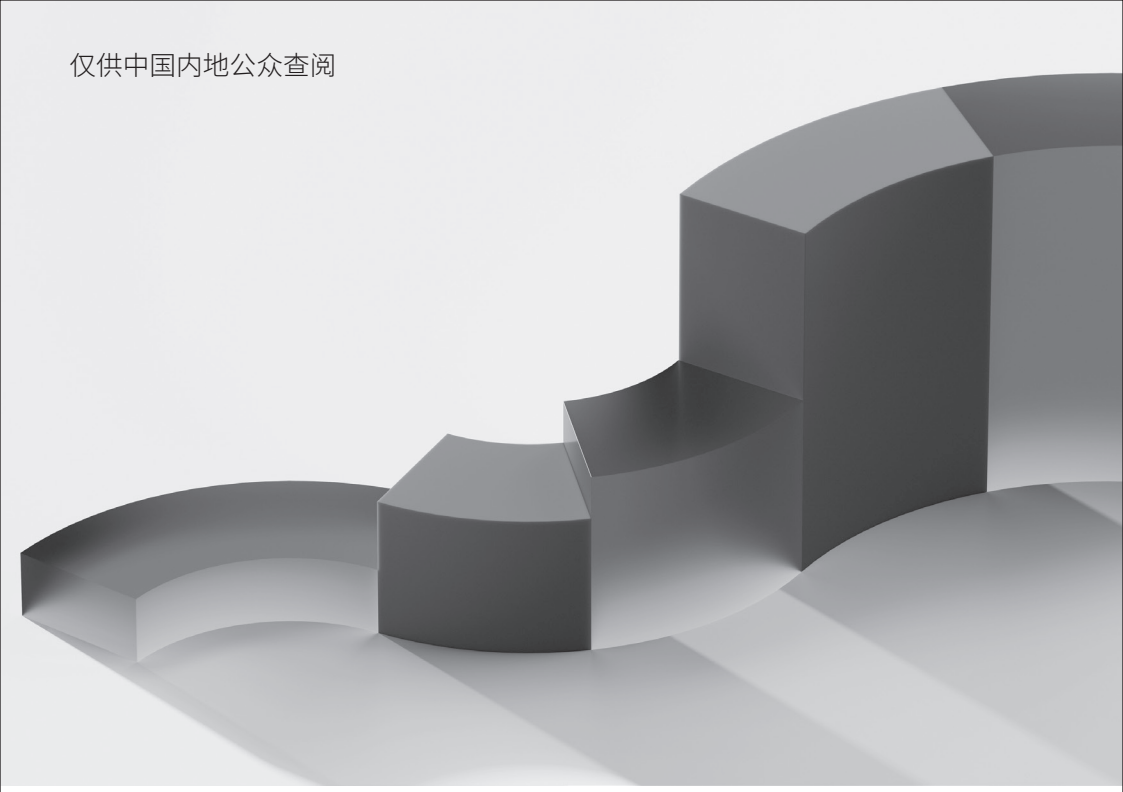
仅供中国内地公众查阅



半年度报告 — 2023年3月31日（未经审核）

摩根国际债券基金

内地与香港互认基金系列

摩根
资产管理

此（等）报告并不构成购买组成本文件内容的任何基金单位之邀请。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，本未经审核半年度报告内若干数据以综合方法表述，因此当中包括并未在中国内地注册的股份类别之资产。

