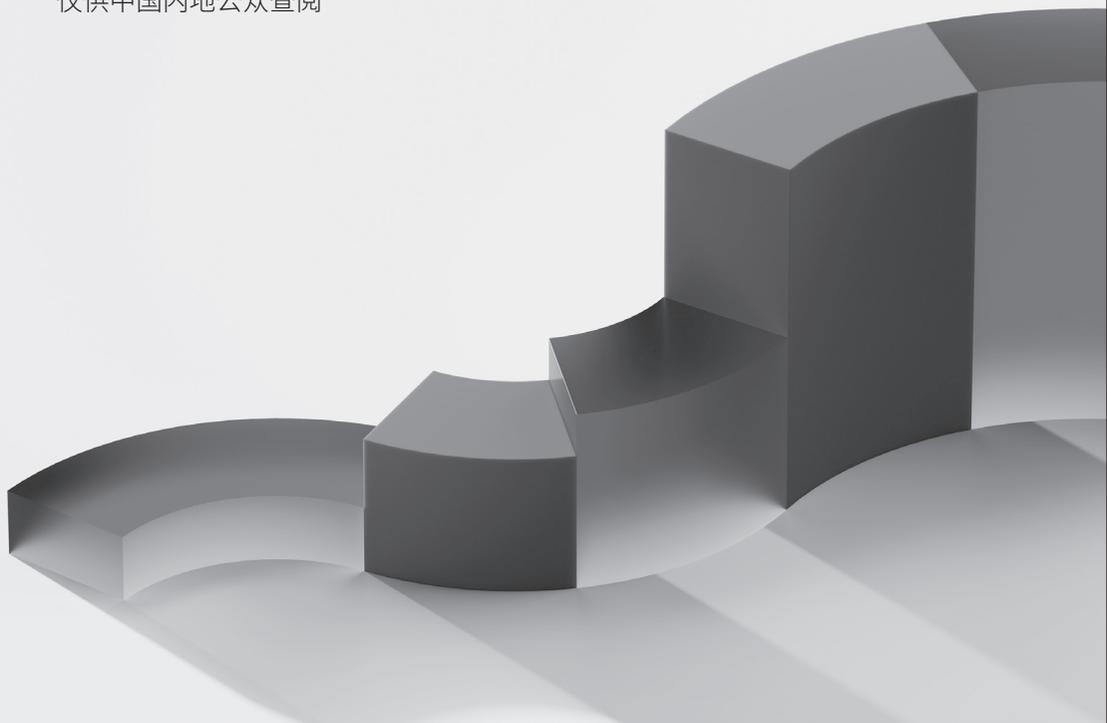


仅供中国内地公众查阅



年度报告— 2022年9月30日（经审核）

摩根亚洲股息基金

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 – 2
投资组合持有变动表 - 未经审计	3
金融衍生工具详情 - 未经审计	4
金融衍生工具风险敞口信息 - 未经审计	4
财务状况表	5
综合收益表	5 – 6
可赎回份额持有人应占净资产变动表	6
现金流量表	7
财务报表之附注	8 – 58
独立核数师报告	59 – 60
管理人及受托人的责任声明	61
受托人对份额持有人的报告	61
业绩纪录 - 未经审计	62 – 64
经营与管理	65

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	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (99.0%)							
(I) 股票 (100.3%)							
				中国人民财产保险股份有限公司 H 股	10,416,000	10,800,932	0.9
澳大利亚 (22.1%)							
ANZ Banking Group Ltd	547,515	8,026,165	0.7	中国平安保险(集团)股份有限 公司 A 股(C1)	784,273	4,574,188	0.4
Australian Stock Exchange Ltd	407,376	18,795,551	1.6	中国邮政储蓄银行股份有限公司 H 股	11,911,000	7,025,303	0.6
BHP Group Ltd	671,963	16,642,127	1.4	康师傅控股有限公司	8,102,000	13,974,838	1.2
Brambles Ltd	3,320,561	24,359,833	2.0	万华化学集团股份有限公司 A 股 (C1)	502,500	6,491,693	0.5
Coles Group	1,083,531	11,446,062	1.0	宜宾五粮液股份有限公司 A 股 (C2)	566,247	13,441,431	1.1
Goodman Group Stapled Sec Insurance Australia Group Limited	1,080,229	10,959,735	0.9	紫金矿业集团股份有限公司 H 股	8,116,000	7,909,324	0.7
Macquarie Group Ltd	53,146	5,219,160	0.4				
Medibank Private Ltd	17,178,647	38,326,189	3.2				
Q B E Insurance Group Limited	3,292,215	24,405,893	2.1				
Rio Tinto Limited	449,183	26,971,238	2.3	香港 (15.7%)			
Santos Ltd	6,359,747	28,991,005	2.4	友邦保险控股有限公司	2,998,400	24,999,717	2.1
Telstra Corporation Limited	1,085,042	2,685,867	0.2	中银香港(控股)有限公司	6,534,500	21,768,070	1.8
Transurban Group	597,813	4,743,050	0.4	中国联塑集团控股有限公司	4,248,000	3,955,831	0.3
Westpac Banking Corporation	667,565	8,858,913	0.7	长江基建集团有限公司	1,264,000	6,448,898	0.5
Woodside Energy Group Ltd	162,101	3,299,695	0.3	中电控股有限公司	1,207,000	9,125,651	0.8
Woolworths Group Ltd	894,402	19,523,143	1.6	石药集团有限公司	404,000	400,403	0.0
				香港宽频网络有限公司	3,157,000	2,449,220	0.2
中国 (18.2%)							
				香港电讯信托与香港电讯有限公 司	8,600,000	10,079,109	0.8
中国建设银行股份有限公司 H 股	38,276,000	22,136,975	1.9	香港交易及结算所有限公司	555,435	19,076,074	1.6
中国招商银行股份有限公司 H 股	3,670,000	17,064,549	1.4	昆仑能源有限公司	15,942,000	11,514,942	1.0
中国海外发展有限公司	2,815,500	7,334,740	0.6	领展房地产投资信托基金	2,670,540	18,677,008	1.6
华润置地有限公司	3,510,000	13,816,609	1.2	敏华控股有限公司	5,574,400	3,550,619	0.3
中国长江电力股份有限公司 A 股 (C1)	5,760,150	18,373,272	1.5	网易股份有限公司	2,041,800	30,822,469	2.6
福耀玻璃工业集团股份有限公司 H 股	3,583,600	14,471,537	1.2	新鸿基地产发展有限公司	1,466,000	16,219,582	1.4
海尔智家股份有限公司 H 股	3,050,801	9,346,841	0.8	信义玻璃控股有限公司	5,513,000	8,020,288	0.7
内蒙古伊利实业集团股份有限公 司 A 股(C1)	4,691,264	21,702,151	1.8	印度 (3.1%)			
顾家家居股份有限公司 A 股(C1)	802,780	4,497,455	0.4	Infosys Technologies Ltd Sponsored ADR	1,778,621	30,183,199	2.6
江苏宁沪高速公路股份有限公司 H 股	8,028,000	6,023,633	0.5	Power Grid Corp of India Ltd	2,385,535	6,222,529	0.5
美的集团股份有限公司 A 股(C2)	2,557,164	17,687,067	1.5	印度尼西亚 (5.9%)			
				Bank Central Asia	46,455,000	26,083,747	2.2

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	公平值 美元	占资产净 值百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
印度尼西亚 (续)							
Bank Rakyat Indonesia				泰国 (2.0%)			
Persero	95,314,200	28,104,466	2.3	Advanced Information			
Telkom Indonesia Persero	56,842,100	16,648,548	1.4	Service PCL	1,806,700	9,340,045	0.8
				SCB X PCL	2,091,200	5,765,769	0.5
				SCB X PCL NVDR	899,500	2,480,064	0.2
				Tisco Financial Group PCL	2,309,500	5,678,847	0.5
韩国 (10.3%)							
BGF Retail Co Ltd	61,106	7,068,598	0.6				
Hana Financial Holdings	281,414	6,972,899	0.6				
Hyundai Motor Co Ltd Pref	31,419	1,838,101	0.2	英国 (0.8%)			
KB Financial Group	237,746	7,261,830	0.6	RIO Tinto PLC	183,477	10,027,761	0.8
Kiwoom Securities Co Ltd	92,427	4,890,420	0.4				
LG Chem Limited Preference					1,195,682,210		100.3
Shares	35,922	6,327,213	0.5				
LG Chemical	8,014	3,002,379	0.2				
Samsung Electronics Co Ltd	1,866,961	69,291,696	5.8	(II) 衍生性产品 (-1.3%)			
Samsung Fire and Marine							
Insurance Company Limited	73,703	9,478,823	0.8	远期外汇合约 (-1.3%)		(15,383,026)	(1.3)
SK Telecom Company Limited	191,332	6,793,643	0.6				
马来西亚 (0.5%)							
CIMB Group Holdings BHD	5,779,300	6,393,748	0.5	总上市投资		1,180,299,184	99.0
				其他净资产		12,242,274	1.0
新加坡 (9.4%)							
AIMS APAC REIT Management							
Ltd REIT	5,247,119	4,680,683	0.4	截至二零二二年九月三十日可赎回			
DBS Group Holdings Ltd	1,728,921	40,231,843	3.4	回份额持有人应占净资产		1,192,541,458	100.0
Mapletree Logistics Trust REIT	13,350,127	14,514,042	1.2				
Singapore Exchange Limited	2,918,500	19,241,069	1.6				
United Overseas Bank Ltd	1,803,300	32,876,387	2.8	总投资, 按成本		1,367,160,588	
台湾 (12.3%)							
智邦科技股份有限公司	781,000	6,703,282	0.6				
研华股份有限公司	746,383	6,899,852	0.6				
日月光投资控股股份有限公司	1,522,000	3,839,875	0.3				
可成科技股份有限公司	127,000	690,022	0.1				
儒鸿企业股份有限公司	835,000	10,309,616	0.9				
亿丰综合工业股份有限公司	755,000	5,980,740	0.5				
统一超商香港控股有限公司	1,666,000	14,823,931	1.2				
台湾积体电路制造股份有限公司	6,341,000	84,283,033	7.0				
纬颖科技服务股份有限公司	530,000	13,488,299	1.1				

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		
股票		
澳大利亚	22.1	15.2
中国	18.2	15.3
香港	15.7	18.1
台湾	12.3	17.1
韩国	10.3	11.5
新加坡	9.4	7.6
印度尼西亚	5.9	5.0
印度	3.1	4.4
泰国	2.0	3.6
英国	0.8	1.8
马来西亚	0.5	-
衍生性产品		
远期外汇合约	(1.3)	(0.5)
总上市投资	<u>99.0</u>	<u>99.1</u>
其他净资产	<u>1.0</u>	<u>0.9</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)

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。

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	-
最高总敞口	-
平均总敞口	-

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	-
最高净敞口	-
平均净敞口	-

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

财务状况表

截至二零二二年九月三十日

	2022 美元	2021 美元
资产		
流动资产		
银行现金	25,815,350	15,996,141
应收经纪款项	2,786,163	7,220,184
分配应收款项	1,897,843	9,810,492
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 11]	1,604,195	1,108,362
投资 [附注 4(l)(a)]	1,195,682,210	1,292,211,675
股息及其他应收款项	1,302,757	4,174,450
总资产	1,229,088,518	1,330,521,304

负债		
流动负债		
短期银行借款 - 无抵押 [附注 9]	-	2,000,000
应付经纪款项	3,631,468	8,443,967
赎回应付款项	8,622,901	8,051,088
应付收益分配 [附注 6]	5,610,708	4,997,620
衍生性产品 [附注 4(l)(a), 11]	16,987,221	7,161,756
应付税项 [附注 7]	-	432,561
其他应付款项	1,694,762	1,768,064
总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)	36,547,060	32,855,056

可赎回份额持有人应占净资产		
[附注 3]	1,192,541,458	1,297,666,248

由受托人及管理人于二零二三年一月二十日批准

签署人:

汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司, 受托人

摩根基金(亚洲)有限公司, 管理人

综合收益表

截至二零二二年九月三十日止年度

	2022 美元	2021 美元
收入		
投资及衍生性产品净(亏损) / 收益 [附注 5]	(389,415,644)	296,321,658
股息收入	52,027,054	52,184,353
存款利息 [附注 8(i), 8(j)]	33,737	72,300
汇兑净亏损	(2,130,937)	(1,200,454)
其他收入	354	1,488,906
	(339,485,436)	348,866,763
支出		
管理费用 [附注 8(e)]	19,970,142	19,025,377
交易成本 [附注 8(i), 8(j)]	2,197,260	2,777,672
托管费用及银行费用 [附注 8(i), 8(j)]	525,339	630,581
受托人费用 [附注 8(g)]	368,804	352,145
基金注册登记机构费用 [附注 8(h)]	247,594	284,187
法律及专业费用	26,507	35,084
估值费用 [附注 8(e)]	17,150	17,220
核数师酬金	16,205	41,432
印刷及出版支出	6,220	11,139
其他经营费用 [附注 8(j)]	17,691	16,432
	23,392,912	23,191,269
净经营(亏损) / 利润	(362,878,348)	325,675,494

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	2021		2022	2021
	美元	美元		美元	美元
财务成本			年初可赎回份额持有人应占净资产		
收益分配 [附注 6]	(61,929,863)	(52,861,098)	产	1,297,666,248	1,102,603,422
利息支出 [附注 8(j)]	(25,024)	(12,427)		-----	-----
	<u>(61,954,887)</u>	<u>(52,873,525)</u>	分配可赎回份额 [附注 3]	982,395,736	766,957,167
	-----	-----	赎回可赎回份额 [附注 3]	(659,534,205)	(839,932,539)
除税前 (亏损) / 利润	(424,833,235)	272,801,969	净分配 / (赎回)	322,861,531	(72,975,372)
税项 [附注 7]	(3,153,086)	(4,763,771)		-----	-----
	<u>(427,986,321)</u>	<u>268,038,198</u>	可赎回份额持有人应占净资产及	1,620,527,779	1,029,628,050
总综合收益之 (减少) / 增加	<u>(427,986,321)</u>	<u>268,038,198</u>	总综合收益之 (减少) / 增加	(427,986,321)	268,038,198
	=====	=====		-----	-----
			年末可赎回份额持有人应占净资产		
			产	1,192,541,458	1,297,666,248
				=====	=====

第八至五十八页之附注乃属本财务报表之一部分。

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	12,810,931	4,337,186
购入投资及衍生性产品	(973,096,517)	(813,554,398)	年初现金及现金等价物	13,996,141	9,423,325
出售投资及衍生性产品所得款项	689,162,998	913,480,444	现金及现金等价物之汇兑 (亏损) / 收益	(991,722)	235,630
已收股息	52,905,608	53,158,140	年末现金及现金等价物	25,815,350	13,996,141
已收利息	33,825	75,925			
已付基金注册登记机构费用	(256,385)	(281,376)	现金及现金等价物余额分析:		
已付受托人费用	(368,960)	(347,856)	银行现金	25,815,350	15,996,141
已付交易成本	(2,198,420)	(2,773,421)	短期银行借款 - 无抵押	-	(2,000,000)
已付税项	(3,585,647)	(4,331,210)			
已付管理费用	(19,986,341)	(18,811,207)			
其他	196,576	(2,654,403)			
经营业务所 (运用) / 产生之 现金净额	(257,193,263)	123,960,638		25,815,350	13,996,141
	-----	-----			
融资活动					
已付利息	(25,024)	(12,427)			
分配可赎回份额所得款项	990,308,385	767,231,908			
赎回可赎回份额付款	(658,962,392)	(834,923,277)			
已付收益分配	(61,316,775)	(51,919,656)			
融资活动所产生 / (运用) 之 现金净额	270,004,194	(119,623,452)			
	-----	-----			

