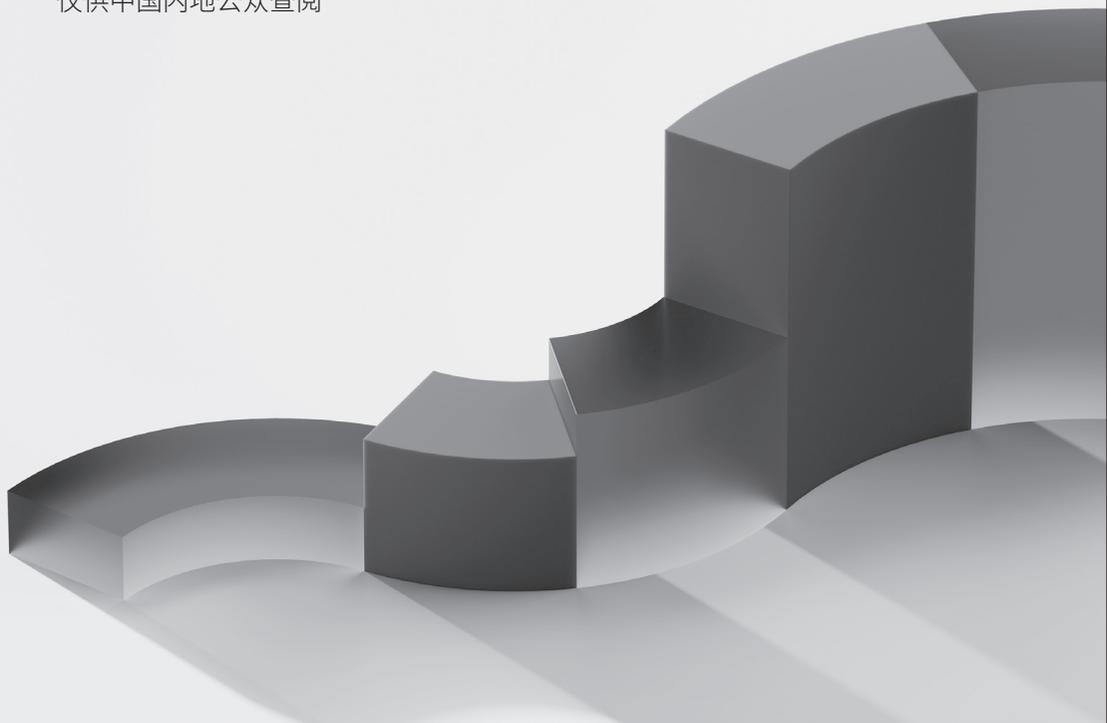


仅供中国内地公众查阅



年度报告— 2022年9月30日（经审核）

摩根亚洲总收益 债券基金



内地与香港互认基金系列

中国内地代理人：

上投摩根
基金 管 理

基金管理人：

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 – 8
投资组合持有变动表 - 未经审计	9
金融衍生工具详情 - 未经审计	10
金融衍生工具风险敞口信息 - 未经审计	10
抵押品持有情况 - 未经审计	11
财务状况表	12
综合收益表	12 – 13
可赎回份额持有人应占净资产变动表	13
现金流量表	14
财务报表之附注	15 – 56
独立核数师报告	57 – 58
管理人及受托人的责任声明	59
受托人对份额持有人的报告	59
业绩纪录 - 未经审计	60 – 63
经营与管理	63

投资组合

(续)

截至二零二二年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	占资产			单位数目	占资产	
		公平值 美元	净值百 分比			公平值 美元	净值百 分比
上市投资 (91.8%)							
(I) 债务证券 (93.3%)				Country Garden Hldgs (Reg) (Reg S) 6.15% 17Sep2025	美元 7,800,000	2,787,655	0.2
百慕大 (0.5%)				Country Garden Hldgs (Reg) (Reg S) 7.25% 08Apr2026	美元 600,000	244,404	0.0
China Oil and Gas Group (Reg) (Reg S) 4.7% 30Jun2026	美元 4,400,000	3,396,274	0.3	Country Garden Hldgs 5.625% 15Dec2026	美元 1,500,000	468,518	0.0
China Oil and Gas Group 5.5% 25Jan2023	美元 10,000,000	2,839,524	0.2	Foxconn Far East Ltd (Reg) (Reg S) 2.5% 28Oct2030	美元 12,200,000	9,960,214	0.7
开曼群岛 (7.7%)				FWD Group Ltd Ser EMTN (Reg S) Var Perp	美元 13,600,000	12,824,950	1.0
Azure Orbit IV Intl Fin Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4% 25Jan2028	美元 700,000	653,751	0.1	Goodman HK Finance Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3% 22Jul2030	美元 2,300,000	1,902,284	0.1
Baidu Inc (Reg) 3.425% 07Apr2030	美元 1,000,000	880,056	0.1	Longfor Holdings Ltd (Reg) (Reg S) 3.85% 13Jan2032	美元 2,000,000	1,306,763	0.1
CDBL Funding Two Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2% 04Mar2026	美元 5,800,000	5,239,163	0.4	Longfor Properties (Reg) (Reg S) 4.5% 16Jan2028	美元 6,600,000	5,011,994	0.4
Champion MTN Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.95% 15Jun2030	美元 11,600,000	9,850,315	0.7	Melco Resorts Finance Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.375% 04Dec2029	美元 500,000	313,036	0.0
China Resources Land Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 8,400,000	8,021,888	0.6	Melco Resorts Finance Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.625% 17Jul2027	美元 4,700,000	3,249,982	0.2
CK Hutchison Intl 19 II Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.75% 06Sep2029	美元 300,000	259,816	0.0	Shui On Development Hldg (Reg) (Reg S) 5.5% 03Mar2025	美元 6,000,000	4,045,208	0.3
CK Hutchison Intl 20 Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 2.5% 08May2030	美元 3,500,000	2,958,391	0.2	Shui On Development Hldg (Reg) (Reg S) 5.75% 12Nov2023	美元 4,700,000	4,087,597	0.3
CN Overseas Fin KY VIII Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.375% 02Mar2025	美元 8,100,000	7,429,152	0.6	Sun Hung Kai Prop (Cap) Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.75% 25Feb2029	美元 6,000,000	5,590,992	0.4
Country Garden Hldgs (Reg) (Reg S) 2.7% 12Jul2026	美元 5,300,000	1,704,878	0.1	Tencent Holdings Ltd Ser Regs (Reg S) 3.84% 22Apr2051	美元 15,000,000	10,353,081	0.8
				Zhongsheng Group (Reg) (Reg S) 3% 13Jan2026	美元 6,400,000	5,712,173	0.4

投资组合 (续)

(续)

截至二零二二年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	占资产			单位数目	占资产	
		公平值 美元	净值百 分比			公平值 美元	净值百 分比
中国 (5.7%)				香港 (12.9%)			
CDB Financial Leasing (Reg) (Reg S) Var 28Sep2030	美元 12,600,000	11,720,641	0.9	AIA Group Ltd Ser Gmtn (Reg) (Reg S) Var Perp AIA Group Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.2% 16Sep2040	美元 9,500,000	8,072,910	0.6
China Citic Bank Intl Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 28Feb2029	美元 10,050,000	9,930,180	0.7	Airport Authority HK (Reg) (Reg S) VAR Perp 2.1% Airport Authority HK (Reg) (Reg S) VAR Perp 2.4%	美元 4,200,000	3,710,463	0.3
China Construction Bank (Reg) (Reg S) Var 21Jan2032	美元 11,000,000	10,175,722	0.7	Airport Authority HK (Reg) (Reg S) VAR Perp 2.4%	美元 5,200,000	4,318,727	0.3
China Construction Bank (Reg) (Reg S) Var 24Jun2030	美元 2,100,000	1,976,920	0.1	Bank of Communication HK (Reg) (Reg S) Var 08Jul2031	美元 14,250,000	12,833,778	0.9
ENN Energy Holdings Ltd Ser Regs (Reg S) 2.625% 17Sep2030	美元 6,800,000	5,510,797	0.4	Bank of East Asia Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp Bank of East Asia Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 3,000,000	2,732,125	0.2
ENN Energy Holdings Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 17May2027	美元 2,400,000	2,381,173	0.2	Chong Hing Bank Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 6,200,000	5,616,511	0.4
ICBCIL Finance Co Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 1.75% 25Aug2025	美元 7,800,000	7,110,113	0.5	Citic Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.875% 28Feb2027	美元 4,800,000	4,689,760	0.4
Ind & Comm Bk of China (Reg) (Reg S) VAR Perp 3.2%	美元 2,500,000	2,291,414	0.2	CMB International Leasin Ser EMTN (Reg S) 2.75% 12Aug2030	美元 7,600,000	5,874,474	0.4
Ind & Comm Bk of China (Reg) (Reg S) VAR Perp 3.58%	美元 2,200,000	2,096,497	0.2	CMB International Leasin Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2% 04Feb2026	美元 2,200,000	1,965,057	0.2
Kunming Rail Transit Grp (Reg) (Reg S) 3.5% 12Dec2022	美元 8,600,000	8,638,359	0.6	CNAC HK Finbridge Co Ltd (Reg) (Reg S) 3.875% 19Jun2029	美元 10,500,000	9,302,907	0.7
Shougang Group Co Ltd (Reg) (Reg S) 4% 23May2024	美元 16,000,000	15,929,171	1.2	CNAC HK Finbridge Co Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp GLP China Holdings Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.95% 29Mar2026	美元 17,800,000	17,484,201	1.3
哥伦比亚 (0.0%)				HBIS Group HK Co Ltd (Reg) (Reg S) 3.75% 18Dec2022	美元 7,000,000	7,057,709	0.5
Republic of Colombia (Reg) 4.375% 21Mar2023	哥伦比亚比索 500,000,000	107,057	0.0			6,960,235	0.5

投资组合 (续)

(续)

截至二零二二年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	占资产			单位数目	占资产		
		公平值 美元	净值百 分比			公平值 美元	净值百 分比	
香港 (续)								
Hongkong Intl Qingdao (Reg S) 3.9% 11Nov2022	美元 5,600,000	5,678,493	0.4	Adani Transmission Ltd Ser Regs (Reg) (Regs) 4% 03/08/2026	美元 9,400,000	8,565,298	0.6	
Hongkong Intl Qingdao (Reg) (Reg S) 4.25% 04Dec2022	美元 5,900,000	5,981,989	0.4	Bharat Petroleum Corp Ser Mtn (Regs) 4% 08May2025	美元 9,840,000	9,638,663	0.7	
ICBCIL Finance Co Ltd Ser Regs (Reg) (Regs) 3.625% 19May2026	美元 12,000,000	11,559,512	0.8	HDFC Bank Ltd Ser Regs (Reg S) Var Perp	美元 14,400,000	11,772,259	0.9	
Jinan URB Const Intl Inv (Reg) (Reg S) 2.4% 23Sep2026	美元 2,800,000	2,536,169	0.2	Indian Railway Finance Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.73% 29Mar2024	美元 1,000,000	978,051	0.1	
Lenovo Group Ltd Ser Regs (Reg S) 3.421% 02Nov2030	美元 7,700,000	5,936,124	0.4	Indian Railway Finance Ser Regs (Reg S) 3.249% 13Feb2030	美元 5,000,000	4,129,855	0.3	
Lenovo Group Ltd Ser Regs (Reg S) 5.831% 27Jan2028	美元 6,700,000	6,433,911	0.5	JSW Infrastructure Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.95% 21Jan2029	美元 5,700,000	4,489,833	0.3	
MCC Holding HK Corp Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 10,600,000	10,315,846	0.8	JSW Steel Ltd (Reg S) 5.95% 18Apr2024	美元 4,000,000	3,972,761	0.3	
MTR Corp Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 1.625% 19Aug2030	美元 7,600,000	6,058,126	0.5	JSW Steel Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.95% 05Apr2027	美元 11,700,000	9,572,087	0.7	
Xiaomi Best Time Intl Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.375% 29Apr2030	美元 15,900,000	12,174,805	0.9	NTPC Ltd Ser EMTN (Reg S) 3.75% 03Apr2024	美元 2,700,000	2,688,763	0.2	
Xiaomi Best Time Intl Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.1% 14Jul2051	美元 4,700,000	2,762,589	0.2	NTPC Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 4.5% 19Mar2028	美元 4,000,000	3,756,406	0.3	
				Oil India Ltd (Reg) (Reg S) 5.125% 04Feb2029	美元 3,250,000	3,077,330	0.2	
印度 (5.9%)								
Adani Ports and Special Ser Regs (Reg S) 3.375% 24Jul2024	美元 7,900,000	7,566,954	0.6	印度尼西亚 (11.9%)				
Adani Ports and Special Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.2% 04Aug2027	美元 10,000,000	8,834,040	0.6	Bank Negara Indonesia (Reg S) Var Perp	美元 15,500,000	12,470,077	0.9	
Adani Transmission Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.25% 21May2036 (Sink)	美元 1,700,000	1,225,300	0.1	Hutama Karya Persero PT Ser Regs (Reg S) 3.75% 11May2030	美元 12,500,000	11,265,017	0.8	
				Hyundai Motor Manu Indo Ser EMTN (Reg) (Reg S) 1.75% 06May2026	美元 6,900,000	6,029,045	0.4	

投资组合 (续)

(续)

截至二零二二年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	占资产			单位数目	占资产		
		公平值 美元	净值百 分比			公平值 美元	净值百 分比	
印度尼西亚 (续)								
Indonesia (Rep of) (Reg)				PT Pertamina (Persero)				
3.05% 12Mar2051	美元 4,600,000	3,031,978	0.2	Ser Regs (Reg S) 4.175%				
Indonesia (Rep of) (Reg)				21Jan2050	美元 25,000,000	17,707,751	1.3	
3.7% 30Oct2049	美元 5,000,000	3,684,142	0.3	PT Pertamina (Persero)				
Indonesia (Rep of) (Reg)				Ser Regs (Reg S) 4.7%				
4.3% 31Mar2052	美元 8,000,000	6,243,948	0.5	30Jul2049	美元 2,000,000	1,493,402	0.1	
Indonesia (Rep of) 3.5%								
14Feb2050	美元 10,000,000	7,005,915	0.5	泽西市 (0.3%)				
Indonesia (Rep of) 5.25%				West China Cement Ltd				
Ser Regs 17Jan2042	美元 3,800,000	3,465,139	0.3	(Reg) (Reg S) 4.95%				
Indonesia (Rep of) 5.45%				08Jul2026	美元 6,000,000	4,339,732	0.3	
20Sep2052	美元 1,000,000	929,635	0.1					
Indonesia (Rep of) Ser				韩国 (8.4%)				
Fr64 6.125Pct	印尼盾			Busan Bank Ser GMTN				
15/05/2028	503,000,000,000	32,156,143	2.4	(Reg) (Regs) 3.625%				
Indonesia (Rep of) Ser	印尼盾			25Jul2026	美元 16,200,000	14,989,566	1.1	
Fr90 5.125% 15Apr2027	120,000,000,000	7,577,818	0.6	GS Caltex Corp Ser Regs				
Indonesia (Rep of) Ser	印尼盾			(Reg) (Reg S) 4.5%				
Fr91 6.375% 15Apr2032	85,000,000,000	5,376,574	0.4	05Jan2026	美元 3,800,000	3,727,207	0.3	
Indonesia (Rep of) Ser				Hana Bank Ser Regs (Reg)				
Regs (Reg S) 3.55%				(Reg S) Var Perp	美元 4,700,000	4,248,321	0.3	
09Jun2051	美元 6,000,000	4,273,767	0.3	Hanwha Energy USA				
Indonesia Asahan Alumini				4.125% 05Jul2025	美元 4,000,000	3,945,331	0.3	
Ser Regs (Reg S) 4.75%				KB Kookmin Card Co Ltd				
15May2025	美元 8,400,000	8,360,851	0.6	(Reg) (Reg S) 4%				
Pertamina Persero Ser				09Jun2025	美元 5,500,000	5,403,257	0.4	
Regs (Reg) 6Pct				Kookmin Bank Ser GMTN				
03/05/2042	美元 6,400,000	5,764,693	0.4	(Reg) (Reg S) 4.5%				
Pertamina Persero Ser				01Feb2029	美元 9,900,000	9,357,203	0.7	
Regs 5.625% 20May2043	美元 7,000,000	6,035,573	0.5	Korea Expressway Corp				
PT Adaro Indonesia Ser				Ser Regs (Reg) (Reg S)				
Regs (Reg) (Reg S) 4.25%				3.625% 18May2025	美元 1,400,000	1,374,021	0.1	
31Oct2024	美元 10,000,000	9,713,064	0.7	Korea Hydro & Nuclear Po				
PT Bank Tabungan Negara				Ser Regs (Reg) (Reg S)				
(Reg) (Reg S) 4.2%				4.25% 27Jul2027	美元 5,000,000	4,835,688	0.3	
23Jan2025	美元 6,300,000	5,908,980	0.4	Korea Inv & Secs Co Ltd				
PT Pertamina (Persero)				(Reg) (Reg S) 2.125%				
Ser Regs (Reg S) 4.15%				19Jul2026	美元 14,000,000	12,315,212	0.9	
25Feb2060	美元 5,000,000	3,225,590	0.2					

投资组合 (续)

(续)

