/06/2028 | 595 | 110,482 | 0.0 | | | | |
| Euro-BOBL Future 08/06/2026 | 2,208 | (2,564,071) | (0.1) | | | | |
| Euro-BTP Future 08/06/2026 | 783 | (1,851,205) | (0.0) | | | | |
| Euro-Bund Future 08/06/2026 | (1,226) | 3,060,762 | 0.1 | | | | |
| Euro-BUXL 30Y Bnd 08/06/026 | (509) | 668,575 | 0.0 | | | | |
| Euro-OAT Future 08/06/2026 | 696 | (2,325,600) | (0.1) | | | | |
| Euro-Schatz Future 08/06/2026 | (740) | (27,428) | (0.0) | | | | |
| ICE 3 Month Sonia Future 16/06/2026 | (1,584) | 428,099 | 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
截至二零二六年三月三十一日止期间(未经审计)

(续)

| | 持有占资产净值百分比 | | 持有占资产净值百分比 | |
|----------------------|------------|-----------|------------|-----------|
| | 31.3.2026 | 30.9.2025 | 31.3.2026 | 30.9.2025 |
| 上市投资 | | | | |
| 债券证券 | | | | |
| 美国 | 26.9 | 23.9 | | |
| 英国 | 9.1 | 8.1 | | |
| 澳大利亚 | 6.1 | 3.5 | | |
| 中国内地 | 4.2 | 5.0 | | |
| 加拿大 | 4.0 | 4.7 | | |
| 墨西哥 | 3.8 | 4.7 | | |
| 德国 | 3.4 | 2.6 | | |
| 西班牙 | 3.1 | 3.3 | | |
| 意大利 | 2.6 | 9.4 | | |
| 日本 | 2.4 | 4.5 | | |
| 哥伦比亚 | 1.9 | 0.7 | | |
| 爱尔兰 | 1.5 | 1.5 | | |
| 匈牙利 | 1.3 | 0.9 | | |
| 南非 | 1.1 | 0.8 | | |
| 印度 | 1.0 | 1.3 | | |
| 法国 | 0.9 | 3.0 | | |
| 捷克共和国 | 0.8 | 1.7 | | |
| 波兰 | 0.8 | - | | |
| 丹麦 | 0.6 | 0.3 | | |
| 澳门特别行政区 | 0.5 | 0.5 | | |
| 土耳其 | 0.5 | 0.5 | | |
| 国际 | 0.4 | 0.8 | | |
| 沙特阿拉伯 | 0.4 | 0.4 | | |
| 百慕大 | 0.3 | 0.4 | | |
| 比利时 | 0.2 | 0.2 | | |
| 卢森堡 | 0.2 | 0.2 | | |
| 荷兰 | 0.2 | 0.1 | | |
| 阿联酋 | 0.1 | 0.5 | | |
| 埃及 | 0.1 | 0.3 | | |
| 罗马尼亚 | 0.1 | 0.3 | | |
| 危地马拉 | 0.1 | 0.2 | | |
| 泰国 | 0.1 | 0.2 | | |
| 奥地利 | 0.1 | 0.1 | | |
| 智利 | 0.1 | 0.1 | | |
| 香港特别行政区 | 0.1 | 0.1 | | |
| 牙买加 | 0.1 | 0.1 | | |
| 科威特 | 0.1 | 0.1 | | |
| 尼日利亚 | 0.1 | 0.1 | | |
| 巴拿马 | 0.1 | 0.1 | | |
| 阿根廷 | 0.1 | - | | |
| 厄瓜多尔 | 0.1 | - | | |
| 加纳 | 0.1 | - | | |
| 象牙海岸 | 0.1 | - | | |
| 苏里南 | 0.1 | - | | |
| 台湾地区 | 0.1 | - | | |
| 特立尼达和多巴哥 | 0.0 | 0.0 | | |
| 巴基斯坦 | 0.0 | - | | |
| 瑞士 | - | 0.6 | | |
| 多米尼加共和国 | - | 0.3 | | |
| 巴林 | - | 0.2 | | |
| 哥斯达黎加 | - | 0.2 | | |
| 萨尔瓦多 | - | 0.1 | | |
| 印度尼西亚 | - | 0.1 | | |
| 哈萨克斯坦 | - | 0.1 | | |
| 集体投资计划 | | | | |
| 卢森堡 | 17.2 | 11.2 | | |
| 衍生性产品 | | | | |
| 远期外汇合约 | | | 0.1 | (0.0) |
| 期货 | | | (0.1) | (0.0) |
| 利率掉期 | | | (0.1) | (0.1) |
| 信贷违约掉期 | | | (0.3) | - |
| 总上市投资 | | | 96.8 | 97.9 |
| 其他净资产 | | | 3.2 | 2.1 |
| 可赎回份额持有人应占净资产 | | | 100.0 | 100.0 |

金融衍生工具详情

于二零二六年三月三十一日(未经审计)

于二零二六年三月三十一日，本基金持有之金融衍生工具概述如下：

(a) 信贷违约掉期

以下为于二零二六年三月三十一日未平仓之信贷违约掉期合约：

| | 标的资产 | 交易对手 | 公允价值 美元 |
|---------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|------------------------------|-------------|
| 于 2026 年 3 月 31 日 | | | |
| (D) Credit Default Swap Index -604~ 75 121,519,000.00 EUR 23/03/2026 20/06/2031 | iTraxx Europe Crossover Series 45 Version 1 | Citigroup Global Markets Ltd | (8,846,755) |
| | | 总金融负债 | (8,846,755) |

(b) 远期外汇合约

以下为于二零二六年三月三十一日未平仓之远期外汇合约：

| 交付合约 | 折算额 | 交割日期 | 交易对手 | 未实现收益/ (亏损) 美元 |
|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|----------------------|
| 于 2026 年 3 月 31 日 | | | | |
| 未平仓合约： | | | | |
| 纽元 231,926 | 美元 134,901 | 2026 年 4 月 1 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 2,599 |
| 纽元 9,053 | 美元 5,213 | 2026 年 4 月 1 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 48 |
| 美元 219,649 | 离岸人民币 1,519,206 | 2026 年 4 月 1 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 312 |
| 美元 51,757 | 离岸人民币 357,976 | 2026 年 4 月 1 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 74 |
| 美元 5,357 | 离岸人民币 37,044 | 2026 年 4 月 1 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 7 |
| 美元 7,352,254 | 离岸人民币 50,838,026 | 2026 年 4 月 2 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 8,429 |
| 美元 75,038 | 离岸人民币 519,091 | 2026 年 4 月 2 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 120 |
| 离岸人民币 6,065,867 | 美元 878,675 | 2026 年 4 月 8 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 2 |
| 美元 201,258 | 离岸人民币 1,391,636 | 2026 年 4 月 8 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 327 |
| 美元 12,216 | 离岸人民币 84,472 | 2026 年 4 月 8 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 20 |
| 美元 1,102 | 离岸人民币 7,610 | 2026 年 4 月 8 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 0 |
| 美元 1,102 | 离岸人民币 7,610 | 2026 年 4 月 8 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 0 |
| 离岸人民币 630,187 | 美元 91,293 | 2026 年 4 月 9 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 0 |
| 美元 3,662,172 | 离岸人民币 25,279,642 | 2026 年 4 月 9 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 5 |
| 澳元 735,515 | 美元 519,020 | 2026 年 4 月 21 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 15,388 |
| 澳元 587,971 | 美元 415,686 | 2026 年 4 月 21 日 | 高盛国际, 伦敦 | 13,082 |
| 澳元 510,229 | 美元 360,739 | 2026 年 4 月 21 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 11,368 |
| 澳元 552,733 | 美元 389,269 | 2026 年 4 月 21 日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 10,794 |
| 澳元 658,292 | 美元 460,377 | 2026 年 4 月 21 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 9,623 |
| 澳元 575,614 | 美元 403,107 | 2026 年 4 月 21 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 8,965 |
| 澳元 505,423 | 美元 353,856 | 2026 年 4 月 21 日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 7,776 |
| 澳元 281,169 | 美元 199,507 | 2026 年 4 月 21 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 6,982 |
| 澳元 223,095 | 美元 157,331 | 2026 年 4 月 21 日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 4,571 |
| 澳元 223,428 | 美元 157,355 | 2026 年 4 月 21 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 4,366 |
| 澳元 829,620 | 美元 571,335 | 2026 年 4 月 21 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 3,267 |
| 澳元 130,296 | 美元 91,612 | 2026 年 4 月 21 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 2,394 |
| 澳元 70,158 | 美元 49,709 | 2026 年 4 月 21 日 | 法国巴黎银行 | 1,670 |
| 澳元 51,639 | 美元 36,792 | 2026 年 4 月 21 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 1,433 |
| 澳元 289,995 | 美元 199,709 | 2026 年 4 月 21 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 1,140 |
| 澳元 83,150 | 美元 57,890 | 2026 年 4 月 21 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 955 |
| 澳元 47,607 | 美元 33,484 | 2026 年 4 月 21 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 885 |
| 澳元 30,958 | 美元 21,897 | 2026 年 4 月 21 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 700 |
| 澳元 35,543 | 美元 24,914 | 2026 年 4 月 21 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 577 |
| 澳元 247,005 | 美元 169,291 | 2026 年 4 月 21 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 158 |
| 澳元 7,527 | 美元 5,263 | 2026 年 4 月 21 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 109 |
| 澳元 1,559 | 美元 1,106 | 2026 年 4 月 21 日 | Citibank N.A., 伦敦 | 39 |
| 澳元 1,550 | 美元 1,096 | 2026 年 4 月 21 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 35 |
| 澳元 1,550 | 美元 1,096 | 2026 年 4 月 21 日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 35 |