第八至五十八页之附注乃属本财务报表之一部分。

财务报表之附注

1 本基金

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

本基金的投资目标为通过主要投资（即至少为资产净值总额的 70%）于亚太区（日本除外）内的、投资管理预期会派发股息的公司之股票，以提供收益及长期资本增长。本基金所持有的此等股票将根据公司的过往派息纪录及公告，以及其长期资本增长潜力而挑选。

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

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

2 主要会计政策

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

(a) 财务报表之编制基础

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

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

于二零二一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的新准则、对准则的修订和解释

若干新准则、对准则的修订和解释在二零二一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。

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

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。

确认、取消确认及计量

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

公允价值估计

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

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

公允价值级次分层间的转拨

在公允价值级次分层之间的转拨视为于报告期间开始时已发生。

(c) 金融工具抵销

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

(d) 收入及支出

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

投资利息收入乃作为投资及衍生性产品净收益/亏损的一部分，在综合收益表确认。

银行现金及短期存款利息收入乃按实际利息法在综合收益表确认。

支出乃按应计基准在综合收益表确认。

(e) 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。

(f) 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。

(g) 现金及现金等价物

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

(h) 应收/应付经纪款项

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

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

(i) 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。

(j) 应付可赎回份额持有人的收益分配

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

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

2022

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目：					
年初	15,818,277.479	7,456,412.191	1,919,678.947	4,439,007.661	1,196,639.730
总分配	9,808,710.204	2,914,273.637	943,488.446	4,725,723.527	1,811,029.726
总赎回	(6,826,633.243)	(2,233,451.843)	(789,621.513)	(2,626,359.591)	(1,181,506.059)
年末	18,800,354.440	8,137,233.985	2,073,545.880	6,538,371.597	1,826,163.397
	澳元	加元	欧元	英镑	港元

可赎回份额持有人应占净资产	136,342,047	61,318,511	16,395,953	50,842,961	22,555,210
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	7.25	7.54	7.91	7.78	12.35

	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲 份额 (累计) 份额
已发行份额数目：					
年初	161,313,873.521	4,705,292.384	1,911,295.530	1,891,564.740	7,641,018.160
总分配	184,403,557.316	2,869,581.893	737,816.370	262,168.680	1,519,402.130
总赎回	(93,500,232.860)	(1,572,783.367)	(1,007,208.320)	(534,481.920)	(4,366,369.620)
年末	252,217,197.977	6,002,090.910	1,641,903.580	1,619,251.500	4,794,050.670
	港元	纽元	人民币	人民币	人民币

可赎回份额持有人应占净资产	2,032,712,595	44,500,103	16,266,496	13,778,756	46,975,544
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	8.06	7.41	9.91	8.51	9.80

2022

	PRC 人民币对冲份额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目：					
年初	10,422,468.550	2,137,889.830	1,822,820.030	1,342,654.039	149,221,298.724
总分配	1,884,652.570	240,242.810	260,076.430	528,998.453	71,351,769.244
总赎回	(2,925,695.420)	(765,779.730)	(627,599.940)	(395,040.657)	(45,642,880.831)
年末	9,381,425.700	1,612,352.910	1,455,296.520	1,476,611.835	174,930,187.137
	人民币	美元	美元	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	74,167,080	15,063,976	11,651,113	21,813,168	1,431,961,989
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	7.91	9.34	8.01	14.77	8.19
	新加坡元对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每季派息) 份额
已发行份额数目：					
年初	1,056,230.405	452,651.110	30,511,465.339	11,819,722.942	1,026,607.148
总分配	224,863.903	328,417.745	29,587,741.366	1,416,970.279	9,467,061.281
总赎回	(500,701.051)	(85,959.615)	(17,961,819.946)	(10,922,754.816)	(1,795,428.782)
年末	780,393.257	695,109.240	42,137,386.759	2,313,938.405	8,698,239.647
	新加坡元	美元	美元	美元	美元
可赎回份额持有人应占 净资产	5,996,821	8,520,838	335,998,871	19,480,421	80,422,237
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	7.68	12.26	7.97	8.42	9.25

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	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	18,288,390.411	8,291,310.412	1,353,952.956	3,644,545.871	1,315,720.065
总分配	7,837,392.547	4,405,435.941	1,603,664.434	2,805,232.357	2,200,925.928
总赎回	(10,307,505.479)	(5,240,334.162)	(1,037,938.443)	(2,010,770.567)	(2,320,006.263)
年末	15,818,277.479	7,456,412.191	1,919,678.947	4,439,007.661	1,196,639.730
	澳元	加元	欧元	英镑	港元
可赎回份额持有人应占净 资产	149,977,939	73,226,870	19,759,475	44,864,442	18,177,591
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	9.48	9.82	10.29	10.11	15.19
	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲 份额 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	160,240,761.757	4,742,186.011	3,171,514.040	3,359,026.210	18,955,920.350
总分配	112,926,912.871	2,598,022.076	2,363,748.190	202,623.690	5,907,567.450
总赎回	(111,853,801.107)	(2,634,915.703)	(3,623,966.700)	(1,670,085.160)	(17,222,469.640)
年末	161,313,873.521	4,705,292.384	1,911,295.530	1,891,564.740	7,641,018.160
	港元	纽元	人民币	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	1,669,881,158	45,460,057	21,317,997	18,880,389	91,573,350
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	10.35	9.66	11.15	9.98	11.98

2021

	PRC 人民币对冲份额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	22,429,544.450	3,652,162.510	3,347,321.140	972,733.833	141,673,624.018
总分配	4,967,077.560	1,125,551.220	1,026,605.780	804,732.636	69,435,740.170
总赎回	(16,974,153.460)	(2,639,823.900)	(2,551,106.890)	(434,812.430)	(61,888,065.464)
年末	10,422,468.550	2,137,889.830	1,822,820.030	1,342,654.039	149,221,298.724
	人民币	美元	美元	人民币	人民币
可赎回份额持有人应 占净资产	107,106,589	24,790,120	18,911,109	24,230,222	1,586,493,943
可赎回份额持有人应 占净资产 (每份 额)	10.28	11.60	10.37	18.05	10.63
	新加坡元对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每季派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	666,937.330	293,253.873	34,126,677.797	10,021,705.390	914,860.915
总分配	675,782.023	469,730.561	20,835,764.033	3,488,167.882	204,085.930
总赎回	(286,488.948)	(310,333.324)	(24,450,976.491)	(1,690,150.330)	(92,339.697)
年末	1,056,230.405	452,651.110	30,511,465.339	11,819,722.942	1,026,607.148
	新加坡元	美元	美元	美元	美元
可赎回份额持有人应占 净资产	10,554,577	6,882,906	315,082,437	127,689,157	12,216,484
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	9.99	15.21	10.33	10.80	11.90

4 财务风险管理

(I) 财务风险因素

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

(a) 市场风险

(i) 市场价格风险

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

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

截至九月三十日，投资及衍生性产品之公平值及其估计市场敏感度如下：

	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>				
股票				
- 澳大利亚	263,484,792	22.1	197,009,437	15.2
- 中国	216,672,538	18.2	198,028,811	15.3
- 香港	187,107,881	15.7	235,209,886	18.1
- 台湾	147,018,650	12.3	222,419,335	17.1
- 韩国	122,925,602	10.3	148,989,358	11.5
- 新加坡	111,544,024	9.4	98,387,607	7.6
- 印度尼西亚	70,836,761	5.9	64,468,483	5.0
- 其他	76,091,962	6.4	127,698,758	9.8
	<u>1,195,682,210</u>	<u>100.3</u>	<u>1,292,211,675</u>	<u>99.6</u>
衍生性产品				
- 远期外汇合约	1,604,195	0.1	1,108,362	0.1
	<u>1,197,286,405</u>	<u>100.4</u>	<u>1,293,320,037</u>	<u>99.7</u>

	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				
负债				
衍生性产品				
- 远期外汇合约	(16,987,221)	(1.4)	(7,161,756)	(0.6)
总上市投资	1,180,299,184	99.0	1,286,158,281	99.1

有关衍生性产品的风险亦请参阅附注 11。

	资产净值 美元	本基金相关基准指数 (注*)	Beta 值 (注**)	占相关基准指数之合 理变动百分比 (注***)	估计对资产净值 的影响 (注****)
					美元
MSCI AC Asia Pacific					
截至二零二二年九月三十日	1,192,541,458	ex Japan Net	0.91	-27.0	(293,007,436)
MSCI AC Asia Pacific					
截至二零二一年九月三十日	1,297,666,248	ex Japan Net	0.94	+16.6	202,487,841

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

注：

* 本基金相关基准指数指投资管理人监测本基金市场价格风险时所使用的有关市场指数。

** Beta 值计量了在过去最长三十六个月期间或自组合启动后的数月期间，本基金回报与各基准指数之间的统计关系。对于推出期间少于十二个月内推出的基金，将采用本基金的每周回报计算 Beta 值。

*** 合理变动百分比取决于过去十二个月的基准指数之实际历史变动，但不包括不大可能出现或“最恶劣”情况或“压力测试”下之变动，亦不代表投资管理人对本基金未来回报的预测。对于推出期间少于十二个月的基金，将采用自经营开始后基准指数之实际历史变动计算合理变动百分比。

**** 假定所有其他变量保持不变，对本基金资产净值的估计影响按照本基金资产净值乘以相关 Beta 值再乘以相关基准指数之合理变动百分比计算。

(ii) 利率风险

利率风险指金融工具的价值或未来现金流量因市场利率变动而波动不定的风险。

下表按剩余到期日分类，概述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。

	2022	2021
	1 个月以内	1 个月以内
	美元	美元
银行现金	25,815,350	15,996,141
短期银行借款 - 无抵押	-	(2,000,000)
	<u>25,815,350</u>	<u>13,996,141</u>
总利率敏感性缺口	<u>25,815,350</u>	<u>13,996,141</u>

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

(iii) 汇兑风险

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

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

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

汇兑风险承担净值 (注*)	美元等值	与美元比较之合理	估计对资产净值的
		变动百分比	影响
		(注**)	美元
<u>2022</u>			
澳元	351,935,772	-11.0	(38,712,935)
加元	44,783,459	-7.8	(3,493,110)
人民币 (离岸)	312,800,096	-9.5	(29,716,009)
欧元	16,131,664	-15.5	(2,500,408)
港元	317,520,115	-0.8	(2,540,161)
印度卢比	6,222,529	-8.8	(547,583)
印尼盾	70,836,761	-6.0	(4,250,206)
韩元	119,781,846	-17.2	(20,602,478)
马来西亚林吉特	6,555,773	-9.7	(635,910)

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
纽元	25,494,563	-18.0	(4,589,021)
新加坡元	115,994,971	-5.4	(6,263,728)
英镑	66,828,349	-17.2	(11,494,476)
台币	147,517,467	-12.2	(17,997,131)
泰铢	23,264,725	-10.3	(2,396,267)
	<u>1,625,668,090</u>		<u>(145,739,423)</u>

2021

澳元	306,164,535	+0.8	2,449,316
加元	57,629,324	+5.4	3,111,983
人民币 (离岸)	346,913,126	+5.1	17,692,569
欧元	22,829,217	-1.2	(273,951)
港元	365,174,528	-0.4	(1,460,698)
印度卢比	18,492,616	-0.6	(110,956)
印尼盾	64,468,483	+4.0	2,578,739
韩元	151,287,796	-1.2	(1,815,454)
纽元	31,455,861	+4.4	1,384,058
新加坡元	106,883,774	+0.6	641,303
英镑	84,058,982	+4.3	3,614,536
台币	228,210,050	+4.0	9,128,402
泰铢	44,331,751	-6.3	(2,792,900)
	<u>1,827,900,043</u>		<u>34,146,947</u>

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

注：

* 资产及负债汇兑风险承担净值包括货币及非货币资产及负债。

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

(b) 信贷风险

信贷风险指交易对手无法于到期日支付全数金额的风险。

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

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，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后即时付款。若任何一方不能履行其责任，交易将告失效。

下表概述本基金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)	2,607,831	7,097,700
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	23,207,519	8,898,441
经纪发行的衍生性产品		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	936,404	244,900
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	667,791	863,462
托管机构的投资余额		
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	1,195,682,210	1,292,211,675

(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
短期银行借款 - 无抵押	-	-	2,000,000	-
应付经纪款项	3,631,468	-	8,443,967	-
赎回应付款项	8,622,901	-	8,051,088	-
应付收益分配	5,610,708	-	4,997,620	-
衍生性产品	16,987,162	59	7,152,957	8,799
其他应付款项	1,694,762	-	1,768,064	-
可赎回份额持有人应占净资产	1,192,541,458	-	1,297,666,248	-
总金融负债	1,229,088,459	59	1,330,079,944	8,799

投资管理人通过投资于预期一般在一个月內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融工具 美元		抵押品及保证金 美元		净额 美元
	资产总额 美元	金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	净额 美元			
<u>2022</u>							
<u>资产</u>							
衍生性产品	1,604,195	(1,206,777)	-			397,418	
按公允价值透过损益列账的金融资产	1,604,195	(1,206,777)	-			397,418	

	财务状况表中列示的经确认金融		受总抵销安排及类似协议规限的相关金额		净额 美元
	负债总额	金融工具	抵押品及保证金		
	美元	美元	美元		
<u>2022</u>					
<u>负债</u>					
衍生性产品	16,987,221	(1,206,777)	-		15,780,444
按公允价值透过损益列账的金融负债	16,987,221	(1,206,777)	-		15,780,444

	财务状况表中列示的经确认金融		受总抵销安排及类似协议规限的相关金额		净额 美元
	资产总额	金融工具	抵押品及保证金		
	美元	美元	美元		
<u>2021</u>					
<u>资产</u>					
衍生性产品	990,585	(226,556)	-		764,029
按公允价值透过损益列账的金融资产	990,585	(226,556)	-		764,029

	财务状况表中列示的经确认金融		受总抵销安排及类似协议规限的相关金额		净额 美元
	负债总额	金融工具	抵押品及保证金		
	美元	美元	美元		
<u>负债</u>					
衍生性产品	6,001,191	(226,556)	-		5,774,635
按公允价值透过损益列账的金融负债	6,001,191	(226,556)	-		5,774,635

(II) 资本风险管理

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

为了维持资本结构，本基金的政策执行如下：

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

(III) 公允价值估计

截至二零二二年及二零二一年九月三十日，管理层认为资产及负债的账面价值与公允价值相若。

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

- 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）按公允价值级次计量之公允价值：

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

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>2021</u>				
<u>资产</u>				
股票	1,292,211,675	-	-	1,292,211,675
衍生性产品	-	1,108,362	-	1,108,362
按公允价值透过损益列账的总金融资产	1,292,211,675	1,108,362	-	1,293,320,037
<u>负债</u>				
衍生性产品	-	7,161,756	-	7,161,756
按公允价值透过损益列账的总金融负债	-	7,161,756	-	7,161,756

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 美元	2021 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益／亏损之变动	(344,940,585)	121,863,151
投资及衍生性产品销售之实现（亏损）／收益	(44,475,059)	174,458,507
	(389,415,644)	296,321,658

