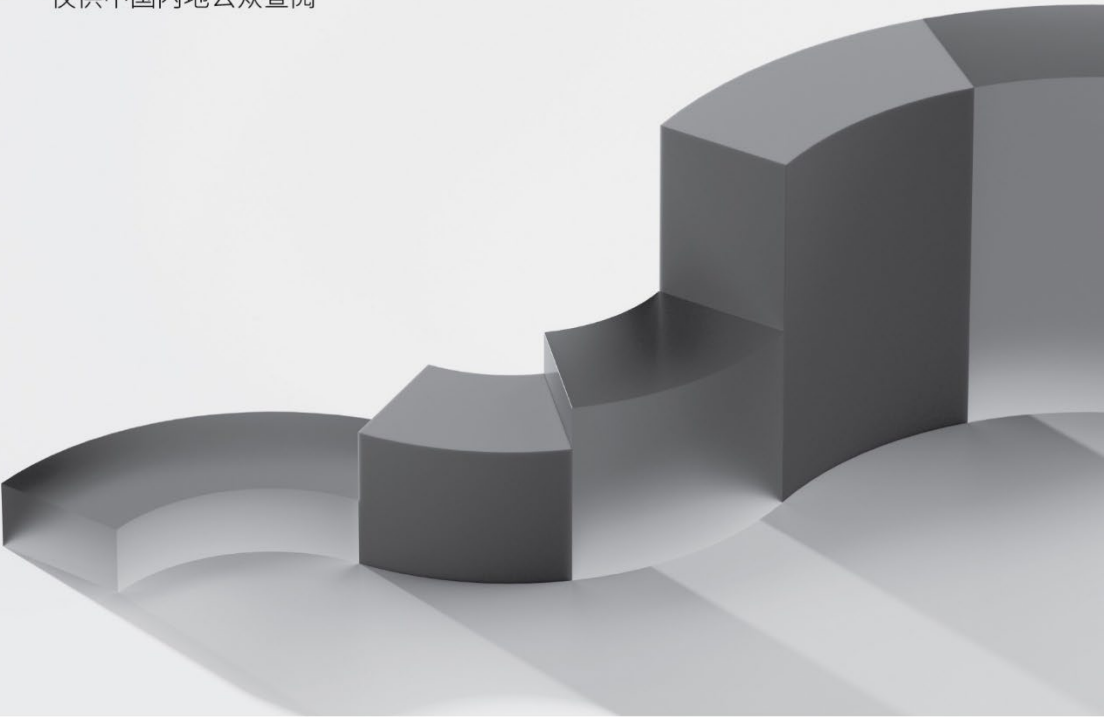


仅供中国内地公众查阅



半年度报告 — 2025年12月31日（未经审核）

摩根宜安香港基金

内地与香港互认基金系列

内容	页码
财务状况表	1
综合收益表	2
可赎回份额持有人应占净资产变动表	3
现金流量表	4
财务报表附注	5 - 9
投资组合	10 - 11
投资组合持有变动表	12
金融衍生工具详情	13 - 14

财务状况表
于二零二五年十二月三十一日 (未经审计)

	附注	31.12.2025 港元	30.6.2025 港元
资产			
流动资产			
银行现金		72,717,168	5,549,831
分配应收款项		2,184,260	1,407,597
远期外汇合约		159,073	7,946
投资		2,602,092,889	1,704,926,142
股息及其他应收款项		3,314,456	6,895,761
总资产		<u>2,680,467,846</u>	<u>1,718,787,277</u>
负债			
流动负债			
赎回应付款项		5,043,980	4,589,953
远期外汇合约		27,055	476
其他应付款项		762,805	626,868
总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)		<u>5,833,840</u>	<u>5,217,297</u>
可赎回份额持有人应占净资产 (根据香港财务报告会计准则)	3	<u>2,674,634,006</u>	<u>1,713,569,980</u>
成立费用摊销调整	3	855,837	964,665
可赎回份额持有人应占净资产 (根据信托契约)	3	<u><u>2,675,489,843</u></u>	<u><u>1,714,534,645</u></u>

