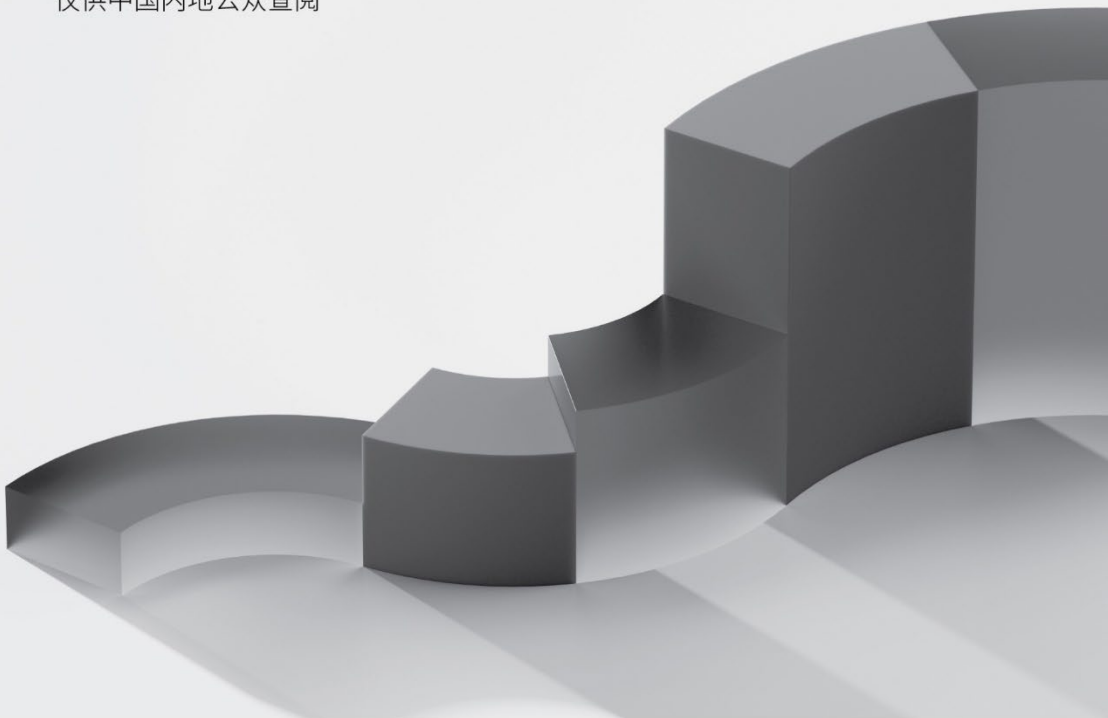


仅供中国内地公众查阅



半年度报告 — 2026年3月31日（未经审核）

摩根亚洲股票 高息基金

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 - 2
投资组合持有变动表	3
金融衍生工具详情	4 - 11
财务状况表	12
综合收益表	12
可赎回份额持有人应占净资产变动表	13
现金流量表	13
财务报表之附注	14 - 19
经营与管理	20

投资组合

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
上市投资 (94.3%)				印度 (6.8%)			
(I) 股票 (95.1%)				Axis Bank Ltd	1,378,242	16,874,787	0.7
澳大利亚 (16.6%)				Computer Age Management Services Ltd	2,196,896	14,494,840	0.6
ANZ Banking Group Ltd	424,473	10,457,254	0.4	Embassy Office Parks REIT	2,179,322	9,656,925	0.4
BHP Group Ltd	682,729	23,562,419	1.0	HDFC Bank Limited	3,522,312	27,166,909	1.1
Coles Group Ltd	2,913,918	43,826,504	1.8	ICICI Bank Ltd	2,612,294	33,212,513	1.4
Commonwealth Bank of Australia	116,834	13,419,288	0.5	Mahindra & Mahindra Ltd	587,100	18,289,164	0.7
GPT Group	6,961,938	21,600,088	0.9	MindSPACE Business Parks REIT	1,200,148	5,683,348	0.2
Insurance Australia Group Limited	3,436,758	17,277,153	0.7	Power Grid Corp of India Ltd	12,945,188	40,412,448	1.7
Medibank Private Ltd	13,050,645	38,971,366	1.6	印度尼西亚 (0.5%)			
National Australia Bank Ltd	1,647,400	46,756,929	1.9	Bank Central Asia	27,139,000	10,300,188	0.4
Rio Tinto Plc	336,690	30,830,881	1.3	Telkom Indonesia Persero	9,574,500	1,723,968	0.1
Santos Ltd	10,111,818	55,127,650	2.3	韩国 (14.0%)			
Telstra Corporation Limited	20,936,329	76,428,425	3.2	Hana Financial Holdings	561,214	39,059,454	1.6
Vicinity Centres REIT	14,678,250	23,524,332	1.0	Hyundai Motor Co Pref KIA Corp	58,479	8,876,942	0.4
中国内地 (25.2%)				KT Corporation	227,316	21,549,495	0.9
阿里巴巴集团控股有限公司	2,983,700	45,287,148	1.9	KT Corporation ADR	1,759,101	8,077,422	0.3
中国建设银行股份有限公司 H股	11,083,000	11,860,204	0.5	Samsung C&T Corp	68,422	37,732,716	1.6
中国招商银行股份有限公司 A股(C1)	2,562,200	14,586,663	0.6	Samsung Electronics Co Ltd	295,782	11,324,374	0.5
中国铁塔股份有限公司 H股	6,903,500	9,404,018	0.4	Samsung Electronics Co Ltd Preference Shares	1,101,029	32,288,545	1.3
中国长江电力股份有限公司 A股(C1)	8,120,256	31,791,119	1.3	Shinhan Financial Group Company Limited	764,557	81,949,078	3.4
宁德时代新能源科技股份有 限公司 A股(C2)	618,250	35,957,986	1.5	SK Hynix Inc	70,794	43,777,396	1.8
福耀玻璃工业集团 H股	468,400	3,503,949	0.1	SK Hynix	81,402	37,300,139	1.5
福耀玻璃工业集团股份有限 公司 A股(C1)	3,905,504	32,231,562	1.3	马来西亚 (1.3%)			
华住集团有限公司 ADR	842,100	42,349,209	1.8	Malayan Banking Bhd	11,605,700	32,561,312	1.3
华勤技术股份有限公司 A股 (C1)	946,300	10,978,763	0.5	新加坡 (4.2%)			
贵州茅台酒股份有限公司 A 股(C1)	134,400	28,216,080	1.2	Capitaland Integrated Commercial Trust REIT	18,949,000	33,634,236	1.4
美的集团股份有限公司 A股 (C2)	2,909,088	32,158,465	1.3	DBS Group Holdings Ltd Sea Ltd ADR	674,500	29,747,743	1.2
国电南瑞科技股份有限公司 A股(C1)	7,551,800	28,417,520	1.2	Singapore Exchange Limited	94,973	7,864,714	0.3
北方华创科技集团股份有限 公司 A股(C2)	450,898	29,182,013	1.2	台湾地区 (18.3%)			
中国石油天然气股份有限公 司 H股	5,014,000	6,874,888	0.3	智邦科技股份有限公司	825,000	38,966,218	1.6
中国平安保险 (集团) 股份 有限公司 H股	7,094,000	53,791,778	2.2	研华股份有限公司	1,288,000	12,831,655	0.5
三一重装国际控股有限公司	8,694,000	12,253,348	0.5	日月光投资控股股份有限 公司	136,000	1,397,435	0.0
申洲国际集团控股有限公司	2,225,900	13,281,243	0.5	联发科技股份有限公司	285,000	13,282,765	0.5
腾讯控股有限公司	1,969,000	121,552,511	5.0	亿丰综合工业股份有限公司	1,164,000	12,015,014	0.5
紫金矿业集团股份有限公司 A股(C1)	9,865,258	46,735,958	1.9	广达电脑股份有限公司	4,232,000	36,866,187	1.5
香港特别行政区 (6.6%)				瑞昱半导体股份有限公司	424,000	6,339,443	0.3
友邦保险控股有限公司	4,631,000	50,118,664	2.1	台湾大哥大股份有限公司	4,713,000	16,068,721	0.7
香港电讯信托及香港电讯有 限公司	60,000	93,518	0.0	台湾积体电路制造股份有限 公司	4,295,000	236,446,669	9.8
香港交易及结算所有限公司	1,142,200	56,613,214	2.3	健鼎科技股份有限公司	2,024,000	21,430,216	0.9
汇丰控股有限公司	1,575,600	25,281,304	1.0	联华电子股份有限公司	6,334,000	11,193,963	0.5
保诚集团	2,105,421	28,819,226	1.2	世界先进积体电路股份有限 公司	662,000	2,402,002	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
台湾地区 (续)							
纬颖科技服务股份有限公司	321,000	33,134,188	1.4	Call Taiwan Stock Exchange Weighted 15/04/2026 34,300.00	(64)	(14,914)	(0.0)
泰国 (1.6%)							
Advanced Information Service PCL - NVDR	3,335,700	37,726,383	1.6	Call Taiwan Stock Exchange Weighted 15/04/2026 34,800.00	(262)	(38,517)	(0.0)
		2,303,081,695	95.1	Call Taiwan Stock Exchange Weighted 15/04/2026 34,900.00	(263)	(33,729)	(0.0)
(II) 衍生性产品 (-0.8%)							
远期外汇合约 (-0.3%)		(7,810,949)	(0.3)	Call Taiwan Stock Exchange Weighted 15/04/2026 35,100.00	(529)	(62,878)	(0.0)
期货 (-0.4%)							
FTSE Taiwan Index 29/04/2026	750	(4,548,470)	(0.2)	Call Taiwan Stock Exchange Weighted 15/04/2026 35,200.00	(801)	(80,175)	(0.0)
HSCEI Futures 29/04/2026	366	(193,254)	(0.0)	Call Taiwan Stock Exchange Weighted 15/04/2026 35,300.00	(534)	(49,274)	(0.0)
KOSPI2 Index Future 11/06/2026	259	(4,040,553)	(0.2)				
卖出期权合约 (-0.1%)							
Call HSCEI Future Options 17/04/2026 8,500.00	(6)	(4,400)	(0.0)			(19,880,712)	(0.8)
Call HSCEI Future Options 17/04/2026 8,600.00	(100)	(51,657)	(0.0)	总上市投资		2,283,200,983	94.3
Call HSCEI Future Options 17/04/2026 8,700.00	(2,568)	(900,742)	(0.1)	其他净资产		138,203,382	5.7
Call HSI Future Options 15/05/2026 8,500.00	(4)	(5,510)	(0.0)	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		2,421,404,365	100.0
Call HSI Future Options 17/04/2026 25,400.00	(35)	(56,695)	(0.0)				
Call HSI Future Options 17/04/2026 25,600.00	(435)	(546,510)	(0.0)	总投资, 按成本		2,201,822,607	
Call HSI Future Options 17/04/2026 25,800.00	(435)	(416,125)	(0.0)				
Call Korea Stock Exchange Kospi 200 09/04/2026 865.00	(85)	(29,274)	(0.0)				
Call Korea Stock Exchange Kospi 200 09/04/2026 867.50	(85)	(29,274)	(0.0)				
Call Korea Stock Exchange Kospi 200 09/04/2026 870.00	(85)	(26,499)	(0.0)				
Call OTC IOPT AS51 01/04/2026 8,980.00	(5,000)	-	-				
Call OTC IOPT AS51 08/04/2026 8,865.00	(5,600)	(3,414)	(0.0)				
Call OTC IOPT AS51 15/04/2026 8,775.00	(6,200)	(74,736)	(0.0)				
Call OTC IOPT AS51 22/04/2026 8,670.00	(6,400)	(286,409)	(0.0)				
Call OTC IOPT KOSPI2 02/04/2026 889.00	(52,000,000)	-	-				
Call OTC IOPT KOSPI2 16/04/2026 902.00	(63,000,000)	(79,385)	(0.0)				
Call OTC IOPT KOSPI2 23/04/2026 850.00	(64,000,000)	(397,793)	(0.0)				
Call Taiwan Stock Exchange Weighted 15/04/2026 34,200.00	(50)	(13,137)	(0.0)				