截至二零二二年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	占资产			单位数目	占资产	
		公平值 美元	净值百 分比			公平值 美元	净值百 分比
韩国 (续)				毛里求斯 (1.8%)			
Korea Midland Power Co (Reg) (Reg S) 3.625% 21Apr2027	美元 4,200,000	3,998,119	0.3	Greenko Mauritius Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.25% 21Feb2023	美元 3,500,000	3,480,556	0.3
Korea Water Resources (Reg) (Reg S) 3.5% 27Apr2025	美元 1,500,000	1,467,197	0.1	Greenko Power II Lt 4.3% 13Dec2028(Sink)	美元 2,000,000	1,567,226	0.1
Kyobo Life Insurance Co Ser Regs (Reg S) Var Perp	美元 5,300,000	5,259,573	0.4	Greenko Solar Mauritius Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.55% 29Jan2025	美元 3,300,000	2,980,918	0.2
Lotte Property & Develop (Reg S) 4.5% 01Aug2025	美元 2,500,000	2,470,080	0.2	Greenko Wind Projects Mu Ser Regs (Reg S) 5.5% 06Apr2025	美元 3,100,000	2,847,694	0.2
Posco Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.375% 04Aug2025	美元 5,200,000	5,064,322	0.4	India Green Energy Hldng Ser Regs (Reg S) 5.375% 29Apr2024	美元 5,000,000	4,807,560	0.4
Posco Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.5% 04Aug2027	美元 3,200,000	3,060,237	0.2	India Green Power Hol 4% 22Feb2027(Sink)	美元 10,150,000	8,183,015	0.6
Shinhan Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.375% 13Apr2032	美元 3,200,000	2,911,868	0.2	墨西哥 (1.2%)			
Shinhan Financial Group Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 05Feb2030	美元 11,200,000	10,572,246	0.8	Mexico (Utd States of) 7.75% 29May2031	墨西哥比索 700,000	3,177,743	0.2
Shinhan Financial Group Ser Regs (Reg)(Reg S) Var Perp	美元 8,000,000	6,907,605	0.5	Mexico (Utd States of) 8.5% 31May2029	墨西哥比索 2,800,000	13,504,984	1.0
Woori Bank Ser Regs (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 12,900,000	12,443,931	0.9	荷兰 (1.4%)			
马来西亚 (1.7%)				Greenko Dutch BV 3.85% 29Mar2026(Sink)	美元 6,100,000	4,737,960	0.3
Axiata Spv5 Labuan Ltd Ser EMTN (Reg S) 3.064% 19Aug2050	美元 5,000,000	3,271,853	0.2	Minejesa Capi BV Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.625% 10Aug2030 (Sink)	美元 16,000,000	13,384,833	1.0
GOHL Capital Ltd 4.25% 24Jan2027	美元 15,900,000	13,418,021	1.0	Minejesa Capital 5.625% 10Aug2037(Sink)	美元 2,000,000	1,448,688	0.1
TNB Global Ventures Cap (Reg S) 4.851% 01Nov2028	美元 7,100,000	6,984,653	0.5	菲律宾 (4.0%)			
				Globe Telecom Inc (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 6,800,000	6,127,863	0.4
				Megaworld Corp (Reg) (Reg S) 4.125% 30Jul2027	美元 14,400,000	13,664,010	1.0

投资组合 (续)

(续)

截至二零二二年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	占资产			单位数目	占资产	
		公平值 美元	净值百 分比			公平值 美元	净值百 分比
菲律宾 (续)							
Metropolitan Bank & Trus Ser EMTN (Reg S) 2.125% 15Jan2026	美元 1,300,000	1,184,910	0.1	Medco Oak Tree Pte Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 7.375% 14May2026	美元 1,700,000	1,530,418	0.1
PLDT Inc (Reg) (Reg S) 2.5% 23Jan2031	美元 3,600,000	2,969,000	0.2	Medco Platinum Road Pte Ser Regs (Reg) (Regs) 6.75% 30/01/2025	美元 11,800,000	10,828,370	0.8
Rizal Commercial Banking (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 15,500,000	14,329,221	1.1	Oversea-Chinese Banking Ser Regs (Reg S) Var 10Sep2030	美元 9,300,000	8,342,599	0.6
SMC Global Power Hldgs (Reg S) Var Perp	美元 7,300,000	6,861,392	0.5	Oversea-Chinese Banking (Reg S) Var 15Jun2032	美元 6,200,000	5,960,670	0.4
SMC Global Power Hldgs (Reg S) Var Perp	美元 1,100,000	986,954	0.1	United Overseas Bank Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 9,000,000	8,915,333	0.7
SMC Global Power Hldgs (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 8,500,000	7,871,944	0.6				
新加坡 (7.0%)							
Abja Investment Co (Reg) (Reg S) 5.45% 24Jan2028	美元 8,700,000	8,165,551	0.6	国际 (1.0%)			
BOC Aviation Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.25% 29Apr2025	美元 3,800,000	3,641,495	0.3	Corp Andina De Fomento Ser EMTN (Reg S) (Br) 6.77% 24May2028	哥伦比亚比索 23,000,000,000	3,953,501	0.3
Continuum Energy 4.5% 09Feb2027(Sinking)	美元 9,400,000	7,416,929	0.5	Intl Bk Recon & Develop Ser Gdif (Reg) 6.75% 04Feb2024	巴西雷亚尔 49,755,000	9,108,468	0.7
DBS Group Holdings Ltd Ser Gmtn (Reg) (Reg S) Var Perp	美元 9,000,000	8,275,020	0.6	泰国 (4.1%)			
GLP Pte Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.875% 04Jun2025	美元 17,100,000	14,566,990	1.1	Bangkok Bank PCL/HK Ser Regs (Reg S) Var Perp	美元 9,000,000	7,992,820	0.6
Indika Energy Capital IV Ser Regs (Reg) (Reg S) 8.25% 22Oct2025	美元 5,200,000	5,066,347	0.4	Kasikornbank PCL HK Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 02Oct2031	美元 13,100,000	11,581,188	0.8
LLPPL Capital Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.875% 04Feb2039 (Sink)	美元 13,800,000	9,621,436	0.7	Krung Thai Bank/Cayman (Reg S) Var Perp	美元 13,200,000	10,748,540	0.8
Medco Bell Pte Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.375% 30Jan2027	美元 3,500,000	2,850,974	0.2	Muang Thai Life Assuranc (Reg) (Reg S) Var 27Jan2037	美元 2,500,000	2,166,455	0.2
				Thailand (Govt of) 1% 17Jun2027	泰铢 335,000,000	8,281,624	0.6
				Thailand Government Bond 2.125% 17Dec2026	泰铢 300,000,000	7,880,653	0.6

投资组合 (续)

(续)

截至二零二二年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	占资产			单位数目	占资产		
		公平值 美元	净值百 分比			公平值 美元	净值百 分比	
泰国 (续)								
Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg S) 3.5% 17Oct2049	美元 6,000,000	3,569,954	0.3	Champion Path Holdings (Reg) (Reg S) 4.5% 27Jan2026	美元 200,000	139,809	0.0	
Thaioil Trsry Center Ser Regs (Reg S) 3.75% 18Jun2050	美元 5,700,000	3,472,141	0.2	Champion Path Holdings (Reg) (Reg S) 4.85% 27Jan2028	美元 300,000	196,895	0.0	
				Chinalco Capital Holding (Reg S) 2.125% 03Jun2026	美元 5,700,000	5,165,832	0.4	
美国 (1.1%)								
Freeport Indonesia PT Ser Regs (Reg) (Reg S) 5.315% 14Apr2032	美元 5,200,000	4,457,210	0.3	Chinalco Capital Holding (Reg) (Reg S) 2.95% 24Feb2027	美元 2,300,000	2,115,006	0.2	
US Treasury 0.125% 15Apr2027	美元 7,000,000	6,773,067	0.5	Chouzhou Intl Inv Ltd (Reg) (Reg S) 3.15% 11Aug2023	美元 5,100,000	5,033,389	0.4	
US Treasury 0.125% 15Feb2052	美元 1,350,000	909,994	0.1	CLP Power HK Financing Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.125% 30Jun2030	美元 10,100,000	8,184,611	0.6	
US Treasury 0.125% 15Jan2032	美元 3,500,000	3,235,737	0.2	CN Huaneng Gp HK Treasur (Reg) (Reg S) Var Perp 2.85%	美元 5,100,000	4,979,470	0.4	
维京群岛 (16.7%)								
Amipeace Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.25% 22Oct2030	美元 5,600,000	4,610,589	0.3	CN Huaneng Gp HK Treasur (Reg) (Reg S) Var Perp 3.08%	美元 4,900,000	4,637,763	0.3	
Beijing Capital Polaris Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.8% 18Mar2023	美元 8,900,000	8,798,550	0.6	CNPC Global Capital (Reg) (Reg S) 2% 23Jun2030	美元 19,600,000	16,239,324	1.2	
Bluestar Fin Holdings (Reg) (Reg S) Var Perp 美元 8,300,000	8,308,150	0.6	Dianjian Haiyu Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp 美元 6,400,000	6,052,952	0.4			
CAS Capital No1 Ltd (Reg) (Reg S) Var Perp 美元 17,200,000	13,996,978	1.0	ENN Clean Energy Ser Regs (Reg S) 3.375% 12May2026	美元 7,300,000	6,358,656	0.5		
Castle Peak Pwr Fin Co Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.125% 03Mar2031	美元 5,900,000	4,681,407	0.3	Franshion Brilliant Ltd (Reg) (Regs) Var Perp 美元 6,700,000	6,517,598	0.5		
Castle Peak Pwr Fin Co Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.2% 22Jun2030	美元 6,200,000	5,077,019	0.4	Haitian BVI Int Invst (Reg) (Reg S) 2.8% 04Nov2023	美元 6,400,000	6,305,589	0.5	
CCCI Treasure Ltd FRN Perp 3.425% 美元 6,000,000	5,737,833	0.4	Huarong Finance 2017 Co Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var Perp 美元 10,400,000	10,514,400	0.8			
CCCI Treasure Ltd FRN Perp 3.65% 美元 4,200,000	3,935,633	0.3						
Central Plaza Dev Ltd Ser EMTN (Reg S) Var Perp 美元 5,000,000	3,858,039	0.3						

投资组合 (续)

(续)

截至二零二二年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	占资产			单位数目	占资产	
		公平值 美元	净值百 分比			公平值 美元	净值百 分比
维京群岛 (续)							
Huarong Finance 2019 Ser EMTN (Reg S) 3.375% 24Feb2030	美元 1,800,000	1,182,994	0.1	Sinopec Grp Dev 2018 Ser Regs (Reg S) 2.7% 13May2030	美元 7,700,000	6,783,251	0.5
Huarong Finance 2019 Ser EMTN (Reg S) 3.875% 13Nov2029	美元 3,169,000	2,213,877	0.2	Studio City Finance Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 6% 15Jul2025	美元 5,500,000	3,145,080	0.2
Huarong Finance 2019 Ser EMTN (Regs) 4.5% 29May2029	美元 7,000,000	5,059,250	0.4	Sunny Express (Reg) (Reg S) 2.95% 01Mar2027	美元 2,900,000	2,693,840	0.2
Hysan MTN Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.875% 02Jun2027	美元 9,400,000	8,604,576	0.6	Talent Yield Intntnl (Reg) (Reg S) 3.125% 06May2031	美元 5,400,000	4,608,699	0.3
JIC Zhixin Ltd (Reg) (Regs) 3.5% 24Nov2027	美元 2,000,000	1,901,282	0.1			1,270,376,289	93.3
Minmetals Bounteous Fin (Reg) (Reg S) 4.2% 27Jul2026	美元 9,000,000	8,775,276	0.6			-----	-----
Minmetals Bounteous Fin (Reg) (Reg S) Var Perp 美元 5,200,000	5,006,274	0.4		(II) 衍生性产品 (-1.5%)			
New Metro Global Ltd (Reg) (Reg S) 4.5% 02May2026	美元 11,500,000	3,879,250	0.3	远期外汇合约 (-1.4%)		(19,281,021)	(1.4)
New Metro Global Ltd (Reg) (Reg S) 4.8% 15Dec2024	美元 7,200,000	3,330,960	0.2	期货 (0.1%)			
NWD MTN Ltd (Reg) (Reg S) 4.125% 18Jul2029	美元 16,400,000	13,451,109	1.0	Aust 10yr Bond Fut 12/22	363	37,444	0.0
RKPF Overseas 2019 A Ltd (Reg) (Reg S) 5.9% 05Mar2025	美元 2,000,000	860,022	0.1	US 10yr Note (CBT) 12/22	(255)	606,750	0.0
RKPF Overseas 2019 A Ltd (Reg) (Reg S) 6.7% 30Sep2024	美元 6,000,000	3,411,757	0.3	US 5yr Note (CBT) 12/22	(498)	1,937,531	0.1
RKPF Overseas 2020 A Ltd (Reg) (Reg S) 5.2% 12Jan2026	美元 9,100,000	3,338,640	0.2	US Ultra Bond (CBT) 12/22	261	(3,339,984)	(0.2)
SD Iron & Steel Xinheng (Reg) (Reg S) 4.8% 28Jul2024	美元 8,800,000	8,310,720	0.6			(20,039,280)	(1.5)
				总上市投资		1,250,337,009	91.8
				其他净资产		111,197,420	8.2
				截至二零二二年九月三十日可赎回份额持有人 应占净资产		1,361,534,429	100.0
				总投资, 按成本		1,462,710,816	

投资组合持有变动表

截至二零二二年九月三十日止年度 (未经审计)

	持有占资产净值 百分比	
	2022	2021
上市投资		
债务证券		
维京群岛	16.7	22.3
香港	12.9	11.9
印度尼西亚	11.9	9.7
韩国	8.4	3.9
开曼群岛	7.7	14.1
新加坡	7.0	6.2
印度	5.9	4.1
中国	5.7	7.2
泰国	4.1	2.6
菲律宾	4.0	2.7
毛里求斯	1.8	1.8
马来西亚	1.7	2.4
荷兰	1.4	1.7
墨西哥	1.2	1.8
美国	1.1	1.6
国际	1.0	1.3
百慕大	0.5	0.6
泽西市	0.3	0.2
哥伦比亚	0.0	0.0
巴基斯坦	-	0.6
斯里兰卡	-	0.5
蒙古	-	0.3
衍生性产品		
期货	(0.1)	0.1
远期外汇合约	(1.4)	(0.2)
总上市投资	<u>91.8</u>	<u>97.4</u>
其他净资产	<u>8.2</u>	<u>2.6</u>
截至九月三十日可赎回份额持有人应占净资产	<u><u>100.0</u></u>	<u><u>100.0</u></u>

金融衍生工具详情

截至二零二二年九月三十日 (未经审计)

(a) 远期外汇合约

截至二零二二年九月三十日，本基金持有之未平仓远期外汇合约，详情请参阅附注 11。

(b) 期货

截至二零二二年九月三十日，本基金持有之未平仓期货合约，详情请参阅附注 11。

金融衍生工具风险敞口信息

截至二零二二年九月三十日止年度 (未经审计)

截至二零二二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。

	2022 占资产净值百分比
最低总敞口	23.1
最高总敞口	188.3
平均总敞口	66.6

截至二零二二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。

	2022 占资产净值百分比
最低净敞口	5.0
最高净敞口	17.0
平均净敞口	10.4

[#]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。

抵押品持有情况

截至二零二二年九月三十日 (未经审计)

抵押品提供方	抵押品的性质	到期期限	计价货币	抵押品所涵盖资产净值	抵押品价值
				百分比	
Citibank N.A., 伦敦	现金	不适用	美元	0.3	4,447,035

现金抵押品再投资详情

截至二零二二年九月三十日止年度，未进行现金抵押品再投资。

托管/保管安排

现金抵押品的托管机构	收到/持有的抵押品金额	计划下提供的抵押品
	2022	所估比例
	美元	2022
		百分比
隔离账户		
香港上海汇丰银行有限公司	4,447,035	100.0

财务状况表

截至二零二二年九月三十日

综合收益表

截至二零二二年九月三十日止年度

	2022 美元	2021 美元		2022 美元	2021 美元
资产			收入		
流动资产			投资及衍生性产品净（亏损）		
银行现金	110,369,125	101,180,556	／收益 [附注 5]	(435,632,110)	167,913,769
现金抵押品	4,447,035	-	存款利息 [附注 8(i), 8(j)]	195,619	240,230
应收经纪款项	15,458,563	180,000	汇兑净亏损	(2,634,293)	(2,412,689)
分配应收款项	963,053	10,504,265	其他收入 [附注 8(i)]	42,676	1,177,135
保证金	6,532,965	1,329,609			
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 11]	7,031,407	10,612,400		(438,028,108)	166,918,445
投资 [附注 4(l)(a)]	1,270,376,289	2,668,285,291		-----	-----
利息及其他应收款项	57	3,516			
	-----	-----	支出		
总资产	1,415,178,494	2,792,095,637	管理费用 [附注 8(e)]	19,650,579	32,755,978
	-----	-----	受托人费用 [附注 8(g)]	510,976	835,686
负债			托管费用及银行费用		
流动负债			[附注 8(i), 8(j)]	475,309	745,812
应付经纪款项	4,447,035	-	基金注册登记机构费用		
赎回应付账款	14,152,564	27,404,073	[附注 8(h)]	270,491	478,388
应付收益分配 [附注 6]	6,315,937	11,544,210	交易成本 [附注 8(j)]	122,875	76,398
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 11]	27,070,687	14,745,926	核数师酬金	48,005	26,005
其他应付款项	1,657,842	2,897,805	法律及专业费用	24,137	58,390
	-----	-----	估值费用 [附注 8(e)]	17,220	17,150
总负债(不含可赎回份额持有人 应占净资产)	53,644,065	56,592,014	印刷及出版支出	7,656	31,748
	-----	-----	其他经营费用	23,715	28,660
				-----	-----
可赎回份额持有人应占净资产			净经营（亏损）／利润	(459,179,071)	131,864,230
[附注 3]	1,361,534,429	2,735,503,623		-----	-----
	=====	=====			
			财务成本		
由受托人及管理人于二零二三年一月二十日批准			收益分配 [附注 6]	(105,332,073)	(142,721,548)
签署人:			利息支出 [附注 8(j)]	(119)	(324)
				-----	-----
汇丰机构信托服务（亚洲）有限公司，受托人				(105,332,192)	(142,721,872)
				-----	-----
摩根基金（亚洲）有限公司，管理人					