综合收益表
截至二零二五年十二月三十一日止期间 (未经审计)

	附注	1.7.2025 至 31.12.2025 港元	1.7.2024 至 31.12.2024 港元
收入			
投资和远期外汇合约净收益	4	252,247,460	304,524,188
股息收入		22,916,653	69,400,412
存款利息		24,172	302,667
汇兑净亏损		(142,105)	(15,599)
其他收入		56,963	-
		<u>275,103,143</u>	<u>374,211,668</u>
支出			
交易成本	5(a), 5(b)	4,876,688	6,628,592
管理费用	5(a)	898,097	1,055,987
受托人费用	5(b)	344,885	495,089
托管费用及银行费用	5(a)	277,010	328,901
核数师酬金		71,922	127,345
估值费用	5(a)	68,040	67,500
法律及专业服务费		17,667	24,751
印刷及出版支出		6,743	1,965
成立费用	2(d)	-	1,080,000
基金注册登记机构费用	5(a)	-	132,894
其他经营费用		8,741	9,949
		<u>6,569,793</u>	<u>9,952,973</u>
除税前利润			
		268,533,350	364,258,695
税项			
		(1,710,730)	(4,860,206)
		<u>266,822,620</u>	<u>359,398,489</u>
成立费用摊销调整			
		(108,829)	1,071,720
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加			
		<u>266,713,791</u>	<u>360,470,209</u>

可赎回份额持有人应占净资产变动表
截至二零二五年十二月三十一日止期间 (未经审计)

	附注	1.7.2025 至 31.12.2025 港元	1.7.2024 至 31.12.2024 港元
期初可赎回份额持有人应占净资产		1,714,534,645	3,770,721,285
		-----	-----
分配可赎回份额	3	933,977,077	113,620,940
赎回可赎回份额	3	(239,735,670)	(1,736,066,551)
净分配／(赎回)		694,241,407	(1,622,445,611)
		-----	-----
		2,408,776,052	2,148,275,674
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加		266,713,791	360,470,209
		-----	-----
期末可赎回份额持有人应占净资产		2,675,489,843	2,508,745,883
		=====	=====

第五至九页之附注乃属本财务报表之一部分。

现金流量表
截至二零二五年十二月三十一日止期间 (未经审计)

	1.7.2025 至 31.12.2025 港元	1.7.2024 至 31.12.2024 港元
经营业务		
购入投资和远期外汇合约	(2,133,125,552)	(1,750,093,875)
出售投资和远期外汇合约所得款项	1,488,081,717	3,275,739,267
已收股息	26,597,090	96,477,072
已收利息	24,172	302,667
已付基金注册登记机构费用	(65,295)	(132,894)
已付受托人费用	(317,207)	(516,122)
已付管理费用	(869,467)	(1,031,458)
已付税项	(1,710,730)	(4,860,206)
已付交易成本	(4,906,649)	(6,660,741)
其他	(464,853)	(816,071)
经营业务所（运用）／产生之现金净额	(626,756,774)	1,608,407,639
融资活动		
分配可赎回份额所得款项	933,200,414	122,175,395
赎回可赎回份额付款	(239,281,643)	(1,735,073,112)
融资活动所产生／（运用）之现金净额	693,918,771	(1,612,897,717)
现金及现金等价物之增加／（减少）	67,161,997	(4,490,078)
期初现金及现金等价物	5,549,831	31,629,847
现金及现金等价物之汇兑收益／（亏损）	5,340	(5,336)
期末现金及现金等价物	72,717,168	27,134,433
现金及现金等价物余额分析：		
银行现金	72,717,168	27,134,433

财务报表附注

1 本基金

摩根宜安香港基金（“本基金”）根据一九九八年九月十六日所订立之信托契约（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。

本基金的投资政策是透过一个主要投资于在香港上市、以香港为基地或主要在当地经营之公司的证券投资组合，以提供予投资者长期资本增长（以港元计算）。

自二零二零年十月三十一日起，本基金已根据《强制性公积金计划（一般）规例》（“一般规例”）第六条获批准为核准汇集投资基金。本基金亦须遵守强制性公积金计划管理局于二零二零年十月三十一日向本基金发出的《汇集投资基金审批条件表》。