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)

	持有占资产净值百分比	
	31.3.2026	30.9.2025
上市投资		
股票		
中国内地	25.2	27.8
台湾地区	18.3	14.8
澳大利亚	16.6	13.3
韩国	14.0	12.6
印度	6.8	10.0
香港特别行政区	6.6	6.7
新加坡	4.2	5.5
泰国	1.6	1.8
马来西亚	1.3	-
印度尼西亚	0.5	2.7
衍生性产品		
卖出期权合约	(0.1)	(0.4)
远期外汇合约	(0.3)	0.0
期货	(0.4)	0.1
总上市投资	94.3	94.9
其他净资产	5.7	5.1
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总结如下：

(a) 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：

未实现收益/
(亏损)
美元

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
<u>于 2026 年 3 月 31 日</u>				
未平仓合约：				
澳元 506,534	美元 352,604	2026 年 4 月 1 日	Citibank N.A., 伦敦	5,679
加元 38,835	美元 28,150	2026 年 4 月 1 日	Citibank N.A., 伦敦	322
离岸人民币 6,894,196	美元 999,076	2026 年 4 月 1 日	Citibank N.A., 伦敦	886
英镑 164,400	美元 219,827	2026 年 4 月 1 日	Citibank N.A., 伦敦	3,033
美元 47,951	离岸人民币 331,590	2026 年 4 月 1 日	巴克莱银行, 伦敦	59
澳元 703,524	美元 486,260	2026 年 4 月 2 日	巴克莱银行, 伦敦	4,417
加元 124,143	美元 89,649	2026 年 4 月 2 日	巴克莱银行, 伦敦	692
英镑 33,576	美元 44,828	2026 年 4 月 2 日	巴克莱银行, 伦敦	552
澳元 1,339,339	美元 922,514	2026 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	5,276
加元 202,772	美元 146,127	2026 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	789
加元 2,353	美元 1,687	2026 年 4 月 8 日	Citibank N.A., 伦敦	0
英镑 52,361	美元 69,589	2026 年 4 月 8 日	巴克莱银行, 伦敦	542
澳元 101,924	美元 69,867	2026 年 4 月 9 日	巴克莱银行, 伦敦	66
澳元 39,253	美元 26,882	2026 年 4 月 9 日	Citibank N.A., 伦敦	0
加元 431,181	美元 309,871	2026 年 4 月 9 日	巴克莱银行, 伦敦	804
英镑 2,549	美元 3,365	2026 年 4 月 9 日	巴克莱银行, 伦敦	3
澳元 1,278,622	美元 875,639	2026 年 4 月 10 日	巴克莱银行, 伦敦	4
加元 10,141	美元 7,269	2026 年 4 月 10 日	Citibank N.A., 伦敦	0
澳元 3,561,242	美元 2,517,873	2026 年 4 月 13 日	高盛国际, 伦敦	79,131
澳元 4,458,443	美元 3,125,328	2026 年 4 月 13 日	摩根士丹利国际股份有限公司	72,182
澳元 143,252,962	美元 98,168,146	2026 年 4 月 13 日	渣打银行, 伦敦	68,375
澳元 2,506,491	美元 1,779,152	2026 年 4 月 13 日	巴克莱银行, 伦敦	62,705
澳元 2,683,486	美元 1,897,351	2026 年 4 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	59,697
澳元 2,502,255	美元 1,749,803	2026 年 4 月 13 日	美国道富银行	36,256
澳元 1,444,003	美元 1,019,010	2026 年 4 月 13 日	法国巴黎银行	30,155
澳元 1,403,523	美元 989,864	2026 年 4 月 13 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	28,730
澳元 955,070	美元 682,704	2026 年 4 月 13 日	法国巴黎银行	28,671
澳元 1,520,520	美元 1,069,170	2026 年 4 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	27,917
澳元 952,841	美元 677,236	2026 年 4 月 13 日	巴克莱银行, 伦敦	24,730
澳元 1,031,391	美元 730,820	2026 年 4 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	24,522
澳元 1,004,049	美元 711,153	2026 年 4 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	23,579
澳元 1,246,346	美元 871,685	2026 年 4 月 13 日	法国巴黎银行	18,187
澳元 1,110,531	美元 778,485	2026 年 4 月 13 日	巴克莱银行, 伦敦	17,993
澳元 857,503	美元 604,622	2026 年 4 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	17,403
澳元 593,359	美元 420,268	2026 年 4 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	13,934
澳元 859,453	美元 601,916	2026 年 4 月 13 日	巴克莱银行, 伦敦	13,362
澳元 434,091	美元 309,302	2026 年 4 月 13 日	巴克莱银行, 伦敦	12,036
澳元 354,792	美元 249,883	2026 年 4 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	6,921
澳元 323,334	美元 228,238	2026 年 4 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	6,819
澳元 408,259	美元 285,854	2026 年 4 月 13 日	巴克莱银行, 伦敦	6,078
澳元 290,782	美元 205,201	2026 年 4 月 13 日	法国巴黎银行	6,272
澳元 251,908	美元 178,111	2026 年 4 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	5,604
澳元 262,794	美元 185,343	2026 年 4 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	5,381
澳元 279,306	美元 196,400	2026 年 4 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	5,131
澳元 335,122	美元 234,382	2026 年 4 月 13 日	法国巴黎银行	4,890
澳元 174,128	美元 122,482	2026 年 4 月 13 日	巴克莱银行, 伦敦	3,239
澳元 119,076	美元 83,375	2026 年 4 月 13 日	巴克莱银行, 伦敦	1,831
澳元 55,510	美元 39,096	2026 年 4 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	1,083
澳元 26,439	美元 18,516	2026 年 4 月 13 日	巴克莱银行, 伦敦	411
澳元 12,931	美元 9,179	2026 年 4 月 13 日	巴克莱银行, 伦敦	324
澳元 11,589	美元 8,212	2026 年 4 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	276
澳元 10,580	美元 7,469	2026 年 4 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	223
澳元 4,756	美元 3,381	2026 年 4 月 13 日	巴克莱银行, 伦敦	123
澳元 1,539	美元 1,100	2026 年 4 月 13 日	法国巴黎银行	46

