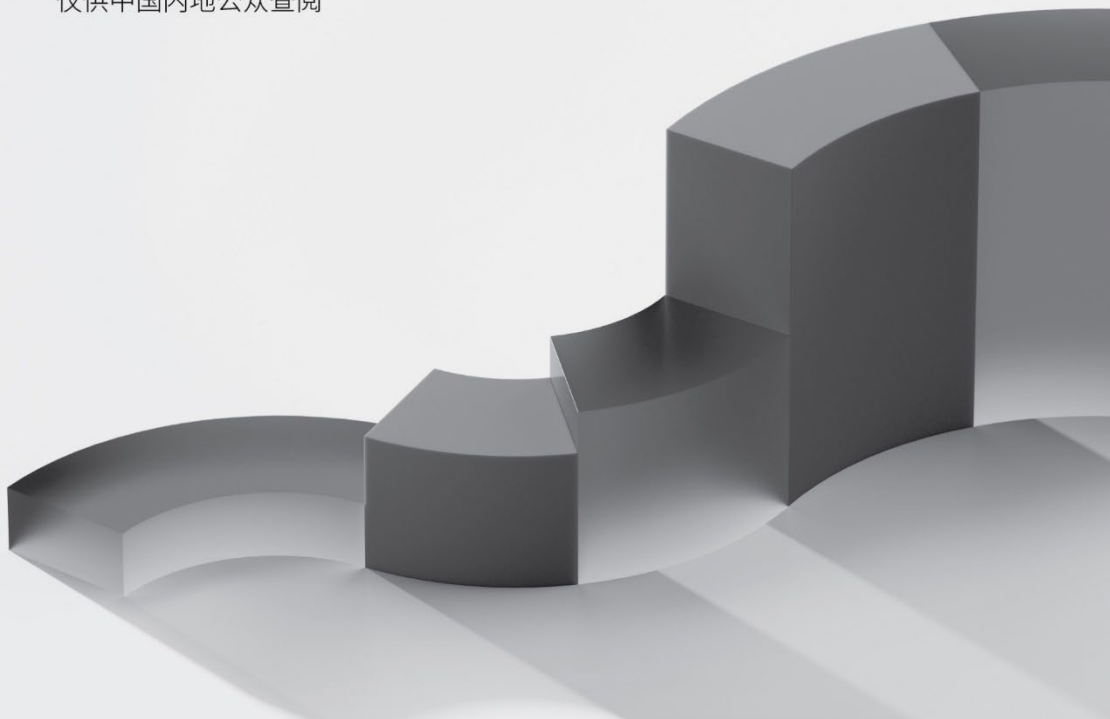


仅供中国内地公众查阅



年度报告 — 2023年9月30日（经审核）

# 摩根亚洲股息基金

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 - 未经审计	1 – 2
投资组合持有变动表 - 未经审计	2
金融衍生工具详情 - 未经审计	3
金融衍生工具风险敞口信息 - 未经审计	3
财务状况表	4
综合收益表	4
可赎回份额持有人应占净资产变动表	5
现金流量表	5
财务报表之附注	6 – 42
独立核数师报告	43 – 44
管理人及受托人的责任声明	45
受托人对份额持有人的报告	45
业绩纪录 - 未经审计	46 – 47
经营与管理	48

投资组合

(续)

于二零二三年九月三十日 (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
<b>上市投资 (99.9%)</b>				申洲国际集团控股有限公司	1,494,400	14,310,795	1.3
				康师傅控股有限公司	4,128,000	5,766,239	0.5
<b>(I) 股票 (99.8%)</b>				万华化学集团股份有限公司			
				A 股(C1)	465,600	5,644,140	0.5
<b>澳大利亚 (15.3%)</b>				宜宾五粮液股份有限公司 A 股			
Australia & New Zealand				(C2)	995,647	21,332,120	2.0
Banking Group Ltd	707,438	11,715,855	1.1	紫金矿业集团股份有限公司			
BHP Group Ltd	461,082	13,168,018	1.2	H 股	5,238,000	8,012,314	0.8
Brambles Ltd	2,348,932	21,709,130	2.0	<b>香港 (7.5%)</b>			
Insurance Australia Group Limited	1,384,656	5,075,972	0.5	友邦保险控股有限公司	3,192,200	26,024,754	2.4
Macquarie Group Ltd	63,852	6,912,167	0.6	长江基建集团有限公司	1,192,000	5,638,974	0.5
Medibank Private Ltd	5,595,057	12,422,011	1.1	中电控股有限公司	2,994,500	22,157,124	2.0
QBE Insurance Group Limited	1,954,900	19,821,189	1.8	香港电讯信托与香港电讯有限公司	3,831,000	4,001,300	0.4
Santos Ltd	5,736,938	29,250,696	2.7	香港交易及结算所有限公司	395,435	14,773,557	1.4
Telstra Group Ltd	6,344,900	15,765,744	1.4	昆仑能源有限公司	5,158,000	4,445,501	0.4
Transurban Group	605,657	4,960,407	0.5	敏华控股有限公司	5,574,400	3,914,682	0.4
Westpac Banking Corp	624,631	8,526,344	0.8	<b>印度 (4.4%)</b>			
Woolworths Group Ltd	702,755	16,926,788	1.6	HDFC Bank Limited	747,100	13,731,714	1.2
<b>中国 (26.1%)</b>				Infosys Technologies Ltd Sponsored ADR	1,634,600	27,968,006	2.6
中国建设银行股份有限公司 H 股	25,693,000	14,500,158	1.3	Power Grid Corp of India	2,572,496	6,187,962	0.6
中国招商银行股份有限公司 H 股	4,152,000	17,335,674	1.6	<b>印度尼西亚 (5.5%)</b>			
中国海外发展有限公司	3,061,500	6,348,278	0.6	Bank Central Asia	33,324,500	19,028,710	1.8
中国太平洋保险 (集团) 股份有限公司 H 股	2,287,200	5,723,950	0.5	Bank Rakyat Indonesia Persero	89,488,200	30,254,018	2.8
华润置地有限公司	1,960,000	7,808,117	0.7	Telkom Indonesia Persero	40,251,000	9,766,499	0.9
中国长江电力股份有限公司 A 股(C1)	7,776,550	23,738,184	2.2	<b>韩国 (13.9%)</b>			
福耀玻璃工业集团股份有限公司 H 股	4,069,600	18,654,423	1.7	BGF Retail Co Ltd	49,514	5,173,762	0.5
海尔智家股份有限公司 H 股	5,822,801	18,326,710	1.7	Hana Financial Holdings	276,000	8,682,525	0.8
内蒙古伊利实业集团股份有限公司 A 股(C1)	5,898,914	21,480,038	2.0	Hyundai Motor Co Ltd Pref	31,419	2,465,742	0.2
顾家家居股份有限公司 A 股(C1)	1,771,899	9,847,194	0.9	KB Financial Group	345,869	14,174,119	1.3
京东集团股份有限公司	595,700	8,754,645	0.8	KIWOOM Securities Co Ltd	87,783	6,141,037	0.6
美的集团股份有限公司 A 股(C2)	2,938,764	22,378,290	2.1	LG Chem Limited Preference Shares	35,922	8,305,665	0.8
国电南瑞科技股份有限公司 A 股(C1)	1,882,640	5,733,903	0.5	LG Chemical	8,014	2,948,681	0.3
网易股份有限公司	1,450,200	29,534,133	2.7	Samsung Electronics Co Ltd	1,252,044	63,465,103	5.8
中国人民财产保险股份有限公司 H 股	1,896,000	2,435,409	0.2	Samsung Electronics Co Ltd Preference Shares	360,200	14,547,873	1.3
中国平安保险 (集团) 股份有限公司 H 股	2,313,000	13,245,664	1.2	Samsung Fire and Marine Insurance Company Limited	61,415	11,856,090	1.1
中国平安保险 (集团) 股份有限公司 A 股(C1)	413,109	2,738,656	0.3	SK Telecom Company Limited	350,353	13,501,079	1.2
				<b>马来西亚 (0.6%)</b>			
				CIMB Group Holdings BHD	5,546,005	6,413,888	0.6
				<b>新加坡 (6.0%)</b>			
				DBS Group Holdings Ltd	992,121	24,452,304	2.3

投资组合 (续)

于二零二三年九月三十日 (未经审计)

投资组合持有变动表

截至二零二三年九月三十日止年度 (未经审计)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比	持有占资产净值百分比	
				2023	2022
<b>新加坡 (续)</b>					
<b>Singapore Exchange</b>					
Limited	3,648,800	26,064,767	2.4		
United Overseas Bank Ltd	691,600	14,441,058	1.3		
<b>台湾 (15.1%)</b>					
智邦科技股份有限公司	1,068,000	16,310,900	1.5	26.1	18.2
研华股份有限公司	758,929	8,111,104	0.8	15.3	22.1
日月光投资控股股份有限公司	1,782,000	6,044,795	0.6	15.1	12.3
儒鸿企业股份有限公司	319,000	4,812,596	0.4	13.9	10.3
亿丰综合工业股份有限公司	710,000	6,818,358	0.6	7.5	15.7
统一超商股份有限公司	1,294,000	10,522,607	1.0	6.0	9.4
台湾积体电路制造股份 有限公司	5,654,000	91,604,591	8.4	5.5	5.9
联华电子股份有限公司	6,856,000	9,599,950	0.9	4.4	3.1
纬颖科技服务股份有限公司	216,000	10,003,562	0.9	3.2	0.8
				2.2	2.0
				0.6	0.5
<b>泰国 (2.2%)</b>					
Bangkok Bank PCL (F)	1,452,200	6,680,220	0.6		
SCB X PCL	3,870,100	10,894,205	1.0		
Tisco Financial Group PCL	2,133,000	5,784,655	0.6		
<b>英国 (3.2%)</b>					
HSBC Holdings PLC	1,680,800	13,241,490	1.2		
RIO Tinto PLC	342,040	21,600,256	2.0		
		1,082,459,138	99.8	0.1	(1.3)
<b>(II) 衍生性产品 (0.1%)</b>					
<b>远期外汇合约 (0.1%)</b>					
		1,478,422	0.1		
<b>总上市投资</b>					
		1,083,937,560	99.9	99.9	99.0
<b>其他净资产</b>					
		1,085,488	0.1	0.1	1.0
<b>于二零二三年九月三十日可赎回份额持有人应占净资产</b>					
		1,085,023,048	100.0	100.0	100.0
<b>总投资, 按成本</b>					
		1,107,125,371			

**金融衍生工具详情**

于二零二三年九月三十日 (未经审计)

于二零二三年九月三十日，本基金持有之未平仓远期外汇合约，详情请参阅附注 11。

**金融衍生工具风险敞口信息**

截至二零二三年九月三十日止年度 (未经审计)

截至二零二三年九月三十日止年度，本基金就任何目的而使用的金融衍生工具所产生的最低、最高及平均总敞口，占本基金资产净值总额的百分比列示如下。

**2023**  
**占资产净值百分比**

最低总敞口	-
最高总敞口	-
平均总敞口	-

截至二零二三年九月三十日止年度，本基金为非对冲目的而使用的金融衍生工具所产生的最低、最高及平均净敞口，占本基金资产净值总额的百分比列示如下。

**2023**  
**占资产净值百分比**

最低净敞口	-
最高净敞口	-
平均净敞口	-

\* 部分基金份额类别具有货币对冲功能。为避免疑义，在计算基金投资组合总风险敞口时不考虑该份额类别的风险敞口。

财务状况表

于二零二三年九月三十日

	2023 美元	2022 美元
<b>资产</b>		
<b>流动资产</b>		
银行现金	5,886,918	25,815,350
应收经纪款项	5,238,868	2,786,163
分配应收款项	1,592,323	1,897,843
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 11]	3,200,060	1,604,195
投资 [附注 4(l)(a)]	1,082,459,138	1,195,682,210
股息及其他应收款项	1,736,837	1,302,757
<b>总资产</b>	<b>1,100,114,144</b>	<b>1,229,088,518</b>
<b>负债</b>		
<b>流动负债</b>		
短期银行借款 - 无抵押 [附注 9]	3,200,000	-
应付经纪款项	-	3,631,468
赎回应付款项	4,682,883	8,622,901
应付收益分配 [附注 6]	4,084,324	5,610,708
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 11]	1,721,638	16,987,221
其他应付款项	1,402,251	1,694,762
<b>总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)</b>	<b>15,091,096</b>	<b>36,547,060</b>
<b>可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]</b>	<b>1,085,023,048</b>	<b>1,192,541,458</b>

由受托人及管理人于二零二四年一月二十四日批准

签署人:

汇丰机构信托服务 (亚洲) 有限公司, 受托人

摩根基金 (亚洲) 有限公司, 管理人

综合收益表

截至二零二三年九月三十日止年度

	2023 美元	2022 美元
<b>收入</b>		
投资及衍生性产品净收益 / (亏损) [附注 5]	127,989,738	(389,415,644)
股息收入	48,640,703	52,027,054
存款利息 [附注 8(i), 8(j)]	114,845	33,737
汇兑亏损	(74,864)	(2,130,937)
其他收入	28	354
	<b>176,670,450</b>	<b>(339,485,436)</b>
<b>支出</b>		
管理费用 [附注 8(e)]	17,869,251	19,970,142
交易成本 [附注 8(i), 8(j)]	1,283,080	2,197,260
托管费用及银行费用 [附注 8(i), 8(j)]	448,661	525,339
受托人费用 [附注 8(g)]	330,148	368,804
基金注册登记机构费用 [附注 8(h)]	217,288	247,594
法律及专业费用	33,465	26,507
核数师酬金	24,737	16,205
估值费用 [附注 8(e)]	17,010	17,150
印刷及出版支出	7,059	6,220
其他经营费用	8,717	17,691
	<b>20,239,416</b>	<b>23,392,912</b>
<b>净经营利润 / (亏损)</b>	<b>156,431,034</b>	<b>(362,878,348)</b>
<b>财务成本</b>		
收益分配 [附注 6]	(44,045,533)	(61,929,863)
利息支出 [附注 8(j)]	(67,333)	(25,024)
	<b>(44,112,866)</b>	<b>(61,954,887)</b>
<b>除税前利润 / (亏损)</b>	<b>112,318,168</b>	<b>(424,833,235)</b>
税项 [附注 7]	(4,110,531)	(3,153,086)
<b>可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益 / (亏损) 之增加 / (减少)</b>	<b>108,207,637</b>	<b>(427,986,321)</b>

可赎回份额持有人应占净资产变动表

截至二零二三年九月三十日止年度

	2023 美元	2022 美元
年初可赎回份额持有人应占净资产	1,192,541,458	1,297,666,248
分配可赎回份额 [附注 3]	414,342,223	982,395,736
赎回可赎回份额 [附注 3]	(630,068,270)	(659,534,205)
净(赎回) / 分配	(215,726,047)	322,861,531
	976,815,411	1,620,527,779
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益 / (亏损) 之增加 / (减少)	108,207,637	(427,986,321)
年末可赎回份额持有人应占净资产	1,085,023,048	1,192,541,458

现金流量表

截至二零二三年九月三十日止年度

	2023 美元	2022 美元
<b>经营业务</b>		
购入投资及衍生性产品	(376,672,137)	(973,096,517)
出售投资及衍生性产品		
所得款项	594,937,569	689,162,998
已收股息	48,207,139	52,905,608
已收利息	114,843	33,825
已付基金注册登记机构费用	(213,722)	(256,385)
已付受托人费用	(335,066)	(368,960)
已付交易成本	(1,283,284)	(2,198,420)
已付税项	(4,110,531)	(3,585,647)
已付管理费用	(18,129,767)	(19,986,341)
其他	(670,037)	196,576
<b>经营业务所产生 / (运用) 之现金净额</b>	<b>241,845,007</b>	<b>(257,193,263)</b>
<b>融资活动</b>		
已付利息	(67,333)	(25,024)
分配可赎回份额所得款项	414,647,743	990,308,385
赎回可赎回份额付款	(634,008,288)	(658,962,392)
已付收益分配	(45,571,917)	(61,316,775)
<b>融资活动所 (运用) / 产生之现金净额</b>	<b>(264,999,795)</b>	<b>270,004,194</b>
<b>现金及现金等价物之 (减少) / 增加</b>	<b>(23,154,788)</b>	<b>12,810,931</b>
年初现金及现金等价物	25,815,350	13,996,141
现金及现金等价物之汇兑收益 / (亏损)	26,356	(991,722)
<b>年末现金及现金等价物</b>	<b>2,686,918</b>	<b>25,815,350</b>
<b>现金及现金等价物余额分析:</b>		
银行现金	5,886,918	25,815,350
短期银行借款 - 无抵押	(3,200,000)	-
	2,686,918	25,815,350



财务报表之附注

1 本基金

摩根亚洲股息基金（“本基金”）根据二零一一年五月六日的信托契约（经修订）（“信托契约”）成立，受香港法律监管。本基金已获香港证券及期货事务监察委员会（“证监会”）认可。

本基金的投资目标为通过主要投资（即至少为资产净值总额的 70%）于亚太区（日本除外）内的、投资管理预期会派发股息公司的股票，以提供收益及长期资本增长。

根据信托契约，管理人可决定发行不同产品类别（分别称为“类别”），虽然各类别之资产将作共同投资，但各类别可应用特定的收费结构、货币或收益分配政策。由于各类别有不同的收费结构，因此每类别应占之资产净值可能不同。

所有基金份额持有人于份额持有人会议上的权利是相同的，包括召开会议、表决或以其他方式行事的权利。

2 主要会计政策

以下为本财务报表采纳之主要会计政策。除另有注明外，该等政策与所呈列年度采纳者一致。

(a) 财务报表之编制基础

本基金之财务报表乃按照香港会计师公会颁布的香港财务报告准则编制。财务报表乃按历史成本准则编制，并就按公允价值透过损益列账的金融资产及金融负债（包括衍生金融工具）之重估而做出调整。