本基金设有不同类别的份额，供不同类别的投资者选择。目前，本基金提供五个类别的基金份额。该五个类别的基金份额为：

A 类别 — 提供予并未能符合投资于 B 类别份额之要求的集体投资计划、退休金计划、独立投资组合或其他类别之投资工具。

B 类别 — 提供予根据《一般规例》注册仅作投资用途的计划，以及获证监会认可的集体投资计划、退休金计划、独立投资组合或其他类型的投资工具，而管理人或其关联方担任该等方案、计划、投资组合或工具的管理人或投资管理人，并向其收取管理费或投资管理费。

C 类别 — 提供予任何根据《一般规例》注册仅作投资用途的计划、管理人确定的指定的集体投资计划、退休金计划、独立投资组合或其他类型的投资工具。

D 类别 — 透过指定分销商提供予香港公众。

PRC 份额 — 经相关监管机构批准（如需要），提供予中国内地投资者。

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二零二五年六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) 投资和远期外汇合约

分类

对于投资和远期外汇合约，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。

公允价值为负数的远期外汇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

投资和远期外汇合约之买卖于交易日确认。投资和远期外汇合约先以公允价值确认，其后以公允价值重新计量。投资和远期外汇合约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。当收取投资和远期外汇合约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，即终止确认投资和远期外汇合约。

公平值估计

公平值指在计量日期，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平值，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平值计算。

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

(c) 外币交易

功能及呈列货币

本基金采用港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“投资和远期外汇合约净收益／亏损”中呈列。

(d) 成立费用

成立费用于实际发生时确认为费用。

(e) 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）

成立费用摊销调整

如附注 2(e)所述，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。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。赎回金额根据按信托契约规定计算的可赎回份额持有人应占净资产（“信托契约资产净值”）确定。

	31.12.2025 港元	30.6.2025 港元
可赎回份额持有人应占净资产（根据香港财务报告会计准则）	2,674,634,006	1,713,569,980
成立费用摊销调整[附注 3(a)]	855,837	964,665
可赎回份额持有人应占净资产（根据信托契约）	<u>2,675,489,843</u>	<u>1,714,534,645</u>

注：

(a) 根据信托契约的规定，成立费用（包括法律、会计和其他专业费用和开支）或与设立 PRC 份额相关的成本，将由 PRC 份额资产支付，并在五个年度内摊销。然而，如附注 2(d)所述，为符合香港会计准则第 38 号“无形资产”的规定，并且出于报告目的，本基金的会计政策是将本基金在成立过程中产生的开支于实际发生时确认为费用。截至 2025 年 12 月 31 日，未摊销金额为 855,837 港元，剩余摊销期为 4 年（二零二五年六月三十日：未摊销金额为 964,665 港元，剩余摊销期为 4.5 年）。

1.7.2025 至 31.12.2025

	(港元) - A 类别 (累计) 份额	(港元) - B 类别 (累计) 份额	(港元) - D 类别 (累计) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额	PRC 人民币对冲 份额 (累计) 份额
已发行份额数目：					
期初	2,208,249.153	18,274,333.974	776.490	2,233.910	169,734.900
总分配	165,096.534	9,658,660.409	-	606,609.400	1,044,570.890
总赎回	(455,242.864)	(2,118,526.944)	-	(12,935.040)	(479,802.670)
期末	1,918,102.823	25,814,467.439	776.490	595,908.270	734,503.120
	PRC 美元份额 (累计) 份额				
已发行份额数目：					
期初	-				
总分配	51,799.280				
总赎回	(117.720)				
期末	51,681.560				

1.7.2024 至 31.12.2024

	(港元) - A 类别 (累计) 份额	(港元) - B 类别 (累计) 份额	(港元) - D 类别 (累计) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额	PRC 人民币对冲 份额 (累计) 份额
已发行份额数目：					
期初	3,941,176.253	56,140,176.738	-	-	-
总分配	220,226.176	1,415,725.409	776.490	726.280	145,255.000
总赎回	(512,590.662)	(25,410,253.520)	-	-	-
期末	3,648,811.767	32,145,648.627	776.490	726.280	145,255.000