6 收益分配

一旦该金额不足以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 0.0309	15,798,906.499	(368,556)	
加元对冲类别（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	加元 0.0337	7,453,695.731	(203,648)	
欧元对冲类别（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	欧元 0.0287	1,907,573.206	(63,926)	
英镑对冲类别（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	英镑 0.0339	4,437,121.286	(207,562)	
港元类别（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	港元 0.0350	162,705,608.385	(732,220)	
纽元对冲类别（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	纽元 0.0351	4,572,868.313	(115,766)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	人民币 0.0335	1,858,625.180	(9,746)	
PRC 人民币对冲份额 （每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	人民币 0.0625	10,229,138.600	(100,067)	
PRC 美元份额（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	美元 0.0352	1,808,866.930	(63,672)	
人民币对冲类别（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	人民币 0.0646	149,162,983.922	(1,508,218)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	新加坡元 0.0348	1,042,064.115	(26,977)	
美元类别（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	美元 0.0350	30,357,742.018	(1,062,521)	
美元 C 类别（每月派息）	2021年10月29日	2021年11月8日	美元 0.0366	11,962,302.095	(437,820)	
澳元对冲类别（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	澳元 0.0310	15,535,818.497	(342,714)	
加元对冲类别（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	加元 0.0336	7,566,053.334	(198,725)	
欧元对冲类别（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	欧元 0.0288	1,922,166.764	(62,381)	
英镑对冲类别（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	英镑 0.0339	5,182,332.610	(233,586)	
港元类别（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	港元 0.0351	161,286,375.091	(725,826)	
纽元对冲类别（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	纽元 0.0368	4,508,711.948	(112,718)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	人民币 0.0335	1,828,453.790	(9,583)	
PRC 人民币对冲份额 （每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	人民币 0.0580	10,127,002.910	(91,897)	
PRC 美元份额（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	美元 0.0351	1,779,314.100	(62,454)	
人民币对冲类别（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	人民币 0.0600	147,383,622.819	(1,383,537)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	新加坡元 0.0352	988,788.466	(25,397)	
美元类别（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	美元 0.0350	30,347,912.578	(1,062,177)	
美元 C 类别（每月派息）	2021年11月30日	2021年12月8日	美元 0.0366	11,591,153.345	(424,236)	
澳元对冲类别（每月派息）	2021年12月31日	2022年1月10日	澳元 0.0289	15,439,413.106	(323,651)	
加元对冲类别（每月派息）	2021年12月31日	2022年1月10日	加元 0.0309	7,499,750.852	(181,226)	
欧元对冲类别（每月派息）	2021年12月31日	2022年1月10日	欧元 0.0241	1,928,066.905	(52,651)	
英镑对冲类别（每月派息）	2021年12月31日	2022年1月10日	英镑 0.0299	5,118,707.487	(206,563)	
港元类别（每月派息）	2021年12月31日	2022年1月10日	港元 0.0352	158,660,355.660	(715,969)	
纽元对冲类别（每月派息）	2021年12月31日	2022年1月10日	纽元 0.0365	4,484,140.659	(111,910)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2021年12月31日	2022年1月10日	人民币 0.0334	1,660,992.020	(8,701)	
PRC 人民币对冲份额 （每月派息）	2021年12月31日	2022年1月10日	人民币 0.0584	9,774,689.520	(89,535)	
PRC 美元份额（每月派息）	2021年12月31日	2022年1月10日	美元 0.0352	1,677,425.250	(59,045)	
人民币对冲类别（每月派息）	2021年12月31日	2022年1月10日	人民币 0.0604	143,600,341.247	(1,360,404)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2022 美元	2021 美元
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	新加坡元 0.0356	817,879.670	(21,533)	
美元类别 (每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	美元 0.0350	30,704,122.424	(1,074,644)	
美元 C 类别 (每季派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	美元 0.1220	1,036,816.691	(126,492)	
美元 C 类别 (每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	美元 0.0367	11,758,882.180	(431,551)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	澳元 0.0312	16,403,034.997	(357,961)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	加元 0.0334	7,345,515.442	(192,085)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	欧元 0.0275	1,771,264.990	(54,387)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	英镑 0.0346	4,581,222.799	(212,626)	
港元类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	港元 0.0351	187,328,523.797	(843,665)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	纽元 0.0369	4,851,026.702	(117,372)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年1月28日	2022年2月11日	人民币 0.0333	1,674,464.160	(8,754)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年1月28日	2022年2月11日	人民币 0.0547	9,356,237.910	(80,346)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年1月28日	2022年2月11日	美元 0.0352	1,626,483.210	(57,252)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	人民币 0.0566	148,981,499.568	(1,324,644)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	新加坡元 0.0355	851,113.446	(22,285)	
美元类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	美元 0.0350	35,744,141.658	(1,251,045)	
美元 C 类别 (每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	美元 0.0368	1,604,735.010	(59,054)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	澳元 0.0310	16,946,854.617	(379,646)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	加元 0.0338	6,957,953.515	(184,606)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	欧元 0.0284	1,711,901.488	(54,673)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	英镑 0.0363	4,503,171.270	(219,329)	
港元类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	港元 0.0351	199,777,385.278	(897,968)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	纽元 0.0375	5,176,586.920	(130,809)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	人民币 0.0332	1,653,700.390	(8,701)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	人民币 0.0573	9,725,827.860	(88,319)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	美元 0.0352	1,615,115.730	(56,852)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	人民币 0.0593	152,298,923.969	(1,430,229)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	新加坡元 0.0352	804,466.281	(20,925)	
美元类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	美元 0.0350	39,566,506.879	(1,384,828)	
美元 C 类别 (每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	美元 0.0368	1,644,973.315	(60,535)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	澳元 0.0285	17,181,177.650	(367,713)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	加元 0.0329	6,913,334.379	(182,097)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	欧元 0.0247	1,691,630.294	(46,490)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	英镑 0.0351	4,562,806.621	(210,867)	
港元类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	港元 0.0352	213,456,752.438	(959,430)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	纽元 0.0369	5,159,539.075	(132,424)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	人民币 0.0334	1,676,555.190	(8,821)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	人民币 0.0592	9,792,978.500	(91,326)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	美元 0.0351	1,603,181.650	(56,272)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	人民币 0.0612	154,417,281.152	(1,488,688)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	新加坡元 0.0346	814,104.778	(20,813)	
美元类别 (每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	美元 0.0350	40,968,152.226	(1,433,885)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2022 美元	2021 美元
美元 C 类别 (每季派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	美元 0.1222	9,515,622.001	(1,162,809)	
美元 C 类别 (每月派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	美元 0.0368	1,747,637.786	(64,313)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	澳元 0.0285	18,076,561.926	(366,114)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	加元 0.0348	7,022,342.786	(191,211)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	欧元 0.0248	1,645,532.186	(43,051)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	英镑 0.0358	5,333,293.788	(239,715)	
港元类别 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	港元 0.0353	236,497,541.330	(1,064,007)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	纽元 0.0369	5,473,484.296	(131,089)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	人民币 0.0338	1,684,618.190	(8,573)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	人民币 0.0560	9,942,344.240	(83,830)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	美元 0.0351	1,576,157.730	(55,323)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	人民币 0.0580	161,050,808.164	(1,406,409)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	新加坡元 0.0351	719,357.406	(18,285)	
美元类别 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	美元 0.0350	42,573,839.023	(1,490,083)	
美元 C 类别 (每月派息)	2022 年 4 月 29 日	2022 年 5 月 11 日	美元 0.0368	1,756,733.409	(64,648)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022 年 5 月 31 日	2022 年 6 月 9 日	澳元 0.0276	18,410,099.521	(364,499)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022 年 5 月 31 日	2022 年 6 月 9 日	加元 0.0343	7,389,925.942	(200,399)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2022 年 5 月 31 日	2022 年 6 月 9 日	欧元 0.0223	1,692,301.447	(40,427)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022 年 5 月 31 日	2022 年 6 月 9 日	英镑 0.0345	5,606,007.776	(243,751)	
港元类别 (每月派息)	2022 年 5 月 31 日	2022 年 6 月 9 日	港元 0.0354	242,703,005.003	(1,095,103)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022 年 5 月 31 日	2022 年 6 月 9 日	纽元 0.0359	5,618,039.935	(131,288)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022 年 5 月 31 日	2022 年 6 月 9 日	人民币 0.0351	1,791,321.800	(9,413)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022 年 5 月 31 日	2022 年 6 月 9 日	人民币 0.0528	9,852,729.120	(77,885)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2022 年 5 月 31 日	2022 年 6 月 9 日	美元 0.0351	1,537,123.360	(53,953)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2022 年 5 月 31 日	2022 年 6 月 9 日	人民币 0.0546	165,334,439.855	(1,351,508)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022 年 5 月 31 日	2022 年 6 月 9 日	新加坡元 0.0350	739,170.379	(18,871)	
美元类别 (每月派息)	2022 年 5 月 31 日	2022 年 6 月 9 日	美元 0.0350	42,339,760.367	(1,481,890)	
美元 C 类别 (每月派息)	2022 年 5 月 31 日	2022 年 6 月 9 日	美元 0.0369	2,103,036.589	(77,602)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022 年 6 月 30 日	2022 年 7 月 11 日	澳元 0.0287	18,737,388.159	(369,792)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022 年 6 月 30 日	2022 年 7 月 11 日	加元 0.0338	8,101,885.406	(212,290)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2022 年 6 月 30 日	2022 年 7 月 11 日	欧元 0.0193	1,859,831.102	(37,526)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022 年 6 月 30 日	2022 年 7 月 11 日	英镑 0.0322	5,864,002.779	(229,313)	
港元类别 (每月派息)	2022 年 6 月 30 日	2022 年 7 月 11 日	港元 0.0354	262,000,559.649	(1,181,965)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022 年 6 月 30 日	2022 年 7 月 11 日	纽元 0.0365	6,247,705.421	(141,785)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022 年 6 月 30 日	2022 年 7 月 11 日	人民币 0.0350	1,793,737.200	(9,364)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022 年 6 月 30 日	2022 年 7 月 11 日	人民币 0.0434	9,682,950.620	(62,683)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2022 年 6 月 30 日	2022 年 7 月 11 日	美元 0.0352	1,550,925.410	(54,593)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2022 年 6 月 30 日	2022 年 7 月 11 日	人民币 0.0449	170,270,705.404	(1,140,353)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022 年 6 月 30 日	2022 年 7 月 12 日	新加坡元 0.0343	841,412.694	(20,737)	
美元类别 (每月派息)	2022 年 6 月 30 日	2022 年 7 月 11 日	美元 0.0350	44,448,080.366	(1,555,682)	
美元 C 类别 (每季派息)	2022 年 6 月 30 日	2022 年 7 月 11 日	美元 0.1226	9,362,815.428	(1,147,881)	
美元 C 类别 (每月派息)	2022 年 6 月 30 日	2022 年 7 月 11 日	美元 0.0369	2,176,046.528	(80,296)	

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)	2022年7月29日	2022年8月8日	澳元 0.0293	19,279,019.391	(394,170)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	加元 0.0336	8,342,211.586	(218,752)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	欧元 0.0158	2,090,464.294	(33,678)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	英镑 0.0290	6,090,757.550	(214,943)	
港元类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	港元 0.0354	265,366,854.788	(1,196,701)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	纽元 0.0346	6,595,193.832	(143,089)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	人民币 0.0354	1,737,000.660	(9,106)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	人民币 0.0357	9,651,494.220	(51,025)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	美元 0.0352	1,516,237.460	(53,372)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	人民币 0.0371	180,003,324.326	(988,941)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	新加坡元 0.0339	849,916.266	(20,835)	
美元类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	美元 0.0350	44,411,156.248	(1,554,389)	
美元 C 类别 (每月派息)	2022年7月29日	2022年8月8日	美元 0.0369	2,228,273.039	(82,223)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	澳元 0.0280	18,898,308.920	(362,760)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	加元 0.0340	8,189,367.786	(212,613)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	欧元 0.0153	2,140,469.713	(32,931)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	英镑 0.0283	6,466,149.431	(212,929)	
港元类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	港元 0.0354	265,284,076.361	(1,196,488)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	纽元 0.0342	6,250,013.611	(131,050)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	人民币 0.0360	1,729,793.220	(9,034)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	人民币 0.0301	9,507,747.020	(41,515)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	美元 0.0352	1,493,334.820	(52,566)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	人民币 0.0312	177,269,593.214	(802,317)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	新加坡元 0.0326	850,198.674	(19,867)	
美元类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	美元 0.0350	43,521,703.591	(1,523,258)	
美元 C 类别 (每月派息)	2022年8月31日	2022年9月8日	美元 0.0369	2,243,012.581	(82,767)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	澳元 0.0282	18,802,855.481	(340,918)	
加元对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	加元 0.0350	8,137,233.985	(207,273)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	欧元 0.0172	2,073,545.880	(34,939)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	英镑 0.0291	6,536,876.022	(212,346)	
港元类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	港元 0.0354	253,090,273.759	(1,141,339)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	纽元 0.0328	6,002,090.910	(111,359)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	人民币 0.0370	1,619,171.660	(8,403)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	人民币 0.0320	9,382,900.800	(42,116)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	美元 0.0352	1,455,296.520	(51,226)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	人民币 0.0330	175,077,078.406	(810,411)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月11日	新加坡元 0.0325	780,393.257	(17,676)	
美元类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	美元 0.0350	42,238,223.578	(1,478,338)	
美元 C 类别 (每季派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	美元 0.1229	8,696,075.145	(1,068,748)	
美元 C 类别 (每月派息)	2022年9月30日	2022年10月12日	美元 0.0370	2,313,938.405	(85,616)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	澳元 0.0271	18,130,864.663		(344,188)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	加元 0.0280	8,217,444.236		(172,145)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2022 美元	2021 美元
欧元对冲类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	欧元 0.0242	1,448,171.156		(40,855)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	英镑 0.0281	3,668,935.473		(132,892)
港元类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	港元 0.0299	157,012,691.849		(605,499)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	纽元 0.0282	4,712,611.666		(87,711)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	人民币 0.0300	3,248,728.270		(14,502)
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 0.0507	21,940,601.490		(165,517)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0302	3,303,691.880		(99,771)
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 0.0524	138,442,834.269		(1,079,412)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	新加坡元 0.0289	667,206.200		(14,093)
美元类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0300	33,114,715.026		(993,441)
美元 C 类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0312	10,142,601.086		(316,449)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	澳元 0.0262	18,178,187.874		(352,343)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	加元 0.0277	8,143,545.335		(173,848)
欧元对冲类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	欧元 0.0236	1,431,590.794		(40,369)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	英镑 0.0278	3,606,368.780		(133,793)
港元类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	港元 0.0300	153,550,044.827		(594,330)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	纽元 0.0280	4,523,399.746		(89,115)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	人民币 0.0296	3,119,868.550		(14,059)
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 0.0502	19,254,783.000		(147,154)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0302	2,957,904.430		(89,329)
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 0.0519	135,785,584.270		(1,072,881)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	新加坡元 0.0288	662,939.258		(14,271)
美元类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0300	32,804,916.454		(984,147)
美元 C 类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0312	10,772,583.813		(336,105)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	澳元 0.0238	17,648,021.240		(322,788)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	加元 0.0259	7,833,493.004		(159,028)
欧元对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	欧元 0.0196	1,330,799.135		(32,084)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	英镑 0.0244	3,588,262.790		(119,156)
港元类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	港元 0.0300	149,885,150.500		(580,025)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	纽元 0.0269	4,327,775.733		(83,861)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	人民币 0.0294	3,061,758.030		(13,840)
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 0.0510	17,167,688.390		(134,615)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0302	2,423,718.730		(73,196)
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 0.0527	134,317,479.700		(1,088,318)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	新加坡元 0.0289	670,744.269		(14,655)
美元类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0300	31,002,691.630		(930,081)
美元 C 类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.1038	972,273.489		(100,922)
美元 C 类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0312	11,217,718.590		(349,993)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	澳元 0.0254	17,654,301.191		(343,915)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	加元 0.0274	8,027,996.922		(171,782)
欧元对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	欧元 0.0218	1,604,385.409		(42,399)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	英镑 0.0268	3,899,423.311		(143,380)
港元类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	港元 0.0309	158,086,930.089		(630,052)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2022 美元	2021 美元
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月9日	纽元 0.0275	4,479,419.801		(88,212)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	人民币 0.0300	2,495,597.930		(11,563)
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 0.0513	12,528,610.260		(99,263)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0312	1,935,597.120		(60,391)
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 0.0529	140,928,247.916		(1,151,385)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	新加坡元 0.0300	885,825.193		(19,993)
美元类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0310	31,953,681.669		(990,564)
美元 C 类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0323	11,430,041.680		(369,190)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	澳元 0.0271	16,777,212.437		(361,798)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	加元 0.0289	8,092,320.726		(186,848)
欧元对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	欧元 0.0244	1,645,791.402		(49,088)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	英镑 0.0292	4,082,717.117		(168,481)
港元类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	港元 0.0309	163,576,622.364		(651,851)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	纽元 0.0292	4,263,504.170		(92,605)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	人民币 0.0300	2,252,172.940		(10,456)
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 0.0536	12,209,374.600		(101,274)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0312	1,781,672.260		(55,588)
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 0.0554	140,825,770.339		(1,207,346)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	新加坡元 0.0302	963,996.629		(22,043)
美元类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0310	33,301,097.103		(1,032,334)
美元 C 类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0323	11,611,261.651		(375,044)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	澳元 0.0272	16,677,125.909		(345,498)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	加元 0.0287	8,159,278.541		(186,316)
欧元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	欧元 0.0234	1,917,454.900		(52,734)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	英镑 0.0288	4,216,663.798		(167,551)
港元类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	港元 0.0310	168,406,366.110		(671,507)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	纽元 0.0295	4,577,870.688		(94,580)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	人民币 0.0302	2,187,354.360		(10,068)
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 0.0552	11,250,640.290		(94,653)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0312	1,747,983.370		(54,537)
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 0.0570	146,428,971.124		(1,272,092)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	新加坡元 0.0312	1,035,498.012		(24,045)
美元类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0310	34,219,177.614		(1,060,794)
美元 C 类别 (每季派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.1074	1,012,678.898		(108,762)
美元 C 类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0323	11,965,379.936		(386,482)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	澳元 0.0271	16,440,852.304		(346,034)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	加元 0.0289	7,821,025.772		(183,852)
欧元对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	欧元 0.0240	1,919,711.163		(55,804)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	英镑 0.0293	4,138,135.104		(169,092)
港元类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	港元 0.0310	169,800,649.663		(678,039)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	纽元 0.0300	4,603,419.743		(99,945)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	人民币 0.0302	2,012,417.610		(9,399)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2022 美元	2021 美元
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 0.0568	11,111,440.390		(97,604)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	美元 0.0312	1,826,523.850		(56,988)
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 0.0586	145,554,240.280		(1,319,087)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	新加坡元 0.0314	1,016,199.217		(24,055)
美元类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	美元 0.0310	33,668,510.027		(1,043,724)
美元 C 类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	美元 0.0323	11,799,825.035		(381,134)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	澳元 0.0272	16,206,429.981		(339,846)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	加元 0.0293	7,681,696.031		(186,319)
欧元对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	欧元 0.0245	2,007,692.256		(59,919)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	英镑 0.0297	4,122,907.549		(173,616)
港元类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	港元 0.0310	169,691,790.606		(677,761)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	纽元 0.0302	4,511,587.005		(98,781)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	人民币 0.0299	2,020,667.450		(9,487)
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 0.0531	11,688,073.660		(97,454)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	美元 0.0312	1,888,954.030		(58,935)
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 0.0548	143,913,251.172		(1,238,352)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	新加坡元 0.0312	1,058,373.455		(24,956)
美元类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	美元 0.0310	32,777,644.415		(1,016,107)
美元 C 类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	美元 0.0324	11,689,965.381		(378,755)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	澳元 0.0271	15,438,800.918		(314,400)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	加元 0.0297	7,562,183.260		(181,273)
欧元对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	欧元 0.0245	1,928,903.414		(56,261)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	英镑 0.0298	4,130,231.436		(170,264)
港元类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	港元 0.0310	161,257,344.021		(643,879)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	纽元 0.0300	4,498,993.245		(94,384)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	人民币 0.0301	2,067,004.990		(9,623)
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 0.0513	11,275,765.240		(89,469)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	美元 0.0311	1,909,235.330		(59,377)
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 0.0531	143,337,501.578		(1,177,242)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	新加坡元 0.0309	1,053,461.381		(24,203)
美元类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	美元 0.0310	31,839,921.634		(987,038)
美元 C 类别 (每季派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	美元 0.1075	1,039,005.356		(111,693)
美元 C 类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	美元 0.0324	11,477,229.999		(371,862)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	澳元 0.0307	16,207,420.692		(368,225)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	加元 0.0334	8,175,062.393		(219,368)
欧元对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	欧元 0.0283	1,945,742.727		(65,441)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	英镑 0.0334	4,217,799.308		(196,879)
港元类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	港元 0.0350	165,515,393.719		(745,397)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	纽元 0.0335	4,712,469.031		(110,681)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	人民币 0.0339	1,997,650.930		(10,488)
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 0.0597	10,950,621.300		(101,249)