第十五至五十六页之附注乃属本财务报表之一部分。

综合收益表 (续)

截至二零二二年九月三十日止年度

可赎回份额持有人应占净资产变动表

截至二零二二年九月三十日止年度

	2022 美元	2021 美元		2022 美元	2021 美元
除税前亏损	(564,511,263)	(10,857,642)	年初可赎回份额持有人应占		
税项 [附注 7]	(297,847)	(1,362,190)	净资产	2,735,503,623	3,098,404,429
可赎回份额持有人应占净资产			分配可赎回份额 [附注 3]	224,574,022	2,042,778,892
及总综合收益之减少	(564,809,110)	(12,219,832)	赎回可赎回份额 [附注 3]	(1,033,734,106)	(2,393,459,866)
			净赎回	(809,160,084)	(350,680,974)
				1,926,343,539	2,747,723,455
			可赎回份额持有人应占净资产		
			及总综合收益之减少	(564,809,110)	(12,219,832)
			年末可赎回份额持有人应占		
			净资产	1,361,534,429	2,735,503,623

现金流量表

(续)

截至二零二二年九月三十日止年度

	2022 美元	2021 美元		2022 美元	2021 美元
经营业务			现金及现金等价物之增加／		
购入投资及衍生性产品	(818,730,870)	(2,398,852,507)	(减少)	10,554,574	(67,122,675)
出售投资及衍生性产品所得 款项	1,786,081,988	2,866,864,121	年初现金及现金等价物	101,180,556	167,618,765
已收利息	199,135	241,852	现金及现金等价物之汇兑 (亏损)／收益	(1,366,005)	684,466
透支经纪款项之减少	-	(391,036)			
已付交易成本	(121,706)	(76,942)	年末现金及现金等价物	110,369,125	101,180,556
已付基金注册登记机构费用	(323,262)	(489,084)			
已付税项	(297,847)	(1,801,555)			
已付受托人费用	(540,321)	(840,324)	现金及现金等价物余额分析：		
现金抵押品之增加	(4,447,035)	-	银行现金	110,369,125	101,180,556
保证金之(增加)／减少	(5,203,356)	188,073			
已付管理费用	(20,847,282)	(32,960,859)			
其他	(1,784,024)	(2,617,309)			
经营业务所产生之现金净额	933,985,420	429,264,430			
融资活动					
已付利息	(119)	(324)			
分配可赎回份额所得款项	234,115,234	2,049,716,814			
赎回可赎回份额付款	(1,046,985,615)	(2,404,405,527)			
已付收益分配	(110,560,346)	(141,698,068)			
融资活动所运用之现金净额	(923,430,846)	(496,387,105)			

财务报表之附注

1 本基金

摩根亚洲总收益债券基金（“本基金”）根据二零零四年十一月三十日的信托契约（经修订）（“信托契约”）成立，受香港法律监管。本基金已获香港证券及期货事务监察委员会（“证监会”）认可。

本基金之投资目标为通过一个主要投资（即至少为资产净值总额的 70%）于亚洲债券及其他债务证券之主动管理组合，致力提供具竞争力的总回报（包括资本增长及定息收益）。

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计、判断和假设。

于二零二一年十月一日生效的新准则及对现有准则的修订

没有于二零二一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。

于二零二一年十月一日后生效且并未提早采纳之新准则、对准则的修订和解释

若干新准则、对准则的修订和解释在二零二一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。

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。

确认、取消确认及计量

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

公允价值估计

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

债务证券的公允价值按包括应计利息的报价计算。

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

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

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) 现金抵押品及保证金

本基金提供的现金抵押品在财务状况表中确认为现金抵押品或保证金，不计入现金及现金等价物。

(i) 应收／应付经纪款项

应收／应付经纪款项指就年末已签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。

(j) 销售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。认购／申购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。

(k) 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）

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	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目：					
年初	22,995,059.343	14,901,951.254	602,138.264	454,579,708.028	9,207,083.277
总分配	2,396,565.142	1,445,107.597	469,208.699	41,225,517.981	862,966.483
总赎回	(8,774,970.786)	(4,131,867.781)	(241,138.280)	(202,600,614.798)	(2,740,597.950)
年末	16,616,653.699	12,215,191.070	830,208.683	293,204,611.211	7,329,451.810
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占 净资产	106,130,688	78,934,141	5,603,013	2,038,454,890	46,587,636
可赎回份额持有人应占 净资产（每份额）	6.39	6.46	6.75	6.95	6.36

2022

	PRC 人民币对冲 份额 (累计) 份额	PRC 人民币对冲 份额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	58,099,327.490	61,388,435.190	30,905,933.500	3,245,234.020	1,082,326.570
总分配	8,478,940.780	2,157,303.280	426,859.490	91,361.750	18,294.357
总赎回	(27,802,104.730)	(14,350,365.970)	(18,333,156.640)	(966,349.740)	(151,591.873)
年末	38,776,163.540	49,195,372.500	12,999,636.350	2,370,246.030	949,029.054

	人民币	人民币	美元	美元	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	437,407,794	351,740,162	128,311,762	17,065,170	11,271,909
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	11.28	7.15	9.87	7.20	11.88

	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:			
年初	471,890,960.288	954,442.901	63,438,929.394
总分配	42,611,029.087	209,060.232	7,143,439.371
总赎回	(169,890,623.373)	(212,804.674)	(25,588,742.299)
年末	344,611,366.002	950,698.459	44,993,626.466
可赎回份额持有人应占净 资产	2,280,668,217	10,505,581	355,501,134
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	6.62	11.05	7.90

2021

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	23,139,739.418	15,637,072.647	510,399.441	422,240,159.913	10,763,076.055
总分配	16,206,340.663	7,595,503.923	518,643.141	354,182,209.391	4,088,819.913
总赎回	(16,351,020.738)	(8,330,625.316)	(426,904.318)	(321,842,661.276)	(5,644,812.691)
年末	22,995,059.343	14,901,951.254	602,138.264	454,579,708.028	9,207,083.277

	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净 资产	191,366,724	125,506,796	5,300,020	4,079,907,047	76,304,693
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	8.32	8.42	8.80	8.98	8.29

	PRC 人民币对冲 份额 (累计) 份额	PRC 人民币对冲 份额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	187,806,607.220	77,860,626.410	41,449,894.640	3,677,328.270	1,116,424.680
总分配	27,597,545.200	13,626,532.440	28,114,061.900	788,677.190	1,368,619.657
总赎回	(157,304,824.930)	(30,098,723.660)	(38,658,023.040)	(1,220,771.440)	(1,402,717.767)
年末	58,099,327.490	61,388,435.190	30,905,933.500	3,245,234.020	1,082,326.570

	人民币	人民币	美元	美元	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	791,153,106	571,858,247	374,577,855	30,423,683	15,519,544
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	13.62	9.32	12.12	9.37	14.34

2021

	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:			
年初	403,471,907.385	195,694.858	68,929,752.615
总分配	263,021,737.884	5,359,382.530	51,811,902.550
总赎回	(194,602,684.981)	(4,600,634.487)	(57,302,725.771)
年末	471,890,960.288	954,442.901	63,438,929.394

	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应占净 资产	4,067,566,571	12,949,102	652,534,891
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	8.62	13.57	10.29

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

本基金主要投资债务证券，此等债券须承担利率风险。利率风险请参阅附注 4(I)(a)(ii)。

(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。本基金须承担现行市场利率水平波动对其投资、衍生性产品及现金存款造成影响的风险。

下表按剩余到期日分类，概述截至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。

	1年以内 美元	1至5年 美元	5年以上 美元	总额 美元
<u>2022</u>				
银行现金	110,369,125	-	-	110,369,125
保证金	6,532,965	-	-	6,532,965
衍生性产品	2,581,725	-	-	2,581,725
投资 (注)	47,615,626	450,480,355	772,280,308	1,270,376,289
	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>
总利率敏感性缺口	167,099,441	450,480,355	772,280,308	1,389,860,104
	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>
<u>2021</u>				
银行现金	101,180,556	-	-	101,180,556
保证金	1,329,609	-	-	1,329,609
衍生性产品	1,253,358	-	-	1,253,358
投资 (注)	97,453,623	918,702,484	1,652,129,184	2,668,285,291
	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>
总利率敏感性缺口	201,217,146	918,702,484	1,652,129,184	2,772,048,814
	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>

注:

* 投资的票面息率范围介乎年率 0.00% - 8.50% (二零二一年: 年率 0.00% - 12.00%)。

截至九月三十日，本基金投资及衍生性产品之公平值如下：

	2022		2021	
	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				
<u>资产</u>				
债务证券				
- 维京群岛	228,002,349	16.7	609,886,103	22.3
- 香港	175,631,937	12.9	324,983,828	11.9
- 印度尼西亚	161,719,102	11.9	265,588,569	9.7
- 韩国	114,350,984	8.4	105,896,472	3.9
- 开曼群岛	104,856,261	7.7	385,558,758	14.1
- 新加坡	95,182,132	7.0	168,640,082	6.2
- 印度	80,267,600	5.9	113,291,939	4.1
- 中国	77,760,987	5.7	197,269,887	7.2
- 其他	232,604,937	17.1	497,169,653	18.1
	<u>1,270,376,289</u>	<u>93.3</u>	<u>2,668,285,291</u>	<u>97.5</u>
衍生性产品				
- 远期外汇合约	4,449,682	0.3	9,266,792	0.3
- 期货	2,581,725	0.1	1,345,608	0.1
	<u>1,277,407,696</u>	<u>93.7</u>	<u>2,678,897,691</u>	<u>97.9</u>

<u>负债</u>				
衍生性产品				
- 远期外汇合约	(23,730,703)	(1.7)	(14,653,676)	(0.5)
- 期货	(3,339,984)	(0.2)	(92,250)	(0.0)
	<u>(27,070,687)</u>	<u>(1.9)</u>	<u>(14,745,926)</u>	<u>(0.5)</u>

总上市投资	<u>1,250,337,009</u>	<u>91.8</u>	<u>2,664,151,765</u>	<u>97.4</u>
=====				

有关衍生性产品的风险亦请参阅附注 11。

投资管理主要通过本基金的修正久期定期监控本基金的利率风险敏感度。修正久期计量某项债券的价格相对于利率变动的敏感度。于二零二二年九月三十日，投资管理人估计本基金的修正久期为 4.41（二零二一年：4.21）。为了披露相关敏感度，采用的利率合理变动百分比为二十五个基点，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。若利率上升二十五个基点，其他变量保持稳定，则将致使本基金的资产净值减少约 15,010,917 美元（二零二一年：28,791,176 美元）。若利率下降二十五个基点，则将致使本基金的资产净值增加相同金额。

任何现金及现金等价物及保证金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(a)。

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*）	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
<u>2022</u>			
澳元	111,930,488	-11.0	(12,312,354)
巴西雷亚尔	1,208,844	+0.7	8,462
加元	58,060,229	-7.8	(4,528,698)
人民币（离岸）	392,460,747	-9.5	(37,283,771)
人民币（在岸）	(297,827)	-8.9	26,507
哥伦比亚比索	4,060,558	-17.0	(690,295)
欧元	3,490	-15.5	(541)
港元	(2,682,092)	-0.8	21,457
印度卢比	14,649,299	-8.8	(1,289,138)
印尼盾	12,041,362	-6.0	(722,482)
日元	608,813	-22.9	(139,418)
墨西哥比索	16,683,250	+2.2	367,032
纽元	33,331,764	-18.0	(5,999,718)
新加坡元	56,354,160	-5.4	(3,043,125)
英镑	6,384,180	-17.2	(1,098,079)
台币	(43,252,134)	-12.2	5,276,760
泰铢	4,930,879	-10.3	(507,881)
	<u>666,476,010</u>		<u>(61,915,282)</u>

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
<u>2021</u>			
澳元	145,620,669	+0.8	1,164,965
巴西雷亚尔	15,445,128	+3.4	525,134
加元	99,264,030	+5.4	5,360,258
人民币 (离岸)	759,550,871	+5.1	38,737,094
人民币 (在岸)	33,242,998	+5.4	1,795,122
哥伦比亚比索	12,134,613	+1.1	133,481
欧元	6,782,906	-1.2	(81,395)
港元	(1,361,823)	-0.4	5,447
印度卢比	48,030,722	-0.6	(288,184)
印尼盾	74,763,068	+4.0	2,990,523
日元	339,136	-5.4	(18,313)
韩元	54,786,403	-1.2	(657,437)
马来西亚林吉特	20,056,013	-0.7	(140,392)
墨西哥比索	30,410,449	+7.5	2,280,784
纽元	59,742,479	+4.4	2,628,669
新加坡元	(45,461,288)	+0.6	(272,768)
英镑	7,234,138	+4.3	311,068
台币	(27,098,326)	+4.0	(1,083,933)
泰铢	28,423,114	-6.3	(1,790,656)
	1,321,905,300		51,599,467

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，本基金在应收经纪款项、分配应收款项或利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。

截至二零二二年及二零二一年九月三十日，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。

本基金主要投资债务证券，因此，本基金须承担信贷风险，即发行机构可能无法于到期时偿还本金及利息。本基金通过参考信贷评级机构提供的信贷评级及信贷展望（如有）以及内部信贷分析，持续管理并监控债务证券之信贷风险。

下表概述截至九月三十日按照信贷评级的债务证券。

	2022 占资产净值百分比	2021 占资产净值百分比
标准普尔(AAA)/穆迪(Aaa)/惠誉(AAA)	1.5	2.3
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	3.4	1.7
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	17.4	13.7
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	48.2	39.1
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	12.7	22.2
标准普尔(B)/穆迪(B)/惠誉(B)	2.7	6.5
标准普尔(CCC)/穆迪(Caa)/惠誉(CCC)	-	0.8
未评级	7.4	11.2
	93.3	97.5
	93.3	97.5

截至九月三十日，按照发行机构的信贷评级，下表概述上述未评级债务证券。

	2022 占资产净值百分比	2021 占资产净值百分比
标准普尔(AAA)/穆迪(Aaa)/惠誉(AAA)	-	0.2
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	0.6	1.9
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	1.0	2.5
未评级	5.8	6.6
	7.4	11.2
	7.4	11.2

为监测无评级债务证券的信用质量，投资管理人将依据内部研究为没有公开信用评级的债务证券划定内部专有评级。投资管理人审查发行的关键财务指标和债务证券的结构特征，以计算每支债务证券的隐含评级。

下表概述本基金截至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。

	2022	2021
	交易对手风险承担	交易对手风险承担
	美元	美元
银行结余		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	2,678,977	7,859,392
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	107,690,148	93,321,164
托管机构的现金抵押		
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	4,447,035	-
存放经纪之保证金及经纪持有/发行的衍生性产品		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	1,325,706	1,471,889
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	12,238,666	10,470,120
托管机构的投资余额		
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	1,270,376,289	2,668,285,291

(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。

下表概述本基金的金融负债，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。

	2022		2021	
	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
应付经纪款项	4,447,035	-	-	-
赎回应付账款	14,152,564	-	27,404,073	-
应付收益分配	6,315,937	-	11,544,210	-
其他应付款项	1,657,842	-	2,897,805	-
衍生性产品	18,220,849	8,849,838	14,648,363	97,563
可赎回份额持有人应占净资产	1,361,534,429	-	2,735,503,623	-
总金融负债	1,406,328,656	8,849,838	2,791,998,074	97,563

投资管理通过投资于预期一般在一个月内在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) 受总抵销安排及类似协议规限的对销与金额

截至二零二二年及二零二一年九月三十日，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截至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	受总抵销安排及类似协议规限的 相关金额		净额 美元
		金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	
<u>2022</u>				
<u>资产</u>				
保证金	6,532,965	-	(6,362,145)	170,820
衍生性产品	7,029,897	(5,373,880)	-	1,656,017
按公允价值透过损益列账的金融资产	13,562,862	(5,373,880)	(6,362,145)	1,826,837
<u>负债</u>				
应付经纪款项	4,447,035	-	(3,038,986)	1,408,049
衍生性产品	27,070,687	(5,373,880)	(3,323,159)	18,373,648
按公允价值透过损益列账的金融负债	31,517,722	(5,373,880)	(6,362,145)	19,781,697

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）。

下表概述本基金截至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>2022</u>				
<u>资产</u>				
债务证券	-	1,270,376,289	-	1,270,376,289
衍生性产品	2,581,725	4,449,682	-	7,031,407
按公平值透过损益列账的总金融资产	2,581,725	1,274,825,971	-	1,277,407,696
<u>负债</u>				
衍生性产品	3,339,984	23,730,703	-	27,070,687
按公平值透过损益列账的总金融负债	3,339,984	23,730,703	-	27,070,687
<u>2021</u>				
<u>资产</u>				
债务证券	-	2,668,285,291	-	2,668,285,291
衍生性产品	1,345,608	9,266,792	-	10,612,400
按公平值透过损益列账的总金融资产	1,345,608	2,677,552,083	-	2,678,897,691
<u>负债</u>				
衍生性产品	92,250	14,653,676	-	14,745,926
按公平值透过损益列账的总金融负债	92,250	14,653,676	-	14,745,926

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。

截至二零二二年及二零二一年九月三十日止年度，公允价值层次之间并无转拨。

截至二零二二年及二零二一年九月三十日，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（亏损）／收益

	2022	2021
	美元	美元
投资及衍生性产品价值未实现收益／亏损之变动	(214,799,717)	(80,408,226)
投资及衍生性产品销售之实现（亏损）／收益	(220,832,393)	248,321,995
	<u>(435,632,110)</u>	<u>167,913,769</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（二零二一年：无）。