管理人及受托人（“管理层”）按照香港财务报告准则编制财务报表时需作出若干关键会计估算、判断和假设。

*于二零二二年十月一日生效的新准则及对现有准则的修订*

没有于二零二二年十月一日开始的财政年度首次生效的新准则或对现有准则的修订对本基金产生重大影响。

*于二零二二年十月一日后生效且并未提早采纳的新准则、对准则的修订和解释*

若干新准则、对准则的修订和解释在二零二二年十月一日开始的年度期间生效，但在编制此等财务报表时并未提前采纳。此等新准则、对准则的修订和解释预期不会对本基金的财务报表产生重大影响。

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公允价值为负数的衍生性产品合约列示为按公允价值透过损益列账的负债。

当预期某一借入证券的市值将会下跌时，本基金出售该证券进行卖空，或通过卖空进行套汇交易。卖空被分类为按公允价值透过损益列账的金融负债。

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。

*确认、取消确认及计量*

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

*公允价值估计*

公允价值指在计量日期，于一项有序交易中由市场参与者出售一项资产而应收取或转让一项负债而应支付的价格。在活跃市场中买卖的金融资产和负债的公允价值，按最后成交价计算。当被投资公司的证券交易暂停，该投资的价值按基金管理人估计的公允价值计算。在非活跃市场中进行金融工具交易时，以市场报价、交易商/经纪报价或其他获可观察输入值支持的报价来源作为估值。

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。

*公允价值级次分层间的转拨*

在公允价值级次分层之间的转拨视为于报告期间开始时已发生。

**(c) 金融工具抵销**

若存在法律上可行使的权利，可对已确认入账的项目进行抵销，且有意以净额方式结算，或将资产变现并同时清偿债务，则金融资产及负债可予抵销，并把净额于财务状况表内列账。

**(d) 收入及支出**

股息收入乃于除息日当日入账，而相应的海外预缴税则入账为支出，并在综合收益表确认。

投资利息收入乃作为投资及衍生性产品净收益/亏损的一部分，在综合收益表确认。

银行现金及短期存款利息收入乃按实际利息法在综合收益表确认。

支出乃按应计基准在综合收益表确认。

**(e) 交易成本**

交易成本是指为购入/出售按公允价值透过损益列账的金融资产或负债而发生的成本。这些成本包括支付给代理机构、经纪和交易商之手续费和佣金。交易成本于发生时在综合收益表支销。

**(f) 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。

(g) 现金及现金等价物

为了编制现金流量表，现金及现金等价物指银行现金及于存放日期起在三个月或以内到期之银行存款，扣除本基金通常作为隔夜银行借款的某些短期银行借款。

(h) 应收/应付经纪款项

应收/应付经纪款项指就年末已签订合同但尚未付款的投资和衍生性产品的应收款项，及就已购投资和衍生性产品的应付款项。

该等金额按公允价值进行初始确认，并以摊余成本进行后续计量。于每一报告日期，若信贷风险自初始确认后显著增加，本基金应按与存续期预期信贷损失相当的金额，对应收经纪款项计量损失准备金。计量损失准备金需考虑的因素包括经纪出现重大财务困难、破产、进行财务重组或拖欠付款的可能性。

(i) 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。

(j) 应付可赎回份额持有人的收益分配

拟分配至可赎回份额持有人的收益分配应于适当授权时在综合收益表中列账。就可赎回份额的收益分配在综合收益表中列账为财务成本。

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）

2023

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	18,800,354.440	8,137,233.985	2,073,545.880	6,538,371.597	1,826,163.397
总分配	9,714,225.151	2,571,458.341	524,844.777	1,419,913.634	225,364.869
总赎回	(9,845,951.324)	(3,578,842.401)	(722,176.671)	(2,582,410.524)	(458,750.068)
年末	18,668,628.267	7,129,849.925	1,876,213.986	5,375,874.707	1,592,778.198
	澳元	加元	欧元	英镑	港元
可赎回份额持有人应占净资产	145,075,588	57,931,310	15,973,298	45,072,406	22,192,592
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	7.77	8.13	8.51	8.38	13.93

2023

	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额	PRC 人民币 对冲份额 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	252,217,197.977	6,002,090.910	1,641,903.580	1,619,251.500	4,794,050.670
总分配	89,905,894.515	2,353,461.402	418,711.260	894,724.880	1,152,295.970
总赎回	(131,934,579.804)	(2,998,498.024)	(880,908.350)	(458,280.360)	(1,036,769.850)
年末	210,188,512.688	5,357,054.288	1,179,706.490	2,055,696.020	4,909,576.790

	港元	纽元	人民币	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	1,829,727,869	42,604,365	13,504,313	19,301,686	52,732,738
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	8.71	7.95	11.45	9.39	10.74

	PRC 人民币 对冲份额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	9,381,425.700	1,612,352.910	1,455,296.520	1,476,611.835	174,930,187.137
总分配	2,071,184.340	53,471.510	82,701.240	335,427.522	47,670,846.334
总赎回	(1,661,015.900)	(467,749.000)	(293,145.510)	(255,084.662)	(83,268,935.155)
年末	9,791,594.140	1,198,075.420	1,244,852.250	1,556,954.695	139,332,098.316

	人民币	美元	美元	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	83,344,001	12,650,318	10,784,066	25,214,077	1,228,111,258
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	8.51	10.56	8.66	16.19	8.81

2023

	新加坡元 对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每季派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	780,393.257	695,109.240	42,137,386.759	2,313,938.405	8,698,239.647
总分配	152,173.107	192,145.439	13,641,035.234	862,511.028	180,334.278
总赎回	(164,604.885)	(362,450.372)	(23,263,610.867)	(193,600.000)	(1,348,388.659)
年末	767,961.479	524,804.307	32,514,811.126	2,982,849.433	7,530,185.266
	新加坡元	美元	美元	美元	美元
可赎回份额持有人应占 净资产	6,357,122	7,274,089	280,663,732	27,387,343	75,937,626
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	8.28	13.86	8.63	9.18	10.08

2022

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	15,818,277.479	7,456,412.191	1,919,678.947	4,439,007.661	1,196,639.730
总分配	9,808,710.204	2,914,273.637	943,488.446	4,725,723.527	1,811,029.726
总赎回	(6,826,633.243)	(2,233,451.843)	(789,621.513)	(2,626,359.591)	(1,181,506.059)
年末	18,800,354.440	8,137,233.985	2,073,545.880	6,538,371.597	1,826,163.397
	澳元	加元	欧元	英镑	港元
可赎回份额持有人应占 净资产	136,342,047	61,318,511	16,395,953	50,842,961	22,555,210
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	7.25	7.54	7.91	7.78	12.35

2022

	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额	PRC 人民币 对冲份额 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	161,313,873.521	4,705,292.384	1,911,295.530	1,891,564.740	7,641,018.160
总分配	184,403,557.316	2,869,581.893	737,816.370	262,168.680	1,519,402.130
总赎回	(93,500,232.860)	(1,572,783.367)	(1,007,208.320)	(534,481.920)	(4,366,369.620)
年末	252,217,197.977	6,002,090.910	1,641,903.580	1,619,251.500	4,794,050.670
	港元	纽元	人民币	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	2,032,712,595	44,500,103	16,266,496	13,778,756	46,975,544
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	8.06	7.41	9.91	8.51	9.80
	PRC 人民币 对冲份额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	10,422,468.550	2,137,889.830	1,822,820.030	1,342,654.039	149,221,298.724
总分配	1,884,652.570	240,242.810	260,076.430	528,998.453	71,351,769.244
总赎回	(2,925,695.420)	(765,779.730)	(627,599.940)	(395,040.657)	(45,642,880.831)
年末	9,381,425.700	1,612,352.910	1,455,296.520	1,476,611.835	174,930,187.137
	人民币	美元	美元	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	74,167,080	15,063,976	11,651,113	21,813,168	1,431,961,989
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	7.91	9.34	8.01	14.77	8.19

2022

	新加坡元 对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每季派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	1,056,230.405	452,651.110	30,511,465.339	11,819,722.942	1,026,607.148
总分配	224,863.903	328,417.745	29,587,741.366	1,416,970.279	9,467,061.281
总赎回	(500,701.051)	(85,959.615)	(17,961,819.946)	(10,922,754.816)	(1,795,428.782)
年末	780,393.257	695,109.240	42,137,386.759	2,313,938.405	8,698,239.647
	新加坡元	美元	美元	美元	美元
可赎回份额持有人应占 净资产	5,996,821	8,520,838	335,998,871	19,480,421	80,422,237
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	7.68	12.26	7.97	8.42	9.25

#### 4 财务风险管理

##### (I) 财务风险因素

本基金面临各种财务风险：市场风险（包括市场价格风险、利率风险及汇兑风险）、信贷风险及流动性风险。

##### (a) 市场风险

##### (i) 市场价格风险

本基金的投资及衍生性产品须面对在所有投资及衍生性产品中所固有的市场价格风险，即持有投资及衍生性产品的价值可升可跌。本基金的市场风险按照特定的投资限制及指南，通过以下方式管理：(i) 审慎的股票选择，及 (ii) 分散的投资组合。

本基金的投资管理人主要通过本基金的 Beta 值定期监测本基金的市场价格敏感度。Beta 值计量基金回报与投资管理人选择的相关基准指数之间的统计关系。

于九月三十日，投资及衍生性产品之公平值及其估计市场敏感度如下：

	2023		2022	
	投资之公平值 美元	占资产净值 百分比	投资之公平值 美元	占资产净值 百分比
上市投资				
资产				
股票				
- 中国	283,649,034	26.1	216,672,538	18.2
- 澳大利亚	166,254,321	15.3	263,484,792	22.1
- 台湾	163,828,463	15.1	147,018,650	12.3
- 韩国	151,261,676	13.9	122,925,602	10.3
- 香港	80,955,892	7.5	187,107,881	15.7
- 新加坡	64,958,129	6.0	111,544,024	9.4
- 印度尼西亚	59,049,227	5.5	70,836,761	5.9
- 其他	112,502,396	10.4	76,091,962	6.4
	1,082,459,138	99.8	1,195,682,210	100.3
衍生性产品				
- 远期外汇合约	3,200,060	0.3	1,604,195	0.1
	1,085,659,198	100.1	1,197,286,405	100.4
负债				
衍生性产品				
- 远期外汇合约	(1,721,638)	(0.2)	(16,987,221)	(1.4)
总上市投资	1,083,937,560	99.9	1,180,299,184	99.0



有关衍生性产品的风险亦请参阅附注 11。

	资产净值 美元	本基金相关基准指数 (注 <sup>*</sup> )	Beta 值 (注 <sup>**</sup> )	占相关基准指数之合 理变动百分比 (注 <sup>***</sup> )	估计对资产净值 的影响 (注 <sup>****</sup> ) 美元
		MSCI AC Asia Pacific			
于二零二三年九月三十日	1,085,023,048	ex Japan Net	0.90	+11.6	113,276,406
		MSCI AC Asia Pacific			
于二零二二年九月三十日	1,192,541,458	ex Japan Net	0.91	-27.0	(293,007,436)

假定所有其他可能影响本基金资产净值的变量保持不变，若相关基准指数收益呈反方向波动，则将导致本基金的资产净值以相同金额呈反向变动。

注：

- \* 本基金相关基准指数指投资管理人监测本基金市场价格风险时所使用的有关市场指数。
- \*\* Beta 值计量了在过去最长三十六个月期间或自组合启动后的数月期间，本基金回报与各基准指数之间的统计关系。对于推出期间少于十二个月内推出的基金，将采用本基金的每周回报计算 Beta 值。
- \*\*\* 合理变动百分比取决于过去十二个月的基准指数之实际历史变动，但不包括不大可能出现或“最恶劣”情况或“压力测试”下之变动，亦不代表投资管理人对本基金未来回报的预测。对于推出期间少于十二个月的基金，将采用自经营开始后基准指数之实际历史变动计算合理变动百分比。
- \*\*\*\* 假定所有其他变量保持不变，对本基金资产净值的估计影响按照本基金资产净值乘以相关 Beta 值再乘以相关基准指数之合理变动百分比计算。

(ii) 利率风险

利率风险指金融工具的价值或未来现金流量因市场利率变动而波动不定的风险。

下表按剩余到期日分类，概述于九月三十日本基金须承担现行市场利率水平波动影响风险的金融资产及负债。

	2023	2022
	1个月以内	1个月以内
	美元	美元
银行现金	5,886,918	25,815,350
短期银行借款 - 无抵押	(3,200,000)	-
总利率敏感性缺口	2,686,918	25,815,350

任何现金及现金等价物均以短期市场利率进行存放/借入。由于现行市场利率水平平稳且波动较低，投资管理人认为本基金不存在重大风险。

(iii) 汇兑风险

本基金持有以若干币种计价的资产及负债。香港财务报告准则第7号认为与非货币资产及负债相关的外汇承担属于市场价格风险，而非汇兑风险。但是，投资管理人监控所有以外币计价的资产及负债（包括货币及非货币资产及负债）的汇兑风险承担。

本基金订立了若干远期外汇合约，以对冲若干外汇承担以维持有限的非美元风险承担。年末未平仓远期外汇合约请参阅附注11。

下表概述截至九月三十日本基金的汇兑风险承担、外币合理变动百分比以及对本基金资产净值的估计影响。

汇兑风险承担净值（注 <sup>1</sup> ）	与美元比较之合理变动百分比		估计对资产净值的影响 美元
	美元等值	（注 <sup>2</sup> ）	
2023			
澳元	260,297,295	+0.4	1,041,189
加元	42,720,372	+1.6	683,526
人民币（离岸）	303,266,449	-2.1	(6,368,595)
欧元	16,850,880	+8.1	1,364,921
港元	262,446,902	+0.2	524,894
印度卢比	20,118,930	-2.0	(402,379)
印尼盾	59,049,227	-1.5	(885,738)
韩元	151,261,676	+6.0	9,075,701
马来西亚林吉特	6,620,597	-1.2	(79,447)
纽元	25,754,068	+6.2	1,596,752
新加坡元	69,788,722	+5.1	3,559,225
英镑	76,180,837	+9.3	7,084,818
台币	164,909,246	-1.6	(2,638,548)
泰铢	25,397,651	+3.6	914,315
	1,484,662,852		15,470,634

汇兑风险承担净值 (注*)	美元等值	与美元比较之合理	
		变动百分比 (注")	估计对资产净值的影响 美元
<b>2022</b>			
澳元	351,935,772	-11.0	(38,712,935)
加元	44,783,459	-7.8	(3,493,110)
人民币 (离岸)	312,800,096	-9.5	(29,716,009)
欧元	16,131,664	-15.5	(2,500,408)
港元	317,520,115	-0.8	(2,540,161)
印度卢比	6,222,529	-8.8	(547,583)
印尼盾	70,836,761	-6.0	(4,250,206)
韩元	119,781,846	-17.2	(20,602,478)
马来西亚林吉特	6,555,773	-9.7	(635,910)
纽元	25,494,563	-18.0	(4,589,021)
新加坡元	115,994,971	-5.4	(6,263,728)
英镑	66,828,349	-17.2	(11,494,476)
台币	147,517,467	-12.2	(17,997,131)
泰铢	23,264,725	-10.3	(2,396,267)
	<u>1,625,668,090</u>		<u>(145,739,423)</u>

假定影响本基金资产净值的其他变量保持不变，若外币呈反方向波动，则**将导致**本基金的资产净值以相同金额呈反向变动。

注：

\* 资产及负债汇兑风险承担净值包括货币及非货币资产及负债。

\*\* 合理变动百分比基于各货币于过去十二个月较本基金功能货币之实际历史变动，不包括不大可能出现或“最恶劣”情况或“压力测试”下之变动，也不代表投资管理人对本基金未来回报的预测。

## (b) 信贷风险

信贷风险指交易对手无法于到期日支付全数金额的风险。

管理人会参考交易对手的违约历史及其信贷评级等因素进行信贷风险监控。由于过去 5 年内，本基金在分配应收款项、应收经纪款项或股息及其他应收款项等应收款项未发生历史违约，故管理人认为该等应收款项不存在重大信贷风险。总体而言，由于该等工具违约风险较低，且本基金交易对手均有足够能力在短期内履行其合同义务，故管理人认为违约概率近乎零。因此，未对十二个月内的预期信贷损失确认损失准备金。

于二零二三年及二零二二年九月三十日，本基金的最高信贷风险承担为财务状况表中金融资产的账面价值。

所有投资及衍生性产品交易均由经核准的经纪按照货银交付原则进行结算。由于本基金的托管银行只会在收取款项后始交付有关投资及衍生性产品，所以违约风险甚低。就购买而言，本基金的托管银行会在收到投资及衍生性产品后即时付款。若任何一方不能履行其责任，交易将告失效。

下表概述本基金于九月三十日存放金融资产的银行/经纪/托管机构的信贷评级。

	2023 交易对手风险承担 美元	2022 交易对手风险承担 美元
银行结余		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	2,426,958	2,607,831
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	3,459,960	23,207,519
经纪发行的衍生性产品		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	3,085,272	936,404
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	114,788	667,791
托管机构的投资余额		
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	1,082,459,138	1,195,682,210

(c) 流动性风险

本基金须面对份额每日赎回的风险，而其大多数投资资产均在活跃市场交易，并可随时出售。管理人亦可将任何一个交易日之赎回份额总数限制为本基金已发行份额的百分之十或更高。