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 0.0352	1,905,849.100		(67,086)
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 0.0618	146,369,354.001		(1,400,935)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月10日	新加坡元 0.0346	1,046,404.570		(26,763)
美元类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	美元 0.0350	31,630,346.556		(1,107,062)
美元 C 类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	美元 0.0366	11,380,156.708		(416,514)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	澳元 0.0307	15,885,297.832		(355,932)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	加元 0.0337	7,719,867.272		(206,664)
欧元对冲类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	欧元 0.0287	1,987,620.941		(67,307)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	英镑 0.0336	4,196,930.648		(194,004)
港元类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	港元 0.0351	163,162,588.941		(735,538)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	纽元 0.0339	4,736,948.216		(112,536)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	人民币 0.0341	1,918,676.030		(10,124)
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 0.0608	11,071,929.540		(104,165)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	美元 0.0352	1,869,130.300		(65,793)
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 0.0629	146,792,974.706		(1,428,725)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	新加坡元 0.0344	1,054,768.190		(26,993)
美元类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	美元 0.0350	31,188,200.287		(1,091,587)
美元 C 类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	美元 0.0366	11,878,797.201		(434,764)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	澳元 0.0306	15,760,602.185		(348,371)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月12日	加元 0.0338	7,525,573.519		(200,785)
欧元对冲类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	欧元 0.0287	1,914,891.670		(63,693)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	英镑 0.0336	4,438,028.335		(201,063)
港元类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	港元 0.0351	161,229,788.200		(726,965)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	纽元 0.0330	4,705,292.384		(107,116)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	人民币 0.0340	1,891,564.740		(9,965)
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 0.0636	10,346,118.220		(101,954)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月12日	美元 0.0352	1,822,820.030		(64,163)
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 0.0658	149,231,046.578		(1,521,445)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	新加坡元 0.0346	1,056,230.405		(26,919)
美元类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月12日	美元 0.0350	30,499,840.291		(1,067,494)
美元 C 类别 (每季派息)	2021年9月30日	2021年10月12日	美元 0.1218	1,026,607.148		(125,041)
美元 C 类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月12日	美元 0.0366	11,820,926.646		(432,646)
可赎回份额持有人之总收益分配					(61,929,863)	(52,861,098)

7 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。

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

8 与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之交易

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

(a) 以下为与受托人、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	占本基金本年 度之总交易价 值百分比	支付佣金 美元	占本基金本年 度支付之总佣 金百分比	平均佣金率 百分比
<u>2022</u>					
J.P. Morgan India Private Limited	1,525,826	0.09	610	0.07	0.04
J.P. Morgan Securities Australia Limited	37,013,888	2.17	16,975	1.88	0.05
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	88,069,315	5.17	56,971	6.29	0.06
香港上海汇丰银行有限公司	26,807,210	1.57	18,969	2.10	0.07
香港上海汇丰银行有限公司, 首尔	165,102	0.01	165	0.02	0.10
<u>2021</u>					
HSBC Securities & Capital Markets (India) Private Limited	3,738,067	0.22	4,112	0.32	0.11
J.P. Morgan India Private Limited	1,203,898	0.07	1,084	0.09	0.09
J.P. Morgan Securities Australia Limited	7,325,182	0.43	5,529	0.43	0.08
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	71,709,776	4.21	55,659	4.37	0.08
香港上海汇丰银行有限公司	51,331,005	3.02	60,003	4.71	0.12
香港上海汇丰银行有限公司, 首尔	657,590	0.04	263	0.02	0.04

(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	2,607,831	7,097,700
应收款项	793,411	2,447,825
应付款项	(1,590,113)	(1,652,488)

(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 5,224,086 美元（二零二一年：实现收益 3,634,401 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 2,908 美元（二零二一年：3,843 美元）。

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

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

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

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

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

	年初	总分配	总赎回	年末	交易利润 美元
--	----	-----	-----	----	------------

2021

摩根资产管理（亚太）有限公司

- 美元类别（累计）	63,615.058	13,300.878	(36,171.106)	40,744.830	60,538
- 美元 C 类别（每季派息）	100.000	1.029	(101.029)	-	18

JPMorgan Asset Management (S)

Limited

- 美元类别（累计）	18,618.090	7,540.986	(3,163.934)	22,995.142	6,707
------------	------------	-----------	-------------	------------	-------

- (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；资产净值介于 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于百分之零点零一至百分之零点五不等。基金注册登记机构费用用于每季季末支付。
- (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額列示如下：

	2022 美元	2021 美元
存款利息	23,386	67,290
托管费用及银行费用	(34,471)	(23,524)
交易成本	(74,556)	(62,272)
	=====	=====

- (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額列示如下：

	2022 美元	2021 美元
存款利息	2,101	4,159
其他经营费用	-	(148)
利息支出	(25,024)	(12,427)
交易成本	(78,539)	(139,750)
托管费用及银行费用	(415,751)	(458,122)
	=====	=====

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

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

该等产品和服务必须对本基金具有明显的利益，并仅限于研究和咨询服务。

截至二零二二年九月三十日止年度，投资管理人经非金钱收益／佣金共享安排而获得的服务交易金额为 1,411,296,461 美元（二零二一年：1,259,721,702 美元）。本基金就该等交易支付佣金 159,412 美元（二零二一年：345,098 美元）。

11 衍生性产品

以下为截至九月三十日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／（亏损） 美元
<u>2022</u>				
未平仓合约：				
纽约 13,526	美元 7,795	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	144
纽约 3,962	美元 2,261	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	20
美元 190,471	英镑 177,234	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	7,380
美元 464,915	新加坡元 669,188	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	1,455
美元 1,099	英镑 1,019	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	39
澳元 10,654	美元 6,899	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	49
加元 148,999	美元 108,549	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	112
加元 12,941	美元 9,457	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	39
美元 82,944	英镑 75,164	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	968
美元 65,736	欧元 67,298	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	206
美元 1,097	英镑 1,021	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	43
美元 1,113	英镑 997	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	0
美元 1,103	欧元 1,126	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	0
澳元 44,536	美元 28,843	2022 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	208
美元 14,074	澳元 21,889	2022 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	0
美元 1,607	英镑 1,439	2022 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	0
澳元 1,964,586	美元 1,337,848	2022 年 10 月 21 日	高盛国际，伦敦	74,438
澳元 1,978,127	美元 1,334,124	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	62,007
澳元 1,832,327	美元 1,234,013	2022 年 10 月 21 日	美林国际，伦敦	55,658
澳元 1,902,852	美元 1,274,254	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	50,545
澳元 1,289,562	美元 870,735	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	41,428

未实现收益 / (亏损)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
澳元 1,728,173	美元 1,150,569	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	39,195
澳元 1,209,118	美元 815,171	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	37,597
澳元 1,223,632	美元 820,933	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	34,024
澳元 1,729,858	美元 1,139,099	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	26,642
澳元 777,401	美元 522,927	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	22,987
澳元 2,298,368	美元 1,494,064	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	16,001
澳元 2,262,106	美元 1,465,965	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	11,222
澳元 2,318,009	美元 1,501,578	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	10,885
澳元 237,888	美元 159,401	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	6,417
澳元 135,900	美元 91,203	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	3,807
澳元 657,872	美元 426,118	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,046
澳元 64,400	美元 44,180	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,765
澳元 62,485	美元 42,821	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,637
澳元 64,703	美元 43,494	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,884
澳元 42,087	美元 28,803	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,737
澳元 31,443	美元 21,571	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,350
澳元 99,481	美元 65,058	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,082
澳元 26,968	美元 18,300	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	957
澳元 21,398	美元 14,664	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	903
澳元 130,892	美元 84,999	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	823
澳元 23,187	美元 15,380	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	468
澳元 11,518	美元 7,809	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	402
澳元 8,670	美元 5,895	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	320
澳元 73,389	美元 47,427	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	232
澳元 4,865	美元 3,260	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	131
澳元 3,231	美元 2,183	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	105
澳元 1,649	美元 1,119	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	59
澳元 1,605	美元 1,089	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	57
澳元 1,597	美元 1,083	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	56
澳元 1,636	美元 1,103	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	51
澳元 1,629	美元 1,095	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	47
澳元 1,637	美元 1,098	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	46
澳元 1,642	美元 1,094	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	38
澳元 3,410	美元 2,230	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	37
澳元 1,652	美元 1,096	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	33
澳元 3,950	美元 2,565	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	25
澳元 1,699	美元 1,100	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	8
加元 1,009,358	美元 767,959	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	33,414
加元 836,023	美元 637,184	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	28,781
加元 804,014	美元 610,645	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	25,536
加元 960,183	美元 719,645	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	20,886
加元 530,396	美元 402,852	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	16,865
加元 667,737	美元 497,069	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	11,133
加元 780,030	美元 576,569	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	8,915
加元 129,169	美元 98,289	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4,288

未实现收益 / (亏损)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
加元 1,022,417	美元 748,248	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	4,199
加元 94,908	美元 72,526	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,459
加元 118,514	美元 88,477	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,230
加元 1,009,551	美元 736,194	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1,509
加元 1,042,318	美元 760,024	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	1,493
加元 19,820	美元 15,036	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	612
加元 107,971	美元 78,897	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	323
加元 16,749	美元 12,413	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	224
加元 119,520	美元 87,144	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	165
加元 1,446	美元 1,095	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	42
加元 12,985	美元 9,488	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	38
加元 1,552	美元 1,142	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	13
加元 16,063	美元 11,702	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	12
离岸人民币 22,426,359	美元 3,243,038	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	96,430
离岸人民币 20,328,402	美元 2,920,770	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	68,524
离岸人民币 18,628,286	美元 2,673,359	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	59,653
离岸人民币 23,090,042	美元 3,287,073	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	47,345
离岸人民币 12,459,298	美元 1,785,648	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	37,503
离岸人民币 14,884,949	美元 2,108,250	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	19,766
离岸人民币 4,956,432	美元 714,072	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	18,643
离岸人民币 24,400,717	美元 3,438,347	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	14,720
离岸人民币 2,997,316	美元 433,714	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	13,165
离岸人民币 2,175,924	美元 313,880	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	8,580
离岸人民币 2,346,063	美元 336,854	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	7,682
离岸人民币 1,526,742	美元 221,578	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	7,364
离岸人民币 1,460,774	美元 212,004	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	7,045
离岸人民币 1,181,360	美元 171,035	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	5,280
离岸人民币 1,239,144	美元 177,967	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	4,105
离岸人民币 892,370	美元 129,195	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,988
离岸人民币 1,741,514	美元 248,188	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	3,839
离岸人民币 1,063,451	美元 152,774	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3,563
离岸人民币 2,440,678	美元 345,651	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,204
离岸人民币 3,489,172	美元 492,753	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3,193
离岸人民币 966,794	美元 138,822	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	3,172
离岸人民币 644,931	美元 92,786	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	2,296
离岸人民币 669,589	美元 96,193	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2,244
离岸人民币 1,100,115	美元 156,567	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,212
离岸人民币 916,794	美元 130,767	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,133
离岸人民币 956,435	美元 136,311	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	2,115
离岸人民币 614,306	美元 88,208	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	2,016
离岸人民币 398,277	美元 57,594	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1,713
离岸人民币 726,356	美元 103,520	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1,606
离岸人民币 18,162,753	美元 2,549,931	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,543
离岸人民币 404,956	美元 58,261	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	1,442
离岸人民币 426,250	美元 61,108	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,301