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2022 美元	2021 美元
澳元对冲类别（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	澳元 0.0345	22,444,233.000	(584,577)	
加元对冲类别（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	加元 0.0363	14,577,681.865	(429,016)	
英镑对冲类别（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	英镑 0.0373	563,583.628	(29,008)	
港元类别（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	港元 0.0383	431,457,900.786	(2,124,753)	
纽元对冲类别（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	纽元 0.0374	8,622,302.810	(232,584)	
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 0.0642	60,692,996.160	(609,880)	
PRC美元份额（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	美元 0.0401	3,173,472.370	(127,256)	
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 0.0594	453,675,880.473	(4,217,962)	
美元类别（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	美元 0.0440	60,714,753.551	(2,671,449)	
澳元对冲类别（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	澳元 0.0346	21,596,951.029	(531,746)	
加元对冲类别（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	加元 0.0363	14,553,196.984	(412,962)	
英镑对冲类别（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	英镑 0.0374	548,980.277	(27,299)	
港元类别（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	港元 0.0384	415,732,782.275	(2,046,789)	
纽元对冲类别（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	纽元 0.0387	8,522,899.413	(224,074)	
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 0.0598	59,654,964.700	(558,134)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2022 美元	2021 美元
PRC 美元份额 (每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	美元 0.0401	3,106,208.720	(124,559)	
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 0.0553	441,457,240.707	(3,819,480)	
美元类别 (每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	美元 0.0440	59,544,962.022	(2,619,978)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	澳元 0.0329	21,364,966.590	(509,854)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	加元 0.0341	14,545,308.039	(387,875)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	英镑 0.0341	553,190.646	(25,460)	
港元类别 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	港元 0.0385	404,177,462.896	(1,994,876)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	纽元 0.0385	8,452,210.383	(222,499)	
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 0.0603	58,768,476.490	(555,824)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	美元 0.0401	3,018,473.070	(121,041)	
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 0.0558	436,923,881.073	(3,823,979)	
美元类别 (每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	美元 0.0440	59,668,848.464	(2,625,429)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	澳元 0.0349	19,416,614.220	(473,975)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	加元 0.0362	13,809,138.185	(391,381)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	英镑 0.0379	566,562.649	(28,803)	
港元类别 (每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	港元 0.0384	390,843,133.008	(1,925,718)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	纽元 0.0387	8,280,191.144	(210,115)	
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 0.0557	57,048,155.580	(498,851)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2022 年 1 月 28 日	2022 年 2 月 11 日	美元 0.0401	2,860,901.890	(114,722)	
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 0.0516	420,787,408.000	(3,410,852)	
美元类别 (每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	美元 0.0440	57,714,699.365	(2,539,447)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	澳元 0.0348	19,002,025.971	(477,867)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	加元 0.0365	13,677,995.973	(391,889)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	英镑 0.0392	557,442.670	(29,320)	
港元类别 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	港元 0.0385	384,008,454.766	(1,893,254)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	纽元 0.0391	8,220,852.861	(216,599)	
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 0.0577	55,898,919.670	(511,152)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	美元 0.0401	2,823,707.350	(113,231)	
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 0.0533	412,963,391.796	(3,485,723)	
美元类别 (每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	美元 0.0440	57,148,612.792	(2,514,539)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	澳元 0.0329	18,831,553.726	(465,257)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	加元 0.0358	13,590,815.434	(389,537)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	英镑 0.0383	528,722.225	(26,662)	
港元类别 (每月派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	港元 0.0386	366,323,033.178	(1,805,561)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	纽元 0.0386	8,107,797.479	(217,680)	
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	54,861,225.740	(511,615)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	美元 0.0401	2,700,172.480	(108,277)	
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 0.0547	405,861,577.120	(3,497,208)	
美元类别 (每月派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	美元 0.0440	55,757,399.395	(2,453,326)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	澳元 0.0328	18,334,322.338	(427,360)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	加元 0.0372	13,218,768.629	(384,757)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	英镑 0.0388	812,453.733	(39,577)	
港元类别 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	港元 0.0387	357,362,061.111	(1,762,637)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	纽元 0.0388	7,960,047.297	(200,459)	
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 0.0571	54,026,201.600	(464,474)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2022	2021
					美元	美元
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	美元0.0401	2,649,589.850	(106,249)	
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0.0528	398,023,552.292	(3,164,196)	
美元类别 (每月派息)	2022年4月29日	2022年5月11日	美元0.0440	54,643,675.083	(2,404,319)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	澳元0.0321	17,581,193.061	(404,841)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	加元0.0369	12,786,462.715	(373,025)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	英镑0.0378	827,616.446	(39,427)	
港元类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	港元0.0387	338,952,473.101	(1,671,962)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	纽元0.0380	7,831,414.769	(193,719)	
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0.0548	53,388,083.890	(438,013)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	美元0.0401	2,600,777.540	(104,291)	
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0.0506	385,619,458.471	(2,921,272)	
美元类别 (每月派息)	2022年5月31日	2022年6月9日	美元0.0440	51,986,428.740	(2,287,400)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	澳元0.0330	16,916,498.784	(383,877)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	加元0.0366	12,743,518.081	(361,574)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	英镑0.0361	855,866.144	(37,522)	
港元类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	港元0.0387	326,338,556.287	(1,609,454)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	纽元0.0385	7,601,609.403	(181,962)	
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0.0471	53,083,592.580	(372,936)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	美元0.0401	2,513,957.880	(100,810)	
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0.0436	378,046,381.658	(2,458,581)	
美元类别 (每月派息)	2022年6月30日	2022年7月11日	美元0.0440	49,886,905.061	(2,195,022)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	澳元0.0335	17,216,504.087	(402,458)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	加元0.0364	12,633,967.177	(358,900)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	英镑0.0336	852,043.388	(34,838)	
港元类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	港元0.0387	311,276,231.545	(1,534,591)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	纽元0.0370	7,552,209.784	(175,218)	
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0.0406	51,524,394.810	(309,781)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	美元0.0401	2,438,450.950	(97,782)	
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0.0377	361,105,430.174	(2,016,005)	
美元类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	美元0.0440	47,422,641.186	(2,086,594)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	澳元0.0323	16,790,754.460	(371,802)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	加元0.0367	12,391,598.674	(347,260)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	英镑0.0330	844,017.328	(32,409)	
港元类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	港元0.0387	304,620,200.914	(1,501,978)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	纽元0.0367	7,474,795.268	(168,189)	
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0.0360	49,979,460.650	(261,006)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	美元0.0401	2,421,805.320	(97,114)	
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0.0333	356,394,024.534	(1,721,598)	
美元类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	美元0.0440	46,545,345.467	(2,047,993)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	澳元0.0325	16,616,653.699	(347,219)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	加元0.0376	12,215,191.070	(334,261)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	英镑0.0334	830,208.683	(30,954)	
港元类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	港元0.0387	293,632,252.167	(1,447,607)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	纽元0.0356	7,329,451.810	(147,594)	
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0.0373	49,226,694.710	(257,556)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2022	2021
					美元	美元
PRC 美元份额 (每月派息)	2022 年 9 月 30 日	2022 年 10 月 12 日	美元 0.0401	2,370,246.030	(95,047)	
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 0.0346	344,878,912.715	(1,673,805)	
美元类别 (每月派息)	2022 年 9 月 30 日	2022 年 10 月 12 日	美元 0.0440	45,043,039.744	(1,981,894)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2020 年 10 月 30 日	2020 年 11 月 9 日	澳元 0.0349	23,084,466.386		(564,356)
加元对冲类别 (每月派息)	2020 年 10 月 30 日	2020 年 11 月 9 日	加元 0.0353	16,151,109.143		(426,556)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020 年 10 月 30 日	2020 年 11 月 9 日	英镑 0.0363	516,526.972		(24,169)
港元类别 (每月派息)	2020 年 10 月 30 日	2020 年 11 月 9 日	港元 0.0382	440,467,908.960		(2,170,129)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020 年 10 月 30 日	2020 年 11 月 9 日	纽元 0.0355	10,788,959.064		(252,785)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020 年 10 月 30 日	2020 年 11 月 9 日	人民币 0.0630	77,925,800.540		(730,478)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020 年 10 月 30 日	2020 年 11 月 9 日	美元 0.0401	3,723,020.140		(149,293)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020 年 10 月 30 日	2020 年 11 月 9 日	人民币 0.0584	410,675,897.533		(3,568,597)
美元类别 (每月派息)	2020 年 10 月 30 日	2020 年 11 月 9 日	美元 0.0440	71,069,638.609		(3,127,064)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020 年 11 月 30 日	2020 年 12 月 8 日	澳元 0.0341	24,367,922.114		(614,734)
加元对冲类别 (每月派息)	2020 年 11 月 30 日	2020 年 12 月 8 日	加元 0.0351	16,153,143.936		(436,958)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020 年 11 月 30 日	2020 年 12 月 8 日	英镑 0.0361	570,102.852		(27,465)
港元类别 (每月派息)	2020 年 11 月 30 日	2020 年 12 月 8 日	港元 0.0382	471,232,405.452		(2,322,495)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020 年 11 月 30 日	2020 年 12 月 8 日	纽元 0.0353	10,632,017.284		(264,068)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020 年 11 月 30 日	2020 年 12 月 8 日	人民币 0.0609	76,715,140.290		(711,261)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020 年 11 月 30 日	2020 年 12 月 8 日	美元 0.0401	3,683,340.710		(147,702)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020 年 11 月 30 日	2020 年 12 月 8 日	人民币 0.0565	429,024,551.741		(3,690,295)
美元类别 (每月派息)	2020 年 11 月 30 日	2020 年 12 月 8 日	美元 0.0440	74,333,057.194		(3,270,655)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 11 日	澳元 0.0318	24,540,427.789		(599,726)
加元对冲类别 (每月派息)	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 11 日	加元 0.0335	16,198,172.444		(425,332)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 11 日	英镑 0.0328	611,338.068		(27,290)
港元类别 (每月派息)	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 11 日	港元 0.0382	471,963,350.121		(2,325,617)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 11 日	纽元 0.0343	10,523,473.158		(260,014)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 11 日	人民币 0.0612	74,058,810.000		(696,853)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 11 日	美元 0.0401	3,667,262.340		(147,057)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 11 日	人民币 0.0566	439,266,135.113		(3,822,583)
美元类别 (每月派息)	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 11 日	美元 0.0440	73,085,260.411		(3,215,572)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021 年 1 月 29 日	2021 年 2 月 8 日	澳元 0.0328	24,993,739.522		(628,742)
加元对冲类别 (每月派息)	2021 年 1 月 29 日	2021 年 2 月 8 日	加元 0.0342	16,130,109.173		(430,808)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021 年 1 月 29 日	2021 年 2 月 8 日	英镑 0.0346	730,981.397		(34,701)
港元类别 (每月派息)	2021 年 1 月 29 日	2021 年 2 月 8 日	港元 0.0383	505,446,087.819		(2,496,867)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021 年 1 月 29 日	2021 年 2 月 9 日	纽元 0.0341	10,641,472.357		(259,854)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021 年 1 月 29 日	2021 年 2 月 8 日	人民币 0.0584	74,475,661.540		(671,729)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021 年 1 月 29 日	2021 年 2 月 8 日	美元 0.0401	3,545,702.910		(142,183)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021 年 1 月 29 日	2021 年 2 月 8 日	人民币 0.0540	466,387,814.988		(3,889,626)
美元类别 (每月派息)	2021 年 1 月 29 日	2021 年 2 月 8 日	美元 0.0440	76,032,676.976		(3,345,438)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021 年 2 月 26 日	2021 年 3 月 8 日	澳元 0.0343	26,997,331.026		(736,871)
加元对冲类别 (每月派息)	2021 年 2 月 26 日	2021 年 3 月 8 日	加元 0.0355	16,517,482.812		(468,478)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021 年 2 月 26 日	2021 年 3 月 8 日	英镑 0.0365	755,143.127		(38,953)
港元类别 (每月派息)	2021 年 2 月 26 日	2021 年 3 月 8 日	港元 0.0382	521,363,238.548		(2,568,457)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021 年 2 月 26 日	2021 年 3 月 8 日	纽元 0.0356	11,045,285.746		(292,491)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021 年 2 月 26 日	2021 年 3 月 8 日	人民币 0.0601	73,590,179.970		(684,438)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2022	2021
					美元	美元
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	美元0.0401	3,618,474.700		(145,101)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	人民币0.0555	487,034,944.886		(4,183,048)
美元类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	美元0.0440	78,716,651.290		(3,463,533)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	澳元0.0343	26,649,326.974		(696,203)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	加元0.0353	16,505,216.408		(463,567)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	英镑0.0363	711,203.884		(35,619)
港元类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	港元0.0383	519,421,996.791		(2,558,877)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	纽元0.0358	11,128,895.344		(279,030)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	人民币0.0620	72,211,245.890		(682,360)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元0.0401	3,652,846.370		(146,479)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	人民币0.0573	495,182,226.693		(4,324,505)
美元类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元0.0440	76,797,893.233		(3,379,107)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	澳元0.0344	26,888,639.616		(718,377)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	加元0.0354	16,521,488.439		(475,729)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	英镑0.0367	713,761.836		(36,532)
港元类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	港元0.0383	518,433,226.606		(2,557,674)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	纽元0.0362	10,910,320.091		(285,828)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	人民币0.0629	71,542,249.850		(695,928)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	美元0.0401	3,567,525.480		(143,058)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	人民币0.0583	492,866,038.868		(4,443,737)
美元类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	美元0.0440	75,550,662.600		(3,324,229)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	澳元0.0345	25,751,909.625		(684,944)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	加元0.0358	16,236,013.634		(481,167)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	英镑0.0372	670,934.114		(35,388)
港元类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	港元0.0383	513,524,830.536		(2,534,046)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	纽元0.0364	10,260,289.675		(270,769)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	人民币0.0597	66,473,763.940		(623,143)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	美元0.0401	3,495,311.580		(140,162)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	人民币0.0552	492,053,202.963		(4,264,950)
美元类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	美元0.0440	73,986,797.766		(3,255,419)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	澳元0.0344	26,197,647.751		(677,206)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	加元0.0362	15,538,127.591		(453,979)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	英镑0.0372	693,444.677		(35,685)
港元类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	港元0.0383	495,368,306.895		(2,443,711)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	纽元0.0363	10,099,294.233		(256,366)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	人民币0.0581	62,995,495.440		(566,105)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	美元0.0401	3,466,483.660		(139,006)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	人民币0.0537	482,986,294.909		(4,011,626)
美元类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	美元0.0440	70,688,186.340		(3,110,280)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	澳元0.0343	25,450,495.822		(646,028)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	加元0.0361	15,210,453.189		(441,148)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	英镑0.0370	723,760.965		(37,425)
港元类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	港元0.0383	475,257,812.341		(2,342,120)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	纽元0.0361	10,122,426.302		(256,196)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	人民币0.0624	62,419,383.250		(603,231)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2022 美元	2021 美元
PRC 美元份额 (每月派息)	2021 年 7 月 30 日	2021 年 8 月 9 日	美元 0.0401	3,399,242.170		(136,310)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021 年 7 月 30 日	2021 年 8 月 9 日	人民币 0.0577	481,497,490.463		(4,302,780)
美元类别 (每月派息)	2021 年 7 月 30 日	2021 年 8 月 9 日	美元 0.0440	67,498,000.222		(2,969,912)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021 年 8 月 31 日	2021 年 9 月 8 日	澳元 0.0344	24,280,205.026		(609,599)
加元对冲类别 (每月派息)	2021 年 8 月 31 日	2021 年 9 月 8 日	加元 0.0363	15,530,647.585		(447,839)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021 年 8 月 31 日	2021 年 9 月 8 日	英镑 0.0370	607,556.909		(30,926)
港元类别 (每月派息)	2021 年 8 月 31 日	2021 年 9 月 8 日	港元 0.0384	467,579,076.241		(2,306,022)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021 年 8 月 31 日	2021 年 9 月 8 日	纽元 0.0364	9,724,544.514		(248,065)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021 年 8 月 31 日	2021 年 9 月 8 日	人民币 0.0640	61,636,603.970		(610,396)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021 年 8 月 31 日	2021 年 9 月 8 日	美元 0.0401	3,274,064.690		(131,290)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021 年 8 月 31 日	2021 年 9 月 8 日	人民币 0.0592	479,794,426.121		(4,395,109)
美元类别 (每月派息)	2021 年 8 月 31 日	2021 年 9 月 8 日	美元 0.0440	66,626,117.029		(2,931,549)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021 年 9 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	澳元 0.0343	23,030,574.588		(570,619)
加元对冲类别 (每月派息)	2021 年 9 月 30 日	2021 年 10 月 12 日	加元 0.0364	14,901,951.254		(428,173)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021 年 9 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	英镑 0.0371	605,528.264		(30,291)
港元类别 (每月派息)	2021 年 9 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	港元 0.0384	454,206,931.236		(2,240,505)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021 年 9 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	纽元 0.0356	9,207,083.277		(226,114)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021 年 9 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	人民币 0.0663	61,388,199.980		(630,622)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021 年 9 月 30 日	2021 年 10 月 12 日	美元 0.0401	3,257,234.020		(130,615)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021 年 9 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	人民币 0.0613	473,440,969.334		(4,496,736)
美元类别 (每月派息)	2021 年 9 月 30 日	2021 年 10 月 12 日	美元 0.0440	63,421,254.299		(2,790,535)
可赎回份额持有人之总收益分配					(105,332,073)	(142,721,548)