31.12.2025

	(港元) - A 类别 (累计) 港币	(港元) - B 类别 (累计) 港币	(港元) - D 类别 (累计) 港币	PRC 人民币份额 (累计) 人民币	PRC 人民币对冲 份额 (累计) 人民币
可赎回份额持有人应占净资产 (根据信托契约)	149,158,777	2,504,390,054	10,093	6,826,887	9,045,517
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额) (根据信托契约)	77.76	97.01	13.00	11.46	12.32

31.12.2025

PRC 美元份额
(累计)
美元

可赎回份额持有人应占净资产
(根据信托契约)

543,617

可赎回份额持有人应占净资产
(每份额) (根据信托契约)

10.52

30.6.2025

(港元) -
A 类别 (累计)
港币

(港元) -
B 类别 (累计)
港币

(港元) -
D 类别 (累计)
港币

PRC 人民币份额
(累计)
人民币

PRC 人民币对冲
份额
(累计)
人民币

可赎回份额持有人应占净资产
(根据信托契约)

151,915,401

1,560,515,974

8,951

24,188

1,886,895

可赎回份额持有人应占净资产
(每份额) (根据信托契约)

68.79

85.39

11.53

10.83

11.12

4 投资和远期外汇合约净收益

	1.7.2025 至 31.12.2025 港元	1.7.2024 至 31.12.2024 港元
投资和远期外汇合约价值未实现收益／亏损之变动	108,450,654	349,015,844
投资和远期外汇合约销售之实现收益／(亏损)	143,796,806	(44,491,656)
	<u>252,247,460</u>	<u>304,524,188</u>

5 与受托人、管理人及其联系人／关联人士之交易

(a) 截至二零二五年及二零二四年十二月三十一日止期间，已付管理人摩根资产管理（亚太）有限公司及其联系人／关联人士的金额列示如下：

	1.7.2025 至 31.12.2025 港元	1.7.2024 至 31.12.2024 港元
管理费用	898,097	1,055,987
托管费用及银行费用	225,538	238,702
交易成本	73,681	89,377
估值费用	68,040	67,500
基金注册登记机构费用	-	132,894
	<u></u>	<u></u>

(b) 截至二零二五年及二零二四年十二月三十一日止期间，已付受托人花旗信托有限公司及其联系人／关联人士的金额列示如下：		
	1.7.2025 至 31.12.2025 港元	1.7.2024 至 31.12.2024 港元
受托人费用	344,885	495,089
交易成本	55,887	131,570
	<u> </u>	<u> </u>

6 收益分配

报告期间无任何收益分配（二零二四年十二月三十一日：无）。

投资组合

于二零二五年十二月三十一日 (未经审计)