未实现收益 / (亏损)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
离岸人民币 263,767	美元 38,222	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,213
离岸人民币 251,739	美元 36,479	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,158
离岸人民币 299,923	美元 43,093	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	1,011
离岸人民币 1,001,549	美元 141,476	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	950
离岸人民币 286,066	美元 41,036	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	899
离岸人民币 274,311	美元 39,367	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	878
离岸人民币 240,213	美元 34,437	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	733
离岸人民币 336,780	美元 47,944	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	691
离岸人民币 191,218	美元 27,405	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	576
离岸人民币 127,963	美元 18,516	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	562
离岸人民币 118,640	美元 17,167	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	521
离岸人民币 516,321	美元 72,934	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	490
离岸人民币 114,375	美元 16,478	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	430
离岸人民币 103,032	美元 14,844	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	388
离岸人民币 108,967	美元 15,650	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	361
离岸人民币 95,754	美元 13,752	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	317
离岸人民币 151,556	美元 21,569	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	305
离岸人民币 223,793	美元 31,697	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	297
离岸人民币 940,092	美元 132,197	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	294
离岸人民币 116,852	美元 16,674	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	278
离岸人民币 363,819	美元 51,266	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	219
离岸人民币 596,044	美元 83,816	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	186
离岸人民币 1,443,790	美元 202,725	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	150
离岸人民币 28,596	美元 4,125	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	113
离岸人民币 34,183	美元 4,901	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	104
离岸人民币 30,891	美元 4,437	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	102
离岸人民币 21,053	美元 3,022	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	68
离岸人民币 20,008	美元 2,854	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	47
离岸人民币 29,344	美元 4,156	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	39
离岸人民币 7,620	美元 1,106	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	37
离岸人民币 7,620	美元 1,106	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	37
离岸人民币 7,620	美元 1,106	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	37
离岸人民币 7,583	美元 1,097	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	33
离岸人民币 9,397	美元 1,349	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	31
离岸人民币 8,336	美元 1,201	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	31
离岸人民币 7,663	美元 1,105	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	30
离岸人民币 7,663	美元 1,105	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	30
离岸人民币 7,663	美元 1,105	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	30
离岸人民币 7,663	美元 1,105	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	30
离岸人民币 7,594	美元 1,094	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	29
离岸人民币 13,271	美元 1,889	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	27
离岸人民币 10,310	美元 1,471	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	25
离岸人民币 7,672	美元 1,102	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	25
离岸人民币 7,664	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	24
离岸人民币 7,664	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	24

未实现收益 / (亏损)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
离岸人民币 268,449	美元 37,689	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	23
离岸人民币 7,602	美元 1,090	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	23
离岸人民币 7,602	美元 1,090	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	23
离岸人民币 11,134	美元 1,585	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	22
离岸人民币 7,713	美元 1,101	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	18
离岸人民币 7,713	美元 1,101	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	18
离岸人民币 7,708	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	17
离岸人民币 7,708	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	17
离岸人民币 7,708	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	17
离岸人民币 7,708	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	17
离岸人民币 7,911	美元 1,126	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	16
离岸人民币 7,732	美元 1,095	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	10
离岸人民币 7,732	美元 1,095	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	10
离岸人民币 7,732	美元 1,095	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	10
离岸人民币 7,771	美元 1,097	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	7
离岸人民币 7,771	美元 1,097	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	7
离岸人民币 7,932	美元 1,114	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1
离岸人民币 7,932	美元 1,114	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1
欧元 387,723	美元 388,417	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	8,076
欧元 269,452	美元 268,989	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,667
欧元 219,288	美元 219,663	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,550
欧元 222,759	美元 222,915	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,397
欧元 240,064	美元 239,791	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,299
欧元 79,481	美元 79,938	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,970
欧元 208,793	美元 206,572	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,755
欧元 72,306	美元 72,419	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,490
欧元 146,086	美元 144,589	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,284
欧元 28,700	美元 28,895	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	741
欧元 32,134	美元 32,207	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	684
欧元 43,312	美元 43,093	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	606
欧元 1,101	美元 1,106	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	27
欧元 1,086	美元 1,090	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	25
欧元 1,100	美元 1,102	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	23
欧元 1,100	美元 1,102	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	23
欧元 1,099	美元 1,100	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	23
欧元 1,094	美元 1,090	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	17
欧元 1,101	美元 1,089	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	10
欧元 1,114	美元 1,095	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3
英镑 791,462	美元 912,006	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	28,126
英镑 648,590	美元 748,737	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	24,412
英镑 570,272	美元 661,096	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	24,234
英镑 712,800	美元 819,350	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	23,317
英镑 434,849	美元 500,376	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	14,750
英镑 829,872	美元 940,879	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	14,103
英镑 519,600	美元 592,926	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	12,653

未实现收益 / (亏损)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
英镑 320,553	美元 368,556	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	10,572
英镑 185,312	美元 213,789	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	6,838
英镑 119,876	美元 136,798	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	2,924
英镑 643,441	美元 721,312	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,737
英镑 82,368	美元 94,521	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,534
英镑 46,258	美元 53,444	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,784
英镑 11,279	美元 12,882	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	286
英镑 3,950	美元 4,579	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	167
英镑 5,845	美元 6,676	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	148
英镑 2,690	美元 3,133	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	129
英镑 1,522	美元 1,764	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	64
英镑 1,941	美元 2,221	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	53
英镑 1,175	美元 1,353	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	41
英镑 954	美元 1,106	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	41
英镑 1,103	美元 1,270	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	38
英镑 940	美元 1,086	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	36
英镑 945	美元 1,091	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	35
英镑 950	美元 1,092	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	31
英镑 964	美元 1,093	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	17
纽元 1,087,711	美元 660,287	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	44,984
纽元 774,900	美元 472,740	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	34,390
纽元 629,241	美元 380,468	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	24,515
纽元 590,503	美元 354,199	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	20,160
纽元 529,747	美元 318,809	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	19,139
纽元 701,699	美元 413,919	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	16,978
纽元 384,042	美元 232,129	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	14,882
纽元 299,311	美元 182,325	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	13,010
纽元 484,261	美元 284,436	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	10,496
纽元 250,777	美元 151,233	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	9,372
纽元 563,768	美元 327,036	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	8,120
纽元 746,942	美元 427,145	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	4,611
纽元 757,944	美元 431,751	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	2,992
纽元 740,146	美元 421,337	2022 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	2,646
纽元 37,370	美元 22,603	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,464
纽元 154,347	美元 88,094	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	782
纽元 5,701	美元 3,495	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	270
纽元 3,510	美元 2,077	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	92
纽元 2,092	美元 1,274	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	91
纽元 1,812	美元 1,111	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	86
纽元 1,795	美元 1,100	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	85
纽元 1,794	美元 1,089	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	74
纽元 1,806	美元 1,092	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	71
纽元 1,828	美元 1,094	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	60
纽元 1,838	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	59
纽元 1,850	美元 1,095	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	48

未实现收益 / (亏损)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
纽元 1,872	美元 1,092	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	34
纽元 1,963	美元 1,131	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	21
纽元 30,226	美元 17,119	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	20
纽元 1,927	美元 1,091	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1
新加坡元 105,404	美元 75,173	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1,703
新加坡元 84,809	美元 60,434	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	1,319
新加坡元 88,446	美元 62,890	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1,240
新加坡元 86,387	美元 61,273	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1,058
新加坡元 84,191	美元 59,527	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	843
新加坡元 57,762	美元 41,041	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	779
新加坡元 82,765	美元 58,153	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	462
新加坡元 110,103	美元 76,777	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	31
新加坡元 1,545	美元 1,098	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	22
新加坡元 1,549	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	19
新加坡元 113,264	美元 78,966	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	16
新加坡元 4,156	美元 2,898	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1
美元 198,069	英镑 179,392	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,270
美元 14,351	英镑 13,154	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	339
美元 40,940	离岸人民币 294,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	311
美元 21,341	离岸人民币 153,834	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	243
美元 6,168	英镑 5,714	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	213
美元 12,121	欧元 12,567	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	207
美元 3,972	欧元 4,122	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	71
美元 1,394	英镑 1,293	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	50
美元 1,330	英镑 1,234	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	48
美元 4,084	离岸人民币 29,442	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	46
美元 3,210	英镑 2,907	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	37
美元 3,893	离岸人民币 27,956	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	30
美元 6,192	离岸人民币 44,296	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	23
美元 1,995	欧元 2,052	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	18
美元 5,589	离岸人民币 39,922	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	12
美元 5,385	离岸人民币 38,467	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	12
美元 7,718	新加坡元 11,082	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	7
美元 1,212	离岸人民币 8,661	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	3
美元 56,613	离岸人民币 403,350	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	15
			未实现总收益	1,604,195
英镑 5,714	美元 6,166	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	(212)
美元 1,091	纽元 1,927	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	(1)
美元 11,702	加元 16,063	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	(12)
美元 17,119	纽元 30,226	2022 年 10 月 3 日	法国巴黎银行	(21)
欧元 4,122	美元 3,967	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(71)
欧元 12,567	美元 12,107	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(207)

未实现收益 / (亏损)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
英镑 1,293	美元 1,393	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(50)
美元 9,488	加元 12,985	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(38)
美元 87,149	加元 119,520	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(165)
美元 426,060	澳元 657,872	2022 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(3,070)
英镑 179,392	美元 197,962	2022 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	(2,310)
美元 1,100	澳元 1,699	2022 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	(8)
英镑 11,621	美元 12,973	2022 年 10 月 7 日	法国巴黎银行	(1)
澳元 5,000	美元 3,215	2022 年 10 月 11 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 29,442	美元 4,083	2022 年 10 月 11 日	法国巴黎银行	(47)
离岸人民币 294,000	美元 40,929	2022 年 10 月 11 日	法国巴黎银行	(317)
离岸人民币 153,834	美元 21,337	2022 年 10 月 12 日	法国巴黎银行	(245)
美元 1,114	离岸人民币 7,932	2022 年 10 月 12 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 7,791	美元 1,091	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 7,791	美元 1,091	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 7,860	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 7,860	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 44,898	美元 6,276	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(23)
离岸人民币 81,871	美元 11,445	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(42)
离岸人民币 97,255	美元 13,543	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(103)
离岸人民币 174,423	美元 24,288	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(185)
离岸人民币 354,943	美元 49,602	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(199)
离岸人民币 162,545	美元 22,549	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(257)
离岸人民币 348,066	美元 48,552	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(285)
离岸人民币 774,639	美元 108,288	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(400)
离岸人民币 785,633	美元 109,619	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(612)
离岸人民币 1,210,090	美元 169,161	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(625)
离岸人民币 460,394	美元 63,869	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(728)
离岸人民币 2,731,407	美元 382,391	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(849)
离岸人民币 1,822,949	美元 254,829	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(946)
离岸人民币 1,240,019	美元 173,019	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(966)
离岸人民币 804,829	美元 111,797	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1,127)
离岸人民币 1,267,137	美元 176,016	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1,774)
离岸人民币 5,248,476	美元 728,107	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(8,298)
离岸人民币 23,969,233	美元 3,349,637	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(13,449)
离岸人民币 23,534,591	美元 3,282,829	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(19,273)
欧元 1,133	美元 1,095	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(16)
欧元 67,298	美元 65,807	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(210)
欧元 206,893	美元 202,443	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(510)
欧元 278,912	美元 272,902	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(700)
欧元 274,401	美元 265,578	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3,599)
欧元 268,385	美元 258,348	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(4,927)
英镑 1,084	美元 1,183	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(28)
英镑 1,009	美元 1,089	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(38)
英镑 1,019	美元 1,099	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(40)
英镑 1,021	美元 1,097	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(43)

未实现收益 / (亏损)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
英镑 75,164	美元 82,949	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(992)
英镑 27,627	美元 29,780	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,073)
英镑 76,494	美元 82,554	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,872)
英镑 177,234	美元 190,489	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(7,441)
英镑 866,355	美元 958,391	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(9,127)
英镑 855,806	美元 930,912	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(24,826)
英镑 825,120	美元 890,915	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(30,553)
新加坡元 13,902	美元 9,673	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(17)
新加坡元 108,842	美元 75,790	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(77)
新加坡元 669,188	美元 464,965	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,485)
美元 1,205	加元 1,655	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1)
美元 1,363	纽元 2,406	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2)
美元 1,365	澳元 2,111	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(7)
美元 1,259	欧元 1,272	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(11)
美元 1,333	离岸人民币 9,413	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(12)
美元 1,294	加元 1,759	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(15)
美元 2,626	离岸人民币 18,591	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(17)
美元 1,155	离岸人民币 8,098	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(19)
美元 2,262	纽元 3,962	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(20)
美元 1,305	离岸人民币 9,143	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(22)
美元 1,311	新加坡元 1,844	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(26)
美元 1,245	离岸人民币 8,687	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(27)
美元 1,221	离岸人民币 8,511	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(27)
美元 1,163	离岸人民币 8,060	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(32)
美元 5,057	离岸人民币 35,811	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(33)
美元 1,086	英镑 940	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(36)
美元 2,148	欧元 2,151	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(37)
美元 9,457	加元 12,941	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(39)
美元 1,624	欧元 1,616	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(39)
美元 1,599	离岸人民币 11,101	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(42)
美元 1,182	纽元 2,010	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(45)
美元 2,147	新加坡元 3,015	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(46)
美元 6,901	澳元 10,654	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(49)
美元 1,784	离岸人民币 12,308	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(57)
美元 7,011	离岸人民币 49,506	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(65)
美元 1,191	纽元 1,991	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(65)
美元 3,153	离岸人民币 21,962	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(72)
美元 3,151	离岸人民币 21,945	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(72)
美元 12,281	离岸人民币 86,963	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(80)
美元 5,011	欧元 5,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(107)
美元 1,688	纽元 2,792	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(109)
美元 3,658	英镑 3,177	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(111)
美元 108,548	加元 148,999	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(116)
美元 7,795	纽元 13,526	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(143)
美元 4,831	离岸人民币 33,281	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(161)

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 7,179	离岸人民币 50,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(164)
美元 10,518	新加坡元 14,818	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(190)
美元 28,850	澳元 44,536	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(209)
美元 7,092	离岸人民币 48,940	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(226)
美元 5,874	澳元 8,713	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(271)
美元 5,768	纽元 9,539	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(372)
美元 8,486	加元 11,145	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(375)
美元 88,963	新加坡元 127,089	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(378)
美元 44,578	欧元 45,030	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(405)
美元 17,796	英镑 15,553	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(427)
美元 6,092	纽元 10,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(435)
美元 492,732	离岸人民币 3,508,657	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(437)
美元 29,917	离岸人民币 209,920	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(463)
美元 11,370	澳元 16,943	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(474)
美元 36,097	离岸人民币 252,960	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(605)
美元 20,866	离岸人民币 144,180	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(636)
美元 30,093	欧元 30,000	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(664)
美元 79,024	离岸人民币 557,986	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(734)
美元 83,740	英镑 74,300	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(764)
美元 11,201	纽元 18,259	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(873)
美元 30,006	英镑 26,009	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(960)
美元 18,625	澳元 27,214	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,124)
美元 28,733	澳元 42,877	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,159)
美元 42,529	欧元 42,155	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,176)
美元 33,893	加元 44,554	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,469)
美元 31,776	澳元 47,037	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,527)
美元 49,827	离岸人民币 343,843	2022 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1,583)
美元 99,349	离岸人民币 696,464	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,629)
美元 62,485	离岸人民币 432,118	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,855)
美元 69,588	离岸人民币 482,453	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(1,896)
美元 84,505	离岸人民币 588,380	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,950)
美元 25,326	纽元 41,313	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,956)
美元 133,634	离岸人民币 937,683	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,070)
美元 49,673	澳元 73,675	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,294)
美元 52,273	澳元 77,708	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,300)
美元 143,839	澳元 219,939	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,398)
美元 58,236	英镑 50,000	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,398)
美元 74,621	英镑 64,367	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,738)
美元 77,368	英镑 66,759	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,814)
美元 110,103	离岸人民币 764,220	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,877)
美元 108,129	英镑 94,226	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,900)
美元 104,650	新加坡元 145,934	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(2,929)
美元 55,322	纽元 92,499	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2,997)
美元 38,708	纽元 63,097	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3,015)
美元 107,128	离岸人民币 739,210	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(3,410)