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 1,697	美元 1,204	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	42
澳元 1,547	美元 1,097	2026年4月13日	摩根士丹利国际股份有限公司	37
澳元 1,538	美元 1,090	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	37
澳元 1,627	美元 1,147	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	33
澳元 1,570	美元 1,106	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	31
加元 64,264,865	美元 46,211,943	2026年4月13日	HSBC Bank Plc, 伦敦	139,514
加元 2,005,584	美元 1,468,089	2026年4月13日	高盛国际, 伦敦	30,256
加元 1,512,364	美元 1,109,020	2026年4月13日	高盛国际, 伦敦	24,784
加元 960,446	美元 705,945	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	17,387
加元 1,136,349	美元 830,753	2026年4月13日	摩根士丹利国际股份有限公司	16,087
加元 597,243	美元 437,968	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	9,795
加元 481,908	美元 352,240	2026年4月13日	法国巴黎银行	6,754
加元 402,594	美元 294,940	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	6,314
加元 352,014	美元 258,558	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	6,195
加元 431,759	美元 315,641	2026年4月13日	法国巴黎银行	6,107
加元 292,637	美元 214,216	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	4,420
加元 221,032	美元 162,462	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	4,001
加元 102,724	美元 75,152	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	1,508
加元 77,445	美元 57,015	2026年4月13日	法国巴黎银行	1,494
加元 44,875	美元 33,107	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	935
加元 23,137	美元 17,081	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	494
加元 26,934	美元 19,724	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	414
加元 19,980	美元 14,652	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	328
加元 21,936	美元 16,036	2026年4月13日	法国巴黎银行	310
加元 6,816	美元 5,010	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	123
加元 3,609	美元 2,642	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	55
加元 1,499	美元 1,106	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	31
加元 1,492	美元 1,099	2026年4月13日	法国巴黎银行	29
加元 1,496	美元 1,100	2026年4月13日	法国巴黎银行	27
加元 1,505	美元 1,106	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	26
加元 1,505	美元 1,102	2026年4月13日	美国道富银行	23
加元 1,505	美元 1,099	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	20
加元 1,507	美元 1,099	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	19
加元 1,510	美元 1,100	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	18
离岸人民币 23,392,865	美元 3,400,991	2026年4月13日	高盛国际, 伦敦	11,061
离岸人民币 11,868,502	美元 1,730,566	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	10,665
离岸人民币 21,218,670	美元 3,084,929	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	10,068
离岸人民币 41,133,125	美元 5,967,764	2026年4月13日	法国巴黎银行	7,039
离岸人民币 4,700,941	美元 687,689	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	6,461
离岸人民币 4,321,149	美元 632,130	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	5,939
离岸人民币 30,095,422	美元 4,364,942	2026年4月13日	摩根士丹利国际股份有限公司	3,724
离岸人民币 3,843,650	美元 560,679	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	3,685
离岸人民币 4,304,454	美元 626,204	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	2,433
离岸人民币 1,401,778	美元 205,439	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	2,303
离岸人民币 2,526,212	美元 367,327	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	1,246
离岸人民币 1,019,918	美元 149,039	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	1,239
离岸人民币 1,892,991	美元 275,085	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	766
离岸人民币 3,991,673	美元 578,949	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	504
离岸人民币 1,326,663	美元 192,741	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	491
离岸人民币 3,952,723	美元 573,251	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	450
离岸人民币 598,494	美元 87,139	2026年4月13日	法国巴黎银行	410
离岸人民币 544,036	美元 79,233	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	395
离岸人民币 1,545,049	美元 224,248	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	350
离岸人民币 2,636,357	美元 382,375	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	333
离岸人民币 1,528,142	美元 221,709	2026年4月13日	法国巴黎银行	262
离岸人民币 443,046	美元 64,413	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	210
离岸人民币 58,093	美元 8,514	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	95
离岸人民币 360,044	美元 52,258	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	83
离岸人民币 216,635	美元 31,473	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	80
离岸人民币 47,877	美元 7,004	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	66
离岸人民币 239,420	美元 34,750	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	55
离岸人民币 76,043	美元 11,048	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	28
离岸人民币 48,471	美元 7,049	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	25
离岸人民币 27,365	美元 3,985	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	20
离岸人民币 23,143	美元 3,373	2026年4月13日	法国巴黎银行	19
离岸人民币 234,277	美元 33,964	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	14