未实现收益/
(亏损)
美元

| 交付合约 | 折算额 | 交割日期 | 交易对手 | 美元 |
|-------------------|---------------|------------|-------------------|---------|
| 澳元 1,554 | 美元 1,093 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 29 |
| 澳元 1,555 | 美元 1,090 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 25 |
| 澳元 1,579 | 美元 1,099 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 18 |
| 澳元 3,428 | 美元 2,349 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 2 |
| 加元 435,554 | 美元 321,441 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 9,077 |
| 加元 502,853 | 美元 368,863 | 2026年4月21日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 8,234 |
| 加元 672,640 | 美元 490,446 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 8,052 |
| 加元 585,231 | 美元 427,213 | 2026年4月21日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 7,505 |
| 加元 338,475 | 美元 249,799 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 7,057 |
| 加元 358,637 | 美元 263,780 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 6,578 |
| 加元 314,142 | 美元 231,048 | 2026年4月21日 | 高盛国际, 伦敦 | 5,756 |
| 加元 271,505 | 美元 199,166 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 4,452 |
| 加元 303,913 | 美元 221,591 | 2026年4月21日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 3,635 |
| 加元 185,776 | 美元 136,817 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 3,585 |
| 加元 231,054 | 美元 168,912 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 3,208 |
| 加元 187,890 | 美元 137,506 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 2,758 |
| 加元 155,328 | 美元 112,686 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 1,291 |
| 加元 102,127 | 美元 74,520 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 1,278 |
| 加元 257,071 | 美元 185,356 | 2026年4月21日 | 高盛国际, 伦敦 | 994 |
| 加元 46,280 | 美元 34,005 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 814 |
| 加元 42,611 | 美元 31,100 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 541 |
| 加元 218,059 | 美元 156,788 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 403 |
| 加元 22,845 | 美元 16,728 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 345 |
| 加元 4,075 | 美元 2,980 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 58 |
| 加元 4,858 | 美元 3,533 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 49 |
| 加元 3,463 | 美元 2,525 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 41 |
| 加元 1,496 | 美元 1,101 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 27 |
| 加元 1,498 | 美元 1,092 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 18 |
| 加元 1,514 | 美元 1,099 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 13 |
| 加元 1,518 | 美元 1,097 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 8 |
| 离岸人民币 468,517,226 | 美元 68,088,943 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 151,210 |
| 离岸人民币 167,436,137 | 美元 24,337,083 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 57,865 |
| 离岸人民币 46,576,305 | 美元 6,779,472 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 25,635 |
| 离岸人民币 52,836,404 | 美元 7,682,143 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 20,556 |
| 离岸人民币 40,296,497 | 美元 5,863,377 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 20,149 |
| 离岸人民币 42,368,629 | 美元 6,162,872 | 2026年4月21日 | 高盛国际, 伦敦 | 19,173 |
| 离岸人民币 25,624,094 | 美元 3,732,460 | 2026年4月21日 | 高盛国际, 伦敦 | 16,817 |
| 离岸人民币 19,659,745 | 美元 2,866,893 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 16,115 |
| 离岸人民币 46,121,477 | 美元 6,703,837 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 15,953 |
| 离岸人民币 14,402,627 | 美元 2,101,967 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 13,502 |
| 离岸人民币 46,516,723 | 美元 6,755,283 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 10,086 |
| 离岸人民币 15,629,541 | 美元 2,272,435 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 6,060 |
| 离岸人民币 24,832,883 | 美元 3,606,439 | 2026年4月21日 | 高盛国际, 伦敦 | 5,526 |
| 离岸人民币 40,128,756 | 美元 5,822,551 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 3,647 |
| 离岸人民币 9,791,681 | 美元 1,423,249 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 3,398 |
| 离岸人民币 2,777,278 | 美元 406,035 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 3,313 |
| 离岸人民币 33,919,856 | 美元 4,921,684 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 3,107 |
| 离岸人民币 7,709,733 | 美元 1,120,036 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 2,080 |
| 离岸人民币 4,119,708 | 美元 599,246 | 2026年4月21日 | 高盛国际, 伦敦 | 1,864 |
| 离岸人民币 4,868,396 | 美元 707,630 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 1,684 |
| 离岸人民币 1,194,657 | 美元 174,658 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 1,425 |
| 离岸人民币 2,691,016 | 美元 391,559 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 1,346 |
| 离岸人民币 8,420,574 | 美元 1,222,291 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 1,259 |
| 离岸人民币 1,809,442 | 美元 263,585 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 1,205 |
| 离岸人民币 3,879,279 | 美元 563,354 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 836 |
| 离岸人民币 3,725,917 | 美元 541,113 | 2026年4月21日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 833 |
| 离岸人民币 1,659,069 | 美元 241,329 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 754 |
| 离岸人民币 1,651,884 | 美元 240,280 | 2026年4月21日 | 高盛国际, 伦敦 | 748 |
| 离岸人民币 3,378,469 | 美元 490,626 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 728 |
| 离岸人民币 3,323,977 | 美元 482,717 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 721 |
| 离岸人民币 3,330,479 | 美元 483,656 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 718 |
| 离岸人民币 572,225 | 美元 83,659 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 683 |
| 离岸人民币 996,481 | 美元 145,510 | 2026年4月21日 | 高盛国际, 伦敦 | 654 |
| 离岸人民币 1,873,816 | 美元 272,362 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 648 |
| 离岸人民币 1,870,844 | 美元 271,922 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 639 |
| 离岸人民币 1,604,025 | 美元 233,215 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 622 |
| 离岸人民币 722,530 | 美元 105,254 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 483 |
| 离岸人民币 2,068,752 | 美元 300,427 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 446 |

| 交付合约 | 折算额 | 交割日期 | 交易对手 | 未实现收益/ (亏损) 美元 |
|-----------------|------------|------------|-------------------|----------------------|
| 离岸人民币 1,135,858 | 美元 165,094 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 388 |
| 离岸人民币 4,004,037 | 美元 580,973 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 364 |
| 离岸人民币 1,308,187 | 美元 190,048 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 353 |
| 离岸人民币 421,162 | 美元 61,416 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 345 |
| 离岸人民币 751,832 | 美元 109,362 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 342 |
| 离岸人民币 471,931 | 美元 68,748 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 315 |
| 离岸人民币 607,776 | 美元 88,367 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 236 |
| 离岸人民币 966,546 | 美元 140,370 | 2026年4月21日 | 高盛国际, 伦敦 | 215 |
| 离岸人民币 507,754 | 美元 73,824 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 197 |
| 离岸人民币 151,953 | 美元 22,215 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 181 |
| 离岸人民币 1,583,585 | 美元 229,805 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 176 |
| 离岸人民币 3,141,238 | 美元 455,647 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 149 |
| 离岸人民币 953,562 | 美元 138,415 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 143 |
| 离岸人民币 1,523,213 | 美元 221,013 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 138 |
| 离岸人民币 345,960 | 美元 50,301 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 134 |
| 离岸人民币 615,463 | 美元 89,379 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 134 |
| 离岸人民币 382,421 | 美元 55,586 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 133 |
| 离岸人民币 283,606 | 美元 41,221 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 97 |
| 离岸人民币 240,637 | 美元 34,987 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 93 |
| 离岸人民币 1,071,191 | 美元 155,421 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 92 |
| 离岸人民币 772,837 | 美元 112,152 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 86 |
| 离岸人民币 130,107 | 美元 18,931 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 65 |
| 离岸人民币 63,669 | 美元 9,292 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 60 |
| 离岸人民币 98,640 | 美元 14,358 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 54 |
| 离岸人民币 52,747 | 美元 7,698 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 49 |
| 离岸人民币 567,658 | 美元 82,363 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 49 |
| 离岸人民币 471,388 | 美元 68,403 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 49 |
| 离岸人民币 53,581 | 美元 7,813 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 44 |
| 离岸人民币 46,560 | 美元 6,795 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 44 |
| 离岸人民币 93,681 | 美元 13,627 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 43 |
| 离岸人民币 357,339 | 美元 51,856 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 40 |
| 离岸人民币 342,390 | 美元 49,687 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 38 |
| 离岸人民币 100,554 | 美元 14,616 | 2026年4月21日 | 高盛国际, 伦敦 | 35 |
| 离岸人民币 97,453 | 美元 14,165 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 34 |
| 离岸人民币 136,193 | 美元 19,778 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 29 |
| 离岸人民币 42,281 | 美元 6,159 | 2026年4月21日 | 高盛国际, 伦敦 | 28 |
| 离岸人民币 20,943 | 美元 3,057 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 20 |
| 离岸人民币 328,905 | 美元 47,709 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 16 |
| 离岸人民币 299,254 | 美元 43,408 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 14 |
| 离岸人民币 30,571 | 美元 4,445 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 12 |
| 离岸人民币 48,023 | 美元 6,974 | 2026年4月21日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 11 |
| 离岸人民币 8,632 | 美元 1,262 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 10 |
| 离岸人民币 7,526 | 美元 1,100 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 9 |
| 离岸人民币 7,556 | 美元 1,102 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 6 |
| 离岸人民币 7,556 | 美元 1,102 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 6 |
| 离岸人民币 7,562 | 美元 1,102 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 5 |
| 离岸人民币 7,562 | 美元 1,102 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 5 |
| 离岸人民币 54,939 | 美元 7,971 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 5 |
| 离岸人民币 7,583 | 美元 1,104 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 4 |
| 离岸人民币 7,583 | 美元 1,104 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 4 |
| 离岸人民币 7,583 | 美元 1,104 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 4 |
| 离岸人民币 44,258 | 美元 6,422 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 4 |
| 离岸人民币 7,574 | 美元 1,102 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 4 |
| 离岸人民币 36,684 | 美元 5,323 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 4 |
| 离岸人民币 7,601 | 美元 1,105 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 3 |
| 离岸人民币 7,569 | 美元 1,099 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 2 |
| 离岸人民币 14,554 | 美元 2,112 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 2 |
| 离岸人民币 7,547 | 美元 1,095 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 1 |
| 离岸人民币 7,547 | 美元 1,095 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 1 |
| 离岸人民币 7,585 | 美元 1,101 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 1 |
| 离岸人民币 7,585 | 美元 1,101 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 1 |
| 离岸人民币 7,585 | 美元 1,101 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 1 |
| 离岸人民币 7,587 | 美元 1,101 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 1 |
| 纽元 327,600 | 美元 194,601 | 2026年4月21日 | 高盛国际, 伦敦 | 7,595 |
| 纽元 296,925 | 美元 176,390 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 6,894 |
| 纽元 272,967 | 美元 161,769 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 5,949 |
| 纽元 374,453 | 美元 218,962 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 5,211 |
| 纽元 201,425 | 美元 118,339 | 2026年4月21日 | 高盛国际, 伦敦 | 3,358 |