7 税项

截至二零二二年及二零二一年九月三十日止年度，已就若干收到的利息收入和所得的资本收益预扣或缴付海外税项。

中国税项

本基金持有若干中国证券之投资。根据中华人民共和国税法，海外投资者从中国获得的股息和利息应缴付百分之十的企业所得税，但政府债券利息根据规定获豁免缴纳所得税，而海外机构投资者于二零一八年十一月七日至二零二五年十二月三十一日期间从中国本地债券市场中买卖债券所得的债券利息亦暂时获豁免缴纳所得税。在中国支付相关款项的单位有责任在支付该等款项时预扣此税项。若源自中国的股息和利息未获得特别税项豁免且支付单位未预扣税项，则全额计提百分之十的中国税项拨备。

根据中华人民共和国税法，海外投资者出售中国证券所实现的收益通常需缴纳百分之十的企业所得税。但目前，出售中国 A 股（包括在沪港通深港通机制下买卖的股份）所得收益获暂时豁免缴纳企业所得税。若出售部分中国证券所得收益目前未经明确认定获豁免缴纳企业所得税，则全额计提百分之十的中国税项拨备。

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。

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) 以下为与受托人、管理人及其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	占本基金			
		本年度之 总交易价值 百分比	本年度支付之 支付佣金 美元	本年度支付之 总佣金 百分比	平均佣金率 百分比	
<u>2022</u>						
汇丰银行（中国）有限公司	63,768,122	0.82	-	-	-	
香港上海汇丰银行有限公司	192,935,610	2.47	-	-	-	
<u>2021</u>						
汇丰银行（中国）有限公司	212,042,979	2.41	-	-	-	
HSBC Securities & Capital Markets (India) Private Limited	97,344,318	1.11	-	-	-	
香港上海汇丰银行有限公司	608,409,112	6.91	-	-	-	

(b) 与管理人及其关联人士之年末结余：

	2022 美元	2021 美元
银行现金	2,678,977	7,859,392
应收款项	-	3,516
应付款项	(1,244,130)	(2,484,539)
	<u> </u>	<u> </u>

(c) 截至二零二二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 7,404,412 美元（二零二一年：实现收益 19,676,042 美元）。

(d) 截至二零二二年九月三十日止年度，扣除支付给代理机构的佣金后，管理人取得本基金销售及赎回收益为 862 美元（二零二一年：4,592 美元）。

(e) 支付给摩根基金（亚洲）有限公司之管理费按本基金资产净值的年率百分之一计算。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>2022</u>					
<u>摩根资产管理（亚太）有限公司</u>					
- 美元类别（累计）	34,940.962	8,569.255	(18,772.503)	24,737.714	6,851
<u>JPMorgan Asset Management</u>					
<u>(S) Limited</u>					
- 美元类别（累计）	223.693	-	(111.847)	111.846	-
<u>2021</u>					
<u>摩根资产管理（亚太）有限公司</u>					
- 美元类别（累计）	38,517.346	7,935.647	(11,512.031)	34,940.962	18,371
<u>JPMorgan Asset Management</u>					
<u>(S) Limited</u>					
- 美元类别（累计）	223.693	-	-	223.693	-

- (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比率为本基金资产净值的年率介乎百分之零点零一五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) 截至二零二二年及二零二一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额列示如下：

	2022	2021
	美元	美元
其他收入	-	1,122,735
存款利息	14,134	67,803
托管费用及银行费用	(41,701)	(19,692)
	<u> </u>	<u> </u>

- (j) 截至二零二二年及二零二一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额列示如下：

	2022	2021
	美元	美元
存款利息	13,016	33,866
利息支出	(119)	(324)
交易成本	(15,181)	(13,907)
托管费用及银行费用	(343,254)	(579,766)
	<u> </u>	<u> </u>

9 借款

截至二零二二年及二零二一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

截至二零二二年及二零二一年九月三十日止年度，投资管理人士及其关联人士未有就本基金通过经纪或交易商指示交易而签订任何非金钱收益／佣金共享安排。

11 衍生性产品

- (a) 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
<u>2022</u>				
未平仓合约：				
纽元 20,416	美元 11,766	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	217
美元 23,664	英镑 21,960	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	850

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 2,408	美元 1,564	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	15
纽元 21,294	美元 12,059	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	13
美元 50,214	英镑 46,724	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	1,946
美元 39,537	离岸人民币 284,004	2022 年 10 月 11 日	法国巴黎银行	306
美元 1,096	离岸人民币 7,903	2022 年 10 月 11 日	法国巴黎银行	13
离岸人民币 134,699	美元 18,914	2022 年 10 月 13 日	法国巴黎银行	16
离岸人民币 8,032	美元 1,128	2022 年 10 月 13 日	法国巴黎银行	1
美元 1,105	离岸人民币 7,878	2022 年 10 月 13 日	法国巴黎银行	0
美元 1,099	离岸人民币 7,835	2022 年 10 月 13 日	法国巴黎银行	0
澳元 687,427	美元 466,106	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	24,027
澳元 464,062	美元 316,018	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	17,583
澳元 419,357	美元 282,413	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	12,728
澳元 644,211	美元 424,208	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	9,921
澳元 282,138	美元 190,513	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	9,073
澳元 09,072	美元 205,771	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	7,010
澳元 175,584	美元 119,390	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	6,473
澳元 148,195	美元 101,420	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	6,116
澳元 189,751	美元 128,123	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	6,096
澳元 196,952	美元 131,890	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	5,232
澳元 968,564	美元 627,681	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	4,805
澳元 463,337	美元 301,194	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	3,226
澳元 86,262	美元 58,025	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,551
澳元 282,113	美元 183,199	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,774
澳元 47,816	美元 32,040	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,290
澳元 208,657	美元 135,166	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	980
澳元 19,553	美元 13,400	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	825
澳元 134,655	美元 87,210	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	614
澳元 26,069	美元 17,291	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	526
澳元 12,953	美元 8,629	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	299
澳元 10,218	美元 6,858	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	286
澳元 37,928	美元 24,567	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	176
澳元 53,455	美元 34,545	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	169
澳元 1,602	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	69
澳元 1,602	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	69
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
加元 1,147,170	美元 870,279	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	35,443
加元 517,705	美元 393,049	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	16,298
加元 338,149	美元 257,277	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	11,194
加元 310,522	美元 235,838	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	9,861
加元 480,530	美元 355,190	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	5,492
加元 149,674	美元 113,717	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,794
加元 237,269	美元 176,625	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	3,956
加元 137,836	美元 103,307	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	2,998
加元 339,818	美元 248,693	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1,396
加元 721,654	美元 526,251	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1,078
加元 35,414	美元 26,666	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	894
加元 25,998	美元 19,709	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	790
加元 17,213	美元 13,154	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	627
加元 28,118	美元 20,839	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	376
加元 147,914	美元 107,854	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	212
加元 65,117	美元 47,578	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	190
加元 4,890	美元 3,723	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	165
加元 2,573	美元 1,948	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	76
加元 2,956	美元 2,207	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	56
加元 1,441	美元 1,100	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	51
加元 1,441	美元 1,100	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	51
加元 1,450	美元 1,104	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	49

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
加元 62,866	美元 45,798	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	48
加元 1,439	美元 1,095	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	48
离岸人民币 15,848,199	美元 2,296,512	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	72,876
离岸人民币 11,408,853	美元 1,651,697	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	50,938
离岸人民币 9,919,190	美元 1,434,397	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	42,651
离岸人民币 9,255,215	美元 1,324,380	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	25,795
离岸人民币 5,222,174	美元 753,306	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	20,591
离岸人民币 4,179,376	美元 604,759	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	18,358
离岸人民币 5,637,187	美元 809,271	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	18,326
离岸人民币 6,111,444	美元 874,622	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	17,134
离岸人民币 10,994,311	美元 1,557,194	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	14,599
离岸人民币 3,475,150	美元 500,664	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	13,071
离岸人民币 2,227,614	美元 322,509	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	9,956
离岸人民币 1,729,247	美元 250,968	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	8,340
离岸人民币 1,794,938	美元 260,108	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	8,263
离岸人民币 2,973,107	美元 424,069	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	6,917
离岸人民币 2,085,320	美元 299,496	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	6,908
离岸人民币 1,506,893	美元 218,165	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	6,735
离岸人民币 1,964,552	美元 282,079	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	6,435
离岸人民币 2,891,703	美元 412,104	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	6,374
离岸人民币 2,285,720	美元 326,149	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	5,444
离岸人民币 1,828,629	美元 261,952	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	5,380
离岸人民币 1,594,458	美元 228,725	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	5,009
离岸人民币 1,007,255	美元 145,751	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4,424
离岸人民币 1,407,600	美元 201,639	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	4,141
离岸人民币 4,376,552	美元 618,072	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4,005
离岸人民币 782,267	美元 113,532	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,773
离岸人民币 1,221,740	美元 175,122	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	3,701
离岸人民币 966,917	美元 139,304	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,637
离岸人民币 1,121,435	美元 160,771	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,424
离岸人民币 1,408,679	美元 200,482	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,832
离岸人民币 934,238	美元 133,912	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	2,830
离岸人民币 4,494,623	美元 633,345	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	2,711
离岸人民币 1,051,751	美元 150,074	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,505
离岸人民币 24,423,386	美元 3,429,224	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,416
离岸人民币 1,082,934	美元 154,332	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	2,387
离岸人民币 514,764	美元 74,487	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,261
离岸人民币 730,251	美元 104,690	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,230
离岸人民币 461,888	美元 66,942	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	2,135
离岸人民币 2,192,795	美元 309,748	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,080
离岸人民币 648,064	美元 92,965	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,036
离岸人民币 584,185	美元 83,750	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,784
离岸人民币 1,344,320	美元 190,384	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,765
离岸人民币 1,672,275	美元 236,221	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,586
离岸人民币 730,381	美元 103,947	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,469
离岸人民币 433,725	美元 62,292	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,437
离岸人民币 320,088	美元 46,173	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,262
离岸人民币 326,595	美元 47,052	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,228
离岸人民币 369,723	美元 53,086	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,211
离岸人民币 13,926,130	美元 1,955,137	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,183
离岸人民币 9,022,115	美元 1,266,799	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	920
离岸人民币 372,844	美元 53,201	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	888
离岸人民币 2,783,311	美元 391,392	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	870
离岸人民币 261,550	美元 37,548	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	850
离岸人民币 226,207	美元 32,480	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	741
离岸人民币 2,130,603	美元 299,607	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	666
离岸人民币 193,570	美元 27,789	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	629
离岸人民币 370,099	美元 52,414	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	486

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 506,377	美元 71,512	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	463
离岸人民币 343,759	美元 48,683	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	451
离岸人民币 74,927	美元 10,874	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	361
离岸人民币 136,258	美元 19,435	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	317
离岸人民币 56,258	美元 8,135	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	242
离岸人民币 48,208	美元 6,987	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	223
离岸人民币 41,558	美元 5,947	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	116
离岸人民币 28,708	美元 4,141	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	113
离岸人民币 29,506	美元 4,223	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	83
离岸人民币 23,035	美元 3,279	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	47
离岸人民币 33,649	美元 4,766	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	45
离岸人民币 21,959	美元 3,125	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	44
离岸人民币 14,005	美元 2,009	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	44
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 7,663	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 7,594	美元 1,094	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	29
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 7,672	美元 1,102	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 7,637	美元 1,097	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	25
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 7,713	美元 1,101	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	18
离岸人民币 141,685	美元 19,894	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	15
离岸人民币 21,937	美元 3,091	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	13
离岸人民币 67,523	美元 9,480	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	6
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
英镑 37,309	美元 43,237	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,572
英镑 35,398	美元 40,869	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,337
英镑 24,604	美元 28,352	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	874
英镑 15,798	美元 18,399	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	757
英镑 21,410	美元 24,611	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	700
英镑 17,431	美元 20,067	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	601
英镑 18,331	美元 21,036	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	564
英镑 23,698	美元 26,868	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	403
英镑 34,116	美元 38,245	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	145
英镑 2,500	美元 2,853	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	61
英镑 959	美元 1,103	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	32
纽元 398,874	美元 244,680	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	19,043
纽元 327,087	美元 198,370	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	13,341
纽元 205,642	美元 125,455	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	9,126
纽元 183,222	美元 110,506	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	6,860
纽元 284,531	美元 165,054	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	4,098
纽元 87,997	美元 52,861	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3,082
纽元 115,181	美元 67,943	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	2,787
纽元 110,694	美元 65,395	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,776
纽元 60,009	美元 36,428	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,482
纽元 52,272	美元 32,043	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,474
纽元 110,559	美元 64,938	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	2,396
纽元 60,891	美元 36,034	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	1,589
纽元 301,163	美元 171,889	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,526
纽元 422,288	美元 240,392	2022 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	1,510
纽元 46,350	美元 27,716	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,496
纽元 204,272	美元 116,815	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,261
纽元 68,389	美元 39,920	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,233
纽元 29,712	美元 17,553	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	745
纽元 90,441	美元 51,518	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	357

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 5,658	美元 3,412	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	211
纽元 3,586	美元 2,184	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	156
纽元 1,795	美元 1,100	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	85
纽元 1,824	美元 1,103	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	71
纽元 1,806	美元 1,092	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	71
纽元 1,788	美元 1,078	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	66
纽元 1,909	美元 1,090	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	10
纽元 1,943	美元 1,100	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1
美元 29,638	英镑 27,457	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,025
美元 22,204	离岸人民币 160,051	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	253
美元 21,110	离岸人民币 151,596	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	160
美元 39,701	离岸人民币 284,004	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	147
美元 28,453	离岸人民币 203,542	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	105
美元 15,696	离岸人民币 112,116	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	35
美元 1,735	离岸人民币 12,504	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	20
美元 5,788	离岸人民币 41,344	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	13
美元 4,451	离岸人民币 31,794	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	10
美元 1,295	离岸人民币 9,252	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3
印尼盾 460,000,000,000	美元 31,115,530	2022 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	928,652
离岸人民币 1,401,608	美元 197,631	2022 年 11 月 21 日	美国道富银行	856
离岸人民币 1,088,142	美元 153,432	2022 年 11 月 21 日	美国道富银行	664
美元 15,740	离岸人民币 112,141	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	4
巴西雷亚尔 43,748,333	美元 8,072,214	2023 年 1 月 13 日	高盛国际, 伦敦	172,590
			澳大利亚和新西兰银行集团	
离岸人民币 286,700,000	美元 40,980,519	2023 年 1 月 13 日	有限公司	663,581
印尼盾 175,000,000,000	美元 11,582,730	2023 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	129,913
印尼盾 54,000,000,000	美元 3,548,896	2023 年 1 月 13 日	渣打银行, 伦敦	14,884
印度卢比 575,000,000	美元 7,124,069	2023 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	122,118
林吉特 22,000,000	美元 4,864,028	2023 年 1 月 13 日	渣打银行, 伦敦	92,047
			澳大利亚和新西兰银行集团	
新加坡元 17,000,000	美元 12,004,548	2023 年 1 月 13 日	有限公司	136,106
			澳大利亚和新西兰银行集团	
新加坡元 10,000,000	美元 6,987,476	2023 年 1 月 13 日	有限公司	6,039
台币 1,142,000,000	美元 36,538,271	2023 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	245,886
美元 7,494,276	台币 236,000,000	2023 年 1 月 13 日	渣打银行, 伦敦	5,726
美元 6,937,007	印度卢比 570,000,000	2023 年 1 月 13 日	高盛国际, 伦敦	4,057
林吉特 68,000,000	美元 15,389,838	2023 年 2 月 13 日	渣打银行, 伦敦	611,371
印尼盾 500,000,000,000	美元 33,138,918	2023 年 5 月 31 日	渣打银行, 伦敦	560,519
			未实现总收益	4,449,682
英镑 27,457	美元 29,631	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	(1,020)
美元 1,090	纽元 1,909	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	(10)
美元 1,100	纽元 1,943	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(1)
美元 45,800	加元 62,866	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(47)
美元 34,540	澳元 53,455	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(170)
美元 24,563	澳元 37,928	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(177)
美元 47,581	加元 65,117	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(191)
美元 87,199	澳元 134,655	2022 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	(619)
离岸人民币 203,542	美元 28,448	2022 年 10 月 11 日	法国巴黎银行	(107)
离岸人民币 284,004	美元 39,694	2022 年 10 月 11 日	法国巴黎银行	(149)
离岸人民币 151,596	美元 21,104	2022 年 10 月 11 日	法国巴黎银行	(163)
离岸人民币 12,504	美元 1,734	2022 年 10 月 12 日	法国巴黎银行	(20)
离岸人民币 160,051	美元 22,200	2022 年 10 月 12 日	法国巴黎银行	(254)
美元 1,114	离岸人民币 7,932	2022 年 10 月 12 日	法国巴黎银行	(1)
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 112,141	美元 15,731	2022 年 10 月 14 日	法国巴黎银行	(2)