在投资限制和指南的规限下，本基金有能力订立借款安排。

下表概述本基金金融负债，按九月三十日距约定到期日的尚余期间分为有关期限组别。下表所载金额乃约定未折现现金流量。

	2023		2022	
	1个月以内 美元	1至12个月 美元	1个月以内 美元	1至12个月 美元
短期银行借款 - 无抵押	3,200,000	-	-	-
应付经纪款项	-	-	3,631,468	-
赎回应付款项	4,682,883	-	8,622,901	-
应付收益分配	4,084,324	-	5,610,708	-
衍生性产品	1,721,610	28	16,987,162	59
其他应付款项	1,402,251	-	1,694,762	-
可赎回份额持有人应占净资产	1,085,023,048	-	1,192,541,458	-
总金融负债	1,100,114,116	28	1,229,088,459	59

投资管理通过投资于预期一般在一个月以内变现到期的资产和借入短期银行借款以偿还金融负债来管理本基金的流动性风险。

(d) 受总净额结算协议及类似协议规限的抵销与金额

于二零二三年及二零二二年九月三十日，本基金受制于与若干衍生品交易对手的总净额结算协议。

若发生违约，本基金及其交易对手有权按净额结算该等交易。违约事件可能包括付款或交付失败、违反协议或破产。

下表按金融工具类型概述于九月三十日本基金受抵销和总净额结算协议及类似协议规限的金融资产及负债。

	财务状况表中列示的经确认金融资产总额 美元	受总净额结算协议及类似协议规限的相关金额 金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	净额 美元
<b>2023</b>				
<b>资产</b>				
衍生性产品	3,199,503	(1,637,462)	-	1,562,041
按公允价值透过损益列账的金融资产	3,199,503	(1,637,462)	-	1,562,041
<b>负债</b>				
衍生性产品	1,708,741	(1,637,462)	-	71,279
按公允价值透过损益列账的金融负债	1,708,741	(1,637,462)	-	71,279
<b>2022</b>				
<b>资产</b>				
衍生性产品	1,604,195	(1,206,777)	-	397,418
按公允价值透过损益列账的金融资产	1,604,195	(1,206,777)	-	397,418
<b>负债</b>				
衍生性产品	16,987,221	(1,206,777)	-	15,780,444
按公允价值透过损益列账的金融负债	16,987,221	(1,206,777)	-	15,780,444

(II) 资本风险管理

本基金的资本是以可赎回份额持有人应占净资产呈示，基金的分配和赎回乃由份额持有人决定。本基金以保障为份额持有人提供回报和长期资本增值为目标。

为了维持资本结构，本基金的政策执行如下：

- 监测相对于流动性资产的分配和赎回活动。
- 为了保护份额持有人在特殊情况下的利益，管理人亦可将任何一个交易日之赎回份额总数限制为本基金已发行份额的百分之十或更高。
- 按照宪制性文件，监测基金的投资指南及限制条件，以透过分散投资维持足够的资金流通性。

(III) 公平值估计

于二零二三年及二零二二年九月三十日，管理层认为资产及负债的账面价值与公平值相若。

香港财务报告准则第 13 号要求本基金根据公平值级次进行分类从而反映公平值在计量时所使用的输入值的重要性。公平值级次分层如下：

- 第一层次—相同资产或负债在活跃市场中的报价（未经调整）。
- 第二层次—直接（即按照价格）或间接（即源于价格）地使用除第一层次中的资产或负债的市场报价以外的其他可观察输入值。
- 第三层次—资产或负债使用了非基于可观察市场数据（即不可观察的输入值）。

下表概述本基金于九月三十日的投资及衍生性产品（按类别）按公平值级次计量之公平值：

上市投资	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总额 美元
<u>2023</u>				
<u>资产</u>				
股票	1,082,459,138	-	-	1,082,459,138
衍生性产品	-	3,200,060	-	3,200,060
按公平值透过损益列账的总金融资产	<u>1,082,459,138</u>	<u>3,200,060</u>	<u>-</u>	<u>1,085,659,198</u>
<u>负债</u>				
衍生性产品	-	1,721,638	-	1,721,638
按公平值透过损益列账的总金融负债	<u>-</u>	<u>1,721,638</u>	<u>-</u>	<u>1,721,638</u>

上市投资	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总额 美元
<u>2022</u>				
资产				
股票	1,195,682,210	-	-	1,195,682,210
衍生性产品	-	1,604,195	-	1,604,195
按公允价值透过损益列账的总金融资产	<u>1,195,682,210</u>	<u>1,604,195</u>	<u>-</u>	<u>1,197,286,405</u>
负债				
衍生性产品	-	16,987,221	-	16,987,221
按公允价值透过损益列账的总金融负债	<u>-</u>	<u>16,987,221</u>	<u>-</u>	<u>16,987,221</u>

由于投资价值是基于活跃市场的报价，因此分类为第一层次，并包括活跃上市股票证券及交易所交易衍生性产品。本基金没有调整这些工具的报价。

于非活跃市场交易的金融投资但以市场报价、交易商／经纪报价或其他报价来源作为可观察输入值，此等投资分类为第二层次。

被分类为第三层次的投资，由于其交易次数疏落，故此有显著的不可观察输入值。

截至二零二三年及二零二二年九月三十日止年度，公允价值层次之间并无转拨。

于二零二三年及二零二二年九月三十日，以摊余成本计量的资产和负债，其账面价值为其公允值的合理约数。

## 5 投资及衍生性产品净收益／（亏损）

	2023 美元	2022 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益／亏损之变动	163,673,593	(344,940,585)
投资及衍生性产品销售之实现亏损	(35,683,855)	(44,475,059)
	<u>127,989,738</u>	<u>(389,415,644)</u>

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。

本年末未结转未分配收入（二零二二年：无）。

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
<u>2023</u>					
澳元对冲类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	澳元 0.0251	18,463,318.725	(296,340)
加元对冲类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	加元 0.0306	7,909,448.549	(177,434)
欧元对冲类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	欧元 0.0145	2,045,962.862	(29,321)
英镑对冲类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	英镑 0.0261	6,445,600.026	(193,692)
港元类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	港元 0.0323	246,653,513.371	(1,014,912)
纽元对冲类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	纽元 0.0287	6,214,253.895	(103,612)
PRC 人民币份额（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	人民币 0.0346	1,623,749.510	(7,665)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	人民币 0.0244	9,370,844.370	(31,193)
PRC 美元份额（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	美元 0.0321	1,438,435.520	(46,174)
人民币对冲类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	人民币 0.0252	170,345,100.135	(585,626)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	新加坡元 0.0297	780,715.619	(16,386)
美元类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	美元 0.0320	40,946,758.048	(1,310,295)
美元 C 类别（每月派息）	2022年10月31日	2022年11月8日	美元 0.0338	2,379,308.636	(80,421)
澳元对冲类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	澳元 0.0224	18,483,541.738	(277,277)
加元对冲类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	加元 0.0292	8,056,147.650	(173,519)
欧元对冲类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	欧元 0.0137	1,959,379.693	(27,639)
英镑对冲类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	英镑 0.0247	6,443,175.493	(189,527)
港元类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	港元 0.0321	241,978,015.296	(995,131)
纽元对冲类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	纽元 0.0267	6,085,798.659	(100,923)
PRC 人民币份额（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	人民币 0.0344	1,623,947.540	(7,886)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	人民币 0.0157	9,272,053.980	(20,551)
PRC 美元份额（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	美元 0.0321	1,398,710.940	(44,899)
人民币对冲类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	人民币 0.0163	168,553,207.795	(387,859)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	新加坡元 0.0289	781,414.011	(16,480)
美元类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	美元 0.0320	39,472,909.470	(1,263,132)
美元 C 类别（每月派息）	2022年11月30日	2022年12月8日	美元 0.0338	2,453,127.736	(82,916)
澳元对冲类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	澳元 0.0190	17,856,810.407	(230,082)
加元对冲类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	加元 0.0268	8,048,955.657	(159,203)
欧元对冲类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	欧元 0.0089	1,856,812.939	(17,637)
英镑对冲类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	英镑 0.0218	6,388,908.054	(167,537)
港元类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	港元 0.0320	237,177,197.041	(972,417)
纽元对冲类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	纽元 0.0257	5,670,514.347	(92,168)
PRC 人民币份额（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	人民币 0.0335	1,494,184.670	(7,235)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	人民币 0.0098	9,194,309.780	(13,023)
PRC 美元份额（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	美元 0.0321	1,397,712.620	(44,867)
人民币对冲类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	人民币 0.0101	166,176,360.639	(242,581)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	新加坡元 0.0288	795,783.669	(17,088)
美元类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	美元 0.0320	38,560,803.380	(1,233,944)
美元 C 类别（每季派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	美元 0.1123	8,400,326.942	(943,357)
美元 C 类别（每月派息）	2022年12月30日	2023年1月10日	美元 0.0338	2,496,320.356	(84,376)
澳元对冲类别（每月派息）	2023年1月31日	2023年2月8日	澳元 0.0182	18,825,377.350	(241,428)
加元对冲类别（每月派息）	2023年1月31日	2023年2月8日	加元 0.0287	8,032,527.262	(172,768)
欧元对冲类别（每月派息）	2023年1月31日	2023年2月8日	欧元 0.0101	1,880,844.683	(20,631)
英镑对冲类别（每月派息）	2023年1月31日	2023年2月8日	英镑 0.0234	6,123,449.039	(176,402)
港元类别（每月派息）	2023年1月31日	2023年2月8日	港元 0.0322	227,787,413.295	(935,728)
纽元对冲类别（每月派息）	2023年1月31日	2023年2月9日	纽元 0.0253	5,910,318.043	(96,634)
PRC 人民币份额（每月派息）	2023年1月31日	2023年2月8日	人民币 0.0325	1,518,139.550	(7,302)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023年1月31日	2023年2月8日	人民币 0.0107	9,065,479.690	(14,356)
PRC 美元份额（每月派息）	2023年1月31日	2023年2月8日	美元 0.0321	1,389,415.160	(44,600)
人民币对冲类别（每月派息）	2023年1月31日	2023年2月8日	人民币 0.0112	166,728,396.873	(276,367)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2023年1月31日	2023年2月8日	新加坡元 0.0261	871,606.015	(17,308)



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)	2023年1月31日	2023年2月8日	美元 0.0320	38,885,544.414	(1,244,336)
美元 C 类别 (每月派息)	2023年1月31日	2023年2月8日	美元 0.0339	2,628,882.328	(89,119)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	澳元 0.0197	18,316,089.728	(243,323)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	加元 0.0288	8,170,764.765	(172,843)
欧元对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	欧元 0.0150	1,908,855.872	(30,365)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	英镑 0.0257	6,113,488.893	(190,213)
港元类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	港元 0.0323	229,659,223.704	(945,027)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	纽元 0.0272	5,706,853.692	(96,170)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	人民币 0.0329	1,564,331.220	(7,403)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	人民币 0.0158	9,039,866.180	(20,546)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	美元 0.0321	1,370,556.470	(43,995)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	人民币 0.0164	162,080,410.511	(382,369)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	新加坡元 0.0252	802,682.656	(15,026)
美元类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	美元 0.0320	39,873,192.735	(1,275,941)
美元 C 类别 (每月派息)	2023年2月28日	2023年3月8日	美元 0.0339	2,578,314.336	(87,405)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	澳元 0.0198	18,707,081.462	(248,075)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	加元 0.0275	8,075,773.669	(164,099)
欧元对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	欧元 0.0150	1,938,664.515	(31,594)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	英镑 0.0254	6,145,505.923	(193,005)
港元类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	港元 0.0324	235,120,202.036	(970,439)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	纽元 0.0297	5,623,114.744	(104,488)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	人民币 0.0330	1,573,277.230	(7,560)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	人民币 0.0125	8,831,241.740	(16,075)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	美元 0.0321	1,370,981.850	(44,009)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	人民币 0.0131	160,415,439.926	(306,007)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	新加坡元 0.0237	802,431.265	(14,304)
美元类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	美元 0.0320	39,882,889.994	(1,276,251)
美元 C 类别 (每季派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	美元 0.1126	8,083,953.632	(910,253)
美元 C 类别 (每月派息)	2023年3月31日	2023年4月13日	美元 0.0339	2,699,834.310	(91,523)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	澳元 0.0194	19,251,407.401	(246,812)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	加元 0.0262	7,934,754.126	(153,278)
欧元对冲类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	欧元 0.0160	2,043,671.473	(36,099)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	英镑 0.0252	6,073,055.570	(192,357)
港元类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	港元 0.0324	236,860,863.102	(977,629)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	纽元 0.0301	5,297,343.053	(98,484)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	人民币 0.0330	1,562,020.520	(7,445)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	人民币 0.0089	8,740,373.030	(11,236)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	美元 0.0321	1,354,567.130	(43,482)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	人民币 0.0092	168,341,988.466	(223,702)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	新加坡元 0.0219	826,218.328	(13,562)
美元类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	美元 0.0320	39,906,242.629	(1,276,998)
美元 C 类别 (每月派息)	2023年4月28日	2023年5月9日	美元 0.0339	2,705,640.496	(91,721)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	澳元 0.0190	19,469,623.545	(239,395)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	加元 0.0248	7,773,630.867	(141,827)
欧元对冲类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	欧元 0.0157	2,053,737.549	(34,375)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	英镑 0.0250	5,828,530.815	(180,597)
港元类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	港元 0.0322	235,817,345.965	(969,989)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	纽元 0.0306	5,239,280.656	(96,089)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	人民币 0.0337	1,581,302.730	(7,478)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	人民币 0.0096	8,630,148.360	(11,627)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	美元 0.0321	1,332,672.140	(42,779)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	人民币 0.0099	167,383,030.109	(232,548)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	新加坡元 0.0208	827,727.856	(12,707)
美元类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	美元 0.0320	38,810,950.299	(1,241,949)
美元 C 类别 (每月派息)	2023年5月31日	2023年6月8日	美元 0.0340	2,699,702.471	(91,790)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	澳元 0.0203	18,211,391.765	(246,085)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	加元 0.0247	8,066,488.001	(150,570)
欧元对冲类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	欧元 0.0158	1,977,375.975	(34,085)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	英镑 0.0257	5,771,738.716	(188,584)
港元类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	港元 0.0322	226,099,775.793	(929,027)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	纽元 0.0309	5,680,655.136	(107,540)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	人民币 0.0344	1,653,156.060	(7,817)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	人民币 0.0096	8,496,196.290	(11,212)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	美元 0.0321	1,279,881.710	(41,084)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	人民币 0.0099	168,466,583.226	(229,260)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	新加坡元 0.0214	817,977.594	(12,934)
美元类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	美元 0.0320	36,488,220.705	(1,167,622)
美元 C 类别 (每季派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	美元 0.1128	7,879,850.472	(888,847)
美元 C 类别 (每月派息)	2023年6月30日	2023年7月10日	美元 0.0340	2,638,102.471	(89,695)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	澳元 0.0208	18,911,257.240	(265,061)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	加元 0.0265	7,868,014.117	(158,406)
欧元对冲类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	欧元 0.0175	1,861,111.180	(35,909)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	英镑 0.0291	5,692,061.963	(213,119)
港元类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	港元 0.0322	221,143,028.633	(913,076)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	纽元 0.0305	5,601,676.972	(106,329)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	人民币 0.0344	1,693,834.790	(8,157)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	人民币 0.0081	9,413,551.180	(10,674)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	美元 0.0321	1,254,422.610	(40,267)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	人民币 0.0083	157,258,512.080	(182,717)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	新加坡元 0.0206	797,979.896	(12,380)
美元类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	美元 0.0320	35,617,115.681	(1,139,746)
美元 C 类别 (每月派息)	2023年7月31日	2023年8月8日	美元 0.0340	2,685,628.755	(91,311)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	澳元 0.0202	18,818,676.148	(246,196)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	加元 0.0267	7,264,412.666	(143,361)
欧元对冲类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	欧元 0.0186	1,867,947.456	(37,709)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	英镑 0.0295	5,295,238.454	(197,941)
港元类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	港元 0.0323	218,770,739.434	(901,112)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	纽元 0.0294	5,424,593.681	(94,964)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	人民币 0.0350	1,960,126.450	(9,426)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	人民币 0.0103	9,739,484.770	(13,783)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	美元 0.0321	1,252,199.560	(40,196)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	人民币 0.0107	145,369,043.866	(213,704)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	新加坡元 0.0190	787,104.385	(11,074)
美元类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	美元 0.0320	33,371,672.898	(1,067,892)
美元 C 类别 (每月派息)	2023年8月31日	2023年9月8日	美元 0.0340	2,787,342.981	(94,770)
澳元对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	澳元 0.0201	18,644,948.327	(241,872)
加元对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月11日	加元 0.0265	7,142,235.804	(139,992)
欧元对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	欧元 0.0193	1,876,213.986	(38,338)
英镑对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	英镑 0.0302	5,374,028.544	(198,090)
港元类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	港元 0.0322	210,496,375.120	(865,438)
纽元对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	纽元 0.0293	5,355,816.235	(94,288)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2023年9月28日	2023年10月11日	人民币 0.0348	2,055,285.260	(9,817)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2023年9月28日	2023年10月11日	人民币 0.0214	9,791,522.140	(28,760)
PRC 美元份额 (每月派息)	2023年9月28日	2023年10月11日	美元 0.0321	1,244,800.060	(39,958)
人民币对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月11日	人民币 0.0222	139,370,659.925	(424,668)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月10日	新加坡元 0.0196	767,961.479	(11,028)
美元类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月11日	美元 0.0320	32,492,123.363	(1,039,747)
美元 C 类别 (每季派息)	2023年9月29日	2023年10月11日	美元 0.1130	7,530,185.266	(850,911)
美元 C 类别 (每月派息)	2023年9月29日	2023年10月11日	美元 0.0340	2,982,849.433	(101,417)