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／ (亏损)	美元
离岸人民币 7,541	美元 1,105	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		12
离岸人民币 16,084	美元 2,340	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		9
离岸人民币 7,576	美元 1,105	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		7
离岸人民币 7,562	美元 1,101	2026年4月13日	法国巴黎银行		5
离岸人民币 7,574	美元 1,101	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		4
离岸人民币 7,620	美元 1,108	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		4
离岸人民币 7,592	美元 1,103	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		3
离岸人民币 7,576	美元 1,100	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		2
离岸人民币 16,524	美元 2,396	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		1
离岸人民币 7,587	美元 1,100	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		1
离岸人民币 7,589	美元 1,100	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		0
英镑 44,268,026	美元 58,602,455	2026年4月13日	加拿大皇家银行		227,493
英镑 3,349,258	美元 4,486,200	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		69,631
英镑 1,607,021	美元 2,160,819	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		41,686
英镑 2,708,525	美元 3,608,122	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		36,468
英镑 1,187,642	美元 1,587,340	2026年4月13日	摩根士丹利国际股份有限公司		21,231
英镑 1,175,098	美元 1,570,613	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		21,046
英镑 1,514,075	美元 2,016,945	2026年4月13日	高盛国际, 伦敦		20,378
英镑 718,629	美元 967,015	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		19,381
英镑 1,215,205	美元 1,616,576	2026年4月13日	法国巴黎银行		14,121
英镑 863,856	美元 1,149,242	2026年4月13日	摩根士丹利国际股份有限公司		10,100
英镑 288,275	美元 389,655	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		9,515
英镑 529,602	美元 707,857	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		9,485
英镑 530,658	美元 707,970	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		8,206
英镑 237,842	美元 321,486	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		7,850
英镑 364,437	美元 487,345	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		6,772
英镑 226,097	美元 304,250	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		6,102
英镑 493,197	美元 656,106	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		5,742
英镑 305,237	美元 407,778	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		5,271
英镑 145,114	美元 196,106	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		4,749
英镑 199,739	美元 267,102	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		3,712
英镑 113,182	美元 152,954	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		3,704
英镑 97,636	美元 132,159	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		3,409
英镑 78,234	美元 105,896	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		2,731
英镑 121,840	美元 162,757	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		2,091
英镑 45,163	美元 60,978	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		1,423
英镑 76,178	美元 101,685	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		1,231
英镑 71,382	美元 95,091	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		961
英镑 75,344	美元 100,216	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		863
英镑 30,821	美元 41,295	2026年4月13日	法国巴黎银行		652
英镑 11,216	美元 15,144	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		353
英镑 5,644	美元 7,519	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		76
英镑 1,760	美元 2,375	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		55
英镑 1,300	美元 1,756	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		43
英镑 1,009	美元 1,366	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		35
英镑 815	美元 1,100	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		25
英镑 817	美元 1,095	2026年4月13日	法国巴黎银行		17
英镑 826	美元 1,103	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦		14
英镑 821	美元 1,096	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		13
英镑 827	美元 1,103	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦		13
美元 946,087	离岸人民币 6,537,566	2026年4月13日	法国巴黎银行		1,291
美元 57,507	离岸人民币 397,377	2026年4月13日	法国巴黎银行		78
澳元 2,091,149	美元 1,457,051	2026年5月13日	摩根士丹利国际股份有限公司		25,613
澳元 599,991	美元 419,400	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦		8,693
澳元 1,416,356	美元 975,113	2026年5月13日	HSBC Bank Plc, 伦敦		5,586
澳元 186,435	美元 129,762	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦		2,143
澳元 103,958	美元 72,328	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦		1,166
澳元 183,669	美元 126,449	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦		724
澳元 2,809,821	美元 1,923,395	2026年5月13日	摩根士丹利国际股份有限公司		11
澳元 1,580	美元 1,092	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦		10
澳元 1,591	美元 1,096	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦		6
澳元 8,968	美元 6,145	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦		6
加元 1,125,894	美元 819,894	2026年5月13日	摩根士丹利国际股份有限公司		11,662
加元 967,120	美元 696,030	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦		1,775
加元 53,844	美元 38,752	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦		99
加元 1,511	美元 1,104	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦		19
加元 1,511	美元 1,104	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦		19