未实现收益/
(亏损)
美元

| 交付合约 | 折算额 | 交割日期 | 交易对手 | 美元 |
|---------------------|-------------------|------------|-------------------|-----------|
| 纽元 194,735 | 美元 113,158 | 2026年4月21日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 1,996 |
| 纽元 125,895 | 美元 73,677 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 1,811 |
| 纽元 49,307 | 美元 29,276 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 1,130 |
| 纽元 171,585 | 美元 98,859 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 912 |
| 纽元 30,062 | 美元 18,070 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 910 |
| 纽元 75,919 | 美元 44,115 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 778 |
| 纽元 18,774 | 美元 11,285 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 568 |
| 纽元 30,706 | 美元 18,036 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 508 |
| 纽元 26,476 | 美元 15,455 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 342 |
| 纽元 144,528 | 美元 82,688 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | 186 |
| 纽元 1,855 | 美元 1,095 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 36 |
| 纽元 1,911 | 美元 1,093 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 2 |
| 美元 3,063,554 | 离岸人民币 21,158,415 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 4,540 |
| 美元 353,838 | 离岸人民币 2,443,783 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 524 |
| 美元 277,365 | 离岸人民币 1,915,208 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 351 |
| 美元 132,668 | 离岸人民币 916,270 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 197 |
| 美元 27,596 | 离岸人民币 190,636 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 48 |
| 美元 5,645 | 离岸人民币 45,886 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 9 |
| 美元 5,649 | 离岸人民币 39,013 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | 9 |
| 澳元 271,146,221 | 美元 191,243,009 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 5,596,241 |
| 澳元 47,609,425 | 美元 33,507,180 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 910,245 |
| 澳元 8,346,850 | 日元 933,992,482 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 171,129 |
| 澳元 15,782,904 | 欧元 9,492,865 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 145,995 |
| 澳元 5,526,814 | 日元 618,787,062 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 115,517 |
| 澳元 2,820,033 | 日元 315,503,260 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | 57,491 |
| 澳元 3,320,328 | 美元 2,274,900 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | 1,558 |
| 巴西雷亚尔 18,527,893 | 美元 3,547,760 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | 17,187 |
| 加元 175,120,994 | 美元 128,157,349 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 2,528,297 |
| 加元 15,902,488 | 欧元 10,085,036 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 226,827 |
| 加元 16,381,756 | 英镑 8,981,433 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 91,240 |
| 加元 1,493 | 美元 1,102 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | 31 |
| 加元 1,498 | 美元 1,093 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 19 |
| 瑞士法郎 60,756,367 | 美元 77,572,958 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | 1,731,971 |
| 智利比索 2,898,470,281 | 美元 3,151,652 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 45,379 |
| 智利比索 3,381,369,786 | 美元 3,666,634 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 42,840 |
| 离岸人民币 648,211,312 | 美元 94,386,189 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | 339,055 |
| 离岸人民币 332,038,692 | 美元 48,318,753 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | 144,205 |
| 离岸人民币 246,483,608 | 美元 35,878,369 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | 116,764 |
| 离岸人民币 229,133,941 | 美元 33,326,086 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 81,695 |
| 离岸人民币 199,176,949 | 美元 28,969,473 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 71,457 |
| 离岸人民币 155,969,324 | 美元 22,696,628 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 67,483 |
| 离岸人民币 96,922,214 | 美元 14,111,367 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 49,199 |
| 离岸人民币 527,083,598 | 美元 76,514,055 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 40,997 |
| 离岸人民币 271,539,547 | 美元 39,427,092 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 30,192 |
| 离岸人民币 34,268,880 | 美元 4,991,177 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 19,203 |
| 离岸人民币 52,468,583 | 美元 7,630,825 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 18,308 |
| 离岸人民币 103,051,600 | 美元 14,969,190 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 17,727 |
| 离岸人民币 14,163,989 | 美元 2,068,053 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 13,040 |
| 离岸人民币 81,554,910 | 美元 11,838,999 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 6,429 |
| 捷克克朗 366,219,846 | 美元 17,200,688 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 19,338 |
| 欧元 9,714,208 | 土耳其里拉 540,566,823 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 529,645 |
| 欧元 13,428,599 | 美元 15,563,049 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 70,233 |
| 英镑 231,047,984 | 美元 306,486,560 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 1,815,136 |
| 英镑 8,881,841 | 欧元 10,249,610 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 113,124 |
| 英镑 3,831,573 | 日元 813,247,507 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 72,520 |
| 英镑 4,224,310 | 日元 890,431,744 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 41,045 |
| 英镑 4,224,316 | 日元 888,738,990 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 30,370 |
| 英镑 3,831,573 | 加元 7,054,788 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 8,494 |
| 英镑 3,831,573 | 加元 7,043,504 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 399 |
| 印度盾 186,273,836,009 | 美元 11,017,296 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 62,431 |
| 印度卢比 386,046,880 | 美元 4,154,669 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 95,488 |
| 印度卢比 372,364,262 | 美元 3,971,885 | 2026年4月28日 | 渣打银行, 伦敦 | 56,573 |
| 日元 164,057,640 | 美元 1,034,296 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 418 |
| 韩元 5,961,646,808 | 美元 3,973,398 | 2026年4月28日 | 渣打银行, 伦敦 | 78,126 |
| 墨西哥比索 1,718,517,722 | 美元 96,135,576 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 1,091,351 |
| 墨西哥比索 597,682,654 | 美元 33,404,089 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 348,692 |
| 纽元 2,212,820 | 美元 1,303,130 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 39,629 |
| 纽元 9,009,303 | 加元 7,218,028 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 33,843 |

| 交付合约 | 折算额 | 交割日期 | 交易对手 | 未实现收益/ (亏损) 美元 |
|-------------------|-------------------|------------|-------------------|----------------------|
| 纽元 17,690,667 | 澳元 14,802,444 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 33,616 |
| 纽元 6,288,834 | 加元 5,044,588 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 28,018 |
| 菲律宾比索 583,559,979 | 美元 9,763,916 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 170,994 |
| 菲律宾比索 119,336,390 | 美元 1,993,925 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 32,199 |
| 波兰兹罗提 85,852,873 | 美元 23,180,430 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 152,585 |
| 波兰兹罗提 15,704,743 | 欧元 3,660,575 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 10,874 |
| 瑞典克朗 105,695,151 | 美元 11,399,575 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 288,500 |
| 瑞典克朗 33,761,545 | 欧元 3,118,625 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 48,801 |
| 新加坡元 71,828,242 | 美元 56,312,954 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 528,707 |
| 土耳其里拉 161,253,192 | 美元 3,510,941 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 9,509 |
| 土耳其里拉 160,484,499 | 美元 3,487,656 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 2,916 |
| 美元 52,449,686 | 巴西雷亚尔 276,930,148 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 320,594 |
| | 土耳其里拉 | | | |
| 美元 32,712,576 | 1,510,470,487 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 85,590 |
| 美元 20,593,492 | 离岸人民币 142,169,189 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 33,431 |
| 美元 15,037,566 | 离岸人民币 103,802,272 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 22,810 |
| 美元 6,569,562 | 离岸人民币 45,366,389 | 2026年4月28日 | 美国道富银行 | 12,518 |
| 美元 3,266,112 | 欧元 2,841,094 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 11,709 |
| 美元 2,343,596 | 台币 75,135,678 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | 11,201 |
| 美元 10,725,776 | 离岸人民币 73,999,272 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 10,568 |
| 美元 4,744,866 | 日元 754,483,400 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 9,829 |
| 美元 29,593,552 | 离岸人民币 204,038,282 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | 9,781 |
| 美元 18,023,573 | 离岸人民币 124,288,846 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 9,142 |
| 美元 4,488,190 | 欧元 3,897,473 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 8,395 |
| 美元 2,602,525 | 日元 414,070,535 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | 6,914 |
| 美元 13,508,857 | 欧元 11,714,960 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 6,904 |
| 美元 2,589,098 | 欧元 2,248,522 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 5,062 |
| 美元 1,765,593 | 欧元 1,533,585 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 3,732 |
| 美元 4,522,302 | 日元 717,958,570 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 2,216 |
| 美元 19,895,853 | 欧元 17,246,229 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 1,431 |
| 美元 4,088,732 | 日元 649,020,858 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 1,345 |
| 美元 11,223,415 | 欧元 9,729,054 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 1,170 |
| 美元 863,280 | 欧元 748,702 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 511 |
| 美元 619,895 | 日元 98,380,385 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 90 |
| 南非兰特 281,818,604 | 美元 16,702,044 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 272,078 |
| 南非兰特 65,353,986 | 美元 3,980,579 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | 170,455 |
| 南非兰特 35,646,850 | 美元 2,122,297 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 44,093 |
| 澳元 44,664 | 美元 30,570 | 2026年5月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 0 |
| 澳元 1,605 | 美元 1,098 | 2026年5月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 0 |
| 美元 1,682,885 | 离岸人民币 11,582,856 | 2026年5月21日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 156 |
| 美元 881,347 | 离岸人民币 6,065,867 | 2026年5月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 51 |
| 美元 196,349 | 离岸人民币 1,351,484 | 2026年5月21日 | 法国巴黎银行 | 28 |
| 美元 91,564 | 离岸人民币 630,187 | 2026年5月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | 5 |
| 美元 65,515 | 纽元 114,649 | 2026年5月21日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 1 |
| 美元 3,702 | 离岸人民币 25,477 | 2026年5月21日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | 0 |