内容 页

投资组合 1 – 5

投资组合持有变动表 6

金融衍生工具详情 7 – 18

财务状况表 19

综合收益表 19 – 20

可赎回份额持有人应占净资产变动表 20

现金流量表 21

财务报表之附注 22 – 30

投资组合

截至二零二三年三月三十一日 *(未经审计)*

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产净值百分比
上市投资(95.4%)			
(I) 债务证券(82.9%)			
澳大利亚(2.8%)			
APA Infrastructure Ltd Ser EMTN (Reg S) (Br) 2% 15Jul2030	欧元 1,500,000	1,405,555	0.1
APT Pipelines Ltd Ser Regs (Regs) 4.2% 23/03/2025	美元 1,000,000	980,894	0.1
Ausgrid Finance Pty Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.85% 01May2023	美元 500,000	507,067	0.0
Aust & NZ Banking Group Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 22Jul2030	美元 3,000,000	2,790,503	0.3
Australia (Govt of) Ser 158 1.25% 21May2032	澳元 16,900,000	9,563,289	0.9
Australia (Govt of) Ser 162 (Reg S) 1.75% 21Jun2051	澳元 2,950,000	1,284,108	0.1
Macquarie Bank Ltd Ser 144A (Reg) Var 03Mar2036	美元 1,500,000	1,146,589	0.1
Macquarie Group Ltd Ser Regs (Reg) (Reg S) Var 14Apr2028	美元 971,000	856,377	0.1
NBN Co Ltd Ser 144A 2.625% 05May2031	美元 4,000,000	3,400,983	0.3
NBN Co Ltd Ser Gmtn (Reg) (Reg S) 4.375% 15Mar2033	欧元 2,000,000	2,243,922	0.2
Scentre Group Trust 1/2 Ser Regs (Regs) 3.5% 12Feb2025	美元 2,250,000	2,192,697	0.2
SGSP Australia Assets (Reg S) 3.25% 29Jul2026	美元 1,950,000	1,859,131	0.2
SGSP Australia Assets Ser EMTN (Reg S) 3.5% 07Jul2027	美元 1,200,000	1,145,452	0.1
Woolworths Group Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 0.375% 15Nov2028	欧元 826,000	727,528	0.1
加拿大(4.5%)			
Bank of Montreal Ser EMTN (Reg S) (Br) 1% 09Sep2026	英镑 1,043,000	1,127,409	0.1
British Columbia Prov of (Reg) 4.3% 18Jun2042	加元 1,000,000	767,542	0.1
British Columbia Prov of 2.2% 18Jun2030	加元 1,000,000	684,107	0.1
Canada (Govt of) 0.25% 01Mar2026	加元 35,000,000	23,664,849	2.1
Canada (Govt of) 0.5% 01Dec2030	加元 4,000,000	2,485,341	0.2
Canada (Govt of) 2% 01Jun2032	加元 9,550,000	6,609,254	0.6
Canada (Govt of) 2.5% 01Dec2032	加元 3,500,000	2,523,783	0.2
Hydro-Quebec 4% 15Feb2055	加元 300,000	221,929	0.0
Hydro-Quebec Ser 19 6.5% 15Feb2035	加元 1,700,000	1,574,65	0.1
Ontario (Province of) (Reg) 2.7% 02Jun2029	加元 1,000,000	714,928	0.1
Ontario (Province of) 2.6% 02Jun2025	加元 600,000	435,962	0.0
Ontario (Province of) 3.5% 02/06/2024	加元 3,750,000	2,779,367	0.2
Ontario Teachers' Financ (Reg) (Reg S) 0.5% 06May2025	欧元 4,009,000	4,111,725	0.4
Province of Quebec (Reg) 2.6% 06Jul2025	加元 2,700,000	1,955,642	0.2
Province of Quebec 3.75% 01Sep2024	加元 1,250,000	922,121	0.1
开曼群岛(0.4%)			
Avolon Holdings Fndg Ltd Ser 144A (Reg) 2.528% 18Nov2027	美元 2,500,000	2,142,101	0.2
CK Hutchison Finance 16 (Br) (Reg S) 0.875% 03Oct2024	欧元 1,800,000	1,876,377	0.2
中国(8.5%)			
China (Govt of) Ser Inbk (Reg) 2.64% 15Jan2028(Interbank)	人民币 190,000,000	27,768,724	2.5
China (Govt of) Ser Inbk (Reg) 2.8% 15Nov2032(Interbank)	人民币 440,000,000	64,306,244	5.8
Tencent Music Ent Grp (Reg) 2% 03Sep2030	美元 2,500,000	1,985,346	0.2
法国(3.4%)			
BPCE Sa Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.5% 15Sep2027	欧元 1,300,000	1,240,920	0.1
Dexia Credit Local (Br) (Reg S) 1.25% 26Nov2024	欧元 1,200,000	1,265,714	0.1
Dexia Credit Local Ser EMTN (Br) (Reg S) 1% 18Oct2027	欧元 1,000,000	994,223	0.1
Dexia Credit Local Ser Regs (Reg) (Reg S) 0.75% 07May2023	美元 3,016,000	3,012,634	0.3
France (Govt of) (Reg S) 2% 25Nov2032	欧元 22,200,347	22,615,601	2.0
France (Govt of) (Regs) 3.5% 25Apr2026	欧元 5,000,000	5,736,595	0.5