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
加元 1,014,660	美元 728,395	2026年5月13日	法国巴黎银行	14
加元 1,527	美元 1,099	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	3
加元 1,531	美元 1,099	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	0
离岸人民币 16,337,337	美元 2,376,971	2026年5月13日	法国巴黎银行	4,258
离岸人民币 4,258,165	美元 619,711	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	1,287
离岸人民币 3,720,193	美元 541,241	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	948
离岸人民币 20,094	美元 2,924	2026年5月13日	法国巴黎银行	5
离岸人民币 7,597	美元 1,106	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	2
英镑 653,559	美元 874,999	2026年5月13日	摩根士丹利国际股份有限公司	13,220
英镑 440,920	美元 585,952	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	4,558
英镑 61,541	美元 82,369	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	1,221
英镑 53,771	美元 71,944	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	1,043
英镑 20,945	美元 27,835	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	217
英镑 138,308	美元 182,535	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	162
英镑 827	美元 1,107	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	16
英镑 823	美元 1,098	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	14
英镑 824	美元 1,095	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	9
英镑 824	美元 1,095	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	9
英镑 828	美元 1,092	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	1
美元 135,743,166	离岸人民币 936,292,834	2026年5月13日	法国巴黎银行	237,006
美元 200,558	离岸人民币 1,383,357	2026年5月13日	法国巴黎银行	350
美元 226,510	离岸人民币 1,561,717	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	303
美元 150,611	离岸人民币 1,038,479	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	210
美元 95,660	离岸人民币 659,588	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	133
美元 54,058	离岸人民币 372,737	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	75
美元 39,609	离岸人民币 273,218	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	71
美元 38,364	离岸人民币 264,627	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	69
美元 176,870	离岸人民币 1,217,992	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	23
			未实现总收益	1,976,332
离岸人民币 372,737	美元 53,891	2026年4月1日	巴克莱银行, 伦敦	(77)
美元 1,098	英镑 823	2026年4月1日	巴克莱银行, 伦敦	(14)
美元 27,837	英镑 20,945	2026年4月1日	巴克莱银行, 伦敦	(217)
美元 126,518	澳元 183,669	2026年4月1日	巴克莱银行, 伦敦	(724)
离岸人民币 1,038,479	美元 150,156	2026年4月2日	巴克莱银行, 伦敦	(202)
美元 6,148	澳元 8,968	2026年4月2日	巴克莱银行, 伦敦	(6)
美元 1,095	英镑 824	2026年4月2日	巴克莱银行, 伦敦	(9)
美元 38,684	加元 53,844	2026年4月2日	巴克莱银行, 伦敦	(101)
美元 182,546	英镑 138,308	2026年4月2日	巴克莱银行, 伦敦	(159)
澳元 129,357	美元 88,589	2026年4月8日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
离岸人民币 264,627	美元 38,270	2026年4月8日	巴克莱银行, 伦敦	(62)
离岸人民币 1,561,717	美元 225,957	2026年4月8日	巴克莱银行, 伦敦	(266)
美元 1,092	英镑 828	2026年4月8日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
美元 895,389	离岸人民币 6,181,250	2026年4月8日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
美元 1,097	加元 1,527	2026年4月8日	巴克莱银行, 伦敦	(3)
离岸人民币 273,218	美元 39,516	2026年4月9日	巴克莱银行, 伦敦	(65)
美元 1,098	加元 1,531	2026年4月9日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
离岸人民币 1,217,992	美元 176,459	2026年4月10日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
英镑 5,000	美元 6,593	2026年4月10日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
离岸人民币 1,383,357	美元 200,142	2026年4月13日	法国巴黎银行	(324)
离岸人民币 3,000,245	美元 434,173	2026年4月13日	法国巴黎银行	(602)
离岸人民币 11,559,015	美元 1,672,733	2026年4月13日	法国巴黎银行	(2,318)
离岸人民币 19,468,253	美元 2,817,043	2026年4月13日	法国巴黎银行	(4,161)
离岸人民币 936,292,834	美元 135,461,737	2026年4月13日	法国巴黎银行	(219,289)
美元 1,235	离岸人民币 8,507	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
美元 1,326	英镑 1,001	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(5)
美元 5,177	离岸人民币 35,683	2026年4月13日	法国巴黎银行	(6)
美元 1,102	离岸人民币 7,541	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(9)
美元 3,153	离岸人民币 21,681	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(11)
美元 20,734	离岸人民币 142,961	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(17)
美元 1,143	加元 1,556	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(27)
美元 1,278	澳元 1,817	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(34)
美元 5,897	离岸人民币 40,426	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(39)
美元 4,497	英镑 3,380	2026年4月13日	法国巴黎银行	(39)
美元 1,272	澳元 1,798	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(41)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／ (亏损) 美元
美元 3,285	加元 4,507	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(54)
美元 3,661	加元 5,023	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(60)
美元 3,594	加元 4,916	2026年4月13日	法国巴黎银行	(70)
美元 8,604	英镑 6,469	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(74)
美元 7,396	英镑 5,552	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(75)
美元 13,687	离岸人民币 93,903	2026年4月13日	法国巴黎银行	(79)
美元 84,721	离岸人民币 584,075	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(81)
美元 28,994	离岸人民币 199,298	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(113)
美元 4,643	澳元 6,579	2026年4月13日	法国巴黎银行	(137)
美元 48,759	离岸人民币 335,361	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(161)
美元 19,905	离岸人民币 136,207	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(167)
美元 15,196	英镑 11,376	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(195)
美元 9,479	澳元 13,537	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(208)
美元 10,042	澳元 14,359	2026年4月13日	法国巴黎银行	(210)
美元 10,307	加元 14,080	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(213)
美元 6,229	澳元 8,715	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(260)
美元 32,139	英镑 24,158	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(282)
美元 12,696	加元 17,313	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(284)
美元 579,306	离岸人民币 3,995,605	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(291)
美元 65,355	离岸人民币 448,868	2026年4月13日	法国巴黎银行	(309)
美元 110,445	离岸人民币 760,005	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(310)
美元 36,221	英镑 27,228	2026年4月13日	法国巴黎银行	(317)
美元 200,067	离岸人民币 1,378,200	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(348)
美元 431,310	离岸人民币 2,973,914	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(351)
美元 28,146	英镑 21,070	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(362)
美元 39,974	英镑 30,006	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(405)
美元 30,632	英镑 22,906	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(426)
美元 40,148	英镑 30,038	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(538)
美元 468,985	离岸人民币 3,232,450	2026年4月13日	法国巴黎银行	(561)
美元 669,852	离岸人民币 4,618,039	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(638)
美元 34,788	加元 47,635	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(638)
美元 21,977	澳元 31,082	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(692)
美元 419,401	离岸人民币 2,889,120	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(730)
美元 39,587	加元 54,168	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(753)
美元 39,824	英镑 29,594	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(799)
美元 522,636	离岸人民币 3,600,619	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(860)
美元 24,462	澳元 34,330	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(952)
美元 71,091	英镑 53,189	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(953)
美元 43,389	澳元 61,894	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(1,004)
美元 62,678	加元 85,997	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(1,026)
美元 56,522	澳元 80,724	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(1,242)
美元 69,536	加元 95,134	2026年4月13日	法国巴黎银行	(1,333)
美元 349,912	英镑 264,319	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(1,363)
美元 487,040	离岸人民币 3,351,468	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(1,369)
美元 161,258	英镑 121,216	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(1,414)
美元 77,349	加元 105,868	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(1,451)
美元 379,719	离岸人民币 2,606,980	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(1,934)
美元 787,511	离岸人民币 5,420,131	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(2,064)
美元 149,709	英镑 111,952	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(2,081)
美元 713,300	离岸人民币 4,906,005	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(2,356)
美元 388,238	离岸人民币 2,661,374	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(2,570)
美元 188,196	加元 258,193	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(3,094)
美元 808,651	离岸人民币 5,558,448	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(3,159)
美元 128,525	加元 174,804	2026年4月13日	法国巴黎银行	(3,205)
美元 176,213	加元 241,284	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(3,233)
美元 104,317	澳元 147,462	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(3,335)
美元 162,228	加元 221,614	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(3,350)
美元 194,055	加元 265,049	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(4,037)
美元 120,438	澳元 169,718	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(4,215)
美元 1,229,177	离岸人民币 8,456,672	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(4,235)
美元 202,004	澳元 288,423	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(4,491)
美元 451,492	英镑 338,916	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(4,574)
美元 792,478	离岸人民币 5,437,029	2026年4月13日	法国巴黎银行	(4,581)
美元 752,413	离岸人民币 5,159,990	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(4,663)
美元 214,075	澳元 305,659	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(4,759)
美元 382,306	英镑 286,169	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(4,943)
美元 178,285	加元 241,651	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(5,041)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／ (亏损) 美元
美元 1,402,493	离岸人民币 9,642,978	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(5,100)
美元 221,669	英镑 163,994	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(5,414)
美元 192,972	加元 261,386	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(5,580)
美元 295,025	英镑 219,412	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(5,692)
美元 286,169	加元 390,786	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(6,009)
美元 645,408	英镑 484,482	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(6,536)
美元 1,396,469	离岸人民币 9,591,103	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(6,536)
美元 799,551	离岸人民币 5,471,256	2026年4月13日	法国巴黎银行	(6,593)
美元 329,563	澳元 471,211	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(6,695)
美元 568,659	英镑 426,016	2026年4月13日	法国巴黎银行	(6,877)
美元 2,645,090	离岸人民币 18,205,089	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(6,884)
美元 642,012	英镑 481,219	2026年4月13日	高盛国际, 伦敦	(6,936)
美元 1,234,194	离岸人民币 8,464,007	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(7,443)
美元 268,349	澳元 380,581	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(7,649)
美元 505,294	英镑 377,134	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(7,727)
美元 448,680	加元 613,738	2026年4月13日	法国巴黎银行	(7,979)
美元 421,923	加元 576,323	2026年4月13日	法国巴黎银行	(8,682)
美元 278,955	澳元 394,329	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(8,748)
美元 361,766	澳元 492,161	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(8,919)
美元 478,121	英镑 355,304	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(8,928)
美元 868,062	英镑 650,636	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(9,592)
美元 259,507	澳元 364,200	2026年4月13日	摩根士丹利国际股份有限公司	(10,087)
美元 1,971,546	离岸人民币 13,527,371	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(10,103)
美元 604,029	加元 826,732	2026年4月13日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(11,254)
美元 431,467	澳元 613,382	2026年4月13日	摩根士丹利国际股份有限公司	(11,332)
美元 666,003	加元 913,027	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(11,422)
美元 466,566	澳元 662,436	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(11,440)
美元 591,881	加元 807,124	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(12,929)
美元 1,373,696	英镑 1,031,195	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(13,242)
美元 460,107	澳元 650,733	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(13,889)
美元 1,180,310	英镑 883,478	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(14,485)
美元 676,089	英镑 500,923	2026年4月13日	高盛国际, 伦敦	(15,294)
美元 804,169	加元 1,097,772	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(15,536)
美元 753,351	澳元 1,074,651	2026年4月13日	摩根士丹利国际股份有限公司	(17,160)
美元 701,813	英镑 518,484	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(17,429)
美元 545,394	澳元 768,553	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(18,103)
美元 760,016	加元 1,032,339	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(19,088)
美元 859,863	英镑 636,852	2026年4月13日	法国巴黎银行	(19,917)
美元 691,329	澳元 980,206	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(20,065)
美元 1,868,871	离岸人民币 12,751,120	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(20,082)
美元 876,859	加元 1,192,891	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(21,067)
美元 1,003,090	英镑 743,983	2026年4月13日	高盛国际, 伦敦	(21,658)
美元 766,701	澳元 1,086,132	2026年4月13日	高盛国际, 伦敦	(22,022)
美元 984,065	英镑 728,180	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(22,917)
美元 823,953	澳元 1,167,589	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(23,835)
美元 960,871	澳元 1,366,459	2026年4月13日	法国巴黎银行	(24,387)
美元 1,342,180	加元 1,832,060	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(25,118)
美元 2,592,654	离岸人民币 17,682,117	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(25,118)
美元 3,222,114	离岸人民币 22,025,200	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(28,749)
美元 1,242,426	英镑 918,798	2026年4月13日	高盛国际, 伦敦	(30,285)
美元 1,271,507	加元 1,729,351	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(30,375)
美元 1,438,127	加元 1,957,916	2026年4月13日	摩根士丹利国际股份有限公司	(30,835)
美元 1,894,176	澳元 2,704,417	2026年4月13日	法国巴黎银行	(31,710)
美元 1,305,858	澳元 1,837,247	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(34,468)
美元 1,436,911	澳元 2,024,300	2026年4月13日	高盛国际, 伦敦	(42,189)
美元 1,718,607	澳元 2,429,367	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(47,710)
美元 1,374,654	澳元 1,923,443	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(50,668)
美元 1,850,683	澳元 2,612,882	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(54,974)
美元 1,511,947	澳元 2,115,132	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(57,478)
美元 2,352,350	澳元 3,319,781	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(61,379)
美元 5,497,468	英镑 4,104,226	2026年4月13日	法国巴黎银行	(63,503)
美元 2,272,758	澳元 3,193,755	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(78,961)
美元 42,051,437	加元 57,435,872	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(85,343)
美元 138,950,512	离岸人民币 948,066,016	2026年4月13日	摩根士丹利国际股份有限公司	(85,671)
美元 64,934,228	英镑 48,049,492	2026年4月13日	巴克莱银行, 伦敦	(87,814)
美元 100,796,783	澳元 142,001,500	2026年4月13日	Citibank N.A., 伦敦	(1,563,399)
离岸人民币 29,868	美元 4,337	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(1,572,756)
			巴克莱银行, 伦敦	(3,554,014)
			法国巴黎银行	(1)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／ (亏损) 美元
离岸人民币 7,609	美元 1,104	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
离岸人民币 7,593	美元 1,101	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(2)
离岸人民币 13,527	美元 1,962	2026年5月13日	高盛国际, 伦敦	(3)
离岸人民币 331,590	美元 48,090	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(67)
离岸人民币 6,181,250	美元 897,484	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(235)
离岸人民币 20,357,425	美元 2,955,867	2026年5月13日	法国巴黎银行	(693)
离岸人民币 9,217,706	美元 1,336,868	2026年5月13日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,842)
英镑 880,769	美元 1,161,366	2026年5月13日	法国巴黎银行	(11)
美元 3,004	英镑 2,278	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
美元 1,689	加元 2,353	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
美元 6,593	英镑 5,000	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
美元 7,280	加元 10,141	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
美元 26,870	澳元 39,253	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
美元 3,365	英镑 2,549	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(3)
美元 4,486	离岸人民币 30,866	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
美元 88,552	澳元 129,357	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
美元 6,465	离岸人民币 44,437	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(12)
美元 1,143	加元 1,564	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(20)
美元 1,391	英镑 1,039	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(20)
美元 33,608	离岸人民币 231,238	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(24)
美元 875,282	澳元 1,278,622	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(37)
美元 26,642	离岸人民币 183,119	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(48)
美元 69,838	澳元 101,924	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(68)
美元 6,385	澳元 9,174	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(106)
美元 23,370	加元 32,305	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(179)
美元 20,347	澳元 29,453	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(186)
美元 15,504	英镑 11,613	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(191)
美元 345,598	离岸人民币 2,377,899	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(250)
美元 28,200	加元 38,835	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(322)
美元 216,205	离岸人民币 1,486,022	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(386)
美元 69,586	英镑 52,361	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(543)
美元 44,826	英镑 33,576	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(553)
美元 240,852	离岸人民币 1,654,380	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(582)
美元 89,807	加元 124,143	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(689)
美元 1,001,985	离岸人民币 6,894,196	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(724)
美元 146,349	加元 202,772	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(788)
美元 310,327	加元 431,181	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(800)
美元 72,673	加元 99,478	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(1,262)
美元 137,957	英镑 103,072	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(2,046)
美元 171,260	加元 235,251	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(2,383)
美元 136,237	澳元 194,887	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(2,833)
美元 219,813	英镑 164,400	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(3,037)
美元 253,111	英镑 189,172	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(3,670)
美元 486,019	澳元 703,524	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(4,441)
美元 218,530	澳元 312,606	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(4,544)
美元 922,111	澳元 1,339,339	2026年5月13日	巴克莱银行, 伦敦	(5,304)
美元 352,421	澳元 506,534	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(5,688)
美元 591,440	澳元 849,725	2026年5月13日	Citibank N.A., 伦敦	(9,785)
美元 98,130,499	澳元 143,252,962	2026年5月13日	渣打银行, 伦敦	(70,695)
美元 46,271,189	加元 64,264,865	2026年5月13日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(138,136)
美元 58,599,533	英镑 44,268,026	2026年5月13日	加拿大皇家银行	(228,025)
			未实现总亏损	(9,787,281)
			未实现净亏损	(7,810,949)