可赎回份额持有人之总收益分配 (44,045,533)

2022

澳元对冲类别 (每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	澳元 0.0309	15,798,906.499	(368,556)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	加元 0.0337	7,453,695.731	(203,648)
欧元对冲类别 (每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	欧元 0.0287	1,907,573.206	(63,926)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	英镑 0.0339	4,437,121.286	(207,562)
港元类别 (每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	港元 0.0350	162,705,608.385	(732,220)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	纽元 0.0351	4,572,868.313	(115,766)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	人民币 0.0335	1,858,625.180	(9,746)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	人民币 0.0625	10,229,138.600	(100,067)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	美元 0.0352	1,808,866.930	(63,672)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	人民币 0.0646	149,162,983.922	(1,508,218)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	新加坡元 0.0348	1,042,064.115	(26,977)
美元类别 (每月派息)	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	美元 0.0350	30,357,742.018	(1,062,521)
美元 C 类别 (每月派息)	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	美元 0.0366	11,962,302.095	(437,820)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	澳元 0.0310	15,535,818.497	(342,714)
加元对冲类别 (每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	加元 0.0336	7,566,053.334	(198,725)
欧元对冲类别 (每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	欧元 0.0288	1,922,166.764	(62,381)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	英镑 0.0339	5,182,332.610	(233,586)
港元类别 (每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	港元 0.0351	161,286,375.091	(725,826)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	纽元 0.0368	4,508,711.948	(112,718)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	人民币 0.0335	1,828,453.790	(9,583)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	人民币 0.0580	10,127,002.910	(91,897)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	美元 0.0351	1,779,314.100	(62,454)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	人民币 0.0600	147,383,622.819	(1,383,537)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	新加坡元 0.0352	988,788.466	(25,397)
美元类别 (每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	美元 0.0350	30,347,912.578	(1,062,177)
美元 C 类别 (每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	美元 0.0366	11,591,153.345	(424,236)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	澳元 0.0289	15,439,413.106	(323,651)
加元对冲类别 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	加元 0.0309	7,499,750.852	(181,226)
欧元对冲类别 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	欧元 0.0241	1,928,066.905	(52,651)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	英镑 0.0299	5,118,707.487	(206,563)
港元类别 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	港元 0.0352	158,660,355.660	(715,969)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	纽元 0.0365	4,484,140.659	(111,910)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	人民币 0.0334	1,660,992.020	(8,701)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	人民币 0.0584	9,774,689.520	(89,535)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	美元 0.0352	1,677,425.250	(59,045)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	人民币 0.0604	143,600,341.247	(1,360,404)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	新加坡元 0.0356	817,879.670	(21,533)
美元类别 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	美元 0.0350	30,704,122.424	(1,074,644)
美元 C 类别 (每季派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	美元 0.1220	1,036,816.691	(126,492)
美元 C 类别 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	美元 0.0367	11,758,882.180	(431,551)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	澳元 0.0312	16,403,034.997	(357,961)
加元对冲类别 (每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	加元 0.0334	7,345,515.442	(192,085)
欧元对冲类别 (每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	欧元 0.0275	1,771,264.990	(54,387)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	英镑 0.0346	4,581,222.799	(212,626)
港元类别 (每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	港元 0.0351	187,328,523.797	(843,665)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	纽元 0.0369	4,851,026.702	(117,372)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022 年 1 月 28 日	2022 年 2 月 11 日	人民币 0.0333	1,674,464.160	(8,754)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022 年 1 月 28 日	2022 年 2 月 11 日	人民币 0.0547	9,356,237.910	(80,346)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022 年 1 月 28 日	2022 年 2 月 11 日	美元 0.0352	1,626,483.210	(57,252)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	人民币 0.0566	148,981,499.568	(1,324,644)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	新加坡元 0.0355	851,113.446	(22,285)
美元类别 (每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	美元 0.0350	35,744,141.658	(1,251,045)
美元 C 类别 (每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	美元 0.0368	1,604,735.010	(59,054)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	澳元 0.0310	16,946,854.617	(379,646)
加元对冲类别 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	加元 0.0338	6,957,953.515	(184,606)
欧元对冲类别 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	欧元 0.0284	1,711,901.488	(54,673)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	英镑 0.0363	4,503,171.270	(219,329)
港元类别 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	港元 0.0351	199,777,385.278	(897,968)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	纽元 0.0375	5,176,586.920	(130,809)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	人民币 0.0332	1,653,700.390	(8,701)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	人民币 0.0573	9,725,827.860	(88,319)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	美元 0.0352	1,615,115.730	(56,852)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	人民币 0.0593	152,298,923.969	(1,430,229)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	新加坡元 0.0352	804,466.281	(20,925)
美元类别 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	美元 0.0350	39,566,506.879	(1,384,828)
美元 C 类别 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	美元 0.0368	1,644,973.315	(60,535)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	澳元 0.0285	17,181,177.650	(367,713)
加元对冲类别 (每月派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	加元 0.0329	6,913,334.379	(182,097)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
欧元对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	欧元 0.0247	1,691,630.294	(46,490)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	英镑 0.0351	4,562,806.621	(210,867)
港元类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	港元 0.0352	213,456,752.438	(959,430)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	纽元 0.0369	5,159,539.075	(132,424)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	人民币 0.0334	1,676,555.190	(8,821)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	人民币 0.0592	9,792,978.500	(91,326)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	美元 0.0351	1,603,181.650	(56,272)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	人民币 0.0612	154,417,281.152	(1,488,688)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	新加坡元 0.0346	814,104.778	(20,813)
美元类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	美元 0.0350	40,968,152.226	(1,433,885)
美元 C 类别 (每季派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	美元 0.1222	9,515,622.001	(1,162,809)
美元 C 类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	美元 0.0368	1,747,637.786	(64,313)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	澳元 0.0285	18,076,561.926	(366,114)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	加元 0.0348	7,022,342.786	(191,211)
欧元对冲类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	欧元 0.0248	1,645,532.186	(43,051)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	英镑 0.0358	5,333,293.788	(239,715)
港元类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	港元 0.0353	236,497,541.330	(1,064,007)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	纽元 0.0369	5,473,484.296	(131,089)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	人民币 0.0338	1,684,618.190	(8,573)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	人民币 0.0560	9,942,344.240	(83,830)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	美元 0.0351	1,576,157.730	(55,323)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	人民币 0.0580	161,050,808.164	(1,406,409)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	新加坡元 0.0351	719,357.406	(18,285)
美元类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	美元 0.0350	42,573,839.023	(1,490,083)
美元 C 类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	美元 0.0368	1,756,733.409	(64,648)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	澳元 0.0276	18,410,099.521	(364,499)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	加元 0.0343	7,389,925.942	(200,399)
欧元对冲类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	欧元 0.0223	1,692,301.447	(40,427)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	英镑 0.0345	5,606,007.776	(243,751)
港元类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	港元 0.0354	242,703,005.003	(1,095,103)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	纽元 0.0359	5,618,039.935	(131,288)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	人民币 0.0351	1,791,321.800	(9,413)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	人民币 0.0528	9,852,721.120	(77,885)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	美元 0.0351	1,537,123.360	(53,953)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	人民币 0.0546	165,334,439.855	(1,351,508)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	新加坡元 0.0350	739,170.379	(18,871)
美元类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	美元 0.0350	42,339,760.367	(1,481,890)
美元 C 类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	美元 0.0369	2,103,036.589	(77,602)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	澳元 0.0287	18,737,388.159	(369,792)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	加元 0.0338	8,101,885.406	(212,290)
欧元对冲类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	欧元 0.0193	1,859,831.102	(37,526)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	英镑 0.0322	5,864,002.179	(229,313)
港元类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	港元 0.0354	262,000,559.649	(1,181,965)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	纽元 0.0365	6,247,705.421	(141,785)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	人民币 0.0350	1,793,737.200	(9,364)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	人民币 0.0434	9,682,950.620	(62,683)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	美元 0.0352	1,550,925.410	(54,593)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	人民币 0.0449	170,270,705.404	(1,140,353)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月12日	新加坡元 0.0343	841,412.694	(20,737)
美元类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	美元 0.0350	44,448,080.366	(1,555,682)
美元 C 类别 (每季派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	美元 0.1226	9,362,815.428	(1,147,881)
美元 C 类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	美元 0.0369	2,176,046.528	(80,296)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	澳元 0.0293	19,279,019.391	(394,170)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	加元 0.0336	8,342,211.586	(218,752)
欧元对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	欧元 0.0158	2,090,464.294	(33,678)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	英镑 0.0290	6,090,757.550	(214,943)
港元类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	港元 0.0354	265,366,854.788	(1,196,701)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	纽元 0.0346	6,595,193.832	(143,089)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	人民币 0.0354	1,737,000.660	(9,106)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	人民币 0.0357	9,651,494.220	(51,025)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	美元 0.0352	1,516,237.460	(53,372)

收益分配类别	除息日	支付日	比率	份额	美元
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	人民币 0.0371	180,003,324.326	(988,941)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	新加坡元 0.0339	849,916.266	(20,835)
美元类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	美元 0.0350	44,411,156.248	(1,554,389)
美元 C 类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	美元 0.0369	2,228,273.039	(82,223)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	澳元 0.0280	18,898,308.920	(362,760)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	加元 0.0340	8,189,367.786	(212,613)
欧元对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	欧元 0.0153	2,140,469.713	(32,931)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	英镑 0.0283	6,466,149.431	(212,929)
港元类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	港元 0.0354	265,284,076.361	(1,196,488)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	纽元 0.0342	6,250,013.611	(131,050)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	人民币 0.0360	1,729,793.220	(9,034)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	人民币 0.0301	9,507,747.020	(41,515)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	美元 0.0352	1,493,334.820	(52,566)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	人民币 0.0312	177,269,593.214	(802,317)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	新加坡元 0.0326	850,198.674	(19,867)
美元类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	美元 0.0350	43,521,703.591	(1,523,258)
美元 C 类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	美元 0.0369	2,243,012.581	(82,767)
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	澳元 0.0282	18,802,855.481	(340,918)
加元对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	加元 0.0350	8,137,233.985	(207,273)
欧元对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	欧元 0.0172	2,073,545.880	(34,939)
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	英镑 0.0291	6,536,876.022	(212,346)
港元类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	港元 0.0354	253,090,273.759	(1,141,339)
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	纽元 0.0328	6,002,090.910	(111,359)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	人民币 0.0370	1,619,171.660	(8,403)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	人民币 0.0320	9,382,900.800	(42,116)
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	美元 0.0352	1,455,296.520	(51,226)
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	人民币 0.0330	175,077,078.406	(810,411)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	新加坡元 0.0325	780,393.257	(17,676)
美元类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	美元 0.0350	42,238,223.578	(1,478,338)
美元 C 类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	美元 0.1229	8,696,075.145	(1,068,748)
美元 C 类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	美元 0.0370	2,313,938.405	(85,616)
可赎回份额持有人之总收益分配					(61,929,863)

## 7 税项

### 澳大利亚税项

本基金对澳大利亚证券交易所上市的证券进行投资。处置澳大利亚境内投资所得的收益可能需要缴纳百分之三十的澳大利亚所得税。二零一二年九月，澳大利亚政府出台法规，豁免境外基金就二零一一年六月三十日或之前实现的收益缴纳所得税，前提是必须满足若干所有权条件和其他标准。二零一五年六月，澳大利亚政府进一步出台法规（“法规”），豁免受境外管理的基金就二零一一年七月一日或之后实现的收益缴纳所得税，前提是必须满足若干所有权条件和其他标准。

管理人认为，于二零二三年九月三十日，在该等财务报表批准之日，本基金所投资的澳大利亚境内投资不太可能被征收资本收益税。此外，管理人认为本基金应符合法规相关标准并获得免税资格。因此，于二零二三年及二零二二年九月三十日并无税项拨备。该评估为管理人的最佳估计。

### 中国税项

在编制该等财务报表时，管理人就未来可能发生的情况，对税务风险做出若干假设并使用不同的估计。由此产生的会计估计可能与相关的实际结果并不一致。

根据《中华人民共和国企业所得税法》（“中国企业所得税法”）的一般税务规定，除非根据中国境内现行税收法律法规或相关税收协定获得豁免或减免，否则在中国境内无实际管理、设立或营业地点的中国境内非居民企业可能需要对出售证券所得的资本收益缴纳百分之十的中国境内预提所得税（“预提所得税”）。

此外，根据财税二零一六年第三十六号通知（“三十六号通知”），自二零一六年五月一日起，将对该等有价值证券的买卖价差征收百分之六的增值税（“增值税”）。此外，如果适用增值税，则根据增值税负债（“增值税相关税项”）征收地方附加税，包括城市维护建设税（当前税率为百分之一至百分之七）、教育费附加（当前税率为百分之三）和地方教育费附加（当前税率为百分之二）。根据新颁布的《城市维护建设税法》以及财政部和中国国家税务总局（“国税总局”）联合发布的二零二一年第二十八号公告，自二零二一年九月一日起，对境外单位向中国境内提供服务和销售无形资产所支付的增值税不征收城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。然而，实际上，获豁免的情况可能会因当地的实际情况而有所不同。

#### *A 股股息收入和资本收益*

本基金通过沪港通和深港通（统称“中华通”）对中国境内上市的 A 股进行投资，并对股票所得的股息收入缴纳百分之十的预提所得税。截至二零二三年及二零二二年九月三十日止年度，已就股票所得的股息收入缴纳预提所得税。

根据财税二零一四年第八十一号和财税二零一六年第一百二十七号，境外投资者通过中华通交易中国境内 A 股所得的资本收益暂时获豁免缴纳中国境内企业所得税。根据三十六号通知及其他现行增值税法规，通过中华通交易有价值证券（包括 A 股和其他中国境内上市证券）所得的资本收益可获豁免缴纳中国境内增值税。

#### *H 股股息收入和资本收益*

本基金对香港联交所上市的中国境内公司股份（“H 股”）进行投资。根据《中华人民共和国企业所得税法》的一般税务规定，除非根据相关双重税收协定获得豁免或减免，否则严格来说，基金须就来自中国境内的资本收益缴纳百分之十的预提所得税。然而，中国境内税务机关实际上可能难以对此类资本收益征收预提所得税。地方税务局并未严格执行对中国境内非税收居民企业从 H 股交易所获得的资本收益收取百分之十的预提所得税。如果资本收益来自 H 股交易，一般不征收增值税，因为购买和出售通常均在中国境外完成。

由于管理人认为，在当前的执法环境下，对 H 股所得的资本收益征税的可能性不大，因此未对财务报表中的此等收益作出税项拨备。

#### 香港税项

由于本基金根据香港证券及期货条例第 104 条获认可为集体投资计划，根据香港税务条例第 26A(1A)条，本基金获豁免缴纳香港利得税，因此并无税项拨备。

#### 其他司法管辖区

截至二零二三年及二零二二年九月三十日止年度，已就若干收到的股息收入和利息收入预扣或缴付海外税项。

## **8 与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之交易**

以下是本基金与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之间于年度内订立的重大关联方交易摘要。受托人及管理人之关联人士是根据香港证券及期货事务监察委员会所颁布的单位信托及互惠基金守则（“证监会守则”）中的定义。所有该等交易均于正常业务过程中按一般商业条款订立。

(a) 以下为受托人及管理人之关联人士之投资交易：

公司名称	投资买卖总价值 美元	占本基金本年度 之总交易价值百 分比	支付佣金 美元	占本基金本年度 支付之总佣金 百分比	平均佣金率 百分比
<u>2023</u>					
J.P. Morgan Securities Plc	510,936	0.05	128	0.03	0.03
J.P. Morgan Securities Australia Limited	19,453,757	1.96	11,087	2.29	0.06
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	52,261,058	5.26	53,214	11.00	0.10
香港上海汇丰银行有限公司	20,662,496	2.08	12,230	2.53	0.06
<u>2022</u>					
J.P. Morgan India Private Limited	1,525,826	0.09	610	0.07	0.04
J.P. Morgan Securities Australia Limited	37,013,888	2.17	16,975	1.88	0.05
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	88,069,315	5.17	56,971	6.29	0.06
香港上海汇丰银行有限公司	26,807,210	1.57	18,969	2.10	0.07
香港上海汇丰银行有限公司，首尔	165,102	0.01	165	0.02	0.10

(b) 与管理人及其关联人士之年末结余：

	2023 美元	2022 美元
银行现金	2,426,958	2,607,831
应收款项	288,913	793,411
应付款项	(1,331,062)	(1,590,113)

(c) 截至二零二三年九月三十日止年度，本基金与受托人之关联人士签订了远期外汇合约，实现亏损 11,353,210 美元（二零二二年：实现收益 5,224,086 美元）。

(d) 截至二零二三年九月三十日止年度，扣除支付给代理机构的佣金后，管理人取得本基金分配及赎回收益为 15,528 美元（二零二二年：2,908 美元）。

(e) 支付给摩根基金（亚洲）有限公司美元 C 类别（每季派息）及美元 C 类别（每月派息）之管理费和其他基金份额类别之管理费分别按各类别资产净值的年率百分之零点七五和百分之一点五计算。此管理费于每个交易日累计，并于每月月底支付。

此外，如果本基金的资产净值超过 500 万美元但低于 2,000 万美元，则管理人就每次评估收取估值费用 40 美元；如果本基金的资产净值超过 2,000 万美元，则管理人就每次评估收取估值费用 70 美元。

(f) 本基金允许受托人及其关联人士、管理人及其关联人士认购/申购及赎回本基金份额。

于本年度内，管理人及其公司集团成员持有本基金份额，并有权获取本基金份额之交易利润，详情如下：

	年初	总分配	总赎回	年末	交易利润 美元
<u>2023</u>					
摩根资产管理（亚太）有限公司 - 美元类别（累计）	42,099.949	26,659.773	(9,800.088)	58,959.634	-