未实现收益 / (亏损)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
美元 153,730	离岸人民币 1,064,979	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(4,304)
美元 145,323	澳元 219,080	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,434)
美元 137,977	英镑 119,423	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,609)
美元 76,540	澳元 111,565	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,793)
美元 227,954	离岸人民币 1,590,024	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,861)
美元 135,438	英镑 116,866	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,926)
美元 220,458	离岸人民币 1,535,624	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(4,997)
美元 181,628	离岸人民币 1,258,249	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(5,085)
美元 85,973	纽元 141,613	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(5,864)
美元 162,735	英镑 140,393	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(5,948)
美元 139,211	澳元 205,327	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(7,167)
美元 314,938	英镑 275,181	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(7,624)
美元 363,127	离岸人民币 2,531,334	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(7,959)
美元 244,007	澳元 363,604	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(10,177)
美元 781,459	离岸人民币 5,490,800	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(11,053)
美元 384,367	欧元 377,772	2022 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(13,788)
美元 591,759	英镑 514,671	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(16,990)
美元 642,842	英镑 558,995	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(18,574)
美元 631,101	澳元 929,998	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(33,027)
美元 715,884	澳元 1,060,199	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(34,079)
美元 586,105	澳元 855,239	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(36,107)
美元 621,579	纽元 1,011,506	2022 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(49,385)
美元 1,065,131	加元 1,382,307	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(59,178)
美元 1,306,870	英镑 1,115,054	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(61,612)
美元 3,417,256	离岸人民币 23,856,413	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(70,000)
美元 5,213,056	新加坡元 7,333,935	2022 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(101,028)
美元 4,704,016	离岸人民币 32,612,795	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(128,165)
美元 2,140,233	澳元 3,097,676	2022 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(148,142)
美元 7,625,586	离岸人民币 53,250,715	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(154,060)
美元 18,815,128	欧元 18,956,379	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(219,678)
美元 12,087,105	离岸人民币 84,406,240	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(244,196)
美元 31,397,043	纽元 52,120,376	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,913,276)
美元 64,940,616	英镑 56,383,956	2022 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(1,972,762)
美元 52,587,586	加元 69,376,498	2022 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(2,099,895)
美元 103,466,494	澳元 153,841,696	2022 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(4,532,130)
美元 233,228,506	离岸人民币 1,628,205,514	2022 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(4,777,498)
澳元 21,889	美元 14,081	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(3)
离岸人民币 8,878	美元 1,246	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 8,806	美元 1,236	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 1,246,952	美元 175,012	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(51)
欧元 1,126	美元 1,107	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(0)
英镑 997	美元 1,113	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(0)
英镑 1,439	美元 1,608	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(1)
美元 3,217	澳元 5,000	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(0)

未实现收益 / (亏损)
美元

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 12,986	英镑 11,621	2022 年 11 月 21 日	法国巴黎银行	(4)
			未实现总亏损	(16,987,221)
			未实现净亏损	(15,383,026)

2021

未平仓合约:

英镑 785	美元 1,062	2021 年 10 月 1 日	多伦多道明银行	4
英镑 25,235	美元 34,592	2021 年 10 月 4 日	美林国际, 伦敦	567
美元 17,410	加元 22,106	2021 年 10 月 4 日	多伦多道明银行	40
澳元 25,790	美元 18,692	2021 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	62
英镑 1,164,911	美元 1,576,875	2021 年 10 月 5 日	多伦多道明银行	6,164
美元 190,192	加元 242,472	2021 年 10 月 5 日	加拿大皇家银行	1,204
美元 74,337	澳元 103,408	2021 年 10 月 5 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	361
美元 14,815	英镑 11,035	2021 年 10 月 5 日	美林国际, 伦敦	64
澳元 70,000	美元 50,673	2021 年 10 月 6 日	美林国际, 伦敦	108
美元 533,341	加元 675,706	2021 年 10 月 6 日	加拿大皇家银行	29
美元 1,093	澳元 1,520	2021 年 10 月 6 日	法国巴黎银行	6
美元 1,109	澳元 1,536	2021 年 10 月 7 日	美国道富银行	0
美元 1,107	加元 1,402	2021 年 10 月 7 日	法国巴黎银行	0
美元 1,098	离岸人民币 7,106	2021 年 10 月 12 日	美国道富银行	2
离岸人民币 8,725	美元 1,352	2021 年 10 月 13 日	多伦多道明银行	2
离岸人民币 804,600	美元 124,681	2021 年 10 月 15 日	多伦多道明银行	145
离岸人民币 10,000	美元 1,550	2021 年 10 月 15 日	多伦多道明银行	2
澳元 1,485,953	美元 1,096,586	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	23,119
澳元 911,360	美元 673,719	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	15,343
澳元 1,432,528	美元 1,047,546	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	12,674
澳元 941,597	美元 691,341	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	11,122
澳元 885,460	美元 649,299	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	9,634
澳元 1,010,870	美元 739,861	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	9,598
澳元 629,908	美元 464,434	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	9,382
澳元 869,761	美元 636,902	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	8,577
澳元 505,262	美元 373,237	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	8,231
澳元 404,904	美元 300,018	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	7,511
澳元 551,880	美元 406,162	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	7,478
澳元 1,093,481	美元 796,307	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	6,365
澳元 1,013,714	美元 736,421	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,104
澳元 171,401	美元 127,601	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	3,779
澳元 348,101	美元 253,418	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	1,946
澳元 164,594	美元 120,756	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,852

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 84,547	美元 62,341	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	1,263
澳元 43,089	美元 32,021	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	894
澳元 52,970	美元 39,101	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	835
澳元 24,384	美元 17,999	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	384
澳元 43,050	美元 31,468	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	368
澳元 18,857	美元 13,915	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	293
澳元 14,671	美元 10,817	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	219
澳元 86,138	美元 62,360	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	133
澳元 3,914	美元 2,900	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	73
澳元 8,184	美元 5,960	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	48
澳元 2,108	美元 1,569	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	46
澳元 2,756	美元 2,028	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	37
澳元 2,984	美元 2,189	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	34
澳元 1,548	美元 1,151	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	32
澳元 2,985	美元 2,187	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	31
澳元 1,478	美元 1,098	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	31
澳元 1,492	美元 1,106	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	28
澳元 5,070	美元 3,689	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	26
澳元 9,973	美元 7,229	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	24
澳元 1,480	美元 1,093	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	24
澳元 1,491	美元 1,099	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	22
澳元 1,491	美元 1,099	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	22
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 94,011	美元 67,923	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	9
澳元 1,631	美元 1,188	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	9
澳元 1,501	美元 1,093	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	8
澳元 1,512	美元 1,097	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	5
澳元 2,292	美元 1,659	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3
加元 376,192	美元 299,432	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2,490
加元 459,270	美元 364,216	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	1,698
加元 502,403	美元 397,524	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	959
加元 146,124	美元 116,112	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	771
加元 367,224	美元 290,563	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	700
加元 426,784	美元 337,532	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	656
加元 468,962	美元 370,798	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	630
加元 193,600	美元 153,320	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	505
加元 373,214	美元 295,016	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	425
加元 705,365	美元 557,100	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	330
加元 508,527	美元 401,625	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	227
加元 11,050	美元 8,831	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	109
加元 11,663	美元 9,297	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	91
加元 26,963	美元 21,335	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	52
加元 17,338	美元 13,722	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	37
加元 18,968	美元 14,997	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	25

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 1,376	美元 1,097	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	11
加元 3,175	美元 2,512	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	6
加元 1,390	美元 1,102	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	5
加元 1,391	美元 1,102	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	4
加元 1,385	美元 1,096	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	3
加元 1,380	美元 1,092	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	3
加元 1,380	美元 1,092	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	3
加元 1,717	美元 1,357	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	2
加元 1,403	美元 1,110	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	2
离岸人民币 9,101,469	美元 1,411,537	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	3,509
离岸人民币 9,618,942	美元 1,491,403	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	3,320
离岸人民币 4,397,632	美元 681,688	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	1,359
离岸人民币 3,278,217	美元 507,944	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	793
离岸人民币 10,697,727	美元 1,655,648	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	673
离岸人民币 4,092,117	美元 633,711	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	647
离岸人民币 9,800,569	美元 1,516,553	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	371
离岸人民币 975,301	美元 151,184	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	301
离岸人民币 652,792	美元 101,164	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	175
离岸人民币 672,724	美元 104,218	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	145
离岸人民币 522,299	美元 80,941	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	140
离岸人民币 557,853	美元 86,422	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	121
离岸人民币 472,216	美元 73,168	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	114
离岸人民币 146,094	美元 22,664	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	63
离岸人民币 730,522	美元 113,069	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	55
离岸人民币 682,285	美元 105,606	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	54
离岸人民币 139,901	美元 21,697	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	54
离岸人民币 145,955	美元 22,630	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	50
离岸人民币 624,805	美元 96,707	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	47
离岸人民币 586,175	美元 90,730	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	47
离岸人民币 1,915,520	美元 296,351	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	14
离岸人民币 45,015	美元 6,978	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	14
离岸人民币 163,064	美元 25,237	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	10
离岸人民币 53,207	美元 8,240	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	8
离岸人民币 21,685	美元 3,361	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	7
离岸人民币 150,196	美元 23,242	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	6
离岸人民币 31,718	美元 4,912	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	5
离岸人民币 356,169	美元 55,103	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
离岸人民币 7,076	美元 1,098	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	3
离岸人民币 279,352	美元 43,219	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币 7,093	美元 1,100	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	2
离岸人民币 7,093	美元 1,100	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	2
离岸人民币 40,963	美元 6,337	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	0
离岸人民币 31,366	美元 4,853	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	0
离岸人民币 7,080	美元 1,095	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	0
离岸人民币 7,080	美元 1,095	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	0

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
离岸人民币 7,080	美元 1,095	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	0
欧元 1,036,812	美元 1,232,877	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	30,816
欧元 199,922	美元 236,672	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	4,886
欧元 185,327	美元 218,417	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	3,552
欧元 117,124	美元 138,674	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	2,883
欧元 120,980	美元 143,112	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	2,850
欧元 100,648	美元 119,451	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	2,762
欧元 110,781	美元 130,956	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,518
欧元 131,059	美元 154,397	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	2,450
欧元 153,030	美元 179,513	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	2,093
欧元 136,793	美元 160,394	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	1,799
欧元 9,5589	美元 112,133	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,309
欧元 125,013	美元 145,661	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	723
欧元 12,104	美元 14,362	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	329
欧元 13,485	美元 15,873	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	239
欧元 5,802	美元 6,886	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	159
欧元 11,941	美元 13,977	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	133
欧元 14,542	美元 16,983	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	123
欧元 4,086	美元 4,799	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	62
欧元 1,395	美元 1,650	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	32
欧元 928	美元 1,102	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	26
欧元 927	美元 1,100	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	24
欧元 931	美元 1,101	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	22
欧元 937	美元 1,102	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	15
欧元 5,890	美元 6,843	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	14
欧元 940	美元 1,098	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	8
英镑 494,345	美元 684,038	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	17,471
英镑 412,976	美元 570,832	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	13,982
英镑 402,592	美元 555,604	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	12,755
英镑 261,990	美元 363,358	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	10,095
英镑 287,015	美元 396,733	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	9,727
英镑 375,134	美元 515,364	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	9,539
英镑 246,818	美元 342,033	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	9,227
英镑 241,394	美元 333,961	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	8,469
英镑 288,183	美元 394,430	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	5,849
英镑 105,434	美元 146,234	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,069
英镑 100,525	美元 138,969	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3,422
英镑 169,632	美元 231,824	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	3,096
英镑 65,009	美元 89,653	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	1,995
英镑 37,698	美元 52,199	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	1,368
英镑 35,828	美元 49,403	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,093
英镑 25,382	美元 34,995	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	770
英镑 84,885	美元 114,905	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	447
英镑 18,245	美元 25,011	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	410
英镑 19,173	美元 26,222	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	369

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
英镑 7,987	美元 11,065	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	295
英镑 7,720	美元 10,676	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	267
英镑 4,112	美元 5,698	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	153
英镑 2,854	美元 3,958	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	110
英镑 3,594	美元 4,937	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	91
英镑 4,931	美元 6,729	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	79
英镑 1,315	美元 1,821	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	48
英镑 798	美元 1,104	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	28
英镑 793	美元 1,096	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	27
英镑 800	美元 1,102	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	24
英镑 796	美元 1,097	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	24
英镑 800	美元 1,100	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	22
英镑 806	美元 1,108	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	21
英镑 806	美元 1,108	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	21
英镑 799	美元 1,098	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	21
英镑 803	美元 1,087	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	4
纽元 433,271	美元 308,081	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	9,219
纽元 373,243	美元 265,790	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	8,335
纽元 432,316	美元 305,723	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	7,520
纽元 307,399	美元 218,671	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	6,633
纽元 270,632	美元 193,230	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	6,554
纽元 266,495	美元 189,992	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	6,169
纽元 278,241	美元 198,066	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	6,141
纽元 260,611	美元 185,014	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	5,250
纽元 168,677	美元 120,446	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	4,096
纽元 307,446	美元 215,867	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	3,797
纽元 203,033	美元 143,566	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	3,518
纽元 279,717	美元 195,684	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	2,741
纽元 49,086	美元 34,790	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	931
纽元 45,675	美元 32,261	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	755
纽元 53,577	美元 37,709	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	753
纽元 290,747	美元 200,951	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	399
纽元 12,390	美元 8,843	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	296
纽元 5,033	美元 3,577	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	105
纽元 1,540	美元 1,098	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	36
纽元 1,555	美元 1,107	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	34
纽元 1,541	美元 1,097	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	34
纽元 2,430	美元 1,708	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	32
纽元 1,542	美元 1,095	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	31
纽元 1,567	美元 1,110	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	30
纽元 1,570	美元 1,108	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	26
纽元 1,570	美元 1,108	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	26
纽元 1,552	美元 1,087	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	16
新加坡元 101,170	美元 75,281	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	762
新加坡元 99,913	美元 74,251	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	659

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
新加坡元 63,642	美元 47,531	2021年10月21日	美国道富银行	654
新加坡元 71,033	美元 52,874	2021年10月21日	加拿大皇家银行	553
新加坡元 65,976	美元 49,146	2021年10月21日	美国道富银行	550
新加坡元 60,324	美元 44,969	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	536
新加坡元 71,995	美元 53,218	2021年10月21日	美国道富银行	189
新加坡元 1,477	美元 1,098	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	10
美元 247,049,954	离岸人民币 1,600,587,242	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	566,374
美元 18,019,453	离岸人民币 116,744,430	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	41,310
美元 14,791,836	离岸人民币 95,833,345	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	33,911
美元 3,889,771	离岸人民币 25,201,045	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	8,917
美元 2,951,569	离岸人民币 19,122,084	2021年10月21日	美国道富银行	6,683
美元 1,614,177	离岸人民币 10,457,790	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	3,679
美元 1,468,293	离岸人民币 9,508,466	2021年10月21日	美国道富银行	2,699
美元 782,843	离岸人民币 5,075,205	2021年10月21日	美国道富银行	2,309
美元 2,464,282	离岸人民币 15,943,325	2021年10月21日	美国道富银行	2,205
美元 512,390	离岸人民币 3,320,293	2021年10月21日	美国道富银行	1,271
美元 420,368	离岸人民币 2,723,461	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	961
美元 183,996	离岸人民币 1,193,035	2021年10月21日	法国巴黎银行	570
美元 122,103	离岸人民币 792,795	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	545
美元 169,840	离岸人民币 1,101,194	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	519
美元 41,498	加元 53,189	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	486
美元 169,401	离岸人民币 1,098,051	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	471
美元 228,949	离岸人民币 1,482,870	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	456
美元 161,327	离岸人民币 1,045,737	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	452
美元 140,216	离岸人民币 909,121	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	428
美元 257,208	离岸人民币 1,665,146	2021年10月21日	多伦多道明银行	396
美元 416,085	离岸人民币 2,691,935	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	367
美元 83,629	英镑 62,287	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	358
美元 150,565	离岸人民币 975,465	2021年10月21日	法国巴黎银行	342
美元 136,171	离岸人民币 882,079	2021年10月21日	美国道富银行	290
美元 95,784	离岸人民币 621,000	2021年10月21日	加拿大皇家银行	287
美元 174,215	离岸人民币 1,127,871	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	270
美元 96,054	离岸人民币 622,632	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	269
美元 170,089	离岸人民币 1,100,809	2021年10月21日	美国道富银行	210
美元 31,621	加元 40,312	2021年10月21日	法国巴黎银行	199
美元 105,507	离岸人民币 683,147	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	179
美元 140,574	离岸人民币 909,793	2021年10月21日	美国道富银行	174
美元 113,529	离岸人民币 734,866	2021年10月21日	美国道富银行	157
美元 68,558	离岸人民币 444,161	2021年10月21日	美国道富银行	155
美元 195,265	离岸人民币 1,263,162	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	151
美元 86,421	离岸人民币 559,568	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	146
美元 68,016	离岸人民币 440,578	2021年10月21日	法国巴黎银行	143
美元 39,007	离岸人民币 252,881	2021年10月21日	美国道富银行	115
美元 15,964	离岸人民币 103,832	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	99
美元 31,482	离岸人民币 204,050	2021年10月21日	法国巴黎银行	85