(b) 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		
FTSE Taiwan Index 29/04/2026	FTSE Taiwan Index	Citigroup Global Markets Ltd (4,548,470)
HSCEI Futures 29/04/2026	HSCEI Index	Citigroup Global Markets Ltd (193,254)
KOSPI2 Index Futures 11/06/2026	KOSPI2 Index	Citigroup Global Markets Ltd (4,040,553)
	未实现总亏损	(8,782,277)

(c) 卖出期权合约

以下为于二零二六年三月三十一日之卖出期权合约：

标的资产	交易对手	公允价值 美元
于 2026 年 3 月 31 日		
Call OTC IOPT AS51 01/04/2026 8,980.00	AS51 Index	UBS AG, London Branch -
Call OTC IOPT KOSPI2 02/04/2026 889.00	KOSPI2 Index	法国巴黎银行 -
Call OTC IOPT AS51 08/04/2026 8,865.00	AS51 Index	UBS AG, London Branch (3,414)
Call HSCEI Future Options 17/04/2026 8,500.00	HCJ6 COMB Index	Citigroup Global Markets Ltd (4,400)
Call HSCEI Future Options 15/05/2026 8,500.00	HCK6 COMB Index	Citigroup Global Markets Ltd (5,510)
Call Taiwan Stock Exchange Weighted 15/04/2026 34,200.00	TWSE Index	Citigroup Global Markets Ltd (13,137)
Call Taiwan Stock Exchange Weighted 15/04/2026 34,300.00	TWSE Index	Citigroup Global Markets Ltd (14,914)
Call Korea Stock Exchange Kospi 200 09/04/2026 870.00	KOSPI2 Index	Citigroup Global Markets Ltd (26,499)
Call Korea Stock Exchange Kospi 200 09/04/2026 865.00	KOSPI2 Index	Citigroup Global Markets Ltd (29,274)
Call Korea Stock Exchange Kospi 200 09/04/2026 867.50	KOSPI2 Index	Citigroup Global Markets Ltd (29,274)
Call Taiwan Stock Exchange Weighted 15/04/2026 34,900.00	TWSE Index	Citigroup Global Markets Ltd (33,729)
Call Taiwan Stock Exchange Weighted 15/04/2026 34,800.00	TWSE Index	Citigroup Global Markets Ltd (38,517)
Call Taiwan Stock Exchange Weighted 15/04/2026 35,300.00	TWSE Index	Citigroup Global Markets Ltd (49,274)
Call HSCEI Future Options 17/04/2026 8,600.00	HCJ6 COMB Index	Citigroup Global Markets Ltd (51,657)
Call HSI Future Options 17/04/2026 25,400.00	HIJ6 COMB Index	Citigroup Global Markets Ltd (56,695)
Call Taiwan Stock Exchange Weighted 15/04/2026 35,000.00	TWSE Index	Citigroup Global Markets Ltd (62,878)
Call OTC IOPT AS51 15/04/2026 8,775.00	AS51 Index	UBS AG, London Branch (74,736)
Call OTC IOPT KOSPI2 16/04/2026 902.00	KOSPI2 Index	高盛国际, 伦敦 (79,385)
Call Taiwan Stock Exchange Weighted 15/04/2026 35,200.00	TWSE Index	Citigroup Global Markets Ltd (80,175)
Call Taiwan Stock Exchange Weighted 15/04/2026 35,100.00	TWSE Index	Citigroup Global Markets Ltd (86,439)
Call OTC IOPT AS51 22/04/2026 8,670.00	AS51 Index	UBS AG, London Branch (286,409)
Call OTC IOPT KOSPI2 23/04/2026 850.00	KOSPI2 Index	法国巴黎银行 (397,793)
Call HSI Future Options 17/04/2026 25,800.00	HIJ6 COMB Index	Citigroup Global Markets Ltd (416,125)
Call HSI Future Options 17/04/2026 25,600.00	HIJ6 COMB Index	Citigroup Global Markets Ltd (546,510)
Call HSCEI Future Options 17/04/2026 8,700.00	HCJ6 COMB Index	Citigroup Global Markets Ltd (900,742)
	总金融负债	(3,287,486)

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	63,327,449	50,846,321
应收经纪款项	14,567,745	3,996,075
分配应收款项	38,983,641	37,436,510
保证金	81,255,083	10,507,269
衍生性产品	1,976,332	1,388,694
投资	2,303,081,695	991,130,941
股息、利息及其他应收款项	11,315,146	16,658,573
总资产	2,514,507,091	1,111,964,383
负债		
流动负债		
透支经纪款项	-	797,951
短期银行借款 - 无抵押	-	12,600,000
应付经纪款项	42,903,349	31,647,024
赎回应付款项	7,884,825	11,405,746
应付收益分配 [附注 6]	17,100,297	6,988,414
衍生性产品	21,857,044	5,119,202
应付税项	-	1,308,322
其他应付款项	3,357,211	1,485,346
总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)	93,102,726	71,352,005
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	2,421,404,365	1,040,612,378