	年初	总分配	总赎回	年末	交易利润 美元
<u>JPMorgan Asset Management (S)</u>					
<u>Limited</u>					
- 美元类别 (累计)	13,686.096	-	(9,915.613)	3,770.483	-
<u>2022</u>					
<u>摩根资产管理 (亚太) 有限公司</u>					
- 美元类别 (累计)	40,744.830	25,649.426	(24,294.307)	42,099.949	72,249
<u>JPMorgan Asset Management (S)</u>					
<u>Limited</u>					
- 美元类别 (累计)	22,995.142	-	(9,309.046)	13,686.096	21,361

- (g) 受托人费用按本基金资产净值的首 4,000 万美元，以本基金资产净值的年率百分之零点零六计算；资产净值介乎 4,000 万美元至 7,000 万美元，按年率百分之零点零四计算；超过 7,000 万美元时，按年率百分之零点零二五计算。受托人费用于每个交易日累计，并于每月月底支付。
- (h) 摩根基金（亚洲）有限公司，即登记代理人及管理人，根据本基金份额持有人的数量及发生交易的数量收取注册费。与受托人商定的收费率为本基金资产净值的年率介乎百分之零点零一至百分之零点五不等。基金注册登记机构费用于每季季末支付。
- (i) 截至二零二三年及二零二二年九月三十日止年度，除附注 8(e)和 8(h)披露的管理费用、估值费用及基金注册登记机构费用外，已收／（已付）管理人摩根基金（亚洲）有限公司及其关联人士的金額列示如下：

	2023 美元	2022 美元
存款利息	28,906	23,386
托管费用及银行费用	(34,834)	(34,471)
交易成本	(64,429)	(74,556)

- (j) 截至二零二三年及二零二二年九月三十日止年度，除附注 8(g)披露的受托人费用外，已收／（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額列示如下：

	2023 美元	2022 美元
存款利息	21,935	2,101
交易成本	(38,103)	(78,539)
利息支出	(67,333)	(25,024)
托管费用及银行费用	(328,748)	(415,751)

## 9 借款

截至二零二三年及二零二二年九月三十日止年度，本基金从香港上海汇丰银行有限公司（受托人的关联人士）借入无抵押短期借款。所有银行借款的久期均在 7 天内。所有交易均为按一般商业条款下进行的正常业务流程。



10 非金钱收益／佣金共享安排

投资管理人与经纪签署了非金钱收益／佣金共享安排，从而收取若干产品和服务以协助作出投资决策。由本基金支付的部分交易佣金会由经纪保留，作为产品和服务的补偿。

该等产品和服务必须对本基金具有明显的利益，并仅限于研究和咨询服务。

截至二零二三年九月三十日止年度，投资管理人经非金钱收益／佣金共享安排而获得的服务交易金额为 988,826,529 美元（二零二二年：1,411,296,461 美元）。本基金就该等交易支付佣金 41,906 美元（二零二二年：159,412 美元）。

11 衍生性产品

以下为截至九月三十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
2023				
未平仓合约：				
加元 64,372	美元 47,736	2023 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	123
美元 242,752	澳元 380,611	2023 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	2,903
美元 13,962	英镑 11,505	2023 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	81
美元 5,603	纽元 9,435	2023 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	66
美元 74,051	加元 100,115	2023 年 10 月 5 日	Citibank N.A., 伦敦	1
美元 28,844	英镑 23,632	2023 年 10 月 5 日	Citibank N.A., 伦敦	0
美元 106,014	离岸人民币 775,082	2023 年 10 月 10 日	法国巴黎银行	391
澳元 824,013	美元 533,463	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,283
澳元 1,820,585	美元 1,176,209	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	402
澳元 92,907	美元 60,269	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	266
澳元 129,171	美元 83,520	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	97
澳元 62,258	美元 40,306	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	97
澳元 8,724	美元 5,676	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	42
澳元 8,549	美元 5,535	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	13
加元 1,063,508	美元 790,263	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3,443
加元 731,736	美元 544,463	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3,100
加元 131,445	美元 98,056	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	808
加元 325,775	美元 241,666	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	646
加元 177,061	美元 131,290	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	294
加元 668,477	美元 494,773	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	211
加元 44,425	美元 32,940	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	73
加元 34,821	美元 25,768	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	6
加元 18,156	美元 13,438	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	6
加元 1,810	美元 1,342	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	3
加元 1,488	美元 1,103	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	2
离岸人民币 10,523,236	美元 1,447,867	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	2,670
离岸人民币 625,718	美元 86,214	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	282
离岸人民币 255,382	美元 35,162	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	89
离岸人民币 129,505	美元 17,835	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	49
离岸人民币 1,835,804	美元 252,153	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	35
离岸人民币 110,679	美元 15,228	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	28
离岸人民币 434,186	美元 59,637	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	8
离岸人民币 7,996	美元 1,102	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	4
离岸人民币 97,453	美元 13,386	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	3
离岸人民币 8,027	美元 1,105	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 8,097	美元 1,114	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 8,039	美元 1,106	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 21,300	美元 2,926	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	0
离岸人民币 8,017	美元 1,101	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	0
离岸人民币 8,017	美元 1,101	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	0
欧元 225,174	美元 241,971	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	3,387

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
欧元 189,510	美元 203,809	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	3,014
欧元 199,439	美元 213,443	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,127
欧元 82,585	美元 89,390	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	1,888
欧元 293,169	美元 312,429	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	1,801
欧元 20,923	美元 22,469	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	300
欧元 13,292	美元 14,264	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	181
欧元 18,807	美元 20,087	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	160
欧元 89,651	美元 95,110	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	120
欧元 12,440	美元 13,281	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	100
欧元 2,072	美元 2,226	2023 年 10 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	30
欧元 1,031	美元 1,102	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	10
欧元 1,031	美元 1,102	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	9
欧元 1,032	美元 1,101	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	8
英镑 574,099	美元 719,172	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	18,377
英镑 525,247	美元 659,472	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	18,309
英镑 289,500	美元 365,733	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	12,344
英镑 565,084	美元 699,686	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	9,895
英镑 824,225	美元 1,009,971	2023 年 10 月 20 日	加拿大皇家银行	3,850
英镑 131,985	美元 164,885	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3,773
英镑 78,979	美元 99,661	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3,252
英镑 84,098	美元 104,295	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	1,638
英镑 84,889	美元 104,133	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	510
英镑 14,685	美元 18,235	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	310
英镑 2,516	美元 3,139	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	68
英镑 1,748	美元 2,195	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	61
英镑 1,485	美元 1,865	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	52
英镑 1,479	美元 1,857	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	52
英镑 1,745	美元 2,180	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	50
英镑 2,250	美元 2,789	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	43
英镑 882	美元 1,102	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	25
英镑 881	美元 1,094	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	19
英镑 886	美元 1,098	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	17
英镑 887	美元 1,099	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	15
新加坡元 166,752	美元 123,292	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	1,021
新加坡元 89,609	美元 65,956	2023 年 10 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	250
新加坡元 34,370	美元 25,434	2023 年 10 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	232
新加坡元 75,671	美元 55,670	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	184
新加坡元 80,103	美元 58,803	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	68
新加坡元 2,947	美元 2,168	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	8
新加坡元 1,501	美元 1,104	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	3
美元 95,594,784	澳元 149,593,695	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	1,018,808
美元 178,918,651	离岸人民币 1,309,539,599	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	925,563
美元 25,995,876	纽元 44,202,554	2023 年 10 月 20 日	加拿大皇家银行	563,450
美元 44,328,161	加元 60,437,861	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	385,842
美元 11,578,188	离岸人民币 84,742,955	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	59,895
美元 7,254,672	离岸人民币 53,098,324	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	37,529
美元 1,795,469	澳元 2,815,346	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	22,794
美元 3,576,603	离岸人民币 26,177,838	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	18,502
美元 486,946	纽元 829,495	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	11,460
美元 836,891	加元 1,141,914	2023 年 10 月 20 日	美林国际, 伦敦	7,937
美元 1,498,557	离岸人民币 10,956,668	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	6,165
美元 827,870	澳元 1,289,406	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	4,880
美元 296,331	纽元 500,803	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,579
美元 851,634	澳元 1,324,574	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3,829
美元 2,633,722	离岸人民币 19,203,425	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3,560
美元 148,527	纽元 251,731	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	2,727
美元 225,190	纽元 378,610	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,300
美元 177,942	澳元 278,712	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	2,061
美元 178,867	纽元 300,793	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,866
美元 539,924	澳元 838,495	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	1,610
美元 987,409	离岸人民币 7,201,420	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	1,590
美元 317,276	离岸人民币 2,319,874	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	1,321
美元 271,738	澳元 422,158	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	909
美元 269,281	澳元 417,885	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	606
美元 30,788	纽元 52,120	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	528
美元 306,113	加元 414,425	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	493

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 164,944	离岸人民币 1,204,498	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	474
美元 55,463	纽元 93,031	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	435
美元 102,083	离岸人民币 746,335	2023 年 10 月 20 日	美林国际, 伦敦	414
美元 28,081	纽元 47,423	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	414
美元 70,045	加元 95,142	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	344
美元 62,781	离岸人民币 458,994	2023 年 10 月 20 日	美林国际, 伦敦	254
美元 1,259,182	离岸人民币 9,170,421	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	228
美元 168,645	离岸人民币 1,229,529	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	211
美元 27,343	离岸人民币 200,340	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	170
美元 106,556	离岸人民币 777,051	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	160
美元 115,380	离岸人民币 841,193	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	145
美元 30,657	离岸人民币 224,144	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	126
美元 52,860	离岸人民币 385,499	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	82
美元 58,007	离岸人民币 422,952	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	78
美元 65,909	离岸人民币 480,434	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	71
美元 41,239	新加坡元 56,324	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	60
美元 5,268	澳元 8,250	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	60
美元 17,756	离岸人民币 129,661	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	51
美元 42,116	离岸人民币 306,995	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	45
美元 13,889	离岸人民币 101,430	2023 年 10 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	41
美元 12,323	离岸人民币 89,988	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	35
美元 5,251	离岸人民币 38,472	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	33
美元 19,799	离岸人民币 144,402	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	32
美元 48,039	离岸人民币 350,000	2023 年 10 月 20 日	美林国际, 伦敦	28
美元 15,002	离岸人民币 109,405	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	23
美元 4,816	离岸人民币 35,201	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	18
美元 7,544	澳元 11,708	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	17
美元 2,487	离岸人民币 18,225	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	16
美元 6,886	离岸人民币 50,232	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	13
美元 28,641	离岸人民币 208,625	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	11
美元 7,951	离岸人民币 57,973	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	11
美元 5,984	离岸人民币 43,644	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	9
美元 3,124	离岸人民币 22,811	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	9
美元 12,381	英镑 10,149	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	8
美元 24,877	离岸人民币 181,176	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	5
美元 1,910	离岸人民币 13,937	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	4
美元 1,242	离岸人民币 9,070	2023 年 10 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	4
美元 2,097	离岸人民币 15,289	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3
美元 1,300	离岸人民币 9,482	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	2
美元 1,279	离岸人民币 9,330	2023 年 10 月 20 日	美林国际, 伦敦	2
美元 2,520	离岸人民币 18,358	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	1
美元 1,152	离岸人民币 8,396	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	1
美元 120,453	澳元 186,326	2023 年 11 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	14
美元 48,835	英镑 40,000	2023 年 11 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1

未实现总收益 3,200,060

纽元 93,031	美元 55,460	2023 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	(437)
美元 1,342	加元 1,810	2023 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	(3)
美元 25,762	加元 34,821	2023 年 10 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
英镑 10,149	美元 12,380	2023 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(8)
英镑 40,000	美元 48,823	2023 年 10 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
纽元 10,012	美元 6,016	2023 年 10 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
澳元 186,326	美元 120,280	2023 年 10 月 10 日	Citibank N.A., 伦敦	(9)
离岸人民币 9,330	美元 1,279	2023 年 10 月 10 日	美林国际, 伦敦	(2)
离岸人民币 35,201	美元 4,815	2023 年 10 月 10 日	法国巴黎银行	(18)
离岸人民币 777,051	美元 106,523	2023 年 10 月 10 日	Citibank N.A., 伦敦	(152)
澳元 2,136	美元 1,377	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
澳元 1,708	美元 1,100	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(4)
澳元 12,205	美元 7,877	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
澳元 1,703	美元 1,092	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(8)
澳元 4,129	美元 2,653	2023 年 10 月 20 日	渣打银行, 伦敦	(14)
澳元 2,206	美元 1,409	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
澳元 5,928	美元 3,809	2023 年 10 月 20 日	渣打银行, 伦敦	(20)
澳元 10,559	美元 6,784	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(35)
澳元 282,700	美元 182,449	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(130)
澳元 64,953	美元 41,733	2023 年 10 月 20 日	渣打银行, 伦敦	(217)
澳元 182,342	美元 117,529	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(234)
澳元 80,171	美元 51,510	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(268)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
澳元 136,979	美元 88,169	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(298)
澳元 89,402	美元 57,410	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(330)
澳元 127,497	美元 81,409	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(934)
澳元 1,090,160	美元 702,466	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(1,603)
澳元 380,611	美元 242,897	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,917)
澳元 2,008,193	美元 1,293,567	2023 年 10 月 20 日	加拿大皇家银行	(3,404)
澳元 816,050	美元 523,539	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3,499)
澳元 2,682,787	美元 1,728,609	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(4,042)
澳元 742,928	美元 474,315	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5,498)
澳元 1,335,895	美元 853,023	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(9,752)
澳元 1,722,644	美元 1,102,527	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(10,025)
澳元 1,661,027	美元 1,060,766	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(11,992)
加元 1,487	美元 1,100	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
加元 1,500	美元 1,106	2023 年 10 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(3)
加元 1,500	美元 1,106	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(3)
加元 43,581	美元 32,236	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
加元 92,253	美元 68,233	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(19)
加元 76,891	美元 56,863	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(24)
加元 36,729	美元 26,888	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(285)
加元 336,367	美元 247,633	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(1,223)
加元 371,991	美元 273,902	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	(1,310)
加元 177,526	美元 129,993	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,347)
加元 776,019	美元 571,028	2023 年 10 月 20 日	加拿大皇家银行	(3,098)
加元 702,387	美元 514,629	2023 年 10 月 20 日	加拿大皇家银行	(5,021)
离岸人民币 11,704	美元 1,606	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 8,097	美元 1,111	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 8,039	美元 1,103	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 8,011	美元 1,099	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 8,011	美元 1,099	2023 年 10 月 20 日	美林国际, 伦敦	(1)
离岸人民币 8,011	美元 1,099	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 8,011	美元 1,099	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 11,788	美元 1,617	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 10,109	美元 1,387	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 8,097	美元 1,110	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 8,097	美元 1,110	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 8,011	美元 1,098	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 7,996	美元 1,096	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 21,960	美元 3,013	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(3)
离岸人民币 8,097	美元 1,109	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 8,097	美元 1,109	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 8,097	美元 1,109	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 8,097	美元 1,109	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 8,041	美元 1,101	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 8,041	美元 1,101	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 27,991	美元 3,840	2023 年 10 月 20 日	美林国际, 伦敦	(4)
离岸人民币 9,565	美元 1,310	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(4)
离岸人民币 10,194	美元 1,395	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
离岸人民币 8,026	美元 1,097	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(5)
离岸人民币 8,026	美元 1,097	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
离岸人民币 7,996	美元 1,091	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(7)
离岸人民币 30,485	美元 4,178	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
离岸人民币 16,861	美元 2,305	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(10)
离岸人民币 10,965	美元 1,496	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(10)
离岸人民币 211,569	美元 29,037	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(18)
离岸人民币 78,880	美元 10,814	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(19)
离岸人民币 28,027	美元 3,825	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(25)
离岸人民币 60,371	美元 8,255	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(36)
离岸人民币 91,480	美元 12,519	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(44)
离岸人民币 305,349	美元 41,873	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(61)
离岸人民币 80,200	美元 10,944	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(70)
离岸人民币 139,866	美元 19,137	2023 年 10 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(71)
离岸人民币 1,050,164	美元 144,143	2023 年 10 月 20 日	美国道富银行	(80)
离岸人民币 153,446	美元 20,993	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(81)
离岸人民币 168,870	美元 23,107	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(85)
离岸人民币 178,524	美元 24,428	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(90)
离岸人民币 320,828	美元 43,954	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(107)
离岸人民币 628,558	美元 86,186	2023 年 10 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(136)
离岸人民币 461,586	美元 63,252	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	(140)
离岸人民币 368,995	美元 50,514	2023 年 10 月 20 日	高盛国际, 伦敦	(162)
离岸人民币 288,965	美元 39,512	2023 年 10 月 20 日	法国巴黎银行	(173)