未实现总收益 20,228,691

| | | | | |
|-----------------|------------|------------|-------------------|---------|
| 美元 571,476 | 澳元 829,620 | 2026年4月1日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (3,269) |
| 离岸人民币 190,636 | 美元 27,558 | 2026年4月2日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (44) |
| 离岸人民币 1,915,208 | 美元 276,980 | 2026年4月2日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (318) |
| 美元 2,350 | 澳元 3,428 | 2026年4月2日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (2) |
| 美元 30,588 | 澳元 44,664 | 2026年4月8日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (0) |
| 离岸人民币 7,601 | 美元 1,100 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (2) |
| 离岸人民币 7,765 | 美元 1,124 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (2) |
| 离岸人民币 7,593 | 美元 1,099 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (2) |
| 离岸人民币 7,593 | 美元 1,099 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (2) |
| 离岸人民币 7,593 | 美元 1,099 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (2) |
| 离岸人民币 8,784 | 美元 1,272 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (2) |
| 离岸人民币 37,044 | 美元 5,364 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (7) |
| 离岸人民币 40,236 | 美元 5,827 | 2026年4月21日 | 高盛国际, 伦敦 | (8) |
| 离岸人民币 33,770 | 美元 4,888 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (9) |
| 离岸人民币 84,472 | 美元 12,227 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (22) |
| 离岸人民币 152,504 | 美元 22,080 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (34) |
| 离岸人民币 148,064 | 美元 21,434 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (36) |
| 离岸人民币 357,976 | 美元 51,821 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (88) |
| 离岸人民币 402,257 | 美元 58,240 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (90) |
| 离岸人民币 448,510 | 美元 64,937 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (100) |

| 交付合约 | 折算额 | 交割日期 | 交易对手 | 未实现收益/ (亏损) 美元 |
|------------------|------------------|------------|-------------------|----------------------|
| 离岸人民币 519,091 | 美元 75,136 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (135) |
| 离岸人民币 801,925 | 美元 116,129 | 2026年4月21日 | 高盛国际, 伦敦 | (155) |
| 离岸人民币 640,000 | 美元 92,638 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (166) |
| 离岸人民币 803,164 | 美元 116,285 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (178) |
| 离岸人民币 1,391,636 | 美元 201,433 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (363) |
| 离岸人民币 1,632,089 | 美元 236,300 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (363) |
| 离岸人民币 1,519,206 | 美元 219,921 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (373) |
| 离岸人民币 2,134,605 | 美元 309,120 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (410) |
| 离岸人民币 1,793,890 | 美元 259,660 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (465) |
| 离岸人民币 2,768,847 | 美元 400,881 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (618) |
| 离岸人民币 18,504,487 | 美元 2,679,696 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (3,563) |
| 离岸人民币 16,495,980 | 美元 2,387,736 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (4,277) |
| 离岸人民币 33,985,602 | 美元 4,920,555 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (7,556) |
| 离岸人民币 50,838,026 | 美元 7,361,869 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (9,942) |
| 美元 1,129 | 离岸人民币 7,785 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (0) |
| 美元 1,456 | 离岸人民币 10,035 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (1) |
| 美元 1,707 | 离岸人民币 11,770 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (1) |
| 美元 1,464 | 澳元 2,136 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (1) |
| 美元 1,230 | 离岸人民币 8,466 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (2) |
| 美元 1,885 | 离岸人民币 12,978 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (4) |
| 美元 5,287 | 离岸人民币 36,436 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (4) |
| 美元 1,252 | 离岸人民币 8,609 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (4) |
| 美元 1,816 | 离岸人民币 12,488 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (5) |
| 美元 1,957 | 离岸人民币 13,463 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (5) |
| 美元 2,172 | 离岸人民币 14,940 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (5) |
| 美元 7,277 | 离岸人民币 50,149 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (5) |
| 美元 6,709 | 离岸人民币 46,230 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (6) |
| 美元 1,965 | 离岸人民币 13,491 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (9) |
| 美元 1,102 | 离岸人民币 7,536 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (9) |
| 美元 6,036 | 离岸人民币 41,480 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (21) |
| 美元 3,852 | 离岸人民币 26,416 | 2026年4月21日 | 美林国际, 伦敦 | (22) |
| 美元 1,296 | 澳元 1,853 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (27) |
| 美元 1,101 | 加元 1,496 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (27) |
| 美元 4,570 | 离岸人民币 31,312 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (30) |
| 美元 4,150 | 离岸人民币 28,366 | 2026年4月21日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (36) |
| 美元 46,799 | 离岸人民币 322,481 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (37) |
| 美元 1,894 | 加元 2,588 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (38) |
| 美元 1,893 | 纽元 3,234 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (47) |
| 美元 5,216 | 纽元 9,053 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (48) |
| 美元 16,519 | 离岸人民币 113,557 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (52) |
| 美元 2,074 | 澳元 2,945 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (58) |
| 美元 13,399 | 离岸人民币 91,976 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (62) |
| 美元 2,130 | 澳元 3,020 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (62) |
| 美元 25,124 | 离岸人民币 172,793 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (68) |
| 美元 1,959 | 澳元 2,760 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (69) |
| 美元 81,928 | 离岸人民币 564,523 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (69) |
| 美元 74,859 | 离岸人民币 515,699 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (79) |
| 美元 103,773 | 离岸人民币 715,076 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (83) |
| 美元 133,757 | 离岸人民币 921,809 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (89) |
| 美元 31,846 | 离岸人民币 218,920 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (101) |
| 美元 130,386 | 离岸人民币 898,424 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (110) |
| 美元 3,841 | 纽元 6,482 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (142) |
| 美元 6,831 | 澳元 9,699 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (190) |
| 美元 76,573 | 离岸人民币 526,738 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (193) |
| 美元 7,225 | 加元 9,789 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (204) |
| 美元 26,098 | 离岸人民币 178,501 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (215) |
| 美元 57,123 | 离岸人民币 392,440 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (217) |
| 美元 13,652 | 澳元 19,608 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (225) |
| 美元 1,592,599 | 离岸人民币 10,981,438 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (226) |
| 美元 127,615 | 离岸人民币 878,411 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (240) |
| 美元 69,212 | 离岸人民币 475,490 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (263) |
| 美元 213,250 | 离岸人民币 1,468,394 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (325) |
| 美元 8,013 | 澳元 11,213 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (335) |
| 美元 10,586 | 澳元 14,966 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (339) |
| 美元 10,853 | 纽元 18,379 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (362) |
| 美元 76,243 | 离岸人民币 522,816 | 2026年4月21日 | 美林国际, 伦敦 | (431) |
| 美元 123,153 | 离岸人民币 846,312 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (432) |
| 美元 23,151 | 纽元 39,604 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (543) |

未实现收益/
(亏损)
美元

| 交付合约 | 折算额 | 交割日期 | 交易对手 | 美元 |
|------------------------|---------------------|------------|-------------------|-------------|
| 美元 20,772 | 加元 28,206 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (544) |
| 美元 35,991 | 加元 49,365 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (589) |
| 美元 81,194 | 离岸人民币 555,026 | 2026年4月21日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (712) |
| 美元 192,262 | 离岸人民币 1,320,852 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (731) |
| 美元 38,030 | 加元 51,963 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (764) |
| 美元 275,218 | 离岸人民币 1,891,345 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (962) |
| 美元 57,357 | 加元 78,431 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (1,109) |
| 美元 319,901 | 离岸人民币 2,198,377 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (1,123) |
| 美元 215,767 | 离岸人民币 1,479,570 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (1,221) |
| 美元 111,122 | 纽元 192,176 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (1,420) |
| 美元 216,229 | 加元 299,177 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (1,670) |
| 美元 225,983 | 澳元 327,020 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (2,062) |
| 美元 256,807 | 离岸人民币 1,756,437 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (2,113) |
| 美元 62,287 | 纽元 105,269 | 2026年4月21日 | 美林国际, 伦敦 | (2,196) |
| 美元 97,599 | 纽元 166,929 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (2,310) |
| 美元 135,001 | 纽元 231,926 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (2,610) |
| 美元 111,607 | 纽元 190,836 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (2,671) |
| 美元 127,155 | 加元 173,468 | 2026年4月21日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (2,749) |
| 美元 133,657 | 澳元 190,667 | 2026年4月21日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (3,101) |
| 美元 65,624 | 纽元 109,420 | 2026年4月21日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (3,163) |
| 美元 122,147 | 加元 165,852 | 2026年4月21日 | 美林国际, 伦敦 | (3,204) |
| 美元 187,031 | 加元 255,830 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (3,559) |
| 美元 30,907,563 | 离岸人民币 213,116,761 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (4,388) |
| 美元 144,498 | 澳元 203,187 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (5,370) |
| 美元 332,338 | 加元 455,446 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (5,708) |
| 美元 208,428 | 澳元 294,654 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (6,668) |
| 美元 290,096 | 纽元 496,032 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (6,942) |
| 美元 2,880,797 | 离岸人民币 19,803,743 | 2026年4月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (9,138) |
| 美元 3,102,314 | 离岸人民币 21,319,294 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (10,892) |
| 美元 1,981,204 | 离岸人民币 13,585,612 | 2026年4月21日 | 美林国际, 伦敦 | (11,210) |
| 美元 81,901,700 | 离岸人民币 564,736,385 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (11,627) |
| 美元 731,065 | 加元 1,000,000 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (13,900) |
| 美元 820,554,985 | 离岸人民币 5,657,968,687 | 2026年4月21日 | 法国巴黎银行 | (116,487) |
| 美元 25,093,317 | 纽元 42,652,526 | 2026年4月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (745,677) |
| 美元 48,655,200 | 加元 66,329,079 | 2026年4月21日 | 渣打银行, 伦敦 | (1,086,297) |
| 美元 53,355,908 | 澳元 76,132,042 | 2026年4月21日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (1,225,787) |
| 巴西雷亚尔 27,438,441 | 美元 5,166,322 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | (62,196) |
| 离岸人民币 104,121,345 | 美元 15,084,335 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (22,334) |
| 离岸人民币 92,805,354 | 美元 13,440,581 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | (24,284) |
| 离岸人民币 205,747,392 | 美元 29,806,959 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (44,345) |
| 哥伦比亚比索 163,674,603,620 | 美元 44,276,228 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (162,921) |
| 欧元 4,466,240 | 瑞士法郎 4,078,410 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | (61,702) |
| 欧元 8,932,481 | 加元 14,252,220 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | (81,134) |
| 欧元 8,773,094 | 瑞士法郎 8,030,829 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (96,824) |
| 欧元 29,189,172 | 美元 33,543,934 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (132,139) |
| 欧元 9,492,865 | 瑞典克朗 102,819,594 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (143,111) |
| 欧元 10,216,210 | 瑞典克朗 110,002,022 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | (222,498) |
| 欧元 25,521,373 | 瑞典克朗 276,518,568 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (375,281) |
| 欧元 592,720,533 | 美元 681,761,323 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (2,071,025) |
| 匈牙利福林 7,313,760,004 | 美元 21,439,728 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | (340,993) |
| 日元 19,910,132,727 | 美元 125,457,317 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | (14,755) |
| 日元 806,041,351 | 澳元 7,360,638 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | (39,869) |
| 日元 870,060,868 | 纽元 9,383,948 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | (124,589) |
| 日元 1,749,588,337 | 英镑 8,238,067 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (162,224) |
| 墨西哥比索 19,828 | 美元 1,093 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (4) |
| 土耳其里拉 81,862,401 | 美元 1,776,046 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (1,504) |
| 土耳其里拉 169,640,078 | 欧元 3,178,450 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | (17,093) |
| 美元 472,238 | 日元 74,935,475 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (1) |
| 美元 4,250,807 | 英镑 3,223,522 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | (110) |
| 美元 3,232,161 | 加元 4,505,196 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (204) |
| 美元 440,273 | 日元 69,815,010 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (304) |
| 美元 5,040,035 | 澳元 7,360,638 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | (397) |
| 美元 4,296,493 | 土耳其里拉 197,816,976 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (1,120) |
| 美元 1,610,644 | 英镑 1,220,486 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (1,250) |
| 美元 3,201,728 | 印尼盾 54,390,001,824 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (3,023) |
| 美元 1,329,960 | 日元 210,444,255 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (3,757) |