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 727,247	美元 463,081	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(4,606)
加元 537,820	美元 388,903	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(2,487)
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 7,903	美元 1,096	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(13)
离岸人民币 41,533	美元 5,804	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(23)
离岸人民币 101,031	美元 14,093	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(83)
离岸人民币 467,459	美元 65,443	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(145)
离岸人民币 501,792	美元 70,250	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(156)
离岸人民币 308,114	美元 43,071	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(160)
离岸人民币 76,618	美元 10,545	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(205)
离岸人民币 146,973	美元 20,389	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(232)
离岸人民币 169,923	美元 23,573	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(269)
离岸人民币 284,004	美元 39,547	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(301)
离岸人民币 316,871	美元 44,124	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(336)
离岸人民币 649,891	美元 90,848	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(337)
离岸人民币 881,994	美元 123,294	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(458)
离岸人民币 520,094	美元 72,423	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(551)
离岸人民币 688,257	美元 95,605	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	(964)
离岸人民币 1,523,337	美元 212,550	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,187)
离岸人民币 889,322	美元 123,534	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1,245)
离岸人民币 1,982,448	美元 276,610	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,545)
离岸人民币 3,175,687	美元 443,935	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,641)
离岸人民币 4,149,280	美元 580,035	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,144)
离岸人民币 2,401,171	美元 331,543	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	(5,362)
离岸人民币 9,952,898	美元 1,390,891	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(5,585)
离岸人民币 3,133,491	美元 432,658	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	(6,997)
离岸人民币 7,251,688	美元 1,009,789	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(7,684)
离岸人民币 8,412,002	美元 1,166,974	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(13,301)
离岸人民币 20,793,213	美元 2,900,435	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(17,028)
离岸人民币 15,760,863	美元 2,169,269	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(42,113)
英镑 11,022	美元 12,193	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(116)
英镑 24,890	美元 27,074	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(722)
英镑 21,960	美元 23,671	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(853)
英镑 38,361	美元 41,044	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,797)
英镑 51,913	美元 56,053	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,922)
英镑 46,724	美元 50,218	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,962)
纽元 322,387	美元 179,761	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(2,609)
美元 1,404	离岸人民币 10,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1)
美元 1,128	离岸人民币 8,032	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1)
美元 1,567	纽元 2,767	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2)
美元 1,666	澳元 2,578	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(8)
美元 417	离岸人民币 2,910	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(9)
美元 539	离岸人民币 3,753	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(12)
美元 12,060	纽元 21,294	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(14)
美元 1,564	澳元 2,408	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(15)
美元 18,916	离岸人民币 134,699	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(17)
美元 1,190	离岸人民币 8,365	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(17)
美元 1,262	离岸人民币 8,847	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(21)
美元 1,490	离岸人民币 10,445	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(24)
美元 1,223	离岸人民币 8,525	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(27)
美元 1,434	离岸人民币 10,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(31)
美元 2,369	离岸人民币 16,623	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(37)
美元 3,195	离岸人民币 22,415	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(49)
美元 1,792	离岸人民币 12,381	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(55)
美元 1,740	离岸人民币 12,008	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(55)
美元 2,769	离岸人民币 19,287	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(63)
美元 3,019	离岸人民币 21,060	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(64)
美元 2,478	英镑 2,156	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(71)
美元 5,896	离岸人民币 41,427	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(83)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 3,178	离岸人民币 22,034	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(87)
美元 2,888	英镑 2,500	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(97)
美元 1,807	纽元 2,986	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(117)
美元 4,348	离岸人民币 30,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(138)
美元 1,839	纽元 3,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(142)
美元 4,644	离岸人民币 32,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(155)
美元 18,711	离岸人民币 132,120	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(174)
美元 3,870	加元 5,065	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(185)
美元 30,497	离岸人民币 215,949	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(198)
美元 11,766	纽元 20,416	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(216)
美元 15,440	离岸人民币 108,488	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(218)
美元 23,763	离岸人民币 167,793	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(221)
美元 14,270	离岸人民币 100,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(239)
美元 15,060	离岸人民币 105,537	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(252)
美元 6,994	澳元 10,436	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(282)
美元 14,722	离岸人民币 102,547	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(334)
美元 16,255	离岸人民币 113,312	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(356)
美元 6,800	澳元 10,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(369)
美元 14,765	离岸人民币 102,030	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(449)
美元 29,357	离岸人民币 205,993	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(455)
美元 14,292	离岸人民币 98,474	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(476)
美元 21,154	离岸人民币 147,329	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(483)
美元 15,529	离岸人民币 107,153	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(494)
美元 10,785	英镑 9,202	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(508)
美元 9,090	纽元 15,033	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(586)
美元 25,800	离岸人民币 179,635	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(595)
美元 17,580	纽元 29,712	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(773)
美元 39,829	离岸人民币 277,813	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(849)
美元 19,847	澳元 29,437	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(916)
美元 17,936	澳元 26,431	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(939)
美元 39,335	离岸人民币 273,022	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,028)
美元 34,821	离岸人民币 240,626	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,060)
美元 67,661	离岸人民币 469,042	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,851)
美元 89,316	离岸人民币 621,874	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,061)
美元 129,624	离岸人民币 908,700	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,125)
美元 87,831	离岸人民币 608,858	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,403)
美元 121,074	离岸人民币 844,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,654)
美元 97,784	离岸人民币 677,411	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(2,738)
美元 44,711	纽元 73,946	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(2,881)
美元 143,298	离岸人民币 998,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3,270)
美元 128,294	离岸人民币 888,770	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(3,592)
美元 125,407	离岸人民币 866,602	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3,816)
美元 149,919	加元 200,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,372)
美元 56,462	纽元 92,037	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,398)
美元 98,681	加元 129,475	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4,457)
美元 128,148	澳元 185,475	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(8,870)
美元 660,135	离岸人民币 4,576,692	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(17,986)
美元 1,690,150	离岸人民币 11,799,211	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(34,621)
美元 6,957,983	英镑 6,041,190	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(211,369)
美元 54,116,509	离岸人民币 377,796,006	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,108,533)
美元 70,200,387	离岸人民币 490,080,133	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,437,998)
美元 30,326,430	纽元 50,343,113	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,848,035)
美元 64,290,685	加元 84,815,885	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(2,567,216)
美元 76,383,210	澳元 113,572,251	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(3,345,804)
美元 357,072,929	离岸人民币 2,492,783,250	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(7,314,351)
美元 15,159,504	印尼盾 230,000,000,000	2022 年 10 月 25 日	渣打银行, 伦敦	(66,155)
美元 15,168,502	印尼盾 230,000,000,000	2022 年 10 月 25 日	渣打银行, 伦敦	(75,153)
澳元 333,287	美元 214,430	2022 年 11 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(10)
加元 249,274	美元 180,972	2022 年 11 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(441)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
离岸人民币 7,878	美元 1,106	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 7,835	美元 1,100	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 34,459	美元 4,837	2022 年 11 月 21 日	美林国际, 伦敦	(1)
离岸人民币 218,947	美元 30,730	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(9)
离岸人民币 372,756	美元 52,317	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(15)
离岸人民币 1,757,626	美元 246,686	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(71)
离岸人民币 6,920,208	美元 971,397	2022 年 11 月 21 日	美林国际, 伦敦	(149)
英镑 16,724	美元 18,612	2022 年 11 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(71)
纽元 145,479	美元 82,039	2022 年 11 月 21 日	加拿大皇家银行	(272)
离岸人民币 63,500,000	美元 8,771,263	2023 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(158,369)
韩元 20,250,000,000	美元 14,216,113	2023 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(7,644)
墨西哥比索 75,000,000	美元 3,659,200	2023 年 1 月 13 日	香港上海汇丰银行有限公司	(1,197)
泰铢 160,000,000	美元 4,262,484	2023 年 1 月 13 日	渣打银行, 伦敦	(16,144)
泰铢 260,000,000	美元 6,877,779	2023 年 1 月 13 日	渣打银行, 伦敦	(74,991)
台币 225,000,000	美元 7,097,210	2023 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(53,216)
台币 230,000,000	美元 7,244,072	2023 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(65,253)
美元 332,217	印尼盾 5,000,000,000	2023 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(4,994)
美元 13,972,715	新加坡元 20,000,000	2023 年 1 月 13 日	渣打银行, 伦敦	(9,843)
美元 3,683,327	墨西哥比索 75,000,000	2023 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(22,930)
美元 7,220,323	离岸人民币 50,800,000	2023 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(76,617)
美元 4,855,440	林吉特 22,000,000	2023 年 1 月 13 日	渣打银行, 伦敦	(83,459)
美元 7,203,045	澳元 11,000,000	2023 年 1 月 13 日	香港上海汇丰银行有限公司	(115,965)
美元 14,097,631	澳元 21,700,000	2023 年 1 月 13 日	香港上海汇丰银行有限公司	(116,755)
美元 15,023,698	印度卢比 1,208,000,000	2023 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(313,513)
美元 6,869,831	纽元 11,500,000	2023 年 1 月 13 日	香港上海汇丰银行有限公司	(360,566)
美元 14,603,752	韩元 20,250,000,000	2023 年 1 月 13 日	Citibank N.A., 伦敦	(379,994)
美元 21,464,334	澳元 31,934,429	2023 年 1 月 13 日	美国道富银行	(889,620)
美元 62,437,319	新加坡元 87,720,000	2023 年 1 月 13 日	高盛国际, 伦敦	(1,196,159)
美元 5,912,625	林吉特 27,000,000	2023 年 2 月 13 日	渣打银行, 伦敦	(44,704)
美元 9,043,785	林吉特 41,000,000	2023 年 2 月 13 日	渣打银行, 伦敦	(133,239)
美元 14,570,578	印尼盾 216,800,000,000	2023 年 5 月 31 日	Citibank N.A., 伦敦	(444,584)
印尼盾 230,000,000,000	美元 14,923,436	2023 年 6 月 26 日	渣打银行, 伦敦	(53,231)
印尼盾 230,000,000,000	美元 14,920,532	2023 年 6 月 26 日	渣打银行, 伦敦	(56,135)
美元 30,783,027	印尼盾 460,000,000,000	2023 年 6 月 26 日	Citibank N.A., 伦敦	(829,693)
			未实现总亏损	(23,730,703)
			未实现净亏损	(19,281,021)

2021

未平仓合约:

美元 14,742	加元 18,716	2021 年 10 月 4 日	加拿大皇家银行	31
澳元 632,932	美元 458,726	2021 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	1,522
美元 246,765	加元 313,318	2021 年 10 月 5 日	Citibank N.A., 伦敦	554
美元 283,094	澳元 393,873	2021 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	1,425
美元 77,537	加元 98,850	2021 年 10 月 6 日	加拿大皇家银行	491
美元 215,546	澳元 298,430	2021 年 10 月 7 日	美国道富银行	29
美元 1,107	加元 1,402	2021 年 10 月 7 日	法国巴黎银行	0
美元 39,755	英镑 29,485	2021 年 10 月 7 日	加拿大皇家银行	2
韩元 17,345,036,705	美元 15,025,413	2021 年 10 月 8 日	高盛国际, 伦敦	377,586
菲律宾比索 762,292,161	美元 15,059,110	2021 年 10 月 8 日	高盛国际, 伦敦	117,897
泰铢 489,537,184	美元 14,772,282	2021 年 10 月 8 日	渣打银行, 伦敦	304,758
美元 15,109,250	离岸人民币 97,844,493	2021 年 10 月 8 日	美林国际, 伦敦	43,947
美元 125,271	离岸人民币 810,233	2021 年 10 月 8 日	多伦多道明银行	210

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 77,326	离岸人民币 500,067	2021 年 10 月 8 日	美国道富银行	120
美元 1,100	离岸人民币 7,113	2021 年 10 月 8 日	美国道富银行	2
美元 1,100	离岸人民币 7,113	2021 年 10 月 8 日	美国道富银行	2
美元 14,841,270	菲律宾比索 762,292,161	2021 年 10 月 8 日	Citibank N.A., 伦敦	99,943
美元 15,032,960	新加坡元 20,431,837	2021 年 10 月 8 日	高盛国际, 伦敦	16,809
美元 1,593	离岸人民币 10,312	2021 年 10 月 12 日	美国道富银行	4
美元 1,098	离岸人民币 7,108	2021 年 10 月 12 日	美国道富银行	3
离岸人民币 245,349	美元 38,015	2021 年 10 月 15 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	39
澳元 2,776,742	美元 2,051,204	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	45,258
澳元 2,944,197	美元 2,144,017	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	17,099
澳元 469,457	美元 349,491	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	10,351
澳元 488,374	美元 361,866	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	9,060
澳元 875,136	美元 641,236	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	9,029
澳元 555,004	美元 409,537	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	8,596
澳元 393,550	美元 290,166	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	5,862
澳元 349,272	美元 257,822	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	5,504
澳元 258,654	美元 192,219	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	5,364
澳元 550,286	美元 402,757	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	5,225
澳元 432,085	美元 315,965	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	3,823
澳元 1,046,298	美元 759,048	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3,192
澳元 778,876	美元 565,821	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3,153
澳元 192,298	美元 141,523	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	2,606
澳元 222,058	美元 162,835	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	2,418
澳元 199,205	美元 146,104	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	2,196
澳元 371,996	美元 270,640	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	1,907
澳元 756,639	美元 548,434	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	1,831
澳元 322,314	美元 234,663	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1,820
澳元 471,551	美元 342,268	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	1,615
澳元 312,630	美元 226,792	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	945
澳元 119,663	美元 87,116	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	670
澳元 36,791	美元 26,891	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	313
澳元 101,394	美元 73,404	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	156
澳元 4,260	美元 3,141	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	64
澳元 386,994	美元 279,624	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	56
澳元 1,495	美元 1,103	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	24
澳元 1,480	美元 1,093	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	24
澳元 1,507	美元 1,105	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	17
澳元 3,216	美元 2,339	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	16
澳元 1,492	美元 1,094	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	16
澳元 1,516	美元 1,108	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	13
澳元 1,507	美元 1,102	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	13
澳元 2,623	美元 1,895	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	0
加元 4,221,496	美元 3,340,336	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	8,158
加元 2,075,179	美元 1,640,375	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	2,361
加元 230,926	美元 183,808	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	1,530
加元 286,090	美元 227,234	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,413
加元 102,530	美元 81,938	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	1,008
加元 664,955	美元 525,751	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	878
加元 325,885	美元 257,923	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	691
加元 344,228	美元 272,369	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	657
加元 75,570	美元 60,239	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	589
加元 206,102	美元 163,079	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	395
加元 161,558	美元 127,831	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	308
加元 502,273	美元 396,686	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	224
加元 203,614	美元 160,935	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	215
加元 280,592	美元 221,612	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	131
加元 95,623	美元 75,576	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	97
加元 7,254	美元 5,745	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	19

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
加元 1,390	美元 1,102	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	5
加元 1,385	美元 1,096	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	3
加元 1,400	美元 1,106	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	1
离岸人民币 195,602,960	美元 30,307,769	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	47,321
离岸人民币 14,070,315	美元 2,181,075	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	4,349
离岸人民币 5,492,174	美元 852,031	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	2,373
离岸人民币 2,996,306	美元 464,465	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	926
离岸人民币 5,829,051	美元 902,696	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	922
离岸人民币 3,652,940	美元 566,006	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	884
离岸人民币 8,550,938	美元 1,323,397	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	538
离岸人民币 538,927	美元 83,607	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	233
离岸人民币 761,559	美元 118,000	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	184
离岸人民币 2,365,371	美元 366,110	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	179
离岸人民币 405,082	美元 62,843	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	175
离岸人民币 767,248	美元 118,817	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	121
离岸人民币 1,225,331	美元 189,655	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	93
离岸人民币 201,955	美元 31,331	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	87
离岸人民币 471,871	美元 73,075	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	75
离岸人民币 3,409,073	美元 527,417	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	21
离岸人民币 1,615,362	美元 249,912	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	10
离岸人民币 16,833	美元 2,609	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	5
离岸人民币 654,606	美元 101,274	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	4
离岸人民币 41,220	美元 6,380	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	3
离岸人民币 201,955	美元 1,098	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	2
离岸人民币 7,094	美元 1,099	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	1
离岸人民币 7,094	美元 1,099	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	1
离岸人民币 7,080	美元 1,095	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	0
英镑 13,823	美元 19,107	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	468
英镑 21,289	美元 29,137	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	432
英镑 11,658	美元 16,089	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	369
英镑 9,299	美元 12,860	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	322
英镑 10,077	美元 13,843	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	255
英镑 12,811	美元 17,519	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	246
英镑 8,850	美元 12,129	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	196
英镑 8,601	美元 11,734	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	136
英镑 801	美元 1,109	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	29
英镑 800	美元 1,102	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	24
纽元 2,676,488	美元 1,896,955	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	50,768
纽元 934,653	美元 660,159	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	15,454
纽元 427,809	美元 304,018	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	8,924
纽元 344,319	美元 245,865	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	8,360
纽元 313,299	美元 219,976	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	3,869
纽元 172,845	美元 122,955	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3,730
纽元 175,657	美元 124,221	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	3,056
纽元 114,793	美元 81,839	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	2,657
纽元 190,912	美元 134,273	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	2,585
纽元 128,407	美元 90,329	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	1,756
纽元 129,451	美元 90,734	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	1,441
纽元 62,072	美元 44,189	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	1,373
纽元 52,001	美元 37,113	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,244
纽元 85,901	美元 60,154	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	901
纽元 123,445	美元 85,915	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	766
纽元 38,376	美元 27,231	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	760
纽元 52,529	美元 36,914	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	680
纽元 47,963	美元 33,758	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	674
纽元 78,322	美元 54,474	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	449
纽元 36,637	美元 25,679	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	407
纽元 20,855	美元 14,781	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	396