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 663,900	美元 90,992	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(184)
离岸人民币 2,741,658	美元 376,311	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(211)
离岸人民币 628,537	美元 86,098	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(221)
离岸人民币 467,461	美元 63,941	2023年10月20日	法国巴黎银行	(257)
离岸人民币 751,980	美元 102,984	2023年10月20日	美国道富银行	(288)
离岸人民币 1,056,942	美元 144,861	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(293)
离岸人民币 1,091,004	美元 149,504	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(328)
离岸人民币 956,126	美元 130,977	2023年10月20日	法国巴黎银行	(332)
离岸人民币 987,833	美元 135,316	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(347)
离岸人民币 775,082	美元 106,037	2023年10月20日	法国巴黎银行	(408)
离岸人民币 895,164	美元 122,492	2023年10月20日	美国道富银行	(445)
离岸人民币 1,195,404	美元 163,711	2023年10月20日	美国道富银行	(458)
离岸人民币 956,970	美元 130,949	2023年10月20日	美国道富银行	(476)
离岸人民币 1,537,333	美元 210,595	2023年10月20日	法国巴黎银行	(533)
离岸人民币 982,192	美元 134,293	2023年10月20日	法国巴黎银行	(596)
离岸人民币 2,851,545	美元 390,970	2023年10月20日	法国巴黎银行	(644)
离岸人民币 1,838,333	美元 251,738	2023年10月20日	美国道富银行	(727)
离岸人民币 1,814,984	美元 248,522	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(737)
离岸人民币 4,169,292	美元 571,839	2023年10月20日	法国巴黎银行	(746)
离岸人民币 3,313,579	美元 454,163	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(904)
离岸人民币 8,287,909	美元 1,136,535	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,676)
离岸人民币 3,984,637	美元 545,129	2023年10月20日	法国巴黎银行	(2,097)
离岸人民币 15,226,954	美元 2,088,112	2023年10月20日	法国巴黎银行	(3,065)
离岸人民币 6,887,678	美元 942,411	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3,501)
离岸人民币 15,646,624	美元 2,143,614	2023年10月20日	法国巴黎银行	(5,198)
离岸人民币 22,568,940	美元 3,092,642	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(6,839)
离岸人民币 18,309,057	美元 2,506,440	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(8,014)
离岸人民币 14,116,831	美元 1,930,267	2023年10月20日	法国巴黎银行	(8,453)
离岸人民币 12,391,372	美元 1,690,926	2023年10月20日	法国巴黎银行	(10,830)
欧元 182,883	美元 193,360	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(414)
英镑 897	美元 1,094	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1)
英镑 50,494	美元 61,602	2023年10月20日	法国巴黎银行	(36)
英镑 11,505	美元 13,963	2023年10月20日	法国巴黎银行	(81)
英镑 251,244	美元 306,286	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(403)
英镑 517,371	美元 628,627	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(2,920)
纽元 1,865	美元 1,104	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(17)
纽元 2,592	美元 1,539	2023年10月20日	法国巴黎银行	(18)
纽元 1,864	美元 1,100	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(20)
纽元 1,864	美元 1,100	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(20)
纽元 1,859	美元 1,097	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(20)
纽元 1,847	美元 1,086	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(24)
纽元 9,435	美元 5,603	2023年10月20日	法国巴黎银行	(66)
纽元 10,475	美元 6,203	2023年10月20日	法国巴黎银行	(92)
纽元 8,187	美元 4,811	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(108)
纽元 24,267	美元 14,324	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(258)
纽元 77,239	美元 46,137	2023年10月20日	法国巴黎银行	(273)
纽元 43,089	美元 25,487	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(403)
纽元 107,303	美元 63,970	2023年10月20日	法国巴黎银行	(504)
纽元 90,944	美元 53,974	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(670)
纽元 108,251	美元 64,063	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(980)
纽元 238,110	美元 141,941	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(1,129)
纽元 287,454	美元 170,895	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,823)
纽元 263,457	美元 156,423	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1,876)
纽元 488,817	美元 290,190	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(3,518)
纽元 542,118	美元 321,894	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(3,840)
纽元 780,423	美元 464,759	2023年10月20日	美林国际, 伦敦	(4,162)
纽元 548,528	美元 324,848	2023年10月20日	加拿大皇家银行	(4,738)
纽元 507,190	美元 298,648	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(6,099)
新加坡元 116,205	美元 85,193	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(14)
新加坡元 35,592	美元 26,055	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(43)
新加坡元 72,988	美元 53,337	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(181)
美元 50,136	离岸人民币 365,053	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
美元 1,795	澳元 2,776	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
美元 1,124	离岸人民币 8,168	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
美元 80,983	离岸人民币 589,656	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
美元 1,222	离岸人民币 8,869	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
美元 3,032	离岸人民币 22,035	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
美元 1,580	加元 2,118	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
美元 3,233	新加坡元 4,391	2023年10月20日	法国巴黎银行	(14)
美元 27,133	新加坡元 36,982	2023年10月20日	美国道富银行	(15)

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 41,284	离岸人民币 300,473	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(19)
美元 124,063	离岸人民币 903,147	2023年10月20日	法国巴黎银行	(30)
美元 14,942	离岸人民币 108,506	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(41)
美元 13,037	欧元 12,217	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(92)
美元 6,198	英镑 5,000	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(95)
美元 47,749	加元 64,372	2023年10月20日	法国巴黎银行	(124)
美元 251,500	加元 339,773	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(125)
美元 55,224	新加坡元 75,133	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(132)
美元 6,236	英镑 5,000	2023年10月20日	渣打银行, 伦敦	(133)
美元 66,762	离岸人民币 485,149	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(135)
美元 84,750	离岸人民币 616,081	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(141)
美元 133,771	离岸人民币 972,436	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(223)
美元 9,938	英镑 7,931	2023年10月20日	法国巴黎银行	(256)
美元 92,759	新加坡元 126,051	2023年10月20日	美国道富银行	(332)
美元 33,847	新加坡元 45,663	2023年10月20日	美国道富银行	(365)
美元 483,068	英镑 395,426	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(377)
美元 151,480	欧元 142,428	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(570)
美元 501,460	加元 676,979	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(608)
美元 280,878	澳元 433,850	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(680)
美元 1,087,128	澳元 1,682,126	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(744)
美元 99,036	欧元 92,764	2023年10月20日	美林国际, 伦敦	(748)
美元 2,012,109	离岸人民币 14,644,501	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(922)
美元 381,739	加元 514,506	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,090)
美元 199,562	欧元 186,834	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1,602)
美元 660,128	澳元 1,018,872	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(2,100)
美元 138,984	欧元 129,126	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2,168)
美元 453,071	英镑 369,342	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2,220)
美元 380,279	澳元 584,502	2023年10月20日	渣打银行, 伦敦	(2,785)
美元 119,634	欧元 109,818	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(3,276)
美元 4,888,068	新加坡元 6,661,522	2023年10月20日	美国道富银行	(3,516)
美元 142,469	英镑 113,468	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(3,961)
美元 322,083	英镑 260,292	2023年10月20日	巴克莱银行, 伦敦	(4,348)
美元 330,558	欧元 307,150	2023年10月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(5,116)
美元 230,277	英镑 184,348	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(5,246)
美元 189,280	英镑 150,000	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(6,177)
美元 379,000	英镑 305,202	2023年10月20日	Citibank N.A., 伦敦	(6,444)
美元 649,749	英镑 522,366	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(12,104)
美元 388,124	英镑 305,946	2023年10月20日	摩根士丹利国际股份有限公司	(14,660)
美元 1,071,578	英镑 853,372	2023年10月20日	高盛国际, 伦敦	(29,878)
美元 17,446,619	欧元 16,258,017	2023年10月20日	法国巴黎银行	(220,405)
美元 56,608,789	英镑 45,371,589	2023年10月20日	法国巴黎银行	(1,224,280)
加元 100,115	美元 74,098	2023年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 8,028	美元 1,103	2023年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币 338,185	美元 46,483	2023年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(23)
英镑 23,632	美元 28,851	2023年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
美元 6,016	纽元 10,012	2023年11月21日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
			未实现总亏损	(1,721,638)
			未实现净收益	1,478,422

2022

未平仓合约:

纽元 13,526	美元 7,795	2022年10月3日	法国巴黎银行	144
纽元 3,962	美元 2,261	2022年10月3日	法国巴黎银行	20
美元 190,471	英镑 177,234	2022年10月3日	法国巴黎银行	7,380
美元 464,915	新加坡元 669,188	2022年10月3日	法国巴黎银行	1,455
美元 1,099	英镑 1,019	2022年10月3日	法国巴黎银行	39
澳元 10,654	美元 6,899	2022年10月5日	法国巴黎银行	49
加元 148,999	美元 108,549	2022年10月5日	法国巴黎银行	112
加元 12,941	美元 9,457	2022年10月5日	法国巴黎银行	39
美元 82,944	英镑 75,164	2022年10月5日	法国巴黎银行	968
美元 65,736	欧元 67,298	2022年10月5日	法国巴黎银行	206
美元 1,097	英镑 1,021	2022年10月5日	法国巴黎银行	43
美元 1,113	英镑 997	2022年10月5日	法国巴黎银行	0

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 1,103	欧元 1,126	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	0
澳元 44,536	美元 28,843	2022 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	208
美元 14,074	澳元 21,889	2022 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	0
美元 1,607	英镑 1,439	2022 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	0
澳元 1,964,586	美元 1,337,848	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	74,438
澳元 1,978,127	美元 1,334,124	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	62,007
澳元 1,832,327	美元 1,234,013	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	55,658
澳元 1,902,852	美元 1,274,254	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	50,545
澳元 1,289,562	美元 870,735	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	41,428
澳元 1,728,173	美元 1,150,569	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	39,195
澳元 1,209,118	美元 815,171	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	37,597
澳元 1,223,632	美元 820,933	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	34,024
澳元 1,729,858	美元 1,139,099	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	26,642
澳元 777,401	美元 522,927	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	22,987
澳元 2,298,368	美元 1,494,064	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	16,001
澳元 2,262,106	美元 1,465,965	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	11,222
澳元 2,318,009	美元 1,501,578	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	10,885
澳元 237,888	美元 159,401	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	6,417
澳元 135,900	美元 91,203	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	3,807
澳元 657,872	美元 426,118	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,046
澳元 64,400	美元 44,180	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,765
澳元 62,485	美元 42,821	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,637
澳元 64,703	美元 43,494	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,884
澳元 42,087	美元 28,803	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,737
澳元 31,443	美元 21,571	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,350
澳元 99,481	美元 65,058	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,082
澳元 26,968	美元 18,300	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	957
澳元 21,398	美元 14,664	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	903
澳元 130,892	美元 84,999	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	823
澳元 23,187	美元 15,380	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	468
澳元 11,518	美元 7,809	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	402
澳元 8,670	美元 5,895	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	320
澳元 73,389	美元 47,427	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	232
澳元 4,865	美元 3,260	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	131
澳元 3,231	美元 2,183	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	105
澳元 1,649	美元 1,119	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	59
澳元 1,605	美元 1,089	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	57
澳元 1,597	美元 1,083	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	56
澳元 1,636	美元 1,103	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	51
澳元 1,629	美元 1,095	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	47
澳元 1,637	美元 1,098	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	46
澳元 1,642	美元 1,094	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	38
澳元 3,410	美元 2,230	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	37
澳元 1,652	美元 1,096	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	33
澳元 3,950	美元 2,565	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	25
澳元 1,699	美元 1,100	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	8
加元 1,009,358	美元 767,959	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	33,414
加元 836,023	美元 637,184	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	28,781
加元 804,014	美元 610,645	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	25,536
加元 960,183	美元 719,645	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	20,886
加元 530,396	美元 402,852	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	16,865
加元 667,737	美元 497,069	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	11,133
加元 780,030	美元 576,569	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	8,915
加元 129,169	美元 98,289	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4,288
加元 1,022,417	美元 748,248	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	4,199
加元 94,908	美元 72,526	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,459
加元 118,514	美元 88,477	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,230
加元 1,009,551	美元 736,194	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1,509
加元 1,042,318	美元 760,024	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	1,493
加元 19,820	美元 15,036	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	612
加元 107,971	美元 78,897	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	323
加元 16,749	美元 12,413	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	224
加元 119,520	美元 87,144	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	165
加元 1,446	美元 1,095	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	42
加元 12,985	美元 9,488	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	38
加元 1,552	美元 1,142	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	13
加元 16,063	美元 11,702	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	12
离岸人民币 22,426,359	美元 3,243,038	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	96,430
离岸人民币 20,328,402	美元 2,920,770	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	68,524
离岸人民币 18,628,286	美元 2,673,359	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	59,653

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 23,090,042	美元 3,287,073	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	47,345
离岸人民币 12,459,298	美元 1,785,648	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	37,503
离岸人民币 14,884,949	美元 2,108,250	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	19,766
离岸人民币 4,956,432	美元 714,072	2022年10月21日	法国巴黎银行	18,643
离岸人民币 24,400,717	美元 3,438,347	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	14,720
离岸人民币 2,997,316	美元 433,714	2022年10月21日	法国巴黎银行	13,165
离岸人民币 2,175,924	美元 313,880	2022年10月21日	法国巴黎银行	8,580
离岸人民币 2,346,063	美元 336,854	2022年10月21日	法国巴黎银行	7,682
离岸人民币 1,526,742	美元 221,578	2022年10月21日	法国巴黎银行	7,364
离岸人民币 1,460,774	美元 212,004	2022年10月21日	法国巴黎银行	7,045
离岸人民币 1,181,360	美元 171,035	2022年10月21日	法国巴黎银行	5,280
离岸人民币 1,239,144	美元 177,967	2022年10月21日	法国巴黎银行	4,105
离岸人民币 892,370	美元 129,195	2022年10月21日	法国巴黎银行	3,988
离岸人民币 1,741,514	美元 248,188	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	3,839
离岸人民币 1,063,451	美元 152,774	2022年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	3,563
离岸人民币 2,440,678	美元 345,651	2022年10月21日	法国巴黎银行	3,204
离岸人民币 3,489,172	美元 492,753	2022年10月21日	法国巴黎银行	3,193
离岸人民币 966,794	美元 138,822	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	3,172
离岸人民币 644,931	美元 92,786	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	2,296
离岸人民币 669,589	美元 96,193	2022年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	2,244
离岸人民币 1,100,115	美元 156,567	2022年10月21日	法国巴黎银行	2,212
离岸人民币 916,794	美元 130,767	2022年10月21日	法国巴黎银行	2,133
离岸人民币 956,435	美元 136,311	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	2,115
离岸人民币 614,306	美元 88,208	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	2,016
离岸人民币 398,277	美元 57,594	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	1,713
离岸人民币 726,356	美元 103,520	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	1,606
离岸人民币 18,162,753	美元 2,549,931	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,543
离岸人民币 404,956	美元 58,261	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	1,442
离岸人民币 426,250	美元 61,108	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,301
离岸人民币 263,767	美元 38,222	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,213
离岸人民币 251,739	美元 36,479	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,158
离岸人民币 299,923	美元 43,093	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	1,011
离岸人民币 1,001,549	美元 141,476	2022年10月21日	法国巴黎银行	950
离岸人民币 286,066	美元 41,036	2022年10月21日	法国巴黎银行	899
离岸人民币 274,311	美元 39,367	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	878
离岸人民币 240,213	美元 34,437	2022年10月21日	法国巴黎银行	733
离岸人民币 336,780	美元 47,944	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	691
离岸人民币 191,218	美元 27,405	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	576
离岸人民币 127,963	美元 18,516	2022年10月21日	法国巴黎银行	562
离岸人民币 118,640	美元 17,167	2022年10月21日	法国巴黎银行	521
离岸人民币 516,321	美元 72,934	2022年10月21日	法国巴黎银行	490
离岸人民币 114,375	美元 16,478	2022年10月21日	法国巴黎银行	430
离岸人民币 103,032	美元 14,844	2022年10月21日	法国巴黎银行	388
离岸人民币 108,967	美元 15,650	2022年10月21日	法国巴黎银行	361
离岸人民币 95,754	美元 13,752	2022年10月21日	法国巴黎银行	317
离岸人民币 151,556	美元 21,569	2022年10月21日	法国巴黎银行	305
离岸人民币 223,793	美元 31,697	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	297
离岸人民币 940,092	美元 132,197	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	294
离岸人民币 116,852	美元 16,674	2022年10月21日	法国巴黎银行	278
离岸人民币 363,819	美元 51,266	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	219
离岸人民币 596,044	美元 83,816	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	186
离岸人民币 1,443,790	美元 202,725	2022年10月21日	法国巴黎银行	150
离岸人民币 28,596	美元 4,125	2022年10月21日	法国巴黎银行	113
离岸人民币 34,183	美元 4,901	2022年10月21日	法国巴黎银行	104
离岸人民币 30,891	美元 4,437	2022年10月21日	法国巴黎银行	102
离岸人民币 21,053	美元 2,022	2022年10月21日	法国巴黎银行	68
离岸人民币 20,008	美元 2,854	2022年10月21日	法国巴黎银行	47
离岸人民币 29,344	美元 4,156	2022年10月21日	法国巴黎银行	39
离岸人民币 7,620	美元 1,106	2022年10月21日	法国巴黎银行	37
离岸人民币 7,620	美元 1,106	2022年10月21日	法国巴黎银行	37
离岸人民币 7,620	美元 1,106	2022年10月21日	法国巴黎银行	37
离岸人民币 7,583	美元 1,097	2022年10月21日	法国巴黎银行	33
离岸人民币 9,397	美元 1,349	2022年10月21日	法国巴黎银行	31
离岸人民币 8,336	美元 1,201	2022年10月21日	法国巴黎银行	31
离岸人民币 7,663	美元 1,105	2022年10月21日	法国巴黎银行	30
离岸人民币 7,663	美元 1,105	2022年10月21日	法国巴黎银行	30
离岸人民币 7,663	美元 1,105	2022年10月21日	法国巴黎银行	30
离岸人民币 7,663	美元 1,105	2022年10月21日	法国巴黎银行	30
离岸人民币 7,594	美元 1,094	2022年10月21日	法国巴黎银行	29
离岸人民币 13,271	美元 1,889	2022年10月21日	法国巴黎银行	27