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亏损[附注 4]	(12,364,825)	(31,564,116)
股息收入	19,500,646	5,344,771
存款利息	982,886	123,358
汇兑净亏损	(4,152,713)	(1,081,005)
其他收益	4,685	171,106
	3,970,679	(27,005,886)
支出		
管理费用 [附注 5(a)]	12,895,918	3,608,114
交易成本 [附注 5(b)]	2,452,226	545,409
托管费用及银行费用 [附注 5(a), 5(b)]	329,333	103,771
受托人费用 [附注 5(b)]	224,456	69,964
基金注册登记机构费用 [附注 5(a)]	87,710	39,306
法律及专业费用	49,231	94,078
核数师酬金	29,371	4,619
估值费用 [附注 5(a)]	8,400	8,470
印刷及出版支出	3,878	1,360
其他经营费用	1,857	3,717
	16,082,380	4,478,808
净经营亏损	(12,111,701)	(31,484,694)
财务成本		
收益分配 [附注 6]	(71,630,962)	(20,408,450)
利息支出 [附注 5(b)]	(327,587)	(64,070)
	(71,958,549)	(20,472,520)
除税前亏损	(84,070,250)	(51,957,214)
税项	(694,476)	284,621
可赎回份额持有人应占净资产及 总综合亏损之减少	(84,764,726)	(51,672,593)

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	1,040,612,378	489,665,231
分配可赎回份额 [附注 3]	2,513,418,633	306,373,469
赎回可赎回份额 [附注 3]	(1,047,861,920)	(262,060,921)
净分配	1,465,556,713	44,312,548
	2,506,169,091	533,977,779
可赎回份额持有人应占净资产及总综合亏损之减少	(84,764,726)	(51,672,593)
期末可赎回份额持有人应占净资产	2,421,404,365	482,305,186

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	(1,855,700,529)	(208,199,584)
出售投资及衍生性产品所得款项	548,198,603	186,412,787
已收股息	14,600,246	4,330,045
已收利息	982,886	123,358
已付基金注册登记机构费用	(132,058)	(85,384)
已付受托人费用	(192,515)	(69,847)
透支经纪款项之减少	(797,951)	-
已付税项	(2,002,798)	(682,327)
已付交易成本	(2,444,813)	(554,189)
已付管理费用	(10,992,744)	(3,606,812)
保证金之(增加)/减少	(70,747,814)	12,917,068
其他	5,560,927	(1,163,759)
经营业务所运用之现金净额	(1,373,668,560)	(10,578,644)
融资活动		
已付利息	(327,587)	(64,238)
分配可赎回份额所得款项	2,511,871,502	317,002,139
赎回可赎回份额付款	(1,051,382,841)	(282,882,763)
已付收益分配	(61,519,079)	(19,711,775)
融资活动所产生之现金净额	1,398,641,995	14,343,363
现金及现金等价物之增加	24,973,435	3,764,719
期初现金及现金等价物	38,246,321	17,876,058
现金及现金等价物之汇兑收益/(亏损)	107,693	(327,098)
期末现金及现金等价物	63,327,449	21,313,679
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	63,327,449	24,613,679
短期银行借款 - 无抵押	-	(3,300,000)
	63,327,449	21,313,679

财务报表之附注

1 本基金

摩根亚洲股票高息基金（“本基金”）根据一九八一年六月五日的信托契约（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。

本基金之投资目标为通过主要（即其资产净值总额至少 70%）投资于亚洲（日本除外）上市公司的股票证券，并在适当情况下使用衍生工具，从而产生高水平的收入，同时维持长远资本增值前景。同时，本基金拟通过使用衍生工具提供波幅小于大市的回报流。

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。本基金按公平值对金融资产组合进行管理并评估业绩。本基金主要关注公平值信息，并运用该等信息对资产业绩进行评估，从而作出相应决策。

公平值为负数的衍生性产品合约列示为按公平值透过损益列账的负债。

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公平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平值确认，其后以公平值重新计量。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。

未平仓期货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。

未平仓期权合约是以在估值日的长短仓最后交易价估值。最后交易价与溢价金额/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。

(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

	澳元类别 (累计) 份额	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
期初	216,362.186	6,392,472.585	2,182,881.851	1,281,084.388	260,838,967.198
总分配	239,404.662	13,961,812.189	5,473,021.550	4,744,902.563	649,391,540.456
总赎回	(100,634.671)	(7,197,769.466)	(1,935,221.461)	(2,078,860.593)	(263,835,861.046)
期末	355,132.177	13,156,515.308	5,720,681.940	3,947,126.358	646,394,646.608
	人民币对冲类别 (icn 月派) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 I2 类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	-	41,973,595.425	517,920.173	42,069,915.592	296,104.087
总分配	137,820.000	71,441,175.120	596,413.636	94,645,435.819	9,623.552
总赎回	-	(34,141,248.163)	(359,415.189)	(38,237,660.566)	(104,100.520)
期末	137,820.000	79,273,522.382	754,918.620	98,477,690.845	201,627.119

1.10.2024 至 31.3.2025

	澳元类别 (累计) 份额	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
期初	264,347.112	3,210,153.470	941,380.304	906,995.269	149,641,544.800
总分配 总赎回	95,774.419 (150,932.277)	3,642,625.158 (2,201,220.559)	648,895.050 (547,631.091)	435,108.870 (620,169.967)	95,186,057.279 (84,325,871.275)
期末	209,189.254	4,651,558.069	1,042,644.263	721,934.172	160,501,730.804

	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 I2 类别 (累计) 份额	美元 I2 类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
期初	24,368,741.471	442,137.865	15,613,286.500	-	673,023.129
总分配 总赎回	17,641,944.144 (13,920,694.165)	55,453.926 (108,990.311)	11,294,310.000 (8,980,740.216)	100.000 -	144,806.583 (505,004.733)
期末	28,089,991.450	388,601.480	17,926,856.284	100.000	312,824.979

31.3.2026

	澳元类别 (累计) 澳元	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	英镑对冲类别 (每月派息) 英镑	港元类别 (每月派息) 港元
可赎回份额持有人应占净 资产	9,693,435	138,762,346	61,359,709	41,820,054	7,321,943,640

可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	27.30	10.55	10.73	10.60	11.33
-------------------------	-------	-------	-------	-------	-------

	人民币对冲类别 (icn 月派) 人民币	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	美元类别 (累计) 美元	美元类别 (每月派息) 美元	美元 I2 类别 (累计) 美元
可赎回份额持有人应占净 资产	1,300,397	882,882,636	45,661,154	1,110,561,976	2,471,926

可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	9.44	11.14	60.48	11.28	12.26
-------------------------	------	-------	-------	-------	-------

30.9.2025

	澳元类别 (累计) 澳元	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	英镑对冲类别 (每月派息) 英镑	港元类别 (每月派息) 港元
可赎回份额持有人应占净资产	5,895,194	67,986,998	23,561,489	13,642,122	2,950,544,892
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	27.25	10.64	10.79	10.65	11.31
	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	美元类别 (累计) 美元	美元类别 (每月派息) 美元	美元 I2 类别 (累计) 美元	美元 I2 类别 (每月派息) 美元
可赎回份额持有人应占净资产	470,298,794	30,265,319	477,378,077	3,491,657	-
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	11.20	58.44	11.35	11.79	-

4 投资及衍生性产品净亏损

	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	(52,566,937)	(27,306,291)
投资及衍生性产品销售之实现收益/(亏损)	40,202,112	(4,257,825)
	(12,364,825)	(31,564,116)

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支付的金额列示如下：

	1.10.2025 至 31.3.2026 美元	1.10.2024 至 31.3.2025 美元
管理费用	12,895,918	3,608,114
基金注册登记机构费用	87,710	39,306
托管费用及银行费用	10,180	7,782
估值费用	8,400	8,470

(b) 截至二零二六年及二零二五年三月三十一日止期间，已付受托人汇丰机构信托服务（亚洲）有限公司及其关联人士的金额列示如下：

	1.10.2025 至 31.3.2026 美元	1.10.2024 至 31.3.2025 美元
利息支出	327,587	64,070
受托人费用	224,456	69,964
托管费用及银行费用	214,144	76,733
交易成本	52,940	33,911