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 138,734	美元 95,887	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	191
纽元 5,687	美元 4,049	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	126
纽元 5,574	美元 3,942	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	97
纽元 1,828	美元 1,302	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	41
纽元 3,194	美元 2,237	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	34
纽元 1,546	美元 1,099	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	32
纽元 1,570	美元 1,107	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	24
纽元 1,570	美元 1,107	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	24
美元 149,061	加元 189,717	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	689
美元 40,788	加元 52,000	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	257
美元 49,373	加元 62,665	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	91
美元 2,224	加元 2,854	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	29
美元 1,217	加元 1,545	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	2
美元 656,701,720	离岸人民币 4,254,639,104	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1,505,522
美元 161,035,842	离岸人民币 1,043,319,015	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	369,183
美元 91,021,668	离岸人民币 589,711,180	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	208,672
美元 2,591,828	离岸人民币 16,791,934	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	5,942
美元 2,418,182	离岸人民币 15,664,326	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	5,143
美元 611,805	离岸人民币 3,975,285	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3,185
美元 2,341,267	离岸人民币 15,149,221	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	2,370
美元 845,229	离岸人民币 5,478,743	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2,351
美元 795,442	离岸人民币 5,156,885	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	2,346
美元 448,791	离岸人民币 2,913,931	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	2,004
美元 583,933	离岸人民币 3,786,233	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,811
美元 572,555	离岸人民币 3,712,073	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	1,716
美元 994,566	离岸人民币 6,438,536	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	1,498
美元 1,604,897	离岸人民币 10,383,159	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,414
美元 582,756	离岸人民币 3,775,535	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,332
美元 362,220	离岸人民币 2,348,532	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,106
美元 443,672	离岸人民币 2,875,000	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	1,100
美元 292,362	离岸人民币 1,895,591	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	893
美元 417,315	离岸人民币 2,702,891	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	831
美元 377,680	离岸人民币 2,446,509	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	803
美元 321,304	离岸人民币 2,081,624	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	731
美元 439,761	离岸人民币 2,847,017	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	682
美元 245,386	离岸人民币 1,590,140	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	614
美元 280,009	离岸人民币 1,813,820	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	595
美元 262,606	离岸人民币 1,700,110	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	407
美元 138,905	离岸人民币 900,126	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	348
美元 144,239	离岸人民币 934,213	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	287
美元 160,817	离岸人民币 1,041,051	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	237
美元 71,603	离岸人民币 464,367	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	236
美元 72,909	离岸人民币 472,743	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	226
美元 213,911	离岸人民币 1,383,932	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	188
美元 220,071	离岸人民币 1,423,630	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	170
美元 105,833	离岸人民币 685,161	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	164
美元 51,071	离岸人民币 331,093	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	151
美元 143,591	离岸人民币 929,110	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	145
美元 46,640	离岸人民币 302,371	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	138
美元 47,990	离岸人民币 311,066	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	133
美元 122,350	离岸人民币 791,666	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	124
美元 43,393	离岸人民币 281,274	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	121
美元 16,912	离岸人民币 110,000	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	105
美元 41,329	离岸人民币 267,814	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	102
美元 31,955	离岸人民币 207,200	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	99
美元 70,048	离岸人民币 453,415	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	97
美元 38,628	离岸人民币 250,243	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	86
美元 47,717	离岸人民币 308,895	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	70

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 32,721	离岸人民币 211,931	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	65
美元 19,377	离岸人民币 125,628	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	58
美元 21,960	离岸人民币 142,300	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	54
美元 322,962	离岸人民币 2,087,912	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	45
美元 36,951	离岸人民币 239,077	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	35
美元 13,769	离岸人民币 89,203	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	31
美元 21,350	离岸人民币 138,198	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	30
美元 31,145	离岸人民币 201,510	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	29
美元 4,410	离岸人民币 28,683	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	27
美元 26,463	离岸人民币 171,210	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	23
美元 5,921	离岸人民币 38,388	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	18
美元 3,115	离岸人民币 20,241	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	16
美元 6,195	离岸人民币 40,129	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	13
美元 3,538	离岸人民币 22,939	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	10
美元 4,060	离岸人民币 26,281	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	6
美元 1,153	离岸人民币 7,488	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	6
美元 2,459	离岸人民币 15,927	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	5
美元 1,389	离岸人民币 9,000	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	3
美元 1,218	离岸人民币 7,890	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	3
美元 1,271	离岸人民币 8,226	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	1
美元 121	离岸人民币 787	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	0
美元 68,780	欧元 100,094	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	263
澳元 20,000,000	美元 14,624,380	2021 年 10 月 25 日	高盛国际, 伦敦	175,920
巴西雷亚尔 50,643,498	美元 9,549,431	2021 年 10 月 25 日	渣打银行, 伦敦	289,322
离岸人民币 90,000,000	美元 13,953,006	2021 年 10 月 25 日	香港上海汇丰银行有限公司	34,332
离岸人民币 185,000,000	美元 28,626,622	2021 年 10 月 25 日	香港上海汇丰银行有限公司	16,013
欧元 12,652,095	美元 15,000,000	2021 年 10 月 25 日	香港上海汇丰银行有限公司	330,263
印尼盾 256,000,000,000	美元 17,850,917	2021 年 10 月 25 日	高盛国际, 伦敦	6,046
韩元 17,200,000,000	美元 14,822,475	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	301,591
韩元 17,000,000,000	美元 14,622,775	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	270,739
韩元 17,500,000,000	美元 15,020,815	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	246,659
韩元 18,070,000,000	美元 15,302,536	2021 年 10 月 25 日	高盛国际, 伦敦	47,165
墨西哥比索 408,362,395	美元 20,380,000	2021 年 10 月 25 日	高盛国际, 伦敦	575,728
墨西哥比索 310,000,000	美元 15,316,567	2021 年 10 月 25 日	高盛国际, 伦敦	282,558
墨西哥比索 300,000,000	美元 14,823,234	2021 年 10 月 25 日	高盛国际, 伦敦	274,192
林吉特 94,000,000	美元 22,555,489	2021 年 10 月 25 日	渣打银行, 伦敦	126,533
菲律宾比索 740,000,000	美元 14,846,321	2021 年 10 月 25 日	高盛国际, 伦敦	351,382
新加坡元 40,000,000	美元 29,798,541	2021 年 10 月 25 日	美国道富银行	336,170
新加坡元 39,500,000	美元 29,415,861	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	321,777
新加坡元 38,955,441	美元 28,994,238	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	301,247
新加坡元 19,000,000	美元 14,119,214	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	124,588
泰铢 500,000,000	美元 14,946,611	2021 年 10 月 25 日	美林国际, 伦敦	171,597
台币 380,000,000	美元 13,683,979	2021 年 10 月 25 日	渣打银行, 伦敦	45,087
台币 375,000,000	美元 13,475,297	2021 年 10 月 25 日	渣打银行, 伦敦	15,864
美元 6,837,435	澳元 9,500,000	2021 年 10 月 25 日	澳大利亚和新西兰银行集团 有限公司	25,583
美元 14,574,149	离岸人民币 95,000,000	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	117,785
美元 29,316,251	离岸人民币 190,000,000	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	67,617
美元 14,649,737	离岸人民币 95,000,000	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	42,197
美元 23,171,076	离岸人民币 150,000,000	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	26,715
美元 8,790,417	离岸人民币 57,000,000	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	24,743
美元 13,914,642	离岸人民币 90,000,000	2021 年 10 月 25 日	高盛国际, 伦敦	4,033
美元 14,886,104	印尼盾 215,000,000,000	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	100,799
美元 53,868,723	印度卢比 4,030,000,000	2021 年 10 月 25 日	渣打银行, 伦敦	279,037
美元 13,063,633	韩元 15,500,000,000	2021 年 10 月 25 日	美林国际, 伦敦	22,048
美元 14,607,483	林吉特 62,000,000	2021 年 10 月 25 日	香港上海汇丰银行有限公司	186,084
美元 11,882,694	林吉特 50,000,000	2021 年 10 月 25 日	渣打银行, 伦敦	47,602
美元 21,000,000	美元 14,710,416	2021 年 10 月 26 日	高盛国际, 伦敦	225,477

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 6,878,678	纽元 10,000,000	2021 年 10 月 26 日	Citibank N.A., 伦敦	18,912
离岸人民币 13,466,503	美元 2,080,301	2021 年 11 月 19 日	多伦多道明银行	1,823
离岸人民币 1,062,871	美元 164,234	2021 年 11 月 19 日	多伦多道明银行	186
离岸人民币 7,120	美元 1,100	2021 年 11 月 19 日	法国巴黎银行	1
离岸人民币 7,120	美元 1,100	2021 年 11 月 19 日	法国巴黎银行	1
纽元 1,601	美元 1,104	2021 年 11 月 19 日	美国道富银行	0
美元 1,806	澳元 2,500	2021 年 11 月 19 日	加拿大皇家银行	0
			未实现总收益	9,266,792
美元 127,835	加元 161,558	2021 年 10 月 4 日	美国道富银行	(308)
美元 25,681	纽元 36,637	2021 年 10 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	(408)
美元 73,399	澳元 101,394	2021 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(156)
美元 2,143,881	澳元 2,944,197	2021 年 10 月 5 日	美国道富银行	(17,114)
美元 54,479	纽元 78,322	2021 年 10 月 5 日	加拿大皇家银行	(450)
纽元 100,094	美元 68,786	2021 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	(263)
美元 1,104	纽元 1,601	2021 年 10 月 6 日	美国道富银行	(0)
加元 52,000	美元 40,789	2021 年 10 月 7 日	法国巴黎银行	(257)
澳元 2,500	美元 1,806	2021 年 10 月 8 日	加拿大皇家银行	(0)
离岸人民币 142,300	美元 21,981	2021 年 10 月 8 日	美国道富银行	(57)
离岸人民币 267,814	美元 41,369	2021 年 10 月 8 日	美国道富银行	(108)
离岸人民币 2,875,000	美元 444,094	2021 年 10 月 8 日	美国道富银行	(1,158)
离岸人民币 97,844,493	美元 15,000,656	2021 年 10 月 8 日	高盛国际, 伦敦	(152,541)
新加坡元 20,431,837	美元 15,012,724	2021 年 10 月 8 日	Citibank N.A., 伦敦	(37,045)
美元 15,061,816	韩元 17,345,036,705	2021 年 10 月 8 日	美林国际, 伦敦	(413,988)
美元 14,859,451	泰铢 489,537,184	2021 年 10 月 8 日	渣打银行, 伦敦	(391,927)
离岸人民币 138,198	美元 21,364	2021 年 10 月 12 日	美国道富银行	(32)
离岸人民币 308,895	美元 47,749	2021 年 10 月 12 日	美国道富银行	(74)
离岸人民币 453,415	美元 70,093	2021 年 10 月 12 日	美国道富银行	(104)
离岸人民币 1,041,051	美元 160,924	2021 年 10 月 12 日	美国道富银行	(251)
离岸人民币 9,000	美元 1,390	2021 年 10 月 13 日	加拿大皇家银行	(3)
离岸人民币 250,243	美元 38,649	2021 年 10 月 13 日	加拿大皇家银行	(91)
美元 1,103	离岸人民币 7,120	2021 年 10 月 13 日	法国巴黎银行	(1)
澳元 348,351	美元 251,095	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(557)
澳元 393,873	美元 283,112	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,426)
加元 2,270	美元 1,780	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(11)
加元 18,716	美元 14,742	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(31)
加元 83,277	美元 65,436	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(298)
加元 98,850	美元 77,536	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(491)
加元 849,133	美元 669,714	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(537)
加元 313,318	美元 246,760	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(554)
加元 227,008	美元 178,530	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(656)
加元 167,415	美元 131,293	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(853)
加元 301,357	美元 235,335	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(2,537)
加元 315,661	美元 245,940	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(3,222)
加元 812,179	美元 633,656	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(7,426)
离岸人民币 7,107	美元 1,099	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1)
离岸人民币 7,107	美元 1,099	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1)
离岸人民币 7,069	美元 1,093	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1)
离岸人民币 13,062	美元 2,019	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(2)
离岸人民币 7,113	美元 1,099	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(2)
离岸人民币 7,113	美元 1,099	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(2)
离岸人民币 7,109	美元 1,097	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(2)
离岸人民币 7,108	美元 1,097	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(2)
离岸人民币 7,097	美元 1,096	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(2)
离岸人民币 7,095	美元 1,096	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(2)
离岸人民币 7,069	美元 1,091	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(2)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
离岸人民币 7,069	美元 1,091	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(2)
离岸人民币 7,109	美元 1,096	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 7,109	美元 1,096	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 7,109	美元 1,096	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 7,109	美元 1,096	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 7,100	美元 1,096	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 7,098	美元 1,095	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 7,098	美元 1,095	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(3)
离岸人民币 32,412	美元 5,010	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(4)
离岸人民币 10,312	美元 1,592	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(4)
离岸人民币 8,938	美元 1,379	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
离岸人民币 25,266	美元 3,903	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(5)
离岸人民币 28,359	美元 4,381	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
离岸人民币 25,918	美元 4,004	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
离岸人民币 7,114	美元 1,095	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
离岸人民币 7,114	美元 1,095	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(6)
离岸人民币 7,114	美元 1,095	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(6)
离岸人民币 24,571	美元 3,791	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(10)
离岸人民币 27,673	美元 4,268	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(13)
离岸人民币 72,540	美元 11,202	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(20)
离岸人民币 49,661	美元 7,662	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(21)
离岸人民币 40,015	美元 6,159	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(32)
离岸人民币 265,958	美元 41,106	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(38)
离岸人民币 174,315	美元 26,927	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(40)
离岸人民币 132,569	美元 20,462	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(47)
离岸人民币 202,015	美元 31,188	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(65)
离岸人民币 189,120	美元 29,193	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(65)
离岸人民币 353,960	美元 54,686	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(73)
离岸人民币 571,605	美元 88,347	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(83)
离岸人民币 1,261,867	美元 195,130	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(86)
离岸人民币 547,377	美元 84,594	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(88)
离岸人民币 249,546	美元 38,518	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(88)
离岸人民币 384,767	美元 59,436	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(89)
离岸人民币 596,572	美元 92,196	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(95)
离岸人民币 500,067	美元 77,255	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(107)
离岸人民币 314,746	美元 48,584	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(108)
离岸人民币 1,798,873	美元 278,170	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(122)
离岸人民币 337,591	美元 52,093	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(133)
离岸人民币 930,382	美元 143,768	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(165)
离岸人民币 380,587	美元 58,706	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(172)
离岸人民币 804,664	美元 124,299	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(185)
离岸人民币 810,233	美元 125,153	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(193)
离岸人民币 458,704	美元 70,751	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(212)
离岸人民币 1,021,103	美元 157,733	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(235)
离岸人民币 1,361,736	美元 210,424	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(241)
离岸人民币 1,219,777	美元 188,423	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(280)
离岸人民币 1,858,806	美元 287,266	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(298)
离岸人民币 2,386,473	美元 368,870	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(325)
离岸人民币 342,163	美元 52,609	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(325)
离岸人民币 1,027,665	美元 158,648	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(335)
离岸人民币 993,370	美元 153,339	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(339)
离岸人民币 1,480,323	美元 228,671	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(340)
离岸人民币 689,175	美元 106,265	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(353)
离岸人民币 950,565	美元 146,701	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(354)
离岸人民币 1,055,804	美元 162,920	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(417)
离岸人民币 932,206	美元 143,795	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(421)
离岸人民币 2,135,367	美元 329,909	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(439)
离岸人民币 1,419,784	美元 219,182	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(464)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
离岸人民币 1,637,591	美元 252,847	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(493)
离岸人民币 1,347,506	美元 207,961	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(502)
离岸人民币 3,253,609	美元 502,824	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(521)
离岸人民币 2,324,093	美元 358,799	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(746)
离岸人民币 5,962,415	美元 921,594	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(812)
离岸人民币 2,398,447	美元 370,230	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(818)
离岸人民币 3,886,813	美元 600,410	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(893)
离岸人民币 2,276,334	美元 351,230	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(927)
离岸人民币 6,834,477	美元 1,056,386	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(931)
离岸人民币 2,411,991	美元 372,015	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1,129)
离岸人民币 3,401,399	美元 525,042	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1,167)
离岸人民币 9,125,529	美元 1,410,566	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1,184)
离岸人民币 2,973,178	美元 458,750	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1,211)
离岸人民币 1,383,374	美元 212,742	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1,271)
离岸人民币 6,639,053	美元 1,025,675	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(1,410)
离岸人民币 6,749,544	美元 1,042,712	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,466)
离岸人民币 7,378,000	美元 1,139,788	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,614)
离岸人民币 4,455,810	美元 687,571	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(1,758)
离岸人民币 1,962,821	美元 301,852	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1,804)
离岸人民币 16,912,572	美元 2,613,998	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2,434)
离岸人民币 8,080,652	美元 1,247,670	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(2,435)
离岸人民币 3,552,182	美元 547,092	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(2,442)
离岸人民币 5,814,892	美元 897,112	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(2,472)
离岸人民币 8,765,470	美元 1,352,985	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(3,064)
离岸人民币 8,905,470	美元 1,373,600	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4,107)
离岸人民币 16,306,544	美元 2,518,210	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(4,469)
离岸人民币 10,056,903	美元 1,551,131	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(4,706)
离岸人民币 23,172,084	美元 3,580,034	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4,767)
离岸人民币 11,572,362	美元 1,785,064	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(5,220)
离岸人民币 7,242,634	美元 1,113,587	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(6,874)
离岸人民币 22,937,209	美元 3,541,103	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(7,362)
离岸人民币 9,916,100	美元 1,526,160	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(7,895)
离岸人民币 20,264,754	美元 3,126,412	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(8,615)
离岸人民币 12,593,004	美元 1,938,308	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(9,873)
英镑 9,715	美元 13,076	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(24)
美元 1,491	澳元 2,050	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(10)
美元 1,308	澳元 1,796	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(10)
美元 2,401	澳元 3,262	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(44)
美元 16,943	澳元 23,180	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(197)
美元 9,698	澳元 13,089	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(243)
美元 15,793	澳元 21,400	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(333)
美元 49,454	澳元 66,949	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(1,090)
美元 458,754	澳元 632,932	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,517)
美元 196,915	澳元 268,500	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(2,948)
美元 203,672	澳元 277,744	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(3,027)
美元 144,079	澳元 195,190	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(3,072)
美元 188,780	澳元 256,512	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(3,473)
美元 160,184	澳元 215,554	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(4,466)
美元 360,399	澳元 484,113	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(10,670)
美元 153,560,822	澳元 206,603,044	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(4,308,717)
美元 9,963	加元 12,605	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(13)
美元 9,487	加元 12,000	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(15)
美元 11,605	加元 14,637	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(51)
美元 31,650	加元 40,000	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(76)
美元 65,563	加元 82,702	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(284)
美元 276,217	加元 349,483	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(358)
美元 158,842	加元 200,000	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(975)
美元 1,012,949	加元 1,280,000	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(2,599)