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 10,310	美元 1,471	2022年10月21日	法国巴黎银行	25
离岸人民币 7,672	美元 1,102	2022年10月21日	法国巴黎银行	25
离岸人民币 7,664	美元 1,099	2022年10月21日	法国巴黎银行	24
离岸人民币 7,664	美元 1,099	2022年10月21日	法国巴黎银行	24
离岸人民币 268,449	美元 37,689	2022年10月21日	法国巴黎银行	23
离岸人民币 7,602	美元 1,090	2022年10月21日	法国巴黎银行	23
离岸人民币 7,602	美元 1,090	2022年10月21日	法国巴黎银行	23
离岸人民币 11,134	美元 1,585	2022年10月21日	法国巴黎银行	22
离岸人民币 7,713	美元 1,101	2022年10月21日	法国巴黎银行	18
离岸人民币 7,713	美元 1,101	2022年10月21日	法国巴黎银行	18
离岸人民币 7,708	美元 1,099	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	17
离岸人民币 7,708	美元 1,099	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	17
离岸人民币 7,708	美元 1,099	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	17
离岸人民币 7,708	美元 1,099	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	17
离岸人民币 7,911	美元 1,126	2022年10月21日	法国巴黎银行	16
离岸人民币 7,732	美元 1,095	2022年10月21日	法国巴黎银行	10
离岸人民币 7,732	美元 1,095	2022年10月21日	法国巴黎银行	10
离岸人民币 7,732	美元 1,095	2022年10月21日	法国巴黎银行	10
离岸人民币 7,771	美元 1,097	2022年10月21日	法国巴黎银行	7
离岸人民币 7,771	美元 1,097	2022年10月21日	法国巴黎银行	7
离岸人民币 7,932	美元 1,114	2022年10月21日	法国巴黎银行	1
离岸人民币 7,932	美元 1,114	2022年10月21日	法国巴黎银行	1
欧元 387,723	美元 388,417	2022年10月21日	法国巴黎银行	8,076
欧元 269,452	美元 268,989	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,667
欧元 219,288	美元 219,663	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,550
欧元 222,759	美元 222,915	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,397
欧元 240,064	美元 239,791	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,299
欧元 79,481	美元 79,938	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,970
欧元 208,793	美元 206,572	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,755
欧元 72,306	美元 72,419	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,490
欧元 146,086	美元 144,589	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,284
欧元 28,700	美元 28,895	2022年10月21日	法国巴黎银行	741
欧元 32,134	美元 32,207	2022年10月21日	法国巴黎银行	684
欧元 43,312	美元 43,093	2022年10月21日	法国巴黎银行	606
欧元 1,101	美元 1,106	2022年10月21日	法国巴黎银行	27
欧元 1,086	美元 1,090	2022年10月21日	法国巴黎银行	25
欧元 1,100	美元 1,102	2022年10月21日	法国巴黎银行	23
欧元 1,100	美元 1,102	2022年10月21日	法国巴黎银行	23
欧元 1,099	美元 1,100	2022年10月21日	法国巴黎银行	23
欧元 1,094	美元 1,090	2022年10月21日	法国巴黎银行	17
欧元 1,101	美元 1,089	2022年10月21日	法国巴黎银行	10
欧元 1,114	美元 1,095	2022年10月21日	法国巴黎银行	3
英镑 791,462	美元 912,006	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	28,126
英镑 648,590	美元 748,737	2022年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	24,412
英镑 570,272	美元 661,096	2022年10月21日	法国巴黎银行	24,234
英镑 712,800	美元 819,350	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	23,317
英镑 434,849	美元 500,376	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	14,750
英镑 829,872	美元 940,879	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	14,103
英镑 519,600	美元 592,926	2022年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	12,653
英镑 320,553	美元 368,556	2022年10月21日	法国巴黎银行	10,572
英镑 185,312	美元 213,789	2022年10月21日	法国巴黎银行	6,838
英镑 119,876	美元 136,798	2022年10月21日	加拿大皇家银行	2,924
英镑 643,441	美元 721,312	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,737
英镑 82,368	美元 94,521	2022年10月21日	法国巴黎银行	2,534
英镑 46,258	美元 53,444	2022年10月21日	法国巴黎银行	1,784
英镑 11,279	美元 12,882	2022年10月21日	法国巴黎银行	286
英镑 3,950	美元 4,579	2022年10月21日	法国巴黎银行	167
英镑 5,845	美元 6,676	2022年10月21日	法国巴黎银行	148
英镑 2,690	美元 3,133	2022年10月21日	法国巴黎银行	129
英镑 1,522	美元 1,764	2022年10月21日	法国巴黎银行	64
英镑 1,941	美元 2,221	2022年10月21日	法国巴黎银行	53
英镑 1,175	美元 1,353	2022年10月21日	法国巴黎银行	41
英镑 954	美元 1,106	2022年10月21日	法国巴黎银行	41
英镑 1,103	美元 1,270	2022年10月21日	法国巴黎银行	38
英镑 940	美元 1,086	2022年10月21日	法国巴黎银行	36
英镑 945	美元 1,091	2022年10月21日	法国巴黎银行	35
英镑 950	美元 1,092	2022年10月21日	法国巴黎银行	31
英镑 964	美元 1,093	2022年10月21日	法国巴黎银行	17
纽元 1,087,711	美元 660,287	2022年10月21日	法国巴黎银行	44,984
纽元 774,900	美元 472,740	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	34,390

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 629,241	美元 380,468	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	24,515
纽元 590,503	美元 354,199	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	20,160
纽元 529,747	美元 318,809	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	19,139
纽元 701,699	美元 413,919	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	16,978
纽元 384,042	美元 232,129	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	14,882
纽元 299,311	美元 182,325	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	13,010
纽元 484,261	美元 284,436	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	10,496
纽元 250,777	美元 151,233	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	9,372
纽元 563,768	美元 327,036	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	8,120
纽元 746,942	美元 427,145	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	4,611
纽元 757,944	美元 431,751	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	2,992
纽元 740,146	美元 421,337	2022 年 10 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	2,646
纽元 37,370	美元 22,603	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,464
纽元 154,347	美元 88,094	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	782
纽元 5,701	美元 3,495	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	270
纽元 3,510	美元 2,077	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	92
纽元 2,092	美元 1,274	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	91
纽元 1,812	美元 1,111	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	86
纽元 1,795	美元 1,100	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	85
纽元 1,794	美元 1,089	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	74
纽元 1,806	美元 1,092	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	71
纽元 1,828	美元 1,094	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	60
纽元 1,838	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	59
纽元 1,850	美元 1,095	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	48
纽元 1,872	美元 1,092	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	34
纽元 1,963	美元 1,131	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	21
纽元 30,226	美元 17,119	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	20
纽元 1,927	美元 1,091	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1
新加坡元 105,404	美元 75,173	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1,703
新加坡元 84,809	美元 60,434	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	1,319
新加坡元 88,446	美元 62,890	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1,240
新加坡元 86,387	美元 61,273	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1,058
新加坡元 84,191	美元 59,527	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	843
新加坡元 57,762	美元 41,041	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	779
新加坡元 82,765	美元 58,153	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	462
新加坡元 110,103	美元 76,777	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	31
新加坡元 1,545	美元 1,098	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	22
新加坡元 1,549	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	19
新加坡元 113,264	美元 78,966	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	16
新加坡元 4,156	美元 2,898	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1
美元 198,069	英镑 179,392	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,270
美元 14,351	英镑 13,154	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	339
美元 40,940	离岸人民币 294,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	311
美元 21,341	离岸人民币 153,834	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	243
美元 6,168	英镑 5,714	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	213
美元 12,121	欧元 12,567	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	207
美元 3,972	欧元 4,122	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	71
美元 1,394	英镑 1,293	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	50
美元 1,330	英镑 1,234	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	48
美元 4,084	离岸人民币 29,442	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	46
美元 3,210	英镑 2,907	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	37
美元 3,893	离岸人民币 27,956	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	30
美元 6,192	离岸人民币 44,296	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	23
美元 1,995	欧元 2,052	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	18
美元 5,589	离岸人民币 39,922	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	12
美元 5,385	离岸人民币 38,467	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	12
美元 7,718	新加坡元 11,082	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	7
美元 1,212	离岸人民币 8,661	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3
美元 56,613	离岸人民币 403,350	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	15
			未实现总收益	1,604,195
英镑 5,714	美元 6,166	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	(212)
美元 1,091	纽元 1,927	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	(1)
美元 11,702	加元 16,063	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	(12)
美元 17,119	纽元 30,226	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	(21)
欧元 4,122	美元 3,967	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(71)
欧元 12,567	美元 12,107	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(207)
英镑 1,293	美元 1,393	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(50)

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 9,488	加元 12,985	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(38)
美元 87,149	加元 119,520	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(165)
美元 426,060	澳元 657,872	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(3,070)
英镑 179,392	美元 197,962	2022 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	(2,310)
美元 1,100	澳元 1,699	2022 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	(8)
英镑 11,621	美元 12,973	2022 年 10 月 7 日	法国巴黎银行	(1)
澳元 5,000	美元 3,215	2022 年 10 月 11 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 29,442	美元 4,083	2022 年 10 月 11 日	法国巴黎银行	(47)
离岸人民币 294,000	美元 40,929	2022 年 10 月 11 日	法国巴黎银行	(317)
离岸人民币 153,834	美元 21,337	2022 年 10 月 12 日	法国巴黎银行	(245)
美元 1,114	离岸人民币 7,932	2022 年 10 月 12 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 7,791	美元 1,091	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 7,791	美元 1,091	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 7,860	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 7,860	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 44,898	美元 6,276	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(23)
离岸人民币 81,871	美元 11,445	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(42)
离岸人民币 97,255	美元 13,543	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(103)
离岸人民币 174,423	美元 24,288	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(185)
离岸人民币 354,943	美元 49,602	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(199)
离岸人民币 162,545	美元 22,549	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(257)
离岸人民币 348,066	美元 48,552	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(285)
离岸人民币 774,639	美元 108,288	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(400)
离岸人民币 785,633	美元 109,619	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(612)
离岸人民币 1,210,090	美元 169,161	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(625)
离岸人民币 460,394	美元 63,869	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(728)
离岸人民币 2,731,407	美元 382,391	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(849)
离岸人民币 1,822,949	美元 254,829	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(946)
离岸人民币 1,240,019	美元 173,019	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(966)
离岸人民币 804,829	美元 111,797	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1,127)
离岸人民币 1,267,137	美元 176,016	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1,774)
离岸人民币 5,248,476	美元 728,107	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(8,298)
离岸人民币 23,969,233	美元 3,349,637	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(13,449)
离岸人民币 23,534,591	美元 3,282,829	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(19,273)
欧元 1,133	美元 1,095	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(16)
欧元 67,298	美元 65,807	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(210)
欧元 206,893	美元 202,443	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(510)
欧元 278,912	美元 272,902	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(700)
欧元 274,401	美元 265,578	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3,599)
欧元 268,385	美元 258,348	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(4,927)
英镑 1,084	美元 1,183	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(28)
英镑 1,009	美元 1,089	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(38)
英镑 1,019	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(40)
英镑 1,021	美元 1,097	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(43)
英镑 75,164	美元 82,949	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(992)
英镑 27,627	美元 29,780	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,073)
英镑 76,494	美元 82,554	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,872)
英镑 177,234	美元 190,489	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(7,441)
英镑 866,355	美元 958,391	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(9,127)
英镑 855,806	美元 930,912	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(24,826)
英镑 825,120	美元 890,915	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(30,553)
新加坡元 13,902	美元 9,673	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(17)
新加坡元 108,842	美元 75,790	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(77)
新加坡元 669,188	美元 464,965	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,485)
美元 1,205	加元 1,655	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1)
美元 1,363	纽元 2,406	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2)
美元 1,365	澳元 2,111	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(7)
美元 1,259	欧元 1,272	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(11)
美元 1,333	离岸人民币 9,413	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(12)
美元 1,294	加元 1,759	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(15)
美元 2,626	离岸人民币 18,591	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(17)
美元 1,155	离岸人民币 8,098	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(19)
美元 2,262	纽元 3,962	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(20)
美元 1,305	离岸人民币 9,143	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(22)
美元 1,311	新加坡元 1,844	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(26)
美元 1,245	离岸人民币 8,687	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(27)
美元 1,221	离岸人民币 8,511	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(27)
美元 1,163	离岸人民币 8,060	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(32)
美元 5,057	离岸人民币 35,811	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(33)
美元 1,086	英镑 940	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(36)

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 2,148	欧元 2,151	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(37)
美元 9,457	加元 12,941	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(39)
美元 1,624	欧元 1,616	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(39)
美元 1,599	离岸人民币 11,101	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(42)
美元 1,182	纽元 2,010	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(45)
美元 2,147	新加坡元 3,015	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(46)
美元 6,901	澳元 10,654	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(49)
美元 1,784	离岸人民币 12,308	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(57)
美元 7,011	离岸人民币 49,506	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(65)
美元 1,191	纽元 1,991	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(65)
美元 3,153	离岸人民币 21,962	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(72)
美元 3,151	离岸人民币 21,945	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(72)
美元 12,281	离岸人民币 86,963	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(80)
美元 5,011	欧元 5,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(107)
美元 1,688	纽元 2,792	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(109)
美元 3,658	英镑 3,177	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(111)
美元 108,548	加元 148,999	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(116)
美元 7,795	纽元 13,526	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(143)
美元 4,831	离岸人民币 33,281	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(161)
美元 7,179	离岸人民币 50,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(164)
美元 10,518	新加坡元 14,818	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(190)
美元 28,850	澳元 44,536	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(209)
美元 7,092	离岸人民币 48,940	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(226)
美元 5,874	澳元 8,713	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(271)
美元 5,768	纽元 9,539	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(372)
美元 8,486	加元 11,145	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(375)
美元 88,963	新加坡元 127,089	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(378)
美元 44,578	欧元 45,030	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(405)
美元 17,796	英镑 15,553	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(427)
美元 6,092	纽元 10,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(435)
美元 492,732	离岸人民币 3,508,657	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(437)
美元 29,917	离岸人民币 209,920	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(463)
美元 11,370	澳元 16,943	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(474)
美元 36,097	离岸人民币 252,960	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(605)
美元 20,866	离岸人民币 144,180	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(636)
美元 30,093	欧元 30,000	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(664)
美元 79,024	离岸人民币 557,986	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(734)
美元 83,740	英镑 74,300	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(764)
美元 11,201	纽元 18,259	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(873)
美元 30,006	英镑 26,009	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(960)
美元 18,625	澳元 27,214	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,124)
美元 28,733	澳元 42,877	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,159)
美元 42,529	欧元 42,155	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,176)
美元 33,893	加元 44,554	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,469)
美元 31,776	澳元 47,037	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,527)
美元 49,827	离岸人民币 343,843	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1,583)
美元 99,349	离岸人民币 696,464	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,629)
美元 62,485	离岸人民币 432,118	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,855)
美元 69,588	离岸人民币 482,453	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(1,896)
美元 84,505	离岸人民币 588,380	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,950)
美元 25,326	纽元 41,313	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,956)
美元 133,634	离岸人民币 937,683	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,070)
美元 49,673	澳元 73,675	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,294)
美元 52,273	澳元 77,708	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,300)
美元 143,839	澳元 219,939	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,398)
美元 58,236	英镑 50,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,398)
美元 74,621	英镑 64,367	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,738)
美元 77,368	英镑 66,759	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,814)
美元 110,103	离岸人民币 764,220	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,877)
美元 108,129	英镑 94,226	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,900)
美元 104,650	新加坡元 145,934	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(2,929)
美元 55,322	纽元 92,499	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,997)
美元 38,708	纽元 63,097	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3,015)
美元 107,128	离岸人民币 739,210	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3,410)
美元 153,730	离岸人民币 1,064,979	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(4,304)
美元 145,323	澳元 219,080	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,434)
美元 137,977	英镑 119,423	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,609)
美元 76,540	澳元 111,565	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,793)
美元 227,954	离岸人民币 1,590,024	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,861)
美元 135,438	英镑 116,866	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,926)

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 220,458	离岸人民币 1,535,624	2022年10月21日	法国巴黎银行	(4,997)
美元 181,628	离岸人民币 1,258,249	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	(5,085)
美元 85,973	纽元 141,613	2022年10月21日	法国巴黎银行	(5,864)
美元 162,735	英镑 140,393	2022年10月21日	法国巴黎银行	(5,948)
美元 139,211	澳元 205,327	2022年10月21日	法国巴黎银行	(7,167)
美元 314,938	英镑 275,181	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(7,624)
美元 363,127	离岸人民币 2,531,334	2022年10月21日	法国巴黎银行	(7,959)
美元 244,007	澳元 363,604	2022年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(10,177)
美元 781,459	离岸人民币 5,490,800	2022年10月21日	法国巴黎银行	(11,053)
美元 384,367	欧元 377,772	2022年10月21日	巴克莱银行, 伦敦	(13,788)
美元 591,759	英镑 514,671	2022年10月21日	法国巴黎银行	(16,990)
美元 642,842	英镑 558,995	2022年10月21日	法国巴黎银行	(18,574)
美元 631,101	澳元 929,998	2022年10月21日	法国巴黎银行	(33,027)
美元 715,884	澳元 1,060,199	2022年10月21日	法国巴黎银行	(34,079)
美元 586,105	澳元 855,239	2022年10月21日	法国巴黎银行	(36,107)
美元 621,579	纽元 1,011,506	2022年10月21日	高盛国际, 伦敦	(49,385)
美元 1,065,131	加元 1,382,307	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	(59,178)
美元 1,306,870	英镑 1,115,054	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(61,612)
美元 3,417,256	离岸人民币 23,856,413	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(70,000)
美元 5,213,056	新加坡元 7,333,935	2022年10月21日	法国巴黎银行	(101,028)
美元 4,704,016	离岸人民币 32,612,795	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	(128,165)
美元 2,140,233	澳元 3,097,676	2022年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(148,142)
美元 7,625,586	离岸人民币 53,250,715	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	(154,060)
美元 18,815,128	欧元 18,956,379	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	(219,678)
美元 12,087,105	离岸人民币 84,406,240	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	(244,196)
美元 31,397,043	纽元 52,120,376	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,913,276)
美元 64,940,616	英镑 56,383,956	2022年10月21日	加拿大皇家银行	(1,972,762)
美元 52,587,586	加元 69,376,498	2022年10月21日	渣打银行, 伦敦	(2,099,895)
美元 103,466,494	澳元 153,841,696	2022年10月21日	美林国际, 伦敦	(4,532,130)
美元 233,228,506	离岸人民币 1,628,205,514	2022年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(4,777,498)
澳元 21,889	美元 14,081	2022年11月21日	法国巴黎银行	(3)
离岸人民币 8,878	美元 1,246	2022年11月21日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 8,806	美元 1,236	2022年11月21日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 1,246,952	美元 175,012	2022年11月21日	法国巴黎银行	(51)
欧元 1,126	美元 1,107	2022年11月21日	法国巴黎银行	(0)
英镑 997	美元 1,113	2022年11月21日	法国巴黎银行	(0)
英镑 1,439	美元 1,608	2022年11月21日	法国巴黎银行	(1)
美元 3,217	澳元 5,000	2022年11月21日	法国巴黎银行	(0)
美元 12,986	英镑 11,621	2022年11月21日	法国巴黎银行	(4)
			未实现总亏损	(16,987,221)
			未实现净亏损	(15,383,026)