未实现收益/
(亏损)
美元

| 交付合约 | 折算额 | 交割日期 | 交易对手 | 美元 |
|---------------|--------------------|------------|-------------------|-----------|
| 美元 4,137,494 | 印尼盾 70,281,949,228 | 2026年4月28日 | 渣打银行, 伦敦 | (4,174) |
| 美元 3,733,654 | 欧元 3,232,327 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (4,461) |
| 美元 4,944,035 | 离岸人民币 34,038,488 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | (5,488) |
| 美元 2,638,548 | 英镑 1,994,655 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | (8,296) |
| 美元 7,629,053 | 欧元 6,605,062 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (8,674) |
| 美元 4,673,456 | 欧元 4,042,131 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (9,977) |
| 美元 358,864 | 澳元 508,785 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (10,512) |
| 美元 33,180,284 | 离岸人民币 228,607,679 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (12,247) |
| 美元 12,871,737 | 离岸人民币 88,616,442 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (14,630) |
| 美元 1,754,899 | 英镑 1,319,226 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (15,301) |
| 美元 8,849,134 | 日元 1,401,529,733 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (16,805) |
| 美元 14,143,064 | 离岸人民币 97,362,906 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (16,958) |
| 美元 10,490,178 | 南非兰特 179,614,084 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (18,714) |
| 美元 4,664,534 | 南非兰特 79,643,141 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (21,356) |
| 美元 3,525,223 | 英镑 2,656,896 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (21,707) |
| 美元 2,950,077 | 墨西哥比索 52,906,678 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (24,024) |
| 美元 5,523,282 | 欧元 4,765,863 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (24,820) |
| 美元 4,071,277 | 新加坡元 5,206,736 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | (27,550) |
| 美元 6,177,152 | 欧元 5,329,392 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (28,537) |
| 美元 4,108,168 | 墨西哥比索 73,762,473 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (28,666) |
| 美元 2,355,143 | 英镑 1,764,064 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (28,960) |
| 美元 9,375,287 | 波兰兹罗提 34,843,762 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (29,336) |
| 美元 3,315,898 | 新加坡元 4,230,506 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (30,344) |
| 美元 2,121,124 | 英镑 1,583,818 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (32,622) |
| 美元 1,175,511 | 新加坡元 5,332,453 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (34,147) |
| 美元 3,904,064 | 英镑 2,933,820 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (35,382) |
| 美元 5,627,418 | 日元 887,303,188 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (35,704) |
| 美元 2,345,519 | 澳元 3,372,715 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (36,309) |
| 美元 3,532,815 | 新加坡元 4,501,647 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | (36,683) |
| 美元 7,224,373 | 离岸人民币 49,530,469 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | (38,138) |
| 美元 3,683,155 | 新加坡元 4,691,912 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | (39,257) |
| 美元 8,934,847 | 欧元 7,706,159 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (44,113) |
| 美元 3,713,984 | 英镑 2,780,666 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | (47,259) |
| 美元 2,800,092 | 加元 3,836,798 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (47,633) |
| 美元 12,385,793 | 欧元 10,693,540 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (48,463) |
| 美元 5,307,816 | 英镑 3,984,721 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (53,363) |
| 美元 3,061,790 | 加元 4,191,596 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (54,804) |
| 美元 5,099,576 | 英镑 3,825,577 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (54,979) |
| 美元 7,097,186 | 墨西哥比索 127,319,265 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (55,676) |
| 美元 5,056,241 | 英镑 3,789,517 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (59,194) |
| 美元 3,223,003 | 加元 4,402,068 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (65,029) |
| 美元 3,999,326 | 瑞典克朗 37,401,276 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | (67,562) |
| 美元 13,216,418 | 离岸人民币 90,590,482 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | (72,903) |
| 美元 14,474,412 | 离岸人民币 99,210,212 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (80,285) |
| 美元 3,740,173 | 瑞士法郎 2,931,343 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | (81,035) |
| 美元 26,102,884 | 离岸人民币 179,343,255 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (82,481) |
| 美元 11,966,264 | 欧元 10,298,521 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (84,674) |
| 美元 4,946,180 | 澳元 7,100,333 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | (84,767) |
| 美元 2,141,910 | 南非兰特 35,125,610 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (94,094) |
| 美元 4,332,420 | 澳元 6,177,720 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (102,696) |
| 美元 6,342,360 | 英镑 4,730,742 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (104,168) |
| 美元 5,125,886 | 瑞士法郎 4,019,012 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (109,031) |
| 美元 31,736,186 | 离岸人民币 217,983,612 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (109,564) |
| 美元 11,795,156 | 英镑 8,853,411 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | (120,605) |
| 美元 15,583,398 | 欧元 13,393,932 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (130,577) |
| 美元 4,072,998 | 澳元 5,757,439 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (131,029) |
| 美元 4,885,554 | 澳元 6,941,411 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (132,950) |
| 美元 4,293,565 | 瑞士法郎 3,332,780 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | (133,320) |
| 美元 5,121,395 | 加元 6,944,756 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | (139,336) |
| 美元 4,093,184 | 澳元 5,762,357 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (147,848) |
| 美元 6,384,182 | 韩元 9,514,281,993 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (167,658) |
| 美元 11,146,829 | 澳元 16,027,324 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (173,337) |
| 美元 38,690,884 | 欧元 33,375,724 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (184,711) |
| 美元 9,629,708 | 墨西哥比索 170,760,197 | 2026年4月28日 | HSBC Bank Plc, 伦敦 | (185,656) |
| 美元 76,322,827 | 离岸人民币 524,702,491 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (195,236) |
| 美元 37,868,618 | 离岸人民币 259,613,650 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | (202,013) |
| 美元 14,386,707 | 英镑 10,755,798 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (203,573) |
| 美元 49,319,280 | 离岸人民币 338,268,417 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (240,879) |
| 美元 51,793,014 | 日元 8,173,067,123 | 2026年4月28日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (286,995) |

| 交付合约 | 折算额 | 交割日期 | 交易对手 | 未实现收益/ (亏损) 美元 |
|------------------|-------------------|------------|-------------------|----------------------|
| | 智利比索 | | | |
| 美元 14,338,856 | 13,110,159,616 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (288,777) |
| 美元 17,371,853 | 南非兰特 292,481,659 | 2026年4月28日 | 法国巴黎银行 | (320,233) |
| 美元 34,628,287 | 欧元 29,648,877 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (421,844) |
| 美元 69,453,899 | 欧元 59,505,333 | 2026年4月28日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (801,525) |
| 美元 34,371,943 | 墨西哥比索 605,681,754 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | (874,149) |
| 美元 50,388,733 | 澳元 71,544,418 | 2026年4月28日 | 高盛国际, 伦敦 | (1,404,131) |
| 美元 77,113,404 | 纽元 132,046,462 | 2026年4月28日 | Citibank N.A., 伦敦 | (1,716,063) |
| 离岸人民币 7,610 | 美元 1,106 | 2026年5月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (0) |
| 离岸人民币 7,610 | 美元 1,106 | 2026年5月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (0) |
| 离岸人民币 7,610 | 美元 1,106 | 2026年5月21日 | 巴克莱银行, 伦敦 | (0) |
| 离岸人民币 25,279,642 | 美元 3,672,648 | 2026年5月21日 | Citibank N.A., 伦敦 | (598) |
| 美元 124,205 | 澳元 181,464 | 2026年5月21日 | 法国巴黎银行 | (5) |
| 美元 118,216 | 加元 164,612 | 2026年5月21日 | 摩根士丹利国际股份有限公司 | (6) |
| | | | 未实现总亏损 | (18,457,052) |
| | | | 未实现净亏损 | 1,771,639 |

(c) 期货

以下为于二零二六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/ (亏损) 美元 |
|-------------------------------------|---------------------------------------------|------------------------------|----------------------|
| 于 2026 年 3 月 31 日 | | | |
| 3 Month Euro Euribor 16/03/2026 | 3 个月欧元银行同业拆借利率 | Citigroup Global Markets Ltd | 101,725 |
| 3 Month Euro Euribor 19/06/2028 | 3 个月欧元银行同业拆借利率 | Citigroup Global Markets Ltd | 110,482 |
| Euro-Bund Future 08/06/2026 | 由联邦德国、意大利共和国、法兰西共和国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 10 年期债务工具 | Citigroup Global Markets Ltd | 3,060,762 |
| Euro-BUXL 30Y Bnd 08/06/026 | 由联邦德国、意大利共和国、法兰西共和国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 30 年期债务工具 | Citigroup Global Markets Ltd | 668,575 |
| ICE 3 Month Sonia Future 16/06/2026 | 3 个月英镑隔夜指数平均利率 | Citigroup Global Markets Ltd | 428,099 |
| ICE 3 Month Sonia Future 14/12/2027 | 3 个月英镑隔夜指数平均利率 | Citigroup Global Markets Ltd | 802,792 |
| US 2Yr Note (CBT) 30/06/2026 | 2 年期美国国债 | Citigroup Global Markets Ltd | 284,078 |
| US 5Yr Note (CBT) 30/06/2026 | 5 年期美国国债 | Citigroup Global Markets Ltd | 1,265,937 |
| US 10Yr Note (CBT) 18/06/2026 | 10 年期美国国债 | Citigroup Global Markets Ltd | 46,188 |
| US 10Yr Ultra Fut 18/06/2026 | 10 年期美国国债 | Citigroup Global Markets Ltd | 977,531 |
| US Long Bond (CBT) 18/06/2026 | 20 年期美国国债 | Citigroup Global Markets Ltd | 14,031 |
| | | 未实现总收益 | 7,760,200 |
| Euro-BOBL Future 08/06/2026 | 由联邦德国、意大利共和国、法兰西共和国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 5 年期债务工具 | Citigroup Global Markets Ltd | (2,564,071) |
| Euro-BTP Future 08/06/2026 | 由联邦德国、意大利共和国、法兰西共和国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 10 年期债务工具 | Citigroup Global Markets Ltd | (1,851,205) |
| Euro-OAT Future 08/06/2026 | 由联邦德国、意大利共和国、法兰西共和国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 5 年期债务工具 | Citigroup Global Markets Ltd | (2,325,600) |