	单位数目	公允价值 港元	占资产净值 百分比
上市投资 (97.3%)			
(I)股票 (97.3%)			
中国 (77.1%)			
基本物料 (3.7%)			
中国宏桥集团有限公司	962,000	31,380,440	1.2
创新实业集团有限公司	1,314,000	27,226,080	1.0
紫金矿业集团股份有限公司 H 股	1,172,000	41,793,520	1.5
非必需消费品 (21.6%)			
阿里巴巴集团控股有限公司	1,702,900	243,174,120	9.1
常州星宇车灯股份有限公司 A 股(C1)	186,048	25,595,121	1.0
华住酒店集团	716,100	26,424,090	1.0
隆鑫通用动力股份有限公司 A 股(C1)	1,919,638	34,485,577	1.3
立讯精密工业股份有限公司 A 股(C2)	510,320	32,271,924	1.2
敏实集团	962,000	30,514,640	1.1
网易股份有限公司	308,300	66,161,180	2.5
泡泡玛特国际集团有限公司	295,400	55,446,580	2.1
携程集团有限公司	113,750	63,017,500	2.3
能源 (3.6%)			
中国石油化工股份有限公司 H 股	6,860,000	32,036,200	1.2
中国神华能源股份有限公司 H 股	680,000	26,384,000	1.0
中国石油天然气股份有限公司 H 股	4,582,000	38,397,160	1.4
金融 (15.8%)			
中国建设银行股份有限公司 H 股	18,371,520	141,276,989	5.3
中国国际金融股份有限公司 H 股	1,376,800	26,943,976	1.0
中国招商银行股份有限公司 H 股	1,536,500	81,127,200	3.0
中国民生银行股份有限公司 H 股	7,451,000	29,282,430	1.1
中信证券股份有限公司 H 股	1,180,500	32,345,700	1.2
中国平安保险 (集团) 股份有限公司 H 股	1,712,500	111,569,375	4.2
健康护理 (2.3%)			
劲方医药科技 (上海) 股份有限公司 H 股	931,200	22,143,936	0.8
江苏恒瑞医药股份有限公司 H 股	546,800	38,959,500	1.5
工业 (7.5%)			
宁德时代新能源科技股份有限公司 H 股	50,600	25,578,300	0.9
福耀玻璃工业集团 H 股	337,600	22,686,720	0.8
三一重工股份有限公司 H 股	1,845,200	41,701,520	1.6
潍柴动力股份有限公司 H 股	1,868,000	35,211,800	1.3
徐州工程机械集团有限公司 A 股(C2)	2,095,500	27,059,442	1.0
株洲中车时代电气股份有限公司 H 股	613,500	23,079,870	0.9
中通快递 (开曼) 有限公司	163,550	26,544,165	1.0
科技 (17.2%)			
鹏鼎控股(深圳)股份有限公司 A 股(C2)	210,800	11,889,732	0.4
百度公司	413,950	54,434,425	2.0
美图公司	3,214,500	22,501,500	0.8
美团	462,800	47,807,240	1.8
澜起科技股份有限公司 A 股(C1)	111,188	14,605,816	0.5
北方华创科技集团股份有限公司 A 股(C2)	72,400	37,063,767	1.4
腾讯控股有限公司	422,100	252,837,900	9.6
上海韦尔半导体股份有限公司 A 股(C1)	128,405	18,027,283	0.7

投资组合 (续)

于二零二五年十二月三十一日 (未经审计)

	单位数目	公允价值 港元	占资产净值 百分比
电讯 (5.4%)			
富士康工业互联网股份有限公司 A 股(C1)	178,800	12,371,772	0.5
小米集团	3,334,600	131,049,780	4.9
中国香港 (20.2%)			
非必需消费品 (1.8%)			
金沙中国有限公司	1,304,000	25,558,400	0.9
九兴控股有限公司	1,541,000	23,053,360	0.9
金融 (18.4%)			
友邦保险控股有限公司	1,747,400	139,617,260	5.2
中银香港 (控股) 有限公司	1,033,500	40,740,570	1.5
香港交易及结算有限公司	113,788	46,379,989	1.8
汇丰控股有限公司	2,159,600	264,335,040	9.9
		2,602,092,889	97.3
(II) 远期外汇合约 (0.0%)		132,018	0.0
总上市投资		2,602,224,907	97.3
其他净资产		73,264,936	2.7
于二零二五年十二月三十一日可赎回份额持有人应占净资产		2,675,489,843	100.0
总投资, 按成本		2,204,492,399	

投资组合持有变动表
截至二零二五年十二月三十一日止期间 (未经审计)

	持有占资产净值百分比	
	31.12.2025	30.6.2025
上市投资		
股票		
中国		
非必需消费品	21.6	21.5
科技	17.2	15.4
金融	15.8	13.8
工业	7.5	4.6
电讯	5.4	6.7
基本物料	3.7	2.1
能源	3.6	1.9
健康护理	2.3	3.4
必需消费品	-	3.1
房地产	-	0.8
公用事业	-	0.2
香港		
金融	18.4	18.9
非必需消费品	1.8	1.1
房地产	-	2.7
工业	-	1.1
科技	-	1.0
公用事业	-	0.6
英国		
金融	-	0.5
远期外汇合约	0.0	0.0
总上市投资	97.3	99.4
其他净资产	2.7	0.6
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
于二零二五年十二月三十一日 (未经审计)