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 1,187,876	加元 1,500,000	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3,872)
美元 1,296,672	加元 1,626,825	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(12,561)
美元 106,298,817	加元 133,884,423	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(619,054)
美元 19,732	离岸人民币 127,545	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
美元 72,559	离岸人民币 469,004	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
美元 1,485	离岸人民币 9,583	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(3)
美元 1,930	离岸人民币 12,438	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(5)
美元 3,875	离岸人民币 25,000	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(8)
美元 13,490	离岸人民币 87,114	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
美元 56,597	离岸人民币 365,497	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(54)
美元 21,926	离岸人民币 141,335	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(61)
美元 36,759	离岸人民币 237,134	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(74)
美元 53,304	离岸人民币 344,024	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(82)
美元 57,733	离岸人民币 372,140	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(161)
美元 1,045,772	离岸人民币 6,753,452	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(990)
美元 1,162,479	离岸人民币 7,502,510	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1,815)
美元 3,271,745	离岸人民币 21,106,172	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(6,548)
美元 1,366	英镑 995	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(25)
美元 1,717	英镑 1,242	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(42)
美元 7,556,061	英镑 5,469,680	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(180,831)
美元 1,555	纽元 2,211	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(30)
美元 18,245	纽元 25,748	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(485)
美元 27,786	纽元 39,209	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(741)
美元 141,984	纽元 200,811	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(3,469)
美元 281,764	纽元 400,382	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(5,589)
美元 58,640,099	纽元 82,412,702	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(1,793,465)
离岸人民币 100,000,000	美元 15,449,308	2021 年 10 月 25 日	澳大利亚和新西兰银行集团 有限公司	(15,886)
离岸人民币 176,000,000	美元 27,162,774	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	(55,967)
离岸人民币 175,000,000	美元 26,998,215	2021 年 10 月 25 日	渣打银行, 伦敦	(65,874)
离岸人民币 95,689,843	美元 14,696,932	2021 年 10 月 25 日	香港上海汇丰银行有限公司	(101,688)
离岸人民币 116,288,505	美元 17,855,501	2021 年 10 月 25 日	美林国际, 伦敦	(128,741)
离岸人民币 330,000,000	美元 50,856,798	2021 年 10 月 25 日	香港上海汇丰银行有限公司	(178,341)
印尼盾 484,814,193,969	美元 33,426,471	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	(368,243)
印度卢比 1,100,000,000	美元 14,719,264	2021 年 10 月 25 日	美林国际, 伦敦	(60,522)
印度卢比 1,100,000,000	美元 14,717,235	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	(62,551)
印度卢比 1,370,000,000	美元 18,324,107	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	(83,445)
林吉特 57,464,650	美元 13,700,000	2021 年 10 月 25 日	渣打银行, 伦敦	(11,405)
林吉特 50,000,000	美元 11,757,513	2021 年 10 月 25 日	香港上海汇丰银行有限公司	(172,783)
林吉特 154,729,101	美元 36,524,223	2021 年 10 月 25 日	渣打银行, 伦敦	(395,505)
菲律宾比索 730,000,000	美元 14,272,866	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	(26,195)
新加坡元 40,684,668	美元 29,891,218	2021 年 10 月 25 日	渣打银行, 伦敦	(75,451)
美元 14,527,220	澳元 20,000,000	2021 年 10 月 25 日	渣打银行, 伦敦	(78,760)
美元 6,791,996	欧元 5,850,000	2021 年 10 月 25 日	澳大利亚和新西兰银行集团 有限公司	(9,091)
美元 14,948,712	欧元 12,652,095	2021 年 10 月 25 日	香港上海汇丰银行有限公司	(278,975)
美元 24,542,114	印尼盾 350,000,000,000	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	(144,829)
美元 14,752,630	印度卢比 1,090,538,000	2021 年 10 月 25 日	渣打银行, 伦敦	(99,977)
美元 20,316,724	印度卢比 1,500,000,000	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	(162,471)
美元 12,747,189	韩元 15,000,000,000	2021 年 10 月 25 日	高盛国际, 伦敦	(83,627)
美元 14,464,638	韩元 17,000,000,000	2021 年 10 月 25 日	Citibank N.A., 伦敦	(112,601)
美元 14,699,016	韩元 17,000,000,000	2021 年 10 月 25 日	美林国际, 伦敦	(346,979)
美元 14,835,371	韩元 17,000,000,000	2021 年 10 月 25 日	高盛国际, 伦敦	(483,334)
美元 46,209,945	韩元 53,164,541,751	2021 年 10 月 25 日	渣打银行, 伦敦	(1,326,448)
美元 14,626,525	墨西哥比索 300,000,000	2021 年 10 月 25 日	美林国际, 伦敦	(77,483)
美元 7,362,545	墨西哥比索 150,000,000	2021 年 10 月 25 日	香港上海汇丰银行有限公司	(88,024)
美元 7,863,421	墨西哥比索 160,000,000	2021 年 10 月 25 日	高盛国际, 伦敦	(103,932)
美元 22,176,568	林吉特 92,729,101	2021 年 10 月 25 日	香港上海汇丰银行有限公司	(50,856)

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 22,647,874	林吉特 94,000,000	2021年10月25日	香港上海汇丰银行有限公司	(218,918)
美元 14,464,898	菲律宾比索 730,000,000	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	(165,837)
美元 14,751,321	菲律宾比索 740,000,000	2021年10月25日	高盛国际, 伦敦	(256,382)
美元 14,732,574	新加坡元 20,000,000	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	(1,389)
美元 27,255,082	新加坡元 37,000,000	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	(2,389)
美元 15,239,907	新加坡元 20,684,668	2021年10月25日	渣打银行, 伦敦	(4,423)
美元 13,736,964	新加坡元 18,600,000	2021年10月25日	香港上海汇丰银行有限公司	(36,961)
美元 14,185,959	新加坡元 19,200,000	2021年10月25日	香港上海汇丰银行有限公司	(44,021)
美元 7,639,209	泰铢 250,000,000	2021年10月25日	美林国际, 伦敦	(251,703)
美元 7,643,390	泰铢 250,000,000	2021年10月25日	美林国际, 伦敦	(255,883)
美元 14,531,738	纽元 21,000,000	2021年10月26日	渣打银行, 伦敦	(46,798)
澳元 298,430	美元 215,585	2021年11月19日	美国道富银行	(30)
澳元 429,399	美元 309,274	2021年11月19日	高盛国际, 伦敦	(966)
加元 1,402	美元 1,107	2021年11月19日	法国巴黎银行	(0)
加元 278,412	美元 218,758	2021年11月19日	加拿大皇家银行	(993)
离岸人民币 34,243	美元 5,278	2021年11月19日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
离岸人民币 1,275,902	美元 196,593	2021年11月19日	美国道富银行	(335)
离岸人民币 1,757,297	美元 270,768	2021年11月19日	美国道富银行	(461)
离岸人民币 9,091,387	美元 1,401,251	2021年11月19日	Citibank N.A., 伦敦	(1,953)
英镑 29,485	美元 39,756	2021年11月19日	加拿大皇家银行	(2)
英镑 11,945	美元 16,061	2021年11月19日	美国道富银行	(45)
纽元 172,168	美元 118,251	2021年11月19日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(479)
美元 37,910	离岸人民币 245,349	2021年11月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(42)
			未实现总亏损	(14,653,676)
			未实现净亏损	(5,386,884)

(b) 以下为截至九月三十日之未平仓期货合约:

	持仓 / (短 仓) 的合约		交割日期	标的资产	交易对手	未实现收益 / (亏损)
	数目	合约金额 美元				美元
<u>2022</u>						
Aust 10yr Bond Fut				Australia	Citigroup Global	
12/22	363	27,333,917	2022年12月	10-year bonds	Markets Ltd	37,444
US 10yr Note (CBT)				10-year U.S.	Citigroup Global	
12/22	(255)	(28,575,938)	2022年12月	Treasury notes	Markets Ltd	606,750
US 5yr Note (CBT)				5-year U.S.	Citigroup Global	
12/22	(498)	(53,538,891)	2022年12月	Treasury notes	Markets Ltd	1,937,531
					未实现总收益	2,581,725

	长仓／(短 仓)的合约 数目	合约金额 美元	交割日期	标的资产	交易对手	未实现收益／ (亏损) 美元
<u>2022</u>						
US Ultra Bond (CBT) 12/22	261	35,757,000	2022年12月	30-year U.S. Treasury bonds	Citigroup Global Markets Ltd	(3,339,984)
					未实现总亏损	(3,339,984)
					未实现净亏损	(758,259)
<u>2021</u>						
US 10yr Note (CBT) Fut 12/21	(371)	(48,827,078)	2021年12月	10-year U.S. Treasury notes	Citigroup Global Markets Ltd	515,922
US 5yr Note (CBT) Fut 12/21	(1,416)	(173,802,938)	2021年12月	5-year U.S. Treasury notes	Citigroup Global Markets Ltd	829,686
					未实现总收益	1,345,608
US Long Bond (CBT) Fut 12/21	72	11,463,750	2021年12月	20-year U.S. Treasury bonds	Citigroup Global Markets Ltd	(92,250)
					未实现总亏损	(92,250)
					未实现净收益	1,253,358

独立核数师报告

致摩根亚洲总收益债券基金（“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

摩根亚洲总收益债券基金列载于第十二页至第五十六页的财务报表，包括：

- 于二零二二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二零二二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二零零四年十一月三十日订立的信托契约（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为重大。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）

致摩根亚洲总收益债券基金（“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，二零二三年一月二十日

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二零二二年九月三十日止财政年度在各个重要方面均依照二零零四年十一月三十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

二零二三年一月二十日

业绩记录 (未经审计)

(续)

资产净值

财务期结算日	本基金资产净值	每份额资产净值
30/9/22		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 106,130,688	澳元 6.39
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 78,934,141	加元 6.46
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 5,603,013	英镑 6.75
- 港元类别 (每月派息)	港元 2,038,454,890	港元 6.95
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 46,587,636	纽元 6.36
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 437,407,794	人民币 11.28
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 351,740,162	人民币 7.15
- PRC 美元份额 (累计)	美元 128,311,762	美元 9.87
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 17,065,170	美元 7.20
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 11,271,909	人民币 11.88
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 2,280,668,217	人民币 6.62
- 美元类别 (累计)	美元 10,505,581	美元 11.05
- 美元类别 (每月派息)	美元 355,501,134	美元 7.90
30/9/21		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 191,366,724	澳元 8.32
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 125,506,796	加元 8.42
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 5,300,020	英镑 8.80
- 港元类别 (每月派息)	港元 4,079,907,047	港元 8.98
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 76,304,693	纽元 8.29
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 791,153,106	人民币 13.62
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 571,858,247	人民币 9.32
- PRC 美元份额 (累计)	美元 374,577,855	美元 12.12
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 30,423,683	美元 9.37
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 15,519,544	人民币 14.34
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 4,067,566,571	人民币 8.62
- 美元类别 (累计)	美元 12,949,102	美元 13.57
- 美元类别 (每月派息)	美元 652,534,891	美元 10.29

财务期结算日	本基金资产净值	每份额资产净值
30/9/20		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 200,080,050	澳元 8.65
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 136,678,850	加元 8.74
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 4,665,897	英镑 9.14
- 港元类别 (每月派息)	港元 3,917,117,050	港元 9.28
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 92,667,985	纽元 8.61
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 2,461,936,140	人民币 13.11
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 754,021,450	人民币 9.68
- PRC 美元份额 (累计)	美元 495,983,658	美元 11.97
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 35,772,394	美元 9.73
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 15,430,879	人民币 13.82
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 3,618,794,584	人民币 8.97
- 美元类别 (累计)	美元 2,621,058	美元 13.39
- 美元类别 (每月派息)	美元 736,162,668	美元 10.68

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
30/9/22			30/9/20		
-澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.32	澳元 6.39	-澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.01	澳元 7.92
-加元对冲类别 (每月派息)	加元 8.42	加元 6.46	-加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.06	加元 8.00
-英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 8.80	英镑 6.75	-英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.47	英镑 8.36
-港元类别 (每月派息)	港元 8.97	港元 6.95	-港元类别 (每月派息)	港元 9.61	港元 8.51
-纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.28	纽元 6.36	-纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.94	纽元 7.88
-PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 13.61	人民币 11.28	-PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 13.17	人民币 11.57
-PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.31	人民币 7.15	-PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.98	人民币 8.89
-PRC 美元份额 (累计)	美元 12.11	美元 9.87	-PRC 美元份额 (累计)	美元 12.05	美元 10.66
-PRC 美元份额 (每月派息)	美元 9.37	美元 7.20	-PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.02	美元 8.92
-人民币对冲类别 (累计)	人民币 14.34	人民币 11.88	-人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.89	人民币 12.16
-人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 8.62	人民币 6.62	-人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.24	人民币 8.23
-美元类别 (累计)	美元 13.56	美元 11.05	-美元类别 (累计)	美元 13.49	美元 11.93
-美元类别 (每月派息)	美元 10.28	美元 7.90	-美元类别 (每月派息)	美元 10.99	美元 9.79
30/9/21			30/9/19		
-澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.85	澳元 8.32	-澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.98	澳元 8.48
-加元对冲类别 (每月派息)	加元 8.95	加元 8.42	-加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.02	加元 8.53
-英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.34	英镑 8.80	-英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.43	英镑 8.92
-港元类别 (每月派息)	港元 9.50	港元 8.97	-港元类别 (每月派息)	港元 9.64	港元 9.07
-纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.81	纽元 8.29	-纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.91	纽元 8.42
-PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 13.84	人民币 13.19	-PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 12.55	人民币 11.41
-PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.94	人民币 9.32	-PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.96	人民币 9.40
-PRC 美元份额 (累计)	美元 12.39	美元 12.03	-PRC 美元份额 (累计)	美元 11.60	美元 10.58
-PRC 美元份额 (每月派息)	美元 9.97	美元 9.37	-PRC 美元份额 (每月派息)	美元 9.99	美元 9.43
-人民币对冲类别 (累计)	人民币 14.57	人民币 13.84	-人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.21	人民币 12.01
-人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.19	人民币 8.62	-人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.22	人民币 8.71
-美元类别 (累计)	美元 13.86	美元 13.41	-美元类别 (累计)	美元 12.98	美元 11.84
-美元类别 (每月派息)	美元 10.93	美元 10.29	-美元类别 (每月派息)	美元 10.96	美元 10.35

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
30/9/18			30/9/16		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.14	澳元 8.54	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.65	澳元 9.01
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.18	加元 8.58	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.68	加元 9.03
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.59	英镑 8.97	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.11	英镑 9.41
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.76	港元 9.17	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.20	港元 9.53
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.07	纽元 8.47	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.58	纽元 8.94
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.72	人民币 11.30	- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.00	人民币 10.02
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.14	人民币 9.48	- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.53	人民币 10.00
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.99	美元 10.49	- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.77	美元 9.96
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.15	美元 9.49	- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.49	美元 9.96
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.32	人民币 11.88	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 11.82	人民币 10.36
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.38	人民币 8.78	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.95	人民币 9.26
- 美元类别 (累计)	美元 12.30	美元 11.75	- 美元类别 (累计)	美元 12.29	美元 11.09
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.13	美元 10.42	- 美元类别 (每月派息)	美元 11.73	美元 10.93
30/9/17			30/9/15		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.56	澳元 8.99	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.97	澳元 9.05
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.60	加元 9.03	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.95	加元 9.07
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.04	英镑 9.43	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.35	英镑 9.45
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.12	港元 9.51	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.46	港元 9.53
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.50	纽元 8.93	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.90	纽元 8.98
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.51	人民币 10.63	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 10.92	人民币 10.12
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.42	人民币 9.92	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.32	人民币 9.32
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.88	美元 10.36	- 美元类别 (累计)	美元 11.83	美元 11.06
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.38	美元 9.98	- 美元类别 (每月派息)	美元 12.04	美元 10.97
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.11	人民币 11.20	30/9/14		
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.86	人民币 9.20	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.05	澳元 9.41
- 美元类别 (累计)	美元 12.24	美元 11.60	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.06	加元 9.42
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.63	美元 10.95	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.54	港元 9.89
			- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.00	纽元 9.36
			- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 10.49	人民币 10.01
			- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.41	人民币 9.91
			- 美元类别 (累计)	美元 11.61	美元 10.53
			- 美元类别 (每月派息)	美元 12.13	美元 11.36

业绩记录 (未经审计) (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
30/9/13		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.46	澳元 9.29
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.46	加元 9.29
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.94	港元 9.73
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.42	纽元 9.24
- 美元类别 (累计)	美元 11.40	美元 10.28
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.58	美元 11.19

经营与管理

管理人及服务提供者	管理人董事
摩根基金 (亚洲) 有限公司	于二零二三年一月二十日
香港	Ayaz Hatim EBRAHIM
中环干诺道中 8 号	Daniel James WATKINS
遮打大厦 19 楼	Ka Li NG
	Kit Yee Elka LEUNG
投资管理人	Stiofan Seamus DEBURCA
摩根资产管理 (亚太) 有限公司	Tsun Kay Edwin CHAN
香港	
中环干诺道中 8 号	受托人
遮打大厦 19 楼	汇丰机构信托服务
	(亚洲) 有限公司
助理管理人	香港
JPMorgan Asset Management	中环皇后大道中 1 号
(UK) Limited	
60 Victoria Embankment	基金注册登记机构
London	HSBC Trustee (Cayman) Limited
EC4Y 0JP	P.O.Box 309
United Kingdom	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