| | 标的资产 | 交易对手 | 未实现收益/ (亏损) 美元 |
|-------------------------------------|--------------------------------------------|------------------------------|----------------------|
| Euro-Schatz Future 08/06/2026 | 由联邦德国、意大利共和国、法兰西共和国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 2 年期债务工具 | Citigroup Global Markets Ltd | (27,428) |
| ICE 3 Month Sonia Future 16/03/2027 | 3 个月英镑隔夜指数平均利率 | Citigroup Global Markets Ltd | (1,102,169) |
| ICE 3 Month Sonia Future 14/09/2027 | 3 个月英镑隔夜指数平均利率 | Citigroup Global Markets Ltd | (1,080,015) |
| Jpn 10Y Bond (OSE) 15/06/2026 | 10 年期日本政府债券 | Citigroup Global Markets Ltd | (525,490) |
| Long Gilt Future 26/06/2026 | 10 年期英国国债 | Citigroup Global Markets Ltd | (686,383) |
| Short Euro-BTP Future 08/06/2026 | 由联邦德国、意大利共和国、法兰西共和国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 5 年期债务工具 | Citigroup Global Markets Ltd | (1,179,157) |
| | | 未实现总亏损 | (11,341,518) |
| | | 未实现净亏损 | (3,581,318) |

(d) 利率掉期

以下为于二零二六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 | 公允价值 美元 |
|----------------------------|--------------------|------------------------------|-------------|
| 于 2026 年 3 月 31 日 | | | |
| (D) Interest Rate Swap | | | |
| ~619~ 73 58,809,650,000.00 | | | |
| KRW 17/06/2026 17/06/2036 | KRW/CD/91D/Reuters | Citigroup Global Markets Ltd | (1,308,373) |
| | | 总金融负债 | (1,308,373) |

抵押品持有情况
 于二零二六年三月三十一日 *(未经审计)*

| 抵押品提供方 | 抵押品的性质 | 到期期限 | 计价货币 | 抵押品所涵盖资产净值 百分比 | 抵押品价值 美元 |
|-------------------|--------|------|------|-------------------|-------------|
| 高盛国际, 伦敦 | 现金 | 不适用 | 美元 | 0.0 | 510,000 |
| HSBC Bank Plc, 伦敦 | 现金 | 不适用 | 美元 | 0.0 | 406,000 |
| | | | | 0.0 | 916,000 |

现金抵押品再投资详情

截至二零二六年三月三十一日止期间, 未进行现金抵押品再投资。

托管/保管安排

| 现金抵押品的托管机构 | 收到/持有的抵押品 金额 31.3.2026 美元 | 计划下提供的抵押品 所占比例 31.3.2026 百分比 |
|-----------------------|------------------------------------|---------------------------------------|
| 隔离账户 摩根大通银行 | 916,000 | 100.0 |

财务状况表

于二零二六年三月三十一日 (未经审计)

| | 31.3.2026 美元 | 30.9.2025 美元 |
|------------------------------|----------------------|----------------------|
| 资产 | | |
| 流动资产 | | |
| 银行现金 | 151,372,612 | 113,960,766 |
| 现金抵押品 | 916,000 | - |
| 应收经纪款项 | 39,628,412 | 71,454,165 |
| 分配应收款项 | 12,568,266 | 17,714,790 |
| 保证金 | 34,498,011 | 33,835,620 |
| 衍生性产品 | 27,988,891 | 12,112,052 |
| 投资 | 2,790,730,869 | 4,173,762,505 |
| 股息、利息及其他应收款项 | 2,222,699 | 23,382,311 |
| 总资产 | 3,059,925,760 | 4,446,222,209 |
| 负债 | | |
| 流动负债 | | |
| 应付经纪款项 | 64,098,467 | 54,539,791 |
| 赎回应付款项 | 75,430,220 | 102,419,104 |
| 应付收益分配 [附注 6] | 8,170,456 | 8,875,971 |
| 衍生性产品 | 39,953,698 | 18,673,938 |
| 其他应付款项 | 2,395,794 | 3,602,834 |
| 总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产) | 190,048,635 | 188,111,638 |
| 可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3] | 2,869,877,125 | 4,258,110,571 |

综合收益表

截至二零二六年三月三十一日止期间 (未经审计)

| | 1.10.2025 至 31.3.2026 美元 | 1.10.2024 至 31.3.2025 美元 |
|-------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 收入 | | |
| 投资及衍生性产品净收益 / (亏损) [附注 4] | 24,476,371 | (8,080,873) |
| 汇兑净收益 / (亏损) | 919,389 | (328,298) |
| 存款利息 | 882,105 | 1,093,903 |
| 其他收入 | 86,834 | 17,709 |
| | 26,364,699 | (7,297,559) |
| 支出 | | |
| 管理费用 [附注 5(a)] | 14,824,002 | 14,626,775 |
| 托管费用及银行费用 [附注 5(a)] | 487,217 | 727,842 |
| 受托人费用 [附注 5(b)] | 354,052 | 342,454 |
| 交易成本 [附注 5(a)] | 280,539 | 288,786 |
| 基金注册登记机构费用 [附注 5(a)] | 150,274 | 87,250 |
| 核数师酬金 | 19,702 | 40,738 |
| 法律及专业费用 | 14,879 | 5,327 |
| 印刷及出版支出 | 6,981 | 2,699 |
| 其他经营费用 | 6,181 | 6,805 |
| | 16,143,827 | 16,128,676 |
| 净营业利润 / (亏损) | 10,220,872 | (23,426,235) |
| 财务成本 | | |
| 收益分配 [附注 6] | (48,259,741) | (40,058,804) |
| 除税前亏损 | (38,038,869) | (63,485,039) |
| 税项 | 210,205 | (247,802) |
| 可赎回份额持有人应占净资产及总综合亏损之减少 | (37,828,664) | (63,732,841) |

可赎回份额持有人应占净资产变动表

截至二零二六年三月三十一日止期间(未经审计)

| | 1.10.2025 至 31.3.2026 美元 | 1.10.2024 至 31.3.2025 美元 |
|------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 期初可赎回份额持有人应占净资产 | 4,258,110,571 | 1,980,473,153 |
| 分配可赎回份额 [附注 3] | 1,030,247,395 | 4,615,897,704 |
| 赎回可赎回份额 [附注 3] | (2,380,652,177) | (729,205,375) |
| 净(赎回) / 分配 | (1,350,404,782) | 3,886,692,329 |
| | 2,907,705,789 | 5,867,165,482 |
| 可赎回份额持有人应占净资产及总综合亏损之减少 | (37,828,664) | (63,732,841) |
| 期末可赎回份额持有人应占净资产 | 2,869,877,125 | 5,803,432,641 |

现金流量表

截至二零二六年三月三十一日止期间(未经审计)

| | 1.10.2025 至 31.3.2026 美元 | 1.10.2024 至 31.3.2025 美元 |
|-----------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 经营业务 | | |
| 购入投资及衍生性产品 | (3,250,929,856) | (6,957,905,231) |
| 出售投资及衍生性产品所得款项 | 4,703,393,106 | 3,272,388,909 |
| 已收股息 | 23,012,630 | - |
| 已收利息 | 882,105 | 1,093,891 |
| 已返还 / (支付) 税项 | 210,205 | (247,802) |
| 已付交易成本 | (279,983) | (289,146) |
| 已付基金注册登记机构费用 | (337,086) | (162,090) |
| 已付受托人费用 | (371,852) | (285,252) |
| 保证金之增加 | (662,391) | (64,253,395) |
| 现金抵押品之增加 | (916,000) | - |
| 已付管理费用 | (15,688,522) | (12,102,958) |
| 其他 | 515,586 | (538,666) |
| 经营业务所产生 / (运用) 之现金净额 | 1,458,827,942 | (3,762,301,740) |
| 融资活动 | | |
| 分配可赎回份额所得款项 | 1,035,393,919 | 4,623,298,453 |
| 赎回可赎回份额付款 | (2,407,641,061) | (734,234,168) |
| 已付收益分配 | (48,965,256) | (38,963,023) |
| 融资活动所(运用) / 产生之现金净额 | (1,421,212,398) | 3,850,101,262 |
| 现金及现金等价物之增加 | 37,615,544 | 87,799,522 |
| 期初现金及现金等价物 | 113,960,766 | 24,708,480 |
| 现金及现金等价物之汇兑亏损 | (203,698) | (855,727) |
| 期末现金及现金等价物 | 151,372,612 | 111,652,275 |
| 现金及现金等价物余额分析: | | |
| 银行现金 | 151,372,612 | 111,652,275 |

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) 中期财务报表的重要会计政策

编制本未经审计简明中期财务报表所使用的重要会计政策和计算方法与截至二零二五年九月三十日止年度财务报表所采纳的会计政策和计算方法一致。

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公允价值为负数的衍生性产品合约列示为按公允价值透过损益列账的负债。

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。

确认、取消确认及计量

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

公允价值估计

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

债务证券的公允价值按包括应计利息的报价计算。

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

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

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

结构性主体

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

(c) 外币交易

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

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

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

(d) 分配份额所得款项及赎回份额支付款项

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

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

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

1.10.2025 至 31.3.2026

| | 澳元对冲类别 (每月派息) 份额 | 加元对冲类别 (每月派息) 份额 | 港元类别 (每月派息) 份额 | 纽元对冲类别 (每月派息) 份额 | PRC 人民币份额 (累计) 份额 |
|----------|------------------------|------------------------|----------------------|------------------------|-------------------------|
| 已发行份额数目: | | | | | |
| 期初 | 10,553,148.205 | 9,787,544.919 | 275,992,490.393 | 6,227,655.462 | 1,278,200,191.030 |
| 总分配 | 1,438,906.784 | 1,183,388.744 | 71,324,435.997 | 984,859.631 | 26,035,685.550 |
| 总赎回 | (2,824,037.808) | (2,719,748.113) | (62,536,165.653) | (1,756,930.404) | (913,242,395.190) |
| 期末 | 9,168,017.181 | 8,251,185.550 | 284,780,760.737 | 5,455,584.689 | 390,993,481.390 |

| | PRC 人民币份额 (每月派息) 份额 | PRC 人民币 对冲份额 (累计) 份额 | PRC 人民币 对冲份额 (每月派息) 份额 | PRC 美元份额 (累计) 份额 | PRC 美元份额 (每月派息) 份额 |
|----------|---------------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------|--------------------------|
| 已发行份额数目: | | | | | |
| 期初 | 310,784,063.280 | 272,725,303.130 | 35,438,371.920 | 4,109,352.850 | 9,602,021.390 |
| 总分配 | 40,763,075.820 | 308,400,851.190 | 4,212,438.080 | 685,426.040 | 1,867,703.480 |
| 总赎回 | (135,286,032.610) | (159,735,314.450) | (14,539,037.470) | (1,063,813.590) | (2,330,683.900) |
| 期末 | 216,261,106.490 | 421,390,839.870 | 25,111,772.530 | 3,730,965.300 | 9,139,040.970 |