## 独立核数师报告

致摩根亚洲股息基金（“贵基金”）份额持有人

### 就财务报表审计作出的报告

#### 意见

我们已审计的内容

摩根亚洲股息基金刊载于第四页至第四十二页的财务报表，包括：

- 于二零二三年九月三十日的财务状况表；
- 截至该日止年度的综合收益表；
- 截至该日止年度的可赎回份额持有人应占净资产变动表；
- 截至该日止年度的现金流量表；及
- 财务报表附注，包括主要会计政策及其他解释信息。

我们的意见

我们认为，该等财务报表已根据香港会计师公会颁布的《香港财务报告准则》真实而中肯地反映了贵基金于二零二三年九月三十日的财务状况及其截至该日止年度的财务交易及现金流量。

#### 意见的基础

我们已根据香港会计师公会颁布的《香港审计准则》进行审计。我们在该等准则下承担的责任已在本报告“核数师就审计财务报表承担的责任”部分中作进一步阐述。

我们相信，我们所获得的审计凭证能充足及适当地为我们的审计意见提供基础。

#### 独立性

根据香港会计师公会颁布的《专业会计师道德守则》（“守则”），我们独立于贵基金，并已履行守则中的其他专业道德责任。

#### 其他信息

贵基金受托人及管理人（“管理层”）须对其他信息负责。其他信息包括年报内的所有信息，但不包括财务报表及我们的核数师报告。

我们对财务报表的意见不涵盖其他信息，我们亦不对该等其他信息发表任何形式的鉴证结论。

## 其他信息（续）

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中所了解的情况存在重大抵触或者似乎存在重大错误陈述的情况。

基于我们已执行的工作，如果我们认为其他信息存在重大错误陈述，我们需要报告该事实。在这方面，我们没有任何报告。

### 管理层就财务报表需承担的责任

贵基金管理层须负责根据香港会计师公会颁布的《香港财务报告准则》拟备真实而中肯的财务报表，并对其认为为使财务报表的拟备不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述所需的内部控制负责。

在拟备财务报表时，贵基金管理层负责评估贵基金持续经营的能力，并在适用情况下披露与持续经营有关的事项，以及使用持续经营为会计基础，除非管理层有意将贵基金清盘或停止经营或别无其他实际的替代方案。

此外，贵基金管理层负责确保财务报表已遵照二零一一年五月六日订立的信托契约（经修订）（“信托契约”）以及香港证券及期货事务监察委员会颁布的单位信托及互惠基金守则（“证监会守则”）附录 E 的相关披露条文适当地拟备。

### 核数师就审计财务报表承担的责任

我们的目标，是对财务报表整体是否不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述取得合理保证，并出具包括我们意见的核数师报告。我们仅向阁下（作为整体）报告我们的意见，除此之外本报告别无其他目的。我们不会就本报告的内容向任何其他人士负上或承担任何责任。合理保证是高水平的保证，但不能保证按照《香港审计准则》进行的审计，在某一重大错误陈述存在时总能发现。错误陈述可以由欺诈或错误所引起，如果合理预期它们单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依赖财务报表所作出的经济决定，则有关的错误陈述可以被视作重大。此外，我们必须评估贵基金的财务报表在所有重大方面是否已根据信托契约及证监会守则附录 E 的相关披露条文适当地拟备。

在根据《香港审计准则》进行审计的过程中，我们运用了专业判断，保持了专业怀疑态度。我们亦：

**独立核数师报告（续）**

致摩根亚洲股息基金（“贵基金”）份额持有人

**核数师就审计财务报表承担的责任（续）**

- 识别和评估由于欺诈或错误而导致财务报表存在重大错误陈述的风险，设计及执行审计程序以应对这些风险，以及获取充足和适当的审计凭证，作为我们意见的基础。由于欺诈可能涉及串谋、伪造、蓄意遗漏、虚假陈述，或凌驾于内部控制之上，因此未能发现因欺诈而导致的重大错误陈述的风险高于未能发现因错误而导致的重大错误陈述的风险。
- 了解与审计相关的内部控制，以设计适当的审计程序，但目的并非对贵基金内部控制的有效性发表意见。
- 评价管理层所采用会计政策的恰当性及作出会计估计及相关披露的合理性。
- 对管理层采用持续经营会计基础的恰当性作出结论。根据所获取的审计凭证，确定是否存在与事项或情况有关的重大不确定性，从而可能导致对贵基金的持续经营能力产生重大疑虑。如果我们认为存在重大不确定性，则有必要在核数师报告中提请使用者注意财务报表中的相关披露。假若有关的披露不足，则我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于核数师报告日止所取得的审计凭证。然而，未来事项或情况可能导致贵基金不能持续经营。
- 评价财务报表的整体列报方式、结构和内容，包括披露，以及财务报表是否中肯反映交易和事项。

除其他事项外，我们与管理层沟通了计划的审计范围、时间安排、重大审计发现等，包括我们在审计中识别出的内部控制的任何重大缺陷。

**根据信托契约与证监会守则附录 E 的相关披露条文就相关事项作出的报告**

我们认为，财务报表在各重大方面已根据信托契约及证监会守则附录 E 的相关披露条文适当地拟备。

罗兵咸永道会计师事务所  
执业会计师

香港，二零二四年一月二十四日

**管理人及受托人的责任声明**

**管理人的责任**

基金管理人务必遵照香港证券及期货事务监察委员会所颁布的单位信托及互惠基金守则和信托契约编制各年度会计期间的财务报表，该等财务报表真实而中肯地反映本基金于该期末的财务状况及截至该日止年度的财务交易。编制该等财务报表时，管理人务必：

- 选择并贯彻地应用适当的会计政策；
- 作出审慎和合理的判断；及
- 按持续营运的基准编制财务报表，除非该假设不恰当。

管理人亦务必遵照信托契约，采取合理措施预防和监测欺诈及其他不法行为。

**受托人的责任**

基金受托人务必：

- 确保管理人遵照信托契约管理本基金且确保投资及借款能力符合要求；
- 确保已保留充分的会计记录及其他记录；
- （在合理可行的情况下）保护本基金的财产及附带权利；  
及
- 就每一个会计年度，若管理人未按照信托契约管理本基金，则须向份额持有人报告。

**受托人对份额持有人的报告**

本受托人谨确认管理人于截至二零二三年九月三十日止财政年度在各个重要方面均依照二零一一年五月六日所订立之信托契约（经修订）之条款管理本基金。

汇丰机构信托服务（亚洲）有限公司，受托人

二零二四年一月二十四日



业绩记录 (未经审计)

资产净值

财务期结算日	本基金资产净值	每份额资产净值
30/9/23		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 145,075,558	澳元 7.77
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 57,391,310	加元 8.13
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 15,973,298	欧元 8.51
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 45,072,406	英镑 8.38
- 港元类别 (累计)	港元 22,192,592	港元 13.93
- 港元类别 (每月派息)	港元 1,829,727,869	港元 8.71
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 42,604,365	纽元 7.95
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 13,504,313	人民币 11.45
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 19,301,686	人民币 9.39
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 52,732,738	人民币 10.74
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 83,344,001	人民币 8.51
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12,650,318	美元 10.56
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10,784,066	美元 8.66
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 25,214,077	人民币 16.19
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 1,228,111,258	人民币 8.81
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 6,357,122	新加坡元 8.28
- 美元类别 (累计)	美元 7,274,089	美元 13.86
- 美元类别 (每月派息)	美元 280,663,732	美元 8.63
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 27,387,343	美元 9.18
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 75,937,626	美元 10.08
30/9/22		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 136,342,047	澳元 7.25
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 61,318,511	加元 7.54
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 16,395,953	欧元 7.91
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 50,842,961	英镑 7.78
- 港元类别 (累计)	港元 22,555,210	港元 12.35
- 港元类别 (每月派息)	港元 2,032,712,595	港元 8.06
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 44,500,103	纽元 7.41
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 16,266,496	人民币 9.91
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 13,778,756	人民币 8.51
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 46,975,544	人民币 9.80
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 74,167,080	人民币 7.91
- PRC 美元份额 (累计)	美元 15,063,976	美元 9.34
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 11,651,113	美元 8.01
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 21,813,168	人民币 14.77
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 1,431,961,989	人民币 8.19
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 5,996,821	新加坡元 7.68
- 美元类别 (累计)	美元 8,520,838	美元 12.26
- 美元类别 (每月派息)	美元 335,998,871	美元 7.97
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 19,480,421	美元 8.42
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 80,422,237	美元 9.25
30/9/21		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 149,977,939	澳元 9.48
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 73,226,870	加元 9.82
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 19,759,475	欧元 10.29
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 44,864,442	英镑 10.11
- 港元类别 (累计)	港元 18,177,591	港元 15.19
- 港元类别 (每月派息)	港元 1,669,881,158	港元 10.35
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 45,460,057	纽元 9.66
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 21,317,997	人民币 11.15
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 18,880,389	人民币 9.98
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 91,573,359	人民币 11.98
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 107,106,589	人民币 10.28
- PRC 美元份额 (累计)	美元 24,720,120	美元 11.60
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 18,911,109	美元 10.37
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 24,230,222	人民币 18.05
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 1,586,493,943	人民币 10.63
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10,554,577	新加坡元 9.99
- 美元类别 (累计)	美元 6,882,906	美元 15.21
- 美元类别 (每月派息)	美元 315,082,437	美元 10.33
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 127,689,157	美元 10.80
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 12,216,484	美元 11.90

(续)

最高卖出价/最低买入价

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
30/9/23		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.66	澳元 6.88
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.05	加元 7.15
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 9.46	欧元 7.50
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.30	英镑 7.37
- 港元类别 (累计)	港元 15.00	港元 11.77
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.68	港元 7.65
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.88	纽元 7.04
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 12.12	人民币 9.63
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.05	人民币 8.28
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.81	人民币 9.33
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.47	人民币 7.51
- PRC 美元份额 (累计)	美元 11.39	美元 8.90
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 9.63	美元 7.60
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 17.80	人民币 14.06
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.80	人民币 7.77
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.21	新加坡元 7.28
- 美元类别 (累计)	美元 14.95	美元 11.68
- 美元类别 (每月派息)	美元 9.60	美元 7.57
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 10.16	美元 7.99
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 11.16	美元 8.82
30/9/22		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.08	澳元 7.25
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.45	加元 7.53
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.95	欧元 7.91
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.75	英镑 7.77
- 港元类别 (累计)	港元 16.42	港元 12.35
- 港元类别 (每月派息)	港元 11.04	港元 8.06
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.28	纽元 7.41
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 11.86	人民币 9.91
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.47	人民币 8.51
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 13.06	人民币 9.80
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.95	人民币 7.90
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12.52	美元 9.34
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 11.05	美元 8.00
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 19.68	人民币 14.77
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 11.33	人民币 8.18
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.64	新加坡元 7.68
- 美元类别 (累计)	美元 16.42	美元 12.26
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.00	美元 7.97
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 11.56	美元 8.42
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 12.76	美元 9.24
30/9/21		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.26	澳元 7.77
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.62	加元 8.04
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.12	欧元 8.41
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.92	英镑 8.26
- 港元类别 (累计)	港元 16.14	港元 11.93
- 港元类别 (每月派息)	港元 11.14	港元 8.41
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.46	纽元 7.92
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 11.81	人民币 9.14
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.69	人民币 8.45
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 12.70	人民币 9.26
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 11.13	人民币 8.41
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12.37	美元 9.15
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 11.21	美元 8.47
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 19.10	人民币 13.93
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 11.51	人民币 8.69
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.80	新加坡元 8.16
- 美元类别 (累计)	美元 16.21	美元 11.99
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.15	美元 8.42
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 11.64	美元 8.75
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 12.90	美元 9.66

业绩记录 (未经审计) (续)

(续)

最高卖出价/最低买入价

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价	财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
30/9/20			30/9/17		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.50	澳元 5.86	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.86	澳元 8.64
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.68	加元 6.09	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.99	加元 8.76
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 9.96	欧元 6.39	- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.23	欧元 8.96
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.90	英镑 6.22	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.20	英镑 8.93
- 港元类别 (累计)	港元 13.63	港元 8.83	- 港元类别 (累计)	港元 12.53	港元 10.56
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.99	港元 6.42	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.28	港元 8.93
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.61	纽元 5.99	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.97	纽元 8.74
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 10.69	人民币 7.20	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 14.09	人民币 11.61
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.28	人民币 6.87	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.68	人民币 9.32
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 10.43	人民币 6.77	- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.04	新加坡元 8.78
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.00	人民币 6.42	- 美元类别 (累计)	美元 12.46	美元 10.57
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.45	美元 6.78	- 美元类别 (每月派息)	美元 10.23	美元 8.94
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.05	美元 6.47			
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 15.72	人民币 10.19	30/9/16		
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.34	人民币 6.63	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.79	澳元 7.71
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.72	新加坡元 6.19	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.93	加元 7.77
- 美元类别 (累计)	美元 13.68	美元 8.88	- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.15	欧元 7.91
- 美元类别 (每月派息)	美元 9.99	美元 6.43	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.14	英镑 7.85
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 10.32	美元 6.65	- 港元类别 (累计)	港元 11.81	港元 9.01
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 10.15	美元 9.62	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.10	港元 7.94
			- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.90	纽元 7.75
			- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.94	人民币 9.65
30/9/19			- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.62	人民币 8.32
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.77	澳元 8.53	- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.96	新加坡元 7.79
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.95	加元 8.69	- 美元类别 (累计)	美元 11.82	美元 8.94
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.20	欧元 8.88	- 美元类别 (每月派息)	美元 10.12	美元 7.88
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.17	英镑 8.88			
- 港元类别 (累计)	港元 13.61	港元 11.60	30/9/15		
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.33	港元 9.00	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 11.36	澳元 8.56
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.88	纽元 8.63	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 11.45	加元 8.63
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 10.55	人民币 9.75	- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.48	欧元 8.72
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.39	人民币 9.57	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 11.48	英镑 8.70
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 10.32	人民币 9.21	- 港元类别 (累计)	港元 12.54	港元 9.68
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.28	人民币 9.04	- 港元类别 (每月派息)	港元 11.45	港元 8.67
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.33	美元 9.26	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 11.43	纽元 8.60
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.29	美元 9.08	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.35	人民币 10.00
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 15.53	人民币 13.24	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 12.29	人民币 9.23
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.62	人民币 9.29	- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 11.41	新加坡元 8.61
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.98	新加坡元 8.72	- 美元类别 (累计)	美元 12.56	美元 9.69
- 美元类别 (累计)	美元 13.52	美元 11.53	- 美元类别 (每月派息)	美元 11.47	美元 8.69
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.22	美元 8.92			
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 10.00	美元 9.29			
			30/9/14		
30/9/18			- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 11.02	澳元 9.02
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.73	澳元 9.08	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 11.08	加元 9.05
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.90	加元 9.23	- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.10	欧元 9.05
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.15	欧元 9.46	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 11.10	英镑 9.06
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 11.11	英镑 9.44	- 港元类别 (累计)	港元 11.79	港元 9.35
- 港元类别 (累计)	港元 13.96	港元 12.27	- 港元类别 (每月派息)	港元 11.08	港元 9.06
- 港元类别 (每月派息)	港元 11.22	港元 9.57	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 11.07	纽元 9.06
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.84	纽元 9.18	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.29	人民币 9.92
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 15.82	人民币 13.95	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 11.91	人民币 9.92
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 11.62	人民币 9.86	- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 11.08	新加坡元 9.06
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.94	新加坡元 9.26	- 美元类别 (累计)	美元 11.81	美元 9.35
- 美元类别 (累计)	美元 13.87	美元 12.19	- 美元类别 (每月派息)	美元 11.10	美元 9.06
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.15	美元 9.47			

**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**

二零二三年十一月三十日之前  
JPMorgan Asset Management  
(UK) Limited  
60 Victoria Embankment  
London  
EC4Y 0JP  
United Kingdom

**管理人董事**

于二零二四年一月二十四日  
Ayaz Hatim EBRAHIM  
Daniel James WATKINS  
Ka Li NG  
Kit Yee Elka LEUNG  
Stiofan Seamus DEBURCA  
Tsun Kay Edwin CHAN

**受托人**

汇丰机构信托服务（亚洲）有  
限公司  
香港  
中环皇后大道中 1 号

**基金注册登记机构**

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

**核数师**

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