以下为于二零二五年十二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) 港元
于 2025 年 12 月 31 日				
港元 18,791	离岸人民币 16,904	2026 年 1 月 5 日	Citibank N.A., 伦敦	60
港元 10,176,489	离岸人民币 9,246,982	2026 年 1 月 13 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	138,020
港元 199,269	离岸人民币 181,231	2026 年 1 月 13 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,884
港元 223,742	离岸人民币 202,331	2026 年 1 月 13 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,948
港元 166,229	离岸人民币 150,757	2026 年 1 月 13 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,932
港元 104,748	离岸人民币 95,095	2026 年 1 月 13 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,326
港元 121,302	离岸人民币 109,809	2026 年 1 月 13 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,184
港元 102,619	离岸人民币 92,693	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	774
港元 90,082	离岸人民币 81,376	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	689
港元 54,137	离岸人民币 48,880	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	386
港元 14,041	离岸人民币 12,800	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	237
港元 29,448	离岸人民币 26,596	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	219
港元 14,409	离岸人民币 13,070	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	170
港元 8,567	离岸人民币 7,819	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	155
港元 12,423	离岸人民币 11,275	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	154
港元 12,432	离岸人民币 11,277	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	147
港元 13,455	离岸人民币 12,175	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	126
港元 11,259	离岸人民币 10,206	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	125
港元 8,801	离岸人民币 7,976	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	96
港元 3,617	离岸人民币 3,302	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	66
港元 2,761	离岸人民币 2,500	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	27
港元 1,324	离岸人民币 1,202	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	16
港元 2,215	离岸人民币 2,000	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	16
港元 10,064,597	离岸人民币 9,022,579	2026 年 2 月 12 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	7,552
港元 128,406	离岸人民币 115,620	2026 年 2 月 12 日	美国道富银行	664
港元 18,881	离岸人民币 17,004	2026 年 2 月 12 日	Citibank N.A., 伦敦	100
未实现总收益				159,073

离岸人民币 17,004	港元 18,856	2026 年 1 月 5 日	Citibank N.A., 伦敦	(106)
离岸人民币 7,779	港元 8,582	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(95)
离岸人民币 7,782	港元 8,582	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(98)
离岸人民币 7,774	港元 8,565	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(107)
离岸人民币 7,817	港元 8,604	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(116)
离岸人民币 7,829	港元 8,576	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(158)
离岸人民币 19,976	港元 22,110	2026 年 1 月 13 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(173)
离岸人民币 25,641	港元 28,286	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(316)
离岸人民币 19,889	港元 21,791	2026 年 1 月 13 日	渣打银行, 伦敦	(394)
离岸人民币 47,320	港元 52,130	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(652)
离岸人民币 105,273	港元 116,510	2026 年 1 月 13 日	渣打银行, 伦敦	(917)
离岸人民币 80,913	港元 89,249	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,006)
离岸人民币 129,328	港元 143,111	2026 年 1 月 13 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,148)
离岸人民币 89,917	港元 99,111	2026 年 1 月 13 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,187)
离岸人民币 96,962	港元 106,936	2026 年 1 月 13 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,219)
离岸人民币 71,609	港元 78,516	2026 年 1 月 13 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,360)
离岸人民币 222,150	港元 243,753	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(4,043)
离岸人民币 360,815	港元 395,762	2026 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(6,707)
离岸人民币 9,022,579	港元 10,057,379	2026 年 1 月 13 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(6,821)
离岸人民币 7,735	港元 8,588	2026 年 2 月 12 日	Citibank N.A., 伦敦	(48)
离岸人民币 16,904	港元 18,805	2026 年 2 月 12 日	Citibank N.A., 伦敦	(65)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／ (亏损) 港元
离岸人民币 83,933	港元 93,616	2026 年 2 月 12 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(80)
离岸人民币 63,470	港元 70,613	2026 年 2 月 12 日	Citibank N.A., 伦敦	(239)
			未实现总亏损	<u>(27,055)</u>
			未实现净亏损	<u><u>132,018</u></u>