1.10.2025 至 31.3.2026

| | 人民币对冲类别 (累计) 份额 | 人民币对冲类别 (每月派息) 份额 | 美元类别 (每月派息) 份额 | 美元类别 (每半年派息) 份额 | 美元 X 类别 (累计) 份额 |
|-------------------------|-----------------------|-------------------------|----------------------|-----------------------|-----------------------|
| 已发行份额数目: | | | | | |
| 期初 | 1,111,152.156 | 90,041,251.412 | 66,923,399.238 | 1,285,171.764 | 15,828,698.008 |
| 总分配 | 47,204.326 | 5,308,642.776 | 13,089,855.560 | 2,757,137.501 | 3,420,337.819 |
| 总赎回 | (378,945.140) | (25,649,257.690) | (25,486,805.825) | (2,553,935.188) | (6,632,930.434) |
| 期末 | 779,411.342 | 69,700,636.498 | 54,526,448.973 | 1,488,374.077 | 12,616,105.393 |
| 美元 X 类别 (每月派息) 份额 | | | | | |
| 已发行份额数目: | | | | | |
| 期初 | - | | | | |
| 总分配 | 13,995,928.086 | | | | |
| 总赎回 | - | | | | |
| 期末 | 13,995,928.086 | | | | |

1.10.2024 至 31.3.2025

| | 澳元对冲类别 (每月派息) 份额 | 加元对冲类别 (每月派息) 份额 | 港元类别 (每月派息) 份额 | 纽元对冲类别 (每月派息) 份额 | PRC 人民币份额 (累计) 份额 |
|---------------------------------|------------------------|------------------------|----------------------|------------------------|-------------------------|
| 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 |
| PRC 人民币份额 (每月派息) 份额 | | | | | |
| PRC 人民币 对冲份额 (累计) 份额 | | | | | |
| PRC 人民币 对冲份额 (每月派息) 份额 | | | | | |
| PRC 美元份额 (累计) 份额 | | | | | |
| PRC 美元份额 (每月派息) 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 | 147,376,987.060 | 225,757,935.300 | 5,135,947.120 | 1,445,432.850 | 1,108,902.990 |
| 总赎回 | (30,338,186.760) | (79,228,440.270) | (12,729,856.940) | (602,791.350) | (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 |

1.10.2024 至 31.3.2025

| | 人民币对冲类别 (累计) 份额 | 人民币对冲类别 (每月派息) 份额 | 美元类别 (每月派息) 份额 | 美元类别 (每半年派息) 份额 | 美元 X 类别 (累计) 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 | 308,957.233 | 9,623,914.075 | 18,232,938.642 | 1,501,881.689 | 1,503,496.057 |
| 总赎回 | (1,459,839.311) | (35,137,935.434) | (23,211,224.005) | (1,093,549.346) | (490,588.000) |
| 期末 | 1,587,600.510 | 103,633,102.493 | 62,295,719.317 | 998,214.318 | 14,225,023.008 |

31.3.2026

| | 澳元对冲类别 (每月派息) 澳元 | 加元对冲类别 (每月派息) 加元 | 港元类别 (每月派息) 港元 | 纽元对冲类别 (每月派息) 纽元 | PRC 人民币份额 (累计) 人民币 |
|------------------------|----------------------------|--------------------------------|----------------------------------|------------------------|--------------------------|
| 可赎回份额持有人应占净资产 | 70,357,644 | 63,710,941 | 2,229,085,889 | 41,914,251 | 4,270,430,319 |
| 可赎回份额持有人应占净资产 (每份额) | 7.67 | 7.72 | 7.83 | 7.68 | 10.92 |
| | PRC 人民币份额 (每月派息) 人民币 | PRC 人民币 对冲份额 (累计) 人民币 | PRC 人民币 对冲份额 (每月派息) 人民币 | PRC 美元份额 (累计) 美元 | PRC 美元份额 (每月派息) 美元 |
| 可赎回份额持有人应占净资产 | 1,752,946,789 | 4,497,848,793 | 198,448,392 | 40,680,633 | 72,268,295 |
| 可赎回份额持有人应占净资产 (每份额) | 8.11 | 10.67 | 7.90 | 10.90 | 7.91 |
| | 人民币对冲类别 (累计) 人民币 | 人民币对冲类别 (每月派息) 人民币 | 美元类别 (每月派息) 美元 | 美元类别 (每半年派息) 美元 | 美元 X 类别 (累计) 美元 |
| 可赎回份额持有人应占净资产 | 9,948,399 | 531,093,863 | 421,969,773 | 25,927,550 | 142,232,582 |
| 可赎回份额持有人应占净资产 (每份额) | 12.76 | 7.62 | 7.74 | 17.42 | 11.27 |
| | 美元 X 类别 (每月派息) 美元 | | | | |
| 可赎回份额持有人应占净资产 | 134,327,744 | | | | |
| 可赎回份额持有人应占净资产 (每份额) | 9.60 | | | | |

30.9.2025

| | 澳元对冲类别 (每月派息) 澳元 | 加元对冲类别 (每月派息) 加元 | 港元类别 (每月派息) 港元 | 纽元对冲类别 (每月派息) 纽元 | PRC 人民币份额 (累计) 人民币 |
|------------------------|----------------------------|--------------------------------|----------------------------------|------------------------|--------------------------|
| 可赎回份额持有人应占净资产 | 84,071,479 | 78,381,407 | 2,224,990,820 | 49,654,690 | 14,474,417,799 |
| 可赎回份额持有人应占净资产 (每份额) | 7.97 | 8.01 | 8.06 | 7.97 | 11.32 |
| | PRC 人民币份额 (每月派息) 人民币 | PRC 人民币 对冲份额 (累计) 人民币 | PRC 人民币 对冲份额 (每月派息) 人民币 | PRC 美元份额 (累计) 美元 | PRC 美元份额 (每月派息) 美元 |
| 可赎回份额持有人应占净资产 | 2,700,196,492 | 2,962,712,166 | 290,668,244 | 45,044,278 | 78,813,814 |
| 可赎回份额持有人应占净资产 (每份额) | 8.69 | 10.86 | 8.20 | 10.96 | 8.21 |
| | 人民币对冲类别 (累计) 人民币 | 人民币对冲类别 (每月派息) 人民币 | 美元类别 (每月派息) 美元 | 美元类别 (每半年派息) 美元 | 美元 X 类别 (累计) 美元 |
| 可赎回份额持有人应占净资产 | 14,421,096 | 711,832,320 | 537,514,608 | 23,245,952 | 178,617,426 |
| 可赎回份额持有人应占净资产 (每份额) | 12.98 | 7.91 | 8.03 | 18.09 | 11.28 |

4 投资及衍生性产品净收益 / (亏损)

| | 1.10.2025 至 31.3.2026 美元 | 1.10.2024 至 31.3.2025 美元 |
|-------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 投资及衍生性产品价值未实现收益 / 亏损之变动 | (124,573,391) | 2,272,936 |
| 投资及衍生性产品销售之实现收益 / (亏损) | 149,049,762 | (10,353,809) |
| | 24,476,371 | (8,080,873) |

5 与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之交易

(a) 截至二零二六年及二零二五年三月三十一日止期间，已付管理人摩根基金（亚洲）有限公司及其关联人士的金额列示如下：

| | 1.10.2025 至 31.3.2026 美元 | 1.10.2024 至 31.3.2025 美元 |
|------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 管理费用 | 14,824,002 | 14,626,775 |
| 托管费用及银行费用 | 298,562 | 562,696 |
| 基金注册登记机构费用 | 150,274 | 87,250 |
| 交易成本 | 5,660 | 18,482 |

(b) 截至二零二六年及二零二五年三月三十一日止期间，已付受托人东亚银行（信托）有限公司及其关联人士的金额列示如下：

| | 1.10.2025 至 31.3.2026 美元 | 1.10.2024 至 31.3.2025 美元 |
|-------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 受托人费用 | 354,052 | 342,454 |