未实现收益 / (亏损)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
美元 13,123	离岸人民币 85,265	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	68
美元 31,400	离岸人民币 203,400	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	67
美元 12,264	澳元 17,059	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	60
美元 25,695	离岸人民币 166,469	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	59
美元 7,967	离岸人民币 51,815	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	49
美元 21,267	加元 27,000	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	45
美元 23,078	离岸人民币 149,451	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	42
美元 7,505	加元 9,552	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	35
美元 37,669	离岸人民币 243,707	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	34
美元 30,275	离岸人民币 195,896	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	31
美元 8,704	离岸人民币 56,455	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	30
美元 10,131	离岸人民币 65,616	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	20
美元 8,223	离岸人民币 53,266	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	17
美元 8,437	离岸人民币 54,610	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	12
美元 3,254	离岸人民币 21,098	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	10
美元 1,437	加元 1,832	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	9
美元 3,506	离岸人民币 22,711	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	7
美元 1,341	离岸人民币 8,701	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	5
美元 1,832	离岸人民币 11,867	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	4
美元 2,758	离岸人民币 17,845	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	3
美元 2,097	离岸人民币 13,574	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
美元 1,211	离岸人民币 7,851	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	3
美元 1,203	离岸人民币 7,800	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	3
美元 1,171	离岸人民币 7,586	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	3
美元 1,108	离岸人民币 7,185	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	3
美元 2,674	离岸人民币 17,297	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	2
美元 1,197	离岸人民币 7,748	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	2
美元 1,726	加元 2,188	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1
美元 1,560	离岸人民币 10,093	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	1
离岸人民币 126,962	美元 19,623	2021 年 11 月 19 日	多伦多道明银行	27
离岸人民币 108,968	美元 16,833	2021 年 11 月 19 日	多伦多道明银行	15
欧元 129,204	美元 149,984	2021 年 11 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	101
英镑 819	美元 1,105	2021 年 11 月 19 日	渣打银行, 伦敦	0
美元 400,880	澳元 554,963	2021 年 11 月 19 日	加拿大皇家银行	80
美元 57,186	欧元 49,302	2021 年 11 月 19 日	渣打银行, 伦敦	7
美元 14,026	英镑 10,403	2021 年 11 月 19 日	加拿大皇家银行	1
美元 1,551	澳元 2,146	2021 年 11 月 19 日	美国道富银行	0
美元 1,362	加元 1,726	2021 年 11 月 19 日	法国巴黎银行	0
			未实现总收益	1,108,362
加元 27,000	美元 21,267	2021 年 10 月 4 日	加拿大皇家银行	(45)
美元 16,977	欧元 14,542	2021 年 10 月 4 日	加拿大皇家银行	(123)
美元 114,903	英镑 84,885	2021 年 10 月 4 日	加拿大皇家银行	(447)

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 290,571	加元 367,224	2021 年 10 月 4 日	美国道富银行	(700)
加元 1,726	美元 1,362	2021 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(0)
美元 1,188	澳元 1,631	2021 年 10 月 5 日	美国道富银行	(9)
美元 6,841	欧元 5,890	2021 年 10 月 5 日	美国道富银行	(15)
美元 62,355	澳元 86,138	2021 年 10 月 5 日	法国巴黎银行	(133)
澳元 2,146	美元 1,550	2021 年 10 月 6 日	美国道富银行	(0)
英镑 62,287	美元 83,627	2021 年 10 月 6 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(358)
美元 1,105	英镑 819	2021 年 10 月 6 日	渣打银行, 伦敦	(0)
澳元 17,059	美元 12,263	2021 年 10 月 7 日	渣打银行, 伦敦	(59)
加元 40,312	美元 31,621	2021 年 10 月 7 日	法国巴黎银行	(199)
欧元 49,302	美元 57,139	2021 年 10 月 7 日	渣打银行, 伦敦	(5)
英镑 10,403	美元 14,026	2021 年 10 月 7 日	加拿大皇家银行	(1)
澳元 554,963	美元 400,810	2021 年 10 月 8 日	加拿大皇家银行	(77)
离岸人民币 7,748	美元 1,198	2021 年 10 月 8 日	多伦多道明银行	(2)
离岸人民币 734,866	美元 113,633	2021 年 10 月 8 日	美国道富银行	(176)
离岸人民币 1,665,146	美元 257,451	2021 年 10 月 8 日	多伦多道明银行	(431)
离岸人民币 3,320,293	美元 512,877	2021 年 10 月 8 日	美国道富银行	(1,338)
离岸人民币 54,610	美元 8,442	2021 年 10 月 12 日	美国道富银行	(13)
澳元 1,520	美元 1,093	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(5)
澳元 103,408	美元 74,342	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(361)
澳元 953,099	美元 687,004	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(1,524)
加元 2,064	美元 1,622	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(7)
加元 22,106	美元 17,410	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(39)
加元 134,540	美元 106,007	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(190)
加元 54,395	美元 42,438	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(497)
加元 735,270	美元 579,536	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(839)
加元 242,472	美元 190,188	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(1,203)
加元 469,012	美元 368,853	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,354)
加元 146,427	美元 114,086	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(1,495)
加元 962,028	美元 755,922	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(3,441)
离岸人民币 7,293	美元 1,127	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(1)
离岸人民币 7,172	美元 1,108	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	高盛国际, 伦敦	(1)
离岸人民币 7,557	美元 1,167	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(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 7,109	美元 1,097	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 7,109	美元 1,097	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 7,108	美元 1,097	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(2)
离岸人民币 7,108	美元 1,097	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(2)
离岸人民币 7,108	美元 1,097	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 7,106	美元 1,098	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(2)
离岸人民币 7,106	美元 1,098	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 7,106	美元 1,098	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)

未实现收益 / (亏损)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	美元
离岸人民币 7,095	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	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 7,095	美元 1,096	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(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	加拿大皇家银行	(2)
离岸人民币 7,069	美元 1,091	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(2)
离岸人民币 7,109	美元 1,097	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 7,109	美元 1,097	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	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3)
离岸人民币 7,106	美元 1,096	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(3)
离岸人民币 7,100	美元 1,096	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(3)
离岸人民币 7,098	美元 1,095	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(3)
离岸人民币 7,098	美元 1,095	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(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	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 17,029	美元 2,631	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(4)
离岸人民币 9,798	美元 1,512	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(4)
离岸人民币 7,098	美元 1,094	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(4)
离岸人民币 22,046	美元 3,406	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(5)
离岸人民币 13,047	美元 2,013	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(6)
离岸人民币 11,881	美元 1,833	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 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 31,480	美元 4,863	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
离岸人民币 15,550	美元 2,399	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(7)
离岸人民币 9,169	美元 1,411	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(7)
离岸人民币 7,128	美元 1,096	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(7)
离岸人民币 27,818	美元 4,295	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(8)
离岸人民币 69,262	美元 10,706	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(9)
离岸人民币 23,741	美元 3,664	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(9)
离岸人民币 24,387	美元 3,762	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(11)
离岸人民币 28,892	美元 4,458	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(12)
离岸人民币 44,033	美元 6,799	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(13)
离岸人民币 49,466	美元 7,636	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(17)
离岸人民币 130,569	美元 20,179	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(21)
离岸人民币 177,420	美元 27,423	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(24)
离岸人民币 120,263	美元 18,580	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(25)
离岸人民币 232,299	美元 35,907	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(30)
离岸人民币 152,287	美元 23,526	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(33)
离岸人民币 76,384	美元 11,782	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(35)
离岸人民币 270,141	美元 41,755	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(37)
离岸人民币 178,421	美元 27,561	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(41)
离岸人民币 146,690	美元 22,649	2021 年 10 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(44)
离岸人民币 168,293	美元 25,989	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(46)
离岸人民币 122,479	美元 18,891	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(57)

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 869,379	美元 134,437	2021年10月21日	美国道富银行	(59)
离岸人民币 195,575	美元 30,193	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(63)
离岸人民币 209,970	美元 32,417	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(66)
离岸人民币 146,191	美元 22,550	2021年10月21日	美国道富银行	(66)
离岸人民币 128,906	美元 19,875	2021年10月21日	多伦多道明银行	(67)
离岸人民币 1,025,004	美元 158,502	2021年10月21日	美国道富银行	(70)
离岸人民币 174,469	美元 26,919	2021年10月21日	美国道富银行	(72)
离岸人民币 352,519	美元 54,463	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(73)
离岸人民币 234,709	美元 36,230	2021年10月21日	美国道富银行	(80)
离岸人民币 672,949	美元 104,016	2021年10月21日	美国道富银行	(92)
离岸人民币 279,686	美元 43,162	2021年10月21日	美国道富银行	(107)
离岸人民币 1,013,464	美元 156,665	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(121)
离岸人民币 291,983	美元 45,046	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(125)
离岸人民币 278,334	美元 42,933	2021年10月21日	美国道富银行	(126)
离岸人民币 651,299	美元 100,624	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(134)
离岸人民币 141,862	美元 21,812	2021年10月21日	多伦多道明银行	(135)
离岸人民币 433,187	美元 66,880	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(136)
离岸人民币 402,627	美元 62,150	2021年10月21日	美国道富银行	(137)
离岸人民币 178,867	美元 27,531	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(140)
离岸人民币 474,532	美元 73,249	2021年10月21日	美国道富银行	(163)
离岸人民币 582,162	美元 89,872	2021年10月21日	法国巴黎银行	(190)
离岸人民币 669,452	美元 103,348	2021年10月21日	法国巴黎银行	(219)
离岸人民币 1,032,375	美元 159,475	2021年10月21日	美国道富银行	(237)
离岸人民币 645,362	美元 99,590	2021年10月21日	美国道富银行	(249)
离岸人民币 622,099	美元 95,987	2021年10月21日	美国道富银行	(253)
离岸人民币 1,257,183	美元 194,202	2021年10月21日	美国道富银行	(289)
离岸人民币 729,317	美元 112,531	2021年10月21日	美国道富银行	(297)
离岸人民币 773,837	美元 119,416	2021年10月21日	美国道富银行	(299)
离岸人民币 2,087,923	美元 322,708	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(301)
离岸人民币 1,041,958	美元 160,881	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(314)
离岸人民币 959,348	美元 148,048	2021年10月21日	美国道富银行	(366)
离岸人民币 1,225,016	美元 189,121	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(393)
离岸人民币 1,195,915	美元 184,453	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(560)
离岸人民币 1,244,083	美元 191,899	2021年10月21日	美国道富银行	(565)
离岸人民币 2,291,223	美元 353,742	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(718)
离岸人民币 761,808	美元 117,131	2021年10月21日	多伦多道明银行	(723)
离岸人民币 1,759,077	美元 271,382	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(753)
离岸人民币 2,251,872	美元 347,600	2021年10月21日	美国道富银行	(772)
离岸人民币 1,942,501	美元 299,680	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(832)
离岸人民币 4,211,998	美元 650,235	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(1,376)
离岸人民币 15,140,957	美元 2,340,393	2021年10月21日	美国道富银行	(1,965)
离岸人民币 10,002,101	美元 1,545,171	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2,188)
离岸人民币 11,232,648	美元 1,735,116	2021年10月21日	美国道富银行	(2,613)
离岸人民币 3,494,140	美元 537,819	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(2,736)
离岸人民币 10,906,269	美元 1,684,248	2021年10月21日	美国道富银行	(2,989)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
英镑 11,035	美元 14,815	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(64)
英镑 283,379	美元 381,397	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(706)
新加坡元 66,421	美元 48,905	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(19)
美元 1,241	离岸人民币 8,021	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(0)
美元 309,408	离岸人民币 2,000,000	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(2)
美元 1,654	离岸人民币 10,673	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(2)
美元 1,403	加元 1,773	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(3)
美元 1,062	英镑 785	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(4)
美元 1,642	离岸人民币 10,586	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(5)
美元 3,818	离岸人民币 24,643	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(6)
美元 8,717	离岸人民币 56,290	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
美元 5,920	加元 7,490	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(8)
美元 6,291	离岸人民币 40,600	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(10)
美元 76,519	澳元 105,900	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(15)
美元 2,347	澳元 3,226	2021 年 10 月 21 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(17)
美元 1,719	欧元 1,465	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(20)
美元 2,234	新加坡元 3,000	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(24)
美元 1,998	加元 2,500	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(24)
美元 1,246	欧元 1,054	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(24)
美元 1,496	澳元 2,033	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(28)
美元 1,626	英镑 1,182	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(33)
美元 3,397	英镑 2,490	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(40)
美元 2,808	澳元 3,829	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(42)
美元 5,369	新加坡元 7,231	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(43)
美元 3,304	澳元 4,509	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(47)
美元 1,593	纽元 2,233	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(53)
美元 7,068	澳元 9,706	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(56)
美元 18,693	澳元 25,790	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(62)
美元 5,516	新加坡元 7,398	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(67)
美元 3,283	澳元 4,448	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(70)
美元 4,081	纽元 5,808	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(75)
美元 79,827	离岸人民币 515,509	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(76)
美元 13,096	澳元 18,000	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(92)
美元 8,571	澳元 11,726	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(100)
美元 50,677	澳元 70,000	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(108)
美元 4,421	英镑 3,193	2021 年 10 月 21 日	法国巴黎银行	(115)
美元 94,053	加元 119,000	2021 年 10 月 21 日	加拿大皇家银行	(122)
美元 47,165	离岸人民币 304,021	2021 年 10 月 21 日	美国道富银行	(132)
美元 9,651	澳元 13,156	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(147)
美元 598,486	加元 757,988	2021 年 10 月 21 日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(178)
美元 7,316	纽元 10,324	2021 年 10 月 21 日	多伦多道明银行	(195)
美元 7,526	纽元 10,620	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(200)
美元 11,068	英镑 8,056	2021 年 10 月 21 日	美林国际, 伦敦	(205)
美元 247,711	离岸人民币 1,599,686	2021 年 10 月 21 日	Citibank N.A., 伦敦	(234)
美元 13,406	英镑 9,698	2021 年 10 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(329)