投资组合（续）

截至二零二三年三月三十一日 ***（未经审计）***

	单位数目	公平值美元	占资产净值百分比
法国（续）			
Societe Generale Ser 144A (Reg) 7.367% 10Jan2053	美元 1,350,000	1,340,955	0.1
Societe Generale Ser Regs (Regs) 4.25% 19Aug2026	美元 2,000,000	1,835,502	0.2
德国(7.8%)			
Bundeschatzanweisungen (Reg S) (Br) 0% 15Aug2052	欧元 5,042,500	2,805,331	0.2
Bundeschatzanweisungen (Reg S) (Br) 1.8% 15Aug2053	欧元 9,000,000	8,659,335	0.8
Bundeschatzanweisungen (Reg S) (Br) 2.3% 15Feb2033	欧元 42,000,000	45,763,324	4.1
Bundeschatzanweisungen Ser 187 (Reg S) (Br) 2.2% 13Apr2028	欧元 4,000,000	4,334,789	0.4
Deutsche Bank Ag Ser EMTN (Reg S) (Br) Var 17Feb2027	欧元 2,100,000	1,984,592	0.2
Deutsche Bank Ag Ser EMTN (Reg S) (Br) Var 22Dec2028	英镑 500,000	495,593	0.0
KFW Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.125% 09Jan2032	欧元 20,000,000	17,182,550	1.5
KFW Ser EMTN (Reg S) (Br) 1.125% 15Sep2032	欧元 4,898,000	4,593,951	0.4
Land Nordrhein-Westfalen Ser EMTN (Reg S) (Br) 2.15% 21Mar2119	欧元 1,200,000	930,168	0.1
Vonovia Se Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.375% 16Jun2027	欧元 1,500,000	1,335,305	0.1
香港(0.1%)			
AIA Group Ltd Ser GMTN (Reg) (Reg S) Var Perp 31Dec2049	美元 1,850,000	1,629,828	0.1
印度(0.2%)			
NTPC Ltd Ser EMTN (Reg) (Reg S) 2.75% 01Feb2027	欧元 1,500,000	1,512,272	0.1
ONGC Videsh Ltd Ser Regs 4.625% 15Jul2024	美元 1,350,000	1,351,121	0.1
印度尼西亚(0.2%)			
Indonesia (Rep of) 1.45% 18Sep2026	欧元 1,000,000	1,008,852	0.1
Perusahaan Listrik Negar Ser Regs (Reg S) 1.875% 05Nov2031	欧元 1,000,000	827,790	0.1

（续）

	单位数目	公平值美元	占资产净值百分比
爱尔兰(0.5%)			
Aercap Ireland Cap/Globa (Reg) 3% 29Oct2028	美元 1,500,000	1,329,513	0.1
Glencore Cap Fin Dac Ser EMTN (Reg S) (Br) 1.125% 10Mar2028	欧元 1,500,000	1,404,452	0.1
Ireland (Govt of) (Reg) (Reg S) 1.3% 15May2033	欧元 667,322	638,296	0.1
Zurich Finance Ireland Ser EMTN (Reg S) (Br) Var 19Apr2051	美元 2,500,000	1,979,658	0.2
以色列(0.2%)			
Israel Electric Corp Ltd (Reg) (Regs) 5% 12Nov2024	美元 2,000,000	2,014,633	0.2
意大利(4.8%)			
Italy (Rep of) (Br) 1.45% 15Nov2024	欧元 6,000,000	6,380,716	0.6
Italy (Rep of) (Reg) 0.875% 06May2024	美元 2,000,000	1,909,524	0.2
Italy (Rep of) (Reg) 2.375% 17Oct2024	美元 5,463,000	5,286,575	0.5
Italy (Rep of) 2.5% 01Dec2024	欧元 21,000,000	22,759,745	2.0
Italy (Rep of) Ser 5Y (Reg S) (Br) 3.4% 01Apr2028	欧元 15,000,000	16,329,467	1.5
日本(3.1%)			
Dai-Ichi Mutual Life Var Perp 31Dec2049	美元 1,200,000	1,195,993	0.1
Development Bk of Japan Ser Gmtn (Reg) (Reg S) 0.875% 10Oct2025	欧元 400,000	408,908	0.0
Japan (Govt of) Ser 183 1.4% 20Dec2042	日元 550,000,000	4,408,500	0.4
Japan (Govt of) Ser 76 1.4% 20Sep2052	日元 3,325,000,000	25,738,327	2.3
Japan Fin Org Municipal Ser Regs (Reg S) 3.375% 27Sep2023	美元 1,000,000	992,110	0.1
Sumitomo Mitsui Finance (Reg) (Reg S) 2.512% 22Jan2025	美元 2,000,000	1,915,273	0.2