6 收益分配

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

| 收益分配类别 | 除息日 | 支付日 | 比率 | 份额 | 美元 |
|-----------------------------|------------------|------------------|------------|-----------------|-------------|
| <u>1.10.2025 至 1.3.2026</u> | | | | | |
| 澳元对冲类别（每月派息） | 2025 年 10 月 31 日 | 2025 年 11 月 10 日 | 澳元 0.0385 | 10,427,237.933 | (262,808) |
| 加元对冲类别（每月派息） | 2025 年 10 月 31 日 | 2025 年 11 月 10 日 | 加元 0.0301 | 9,602,372.747 | (206,281) |
| 港元类别（每月派息） | 2025 年 10 月 31 日 | 2025 年 11 月 10 日 | 港元 0.0426 | 282,697,714.126 | (1,549,487) |
| 纽元对冲类别（每月派息） | 2025 年 10 月 31 日 | 2025 年 11 月 10 日 | 纽元 0.0319 | 6,153,506.391 | (112,409) |
| PRC 人民币份额（每月派息） | 2025 年 10 月 31 日 | 2025 年 11 月 10 日 | 人民币 0.0460 | 315,239,844.410 | (2,036,019) |
| PRC 人民币对冲份额（每月派息） | 2025 年 10 月 31 日 | 2025 年 11 月 10 日 | 人民币 0.0248 | 32,438,765.880 | (112,953) |
| PRC 美元份额（每月派息） | 2025 年 10 月 31 日 | 2025 年 11 月 10 日 | 美元 0.0434 | 9,777,398.670 | (424,339) |
| 人民币对冲类别（每月派息） | 2025 年 10 月 31 日 | 2025 年 11 月 10 日 | 人民币 0.0240 | 88,166,273.554 | (297,096) |
| 美元类别（每月派息） | 2025 年 10 月 31 日 | 2025 年 11 月 10 日 | 美元 0.0425 | 66,438,753.551 | (2,823,646) |
| 美元 X 类别（每月派息） | 2025 年 10 月 31 日 | 2025 年 11 月 10 日 | 美元 0.0525 | 7,237,451.658 | (379,966) |
| 澳元对冲类别（每月派息） | 2025 年 11 月 28 日 | 2025 年 12 月 8 日 | 澳元 0.0395 | 10,280,309.598 | (266,302) |
| 加元对冲类别（每月派息） | 2025 年 11 月 28 日 | 2025 年 12 月 8 日 | 加元 0.0301 | 8,964,312.894 | (193,555) |
| 港元类别（每月派息） | 2025 年 11 月 28 日 | 2025 年 12 月 8 日 | 港元 0.0427 | 282,747,834.210 | (1,550,726) |
| 纽元对冲类别（每月派息） | 2025 年 11 月 28 日 | 2025 年 12 月 8 日 | 纽元 0.0319 | 6,240,697.160 | (114,281) |
| PRC 人民币份额（每月派息） | 2025 年 11 月 28 日 | 2025 年 12 月 8 日 | 人民币 0.0459 | 320,357,674.880 | (2,080,142) |
| PRC 人民币对冲份额（每月派息） | 2025 年 11 月 28 日 | 2025 年 12 月 8 日 | 人民币 0.0266 | 31,306,196.930 | (117,803) |
| PRC 美元份额（每月派息） | 2025 年 11 月 28 日 | 2025 年 12 月 8 日 | 美元 0.0435 | 10,168,374.410 | (442,324) |
| 人民币对冲类别（每月派息） | 2025 年 11 月 28 日 | 2025 年 12 月 8 日 | 人民币 0.0257 | 86,779,148.523 | (315,496) |
| 美元类别（每月派息） | 2025 年 11 月 28 日 | 2025 年 12 月 8 日 | 美元 0.0425 | 64,249,758.399 | (2,730,614) |
| 美元 X 类别（每月派息） | 2025 年 11 月 28 日 | 2025 年 12 月 8 日 | 美元 0.0526 | 7,275,677.635 | (382,701) |
| 澳元对冲类别（每月派息） | 2025 年 12 月 31 日 | 2026 年 1 月 9 日 | 澳元 0.0406 | 9,943,870.754 | (269,221) |
| 加元对冲类别（每月派息） | 2025 年 12 月 31 日 | 2026 年 1 月 9 日 | 加元 0.0297 | 8,826,997.963 | (191,254) |
| 港元类别（每月派息） | 2025 年 12 月 31 日 | 2026 年 1 月 9 日 | 港元 0.0427 | 287,367,015.583 | (1,576,485) |
| 纽元对冲类别（每月派息） | 2025 年 12 月 31 日 | 2026 年 1 月 9 日 | 纽元 0.0315 | 5,845,102.117 | (105,879) |
| PRC 人民币份额（每月派息） | 2025 年 12 月 31 日 | 2026 年 1 月 9 日 | 人民币 0.0454 | 292,264,947.630 | (1,900,992) |
| PRC 人民币对冲份额（每月派息） | 2025 年 12 月 31 日 | 2026 年 1 月 9 日 | 人民币 0.0264 | 30,101,475.570 | (113,852) |
| PRC 美元份额（每月派息） | 2025 年 12 月 31 日 | 2026 年 1 月 9 日 | 美元 0.0435 | 10,073,766.390 | (438,209) |
| 人民币对冲类别（每月派息） | 2025 年 12 月 31 日 | 2026 年 1 月 9 日 | 人民币 0.0254 | 82,481,424.360 | (300,149) |
| 美元类别（每月派息） | 2025 年 12 月 31 日 | 2026 年 1 月 9 日 | 美元 0.0425 | 61,254,028.819 | (2,603,296) |
| 美元 X 类别（每月派息） | 2025 年 12 月 31 日 | 2026 年 1 月 9 日 | 美元 0.0526 | 12,666,285.305 | (666,247) |
| 澳元对冲类别（每月派息） | 2026 年 1 月 30 日 | 2026 年 2 月 9 日 | 澳元 0.0413 | 10,226,141.977 | (295,870) |
| 加元对冲类别（每月派息） | 2026 年 1 月 30 日 | 2026 年 2 月 9 日 | 加元 0.0310 | 8,504,208.920 | (194,683) |
| 港元类别（每月派息） | 2026 年 1 月 30 日 | 2026 年 2 月 9 日 | 港元 0.0428 | 282,650,296.779 | (1,549,027) |
| 纽元对冲类别（每月派息） | 2026 年 1 月 30 日 | 2026 年 2 月 9 日 | 纽元 0.0322 | 5,516,435.928 | (107,439) |
| PRC 人民币份额（每月派息） | 2026 年 1 月 30 日 | 2026 年 2 月 9 日 | 人民币 0.0448 | 265,938,492.310 | (1,713,930) |
| PRC 人民币对冲份额（每月派息） | 2026 年 1 月 30 日 | 2026 年 2 月 9 日 | 人民币 0.0281 | 28,864,042.610 | (116,688) |
| PRC 美元份额（每月派息） | 2026 年 1 月 30 日 | 2026 年 2 月 9 日 | 美元 0.0434 | 10,072,194.470 | (437,133) |
| 人民币对冲类别（每月派息） | 2026 年 1 月 30 日 | 2026 年 2 月 9 日 | 人民币 0.0271 | 75,633,558.037 | (294,861) |

| 收益分配类别 | 除息日 | 支付日 | 比率 | 份额 | 美元 |
|--------------------|------------|------------|------------|-----------------|-------------|
| 美元类别 (每月派息) | 2026年1月30日 | 2026年2月9日 | 美元 0.0425 | 57,586,966.617 | (2,447,445) |
| 美元 X 类别 (每月派息) | 2026年1月30日 | 2026年2月9日 | 美元 0.0526 | 12,733,582.941 | (669,787) |
| 澳元对冲类别 (每月派息) | 2026年2月27日 | 2026年3月9日 | 澳元 0.0427 | 9,564,920.121 | (291,062) |
| 加元对冲类别 (每月派息) | 2026年2月27日 | 2026年3月9日 | 加元 0.0327 | 8,303,386.547 | (199,084) |
| 港元类别 (每月派息) | 2026年2月27日 | 2026年3月9日 | 港元 0.0429 | 279,681,234.119 | (1,533,891) |
| 纽元对冲类别 (每月派息) | 2026年2月27日 | 2026年3月9日 | 纽元 0.0336 | 5,363,696.817 | (108,141) |
| PRC 人民币份额 (每月派息) | 2026年2月27日 | 2026年3月9日 | 人民币 0.0445 | 247,529,757.810 | (1,605,485) |
| PRC 人民币对冲份额 (每月派息) | 2026年2月27日 | 2026年3月9日 | 人民币 0.0292 | 26,092,802.700 | (111,051) |
| PRC 美元份额 (每月派息) | 2026年2月27日 | 2026年3月9日 | 美元 0.0435 | 9,822,087.960 | (427,261) |
| 人民币对冲类别 (每月派息) | 2026年2月27日 | 2026年3月9日 | 人民币 0.0282 | 17,566,924.917 | (294,158) |
| 美元类别 (每月派息) | 2026年2月27日 | 2026年3月9日 | 美元 0.0425 | 56,332,453.361 | (2,394,129) |
| 美元 X 类别 (每月派息) | 2026年2月27日 | 2026年3月9日 | 美元 0.0527 | 13,920,838.202 | (733,628) |
| 澳元对冲类别 (每月派息) | 2026年3月31日 | 2026年4月13日 | 澳元 0.0438 | 9,174,017.181 | (275,208) |
| 加元对冲类别 (每月派息) | 2026年3月31日 | 2026年4月13日 | 加元 0.0322 | 8,251,185.550 | (190,382) |
| 港元类别 (每月派息) | 2026年3月31日 | 2026年4月13日 | 港元 0.0429 | 281,314,867.934 | (1,539,299) |
| 纽元对冲类别 (每月派息) | 2026年3月31日 | 2026年4月13日 | 纽元 0.0333 | 5,455,584.689 | (103,634) |
| PRC 人民币份额 (每月派息) | 2026年3月31日 | 2026年4月13日 | 人民币 0.0445 | 216,584,701.940 | (1,395,459) |
| PRC 人民币对冲份额 (每月派息) | 2026年3月31日 | 2026年4月13日 | 人民币 0.0273 | 25,032,393.390 | (98,945) |
| PRC 美元份额 (每月派息) | 2026年3月31日 | 2026年4月13日 | 美元 0.0434 | 9,136,659.050 | (396,531) |
| 人民币对冲类别 (每月派息) | 2026年3月31日 | 2026年4月13日 | 人民币 0.0263 | 68,915,880.857 | (262,425) |
| 美元类别 (每月派息) | 2026年3月31日 | 2026年4月13日 | 美元 0.0425 | 54,501,606.929 | (2,316,318) |
| 美元类别 (每半年派息) | 2026年3月31日 | 2026年4月13日 | 美元 0.5743 | 1,488,193.908 | (854,670) |
| 美元 X 类别 (每月派息) | 2026年3月31日 | 2026年4月13日 | 美元 0.0527 | 13,995,928.086 | (737,585) |

可赎回份额持有人之总收益分配 (48,259,741)

1.10.2024 至 31.3.2025

| | | | | | |
|--------------------|-------------|------------|------------|-----------------|-------------|
| 澳元对冲类别 (每月派息) | 2024年10月31日 | 2024年11月8日 | 澳元 0.0399 | 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) |
| 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) |

| 收益分配类别 | 除息日 | 支付日 | 比率 | 份额 | 美元 |
|--------------------|------------|------------|------------|-----------------|--------------|
| 美元类别 (每月派息) | 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) |
| 可赎回份额持有人的总收益分配 | | | | | (40,058,804) |

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

JPMorgan Asset Management
(UK) Limited
60 Victoria Embankment
London
EC4Y 0JP
United Kingdom

管理人董事

Christopher David SPELMAN
Daniel James WATKINS
Kit Yee Elka LEUNG
Stiofan Seamus DEBURCA
Tsun Kay Edwin CHAN

受托人

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