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 134,114	加元 169,472	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(344)
美元 245,865	离岸人民币 1,586,784	2021年10月21日	美国道富银行	(384)
美元 38,910	澳元 53,235	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(453)
美元 109,823	澳元 151,384	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(462)
美元 52,238	新加坡元 70,223	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(514)
美元 46,373	新加坡元 62,258	2021年10月21日	美国道富银行	(515)
美元 34,593	英镑 25,235	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(567)
美元 33,344	欧元 28,125	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(737)
美元 36,899	澳元 50,000	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(778)
美元 78,601	新加坡元 105,527	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(873)
美元 64,711	澳元 88,311	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(915)
美元 37,106	英镑 26,830	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(929)
美元 79,138	英镑 58,000	2021年10月21日	法国巴黎银行	(932)
美元 52,453	英镑 38,094	2021年10月21日	美国道富银行	(1,088)
美元 115,002	新加坡元 154,606	2021年10月21日	美国道富银行	(1,125)
美元 83,291	欧元 70,457	2021年10月21日	法国巴黎银行	(1,604)
美元 762,571	离岸人民币 4,917,159	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(1,869)
美元 401,095	加元 505,722	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(1,911)
美元 70,287	纽元 98,912	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(2,060)
美元 317,816	加元 400,000	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(2,082)
美元 115,236	纽元 163,813	2021年10月21日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(2,241)
美元 876,936	加元 1,107,138	2021年10月21日	多伦多道明银行	(3,032)
美元 140,395	澳元 190,060	2021年10月21日	多伦多道明银行	(3,094)
美元 127,778	英镑 92,220	2021年10月21日	法国巴黎银行	(3,431)
美元 159,225	欧元 134,315	2021年10月21日	法国巴黎银行	(3,503)
美元 146,447	欧元 123,293	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3,503)
美元 364,649	加元 457,166	2021年10月21日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(3,791)
美元 463,495	加元 582,354	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(3,822)
美元 129,154	澳元 173,489	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(3,824)
美元 157,724	澳元 212,864	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(3,948)
美元 229,285	欧元 194,310	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(4,006)
美元 213,209	纽元 300,455	2021年10月21日	多伦多道明银行	(5,961)
美元 1,576,909	英镑 1,164,911	2021年10月21日	多伦多道明银行	(6,161)
美元 194,158	纽元 272,027	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(6,519)
美元 457,221	澳元 623,505	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(6,795)
美元 316,807	英镑 229,812	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(6,932)
美元 392,285	澳元 532,015	2021年10月21日	法国巴黎银行	(7,953)
美元 371,364	欧元 313,155	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(8,298)
美元 387,841	英镑 281,276	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(8,573)
美元 342,270	英镑 247,209	2021年10月21日	法国巴黎银行	(8,937)
美元 4,477,918	离岸人民币 28,887,249	2021年10月21日	美国道富银行	(8,962)
美元 352,683	英镑 254,842	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(9,058)
美元 317,639	纽元 446,748	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(9,481)
美元 668,754	欧元 568,159	2021年10月21日	多伦多道明银行	(10,041)
美元 470,907	纽元 666,185	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(11,386)

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 458,987	英镑 331,711	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(11,713)
美元 582,596	英镑 421,393	2021年10月21日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(14,396)
美元 550,043	英镑 397,093	2021年10月21日	法国巴黎银行	(14,610)
美元 723,690	澳元 978,547	2021年10月21日	多伦多道明银行	(16,778)
美元 865,100	英镑 627,537	2021年10月21日	美国道富银行	(18,940)
美元 612,263	纽元 860,117	2021年10月21日	法国巴黎银行	(18,972)
美元 669,979	澳元 900,789	2021年10月21日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(19,240)
美元 1,117,996	澳元 1,518,828	2021年10月21日	多伦多道明银行	(20,779)
美元 1,229,161	澳元 1,670,168	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(22,615)
美元 1,648,156	澳元 2,236,098	2021年10月21日	多伦多道明银行	(32,777)
美元 1,778,542	英镑 1,294,072	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(33,636)
美元 8,012,962	新加坡元 1,0765,864	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(83,201)
美元 61,293,117	加元 77,199,294	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(356,954)
美元 24,815,375	欧元 20,878,063	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(609,725)
美元 33,275,320	纽元 46,765,082	2021年10月21日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(1,017,702)
美元 59,852,658	英镑 43,326,134	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(1,432,392)
美元 114,453,140	澳元 153,986,979	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3,211,406)
澳元 1,536	美元 1,109	2021年11月19日	美国道富银行	(0)
澳元 983,916	美元 708,664	2021年11月19日	高盛国际, 伦敦	(2,214)
加元 1,402	美元 1,107	2021年11月19日	法国巴黎银行	(0)
加元 675,706	美元 533,310	2021年11月19日	加拿大皇家银行	(27)
加元 483,689	美元 380,052	2021年11月19日	加拿大皇家银行	(1,725)
离岸人民币 157,749	美元 24,314	2021年11月19日	Citibank N.A., 伦敦	(34)
离岸人民币 598,877	美元 92,276	2021年11月19日	美国道富银行	(157)
离岸人民币 695,316	美元 107,136	2021年11月19日	美国道富银行	(183)
离岸人民币 10,384,819	美元 1,600,607	2021年11月19日	Citibank N.A., 伦敦	(2,231)
英镑 295,710	美元 397,621	2021年11月19日	美国道富银行	(1,113)
纽元 301,439	美元 207,039	2021年11月19日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(839)
新加坡元 68,917	美元 50,640	2021年11月19日	美国道富银行	(119)
美元 1,546	离岸人民币 10,000	2021年11月19日	多伦多道明银行	(2)
美元 1,348	离岸人民币 8,725	2021年11月19日	多伦多道明银行	(2)
美元 124,338	离岸人民币 804,600	2021年11月19日	多伦多道明银行	(153)
			未实现总亏损	(7,161,756)
			未实现净亏损	(6,053,394)

独立核数师报告

致摩根亚洲股息基金（“贵基金”）份额持有人

就财务报表审计作出的报告

意见

我们已审计的内容

摩根亚洲股息基金列载于第五页至第五十八页的财务报表，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二零一一年五月六日订立的信托契约（经修订）（“信托契约”）以及香港证券及期货事务监察委员会颁布的单位信托及互惠基金守则（“证监会守则”）附录 E 的相关披露条文适当地拟备。

核数师就审计财务报表承担的责任

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

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

独立核数师报告（续）

致摩根亚洲股息基金（“贵基金”）份额持有人

核数师就审计财务报表承担的责任（续）

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

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

根据信托契约与证监会守则附录 E 的相关披露条文就相关事项作出的报告

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

罗兵咸永道会计师事务所

执业会计师

香港，二零二三年一月二十日

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二零一一年五月六日所订立之信托契约（经修订）之条款管理本基金。

汇丰机构信托服务（亚洲）有限公司，受托人

二零二三年一月二十日

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	财务期结算日	本基金资产净值	每份额资产净值
30/9/22			30/9/21 (续)		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 136,342,047	澳元 7.25	- PRC 美元份额 (累计)	美元 24,790,120	美元 11.60
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 61,318,511	加元 7.54	- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 18,911,109	美元 10.37
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 16,395,953	欧元 7.91	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 24,230,222	人民币 18.05
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 50,842,961	英镑 7.78	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 1,586,493,943	人民币 10.63
- 港元类别 (累计)	港元 22,555,210	港元 12.35	- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10,554,577	新加坡元 9.99
- 港元类别 (每月派息)	港元 2,032,712,595	港元 8.06	- 美元类别 (累计)	美元 6,882,906	美元 15.21
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 44,500,103	纽元 7.41	- 美元类别 (每月派息)	美元 315,082,437	美元 10.33
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 16,266,496	人民币 9.91	- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 127,689,157	美元 10.80
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 13,778,756	人民币 8.51	- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 12,216,484	美元 11.90
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 46,975,544	人民币 9.80			
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 74,167,080	人民币 7.91	30/9/20		
- PRC 美元份额 (累计)	美元 15,063,976	美元 9.34	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 142,122,799	澳元 7.77
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 11,651,113	美元 8.01	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 66,613,896	加元 8.03
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 21,813,168	人民币 14.77	- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11,380,303	欧元 8.41
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 1,431,961,989	人民币 8.19	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 30,083,335	英镑 8.25
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 5,996,821	新加坡元 7.68	- 港元类别 (累计)	港元 15,620,126	港元 11.87
- 美元类别 (累计)	美元 8,520,838	美元 12.26	- 港元类别 (每月派息)	港元 1,345,765,273	港元 8.40
- 美元类别 (每月派息)	美元 335,998,871	美元 7.97	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 37,561,058	纽元 7.92
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 19,480,421	美元 8.42	- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 29,249,658	人民币 9.22
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 80,422,237	美元 9.25	- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 28,757,606	人民币 8.56
			- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 174,448,284	人民币 9.20
			- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 188,653,747	人民币 8.41
30/9/21			- PRC 美元份额 (累计)	美元 33,288,437	美元 9.11
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 149,977,939	澳元 9.48	- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 28,328,391	美元 8.46
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 73,226,870	加元 9.82	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13,466,808	人民币 13.84
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 19,759,475	欧元 10.29	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 1,231,267,494	人民币 8.69
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 44,864,442	英镑 10.11	- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 5,439,360	新加坡元 8.16
- 港元类别 (累计)	港元 18,177,591	港元 15.19	- 美元类别 (累计)	美元 3,502,317	美元 11.94
- 港元类别 (每月派息)	港元 1,669,881,158	港元 10.35	- 美元类别 (每月派息)	美元 287,170,267	美元 8.41
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 45,460,057	纽元 9.66	- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 87,566,453	美元 8.74
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 21,317,997	人民币 11.15	- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 8,827,529	美元 9.65
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 18,880,389	人民币 9.98			
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 91,573,350	人民币 11.98			
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 107,106,589	人民币 10.28			

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 10.08	澳元 7.25	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.50	澳元 5.86
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.45	加元 7.53	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.68	加元 6.09
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.95	欧元 7.91	- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 9.96	欧元 6.39
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.75	英镑 7.77	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.90	英镑 6.22
- 港元类别 (累计)	港元 16.42	港元 12.35	- 港元类别 (累计)	港元 13.63	港元 8.83
- 港元类别 (每月派息)	港元 11.04	港元 8.06	- 港元类别 (每月派息)	港元 9.99	港元 6.42
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.28	纽元 7.41	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.61	纽元 5.99
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 11.86	人民币 9.91	- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 10.69	人民币 7.20
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.47	人民币 8.51	- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.28	人民币 6.87
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 13.06	人民币 9.80	- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 10.43	人民币 6.77
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.95	人民币 7.90	- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.00	人民币 6.42
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12.52	美元 9.34	- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.45	美元 6.78
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 11.05	美元 8.00	- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.05	美元 6.47
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 19.68	人民币 14.77	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 15.72	人民币 10.19
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 11.33	人民币 8.18	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.34	人民币 6.63
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.64	新加坡元 7.68	- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.72	新加坡元 6.19
- 美元类别 (累计)	美元 16.42	美元 12.26	- 美元类别 (累计)	美元 13.68	美元 8.88
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.00	美元 7.97	- 美元类别 (每月派息)	美元 9.99	美元 6.43
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 11.56	美元 8.42	- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 10.32	美元 6.65
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 12.76	美元 9.24	- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 10.15	美元 9.62
30/9/21			30/9/19		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.26	澳元 7.77	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.77	澳元 8.53
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.62	加元 8.04	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.95	加元 8.69
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.12	欧元 8.41	- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.20	欧元 8.88
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.92	英镑 8.26	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.17	英镑 8.88
- 港元类别 (累计)	港元 16.14	港元 11.93	- 港元类别 (累计)	港元 13.61	港元 11.60
- 港元类别 (每月派息)	港元 11.14	港元 8.41	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.33	港元 9.00
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.46	纽元 7.92	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.88	纽元 8.63
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 11.81	人民币 9.14	- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 10.55	人民币 9.75
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.69	人民币 8.45	- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.39	人民币 9.57
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 12.70	人民币 9.26	- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 10.32	人民币 9.21
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 11.13	人民币 8.41	- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.28	人民币 9.04
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12.37	美元 9.15	- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.33	美元 9.26
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 11.21	美元 8.47	- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.29	美元 9.08
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 19.10	人民币 13.93	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 15.53	人民币 13.24
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 11.51	人民币 8.69	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.62	人民币 9.29
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.80	新加坡元 8.16	- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.98	新加坡元 8.72
- 美元类别 (累计)	美元 16.21	美元 11.99	- 美元类别 (累计)	美元 13.52	美元 11.53
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.15	美元 8.42	- 美元类别 (每月派息)	美元 10.22	美元 8.92
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 11.64	美元 8.75	- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 10.00	美元 9.29
- 美元 C 类别 (每季派息)	美元 12.90	美元 9.66			

业绩记录 (未经审计) (续)

(续)

最高卖出价/最低买入价

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价	财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
30/9/18			30/9/15		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.73	澳元 9.08	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 11.36	澳元 8.56
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.90	加元 9.23	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 11.45	加元 8.63
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.15	欧元 9.46	- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.48	欧元 8.72
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 11.11	英镑 9.44	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 11.48	英镑 8.70
- 港元类别 (累计)	港元 13.96	港元 12.27	- 港元类别 (累计)	港元 12.54	港元 9.68
- 港元类别 (每月派息)	港元 11.22	港元 9.57	- 港元类别 (每月派息)	港元 11.45	港元 8.67
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.84	纽元 9.18	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 11.43	纽元 8.60
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 15.82	人民币 13.95	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.35	人民币 10.00
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 11.62	人民币 9.86	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 12.29	人民币 9.23
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.94	新加坡元 9.26	- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 11.41	新加坡元 8.61
- 美元类别 (累计)	美元 13.87	美元 12.19	- 美元类别 (累计)	美元 12.56	美元 9.69
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.15	美元 9.47	- 美元类别 (每月派息)	美元 11.47	美元 8.69
30/9/17			30/9/14		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.86	澳元 8.64	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 11.02	澳元 9.02
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.99	加元 8.76	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 11.08	加元 9.05
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.23	欧元 8.96	- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.10	欧元 9.05
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.20	英镑 8.93	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 11.10	英镑 9.06
- 港元类别 (累计)	港元 12.53	港元 10.56	- 港元类别 (累计)	港元 11.79	港元 9.35
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.28	港元 8.93	- 港元类别 (每月派息)	港元 11.08	港元 9.06
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.97	纽元 8.74	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 11.07	纽元 9.06
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 14.09	人民币 11.61	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.29	人民币 9.92
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.68	人民币 9.32	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 11.91	人民币 9.92
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.04	新加坡元 8.78	- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 11.08	新加坡元 9.06
- 美元类别 (累计)	美元 12.46	美元 10.57	- 美元类别 (累计)	美元 11.81	美元 9.35
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.23	美元 8.94	- 美元类别 (每月派息)	美元 11.10	美元 9.06
30/9/16			30/9/13		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.79	澳元 7.71	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.57	澳元 9.30
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.93	加元 7.77	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.58	加元 9.32
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.15	欧元 7.91	- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.56	欧元 9.31
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.14	英镑 7.85	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.57	英镑 9.32
- 港元类别 (累计)	港元 11.81	港元 9.01	- 港元类别 (累计)	港元 10.65	港元 9.31
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.10	港元 7.94	- 港元类别 (每月派息)	港元 10.56	港元 9.31
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.90	纽元 7.75	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.59	纽元 9.33
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.94	人民币 9.65	- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.57	新加坡元 9.32
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.62	人民币 8.32	- 美元类别 (累计)	美元 10.66	美元 9.32
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.96	新加坡元 7.79	- 美元类别 (每月派息)	美元 10.57	美元 9.32
- 美元类别 (累计)	美元 11.82	美元 8.94			
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.12	美元 7.88			

经营与管理

管理人及服务提供者

摩根基金（亚洲）有限公司
香港
中环干诺道中 8 号
遮打大厦 19 楼

投资管理

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

助理管理人

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

管理人董事

于二零二三年一月二十日
Ayaz Hatim EBRAHIM
Daniel James WATKINS
Ka Li NG
Kit Yee Elka LEUNG
Stiofan Seamus DEBURCA
Tsun Kay Edwin CHAN

受托人

汇丰机构信托服务（亚洲）有限公
司
香港
中环皇后大道中 1 号

基金注册登记机构

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

核数师

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