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 31.3.2026</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 0.0668	7,859,272.371	(343,691)
加元对冲类别（每月派息）	2025年10月31日	2025年11月10日	加元 0.0561	2,717,349.851	(108,799)
英镑对冲类别（每月派息）	2025年10月31日	2025年11月10日	英镑 0.0704	1,743,967.306	(161,308)
港元类别（每月派息）	2025年10月31日	2025年11月10日	港元 0.0762	297,107,827.762	(2,912,897)
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 0.0498	51,632,521.013	(361,023)
美元类别（每月派息）	2025年10月31日	2025年11月10日	美元 0.0765	51,085,204.662	(3,908,018)
澳元对冲类别（每月派息）	2025年11月28日	2025年12月8日	澳元 0.0680	8,300,096.785	(370,138)
加元对冲类别（每月派息）	2025年11月28日	2025年12月8日	加元 0.0561	2,889,089.701	(116,264)
英镑对冲类别（每月派息）	2025年11月28日	2025年12月8日	英镑 0.0718	2,105,421.728	(200,299)
港元类别（每月派息）	2025年11月28日	2025年12月8日	港元 0.0764	324,693,735.059	(3,186,216)
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 0.0524	54,325,759.502	(402,701)
美元类别（每月派息）	2025年11月28日	2025年12月8日	美元 0.0765	56,109,000.121	(4,292,338)
澳元对冲类别（每月派息）	2025年12月31日	2026年1月9日	澳元 0.0696	7,892,565.887	(366,316)
加元对冲类别（每月派息）	2025年12月31日	2026年1月9日	加元 0.0553	2,724,001.837	(109,894)
英镑对冲类别（每月派息）	2025年12月31日	2026年1月9日	英镑 0.0721	2,132,793.574	(206,834)
港元类别（每月派息）	2025年12月31日	2026年1月9日	港元 0.0762	328,631,958.803	(3,217,287)
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 0.0519	53,535,825.807	(398,070)
美元类别（每月派息）	2025年12月31日	2026年1月9日	美元 0.0765	54,891,503.713	(4,199,199)
澳元对冲类别（每月派息）	2026年1月30日	2026年2月9日	澳元 0.0771	11,222,133.360	(606,134)
加元对冲类别（每月派息）	2026年1月30日	2026年2月9日	加元 0.0635	4,115,115.383	(192,970)
英镑对冲类别（每月派息）	2026年1月30日	2026年2月9日	英镑 0.0790	3,193,642.774	(346,215)
港元类别（每月派息）	2026年1月30日	2026年2月9日	港元 0.0836	502,223,321.267	(5,376,118)
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 0.0603	73,907,850.445	(641,124)
美元类别（每月派息）	2026年1月30日	2026年2月9日	美元 0.0837	77,472,353.459	(6,484,435)
澳元对冲类别（每月派息）	2026年2月27日	2026年3月9日	澳元 0.0792	12,248,286.937	(691,316)
加元对冲类别（每月派息）	2026年2月27日	2026年3月9日	加元 0.0653	5,105,445.149	(244,444)
英镑对冲类别（每月派息）	2026年2月27日	2026年3月9日	英镑 0.0790	4,257,977.540	(452,246)
港元类别（每月派息）	2026年2月27日	2026年3月9日	港元 0.0838	585,944,569.797	(6,277,322)
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 0.0615	80,323,379.979	(720,006)
美元类别（每月派息）	2026年2月27日	2026年3月9日	美元 0.0837	91,243,058.052	(7,637,043)
澳元对冲类别（每月派息）	2026年3月31日	2026年4月13日	澳元 0.0806	13,019,718.348	(718,727)
加元对冲类别（每月派息）	2026年3月31日	2026年4月13日	加元 0.0645	5,719,741.795	(264,357)
英镑对冲类别（每月派息）	2026年3月31日	2026年4月13日	英镑 0.0786	3,946,654.660	(409,070)
港元类别（每月派息）	2026年3月31日	2026年4月13日	港元 0.0840	641,558,412.103	(6,873,665)
人民币对冲类别（icn月派）	2026年3月31日	2026年4月13日	人民币 0.0700	137,820.000	(1,397)
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 0.0587	79,710,270.875	(677,457)
美元类别（每月派息）	2026年3月31日	2026年4月13日	美元 0.0837	97,438,763.449	(8,155,624)
可赎回份额持有人之总收益分配					<u>(71,630,962)</u>

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
<u>1.10.2024 至 31.3.2025</u>					
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	澳元 0.0637	3,587,200.683	(149,671)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	加元 0.0603	768,270.355	(33,234)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	英镑 0.0686	777,423.394	(68,565)
港元类别 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	港元 0.0718	159,780,593.965	(1,475,644)
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 0.0447	26,878,997.121	(168,563)
美元类别 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	美元 0.0721	17,247,874.759	(1,243,571)
美元 I2 类别 (每月派息)	2024 年 10 月 31 日	2024 年 11 月 8 日	美元 0.0663	685,623.616	(45,457)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	澳元 0.0655	3,720,082.767	(158,736)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	加元 0.0596	804,097.456	(34,228)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	英镑 0.0688	818,522.131	(71,578)
港元类别 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	港元 0.0719	165,114,908.924	(1,525,629)
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 0.0549	27,421,297.815	(207,628)
美元类别 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	美元 0.0721	17,784,252.687	(1,282,244)
美元 I2 类别 (每月派息)	2024 年 11 月 29 日	2024 年 12 月 9 日	美元 0.0664	739,492.437	(49,102)
澳元对冲类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	澳元 0.0662	3,451,176.601	(141,456)
加元对冲类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	加元 0.0569	725,026.910	(28,684)
英镑对冲类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	英镑 0.0691	771,437.174	(66,761)
港元类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	港元 0.0718	159,111,180.172	(1,470,682)
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 0.0570	25,663,804.733	(199,256)
美元类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	美元 0.0721	16,682,710.857	(1,202,823)
美元 I2 类别 (每月派息)	2024 年 12 月 31 日	2025 年 1 月 9 日	美元 0.0665	493,594.692	(32,824)
澳元对冲类别 (每月派息)	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	澳元 0.0754	3,934,039.755	(185,228)
加元对冲类别 (每月派息)	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	加元 0.0651	753,477.779	(34,080)
英镑对冲类别 (每月派息)	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	英镑 0.0779	791,270.618	(76,637)
港元类别 (每月派息)	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	港元 0.0796	161,225,778.133	(1,647,294)
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 0.0709	28,661,240.625	(279,176)
美元类别 (每月派息)	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	美元 0.0798	16,749,008.759	(1,336,571)
美元 I2 类别 (每月派息)	2025 年 1 月 28 日	2025 年 2 月 10 日	美元 0.0736	480,574.718	(35,370)
澳元对冲类别 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	澳元 0.0745	4,010,739.740	(185,809)
加元对冲类别 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	加元 0.0646	883,174.198	(39,605)
英镑对冲类别 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	英镑 0.0765	858,370.349	(82,682)
港元类别 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	港元 0.0796	153,373,060.151	(1,569,922)
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 0.0636	27,067,686.899	(236,064)
美元类别 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	美元 0.0798	17,108,933.825	(1,365,293)
美元 I2 类别 (每月派息)	2025 年 2 月 28 日	2025 年 3 月 10 日	美元 0.0736	453,452.172	(33,374)
澳元对冲类别 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	澳元 0.0732	4,652,830.651	(212,237)
加元对冲类别 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	加元 0.0624	1,045,417.065	(45,325)
英镑对冲类别 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	英镑 0.0763	726,980.724	(71,596)
港元类别 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	港元 0.0795	160,279,501.006	(1,637,754)
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 0.0570	28,071,737.498	(220,219)
美元类别 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	美元 0.0798	17,893,293.583	(1,427,884)
美元 I2 类别 (每月派息)	2025 年 3 月 31 日	2025 年 4 月 9 日	美元 0.0737	406,970.637	(29,994)
可赎回份额持有人之总收益分配					(20,408,450)

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

管理人董事

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

投资管理人

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

受托人

汇丰机构信托服务（亚洲）
有限公司
香港
中环皇后大道中 1 号

基金注册登记机构

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

核数师

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