投资组合（续）

截至二零二三年三月三十一日 ***（未经审计）***

	单位数目	公平值 美元	占资产净值百分比
韩国(0.3%)			
Hanwha Life Insurance 04/02/32-RegS	美元 2,000,000	1,789,425	0.2
KB Capital Co Ltd (Reg) (Reg S) 1.5% 28Oct2025	美元 800,000	726,288	0.1
卢森堡(0.3%)			
EFSF Ser EMTN (Br) (Reg S) 0.75% 03May2027	欧元 1,550,000	1,555,129	0.1
European Investment Bank 4.875Pct 15/02/2036	美元 800,000	893,039	0.1
Traton Finance Luxembrg Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.125% 24Mar2025	欧元 1,200,000	1,212,670	0.1
墨西哥(2.4%)			
Mexico (Utd States O) 7.75% 29/05/31	墨西哥比索 4,400,000	23,477,754	2.1
Petroleos Mexicanos (Reg) 6.5% 13Mar2027	美元 3,500,000	3,195,213	0.3
摩洛哥(0.1%)			
Kingdom of Morocco Ser Regs (Reg S) 2% 30Sep2030	欧元 1,150,000	1,016,465	0.1
荷兰(0.2%)			
JT Intl Fin Services Bv Ser EMTN (Reg) (Reg S) 3.3% 14Sep2051	美元 2,750,000	1,726,885	0.2
新西兰(0.6%)			
ASB Bank Limited Ser EMTN (Reg S) (Br) 4.5% 16Mar2027	欧元 636,000	705,277	0.1
ASB Bank Limited Ser Regs (Reg S) 5.398% 29Nov2027	美元 2,650,000	2,730,828	0.2
Auckland Council Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.125% 26Sep2029	欧元 3,000,000	2,681,211	0.2
Westpac Sec Nz/London (Reg S) (Br) 0.1% 13Jul2027	欧元 1,500,000	1,379,907	0.1
葡萄牙(0.3%)			
Portugal (Govt of) (Reg S) 2.875% 15Oct2025	欧元 2,700,000	2,983,906	0.3

（续）

	单位数目	公平值 美元	占资产净值百分比
罗马尼亚(0.2%)			
Romania (Govt of) Ser Regs (Reg) (Reg S) 6.625% 27Sep2029	欧元 2,000,000	2,297,082	0.2
沙特阿拉伯(0.5%)			
Gaci First Investment (Reg) (Reg S) 4.75% 14Feb2030	美元 2,788,000	2,832,946	0.3
Saudi International Bond Ser Regs (Reg S) 0% 03Mar2024	欧元 2,000,000	2,097,009	0.2
新加坡(0.3%)			
Temasek Financial I Ltd Ser Gmtn (Reg) (Reg S) 3.5% 15Feb2033	欧元 2,791,000	3,043,905	0.3
南非(0.5%)			
Republic of South Africa Ser 2035 (Reg) 8.875% 28Feb2035	南非兰特 120,000,000	5,858,008	0.5
西班牙(2.5%)			
Banco De Sabadell Sa Ser Dmtn (Reg) (Reg S) 3.5% 28Aug2026	欧元 1,900,000	2,074,887	0.2
Santander UK Group Hldgs (Reg) Var 21Nov2026	美元 2,600,000	2,699,661	0.2
Spain (Govt of) 0% 31Jan2027	欧元 5,000,000	4,863,412	0.4
Spain (Govt of) 0% 31Jan2028	欧元 20,000,000	18,861,641	1.7
国际(2.0%)			
African Export-Import Ba Ser 144A (Reg) 2.634% 17May2026	美元 2,000,000	1,806,629	0.2
Banque Ouest Africaine D Ser Regs (Reg S) 2.75% 22Jan2033	欧元 2,000,000	1,630,215	0.1
European Union Ser EMTN (Reg S) (Br) 3.375% 04Apr2032	欧元 10,000,000	11,557,662	1.0
European Union Ser Ngeu (Reg S) (Br) 0% 04Oct2028	欧元 1,465,000	1,358,782	0.1
European Union Ser Ngeu (Reg S) (Br) 2% 04Oct2027	欧元 14,000,000	14,794,790	1.3
European Union Ser Ngeu (Reg S) (Br) 3.375% 04Nov2042	欧元 10,000,000	11,090,186	1.0

投资组合（续）

截至二零二三年三月三十一日 ***（未经审计）***

	单位数目	公平值 美元	占资产净值百分比
瑞士(0.3%)			
Credit Suisse Group Ag (Reg S) Var 30Sep2027	英镑 2,700,000	3,432,573	0.3
土耳其(0.1%)			
Hyundai Assan Otomotiv 1.625% 12/07/26-RegS	美元 1,000,000	880,460	0.1
英国(3.1%)			
HSBC Holdings Plc (Reg) Var 24Jul2027	英镑 1,000,000	1,097,842	0.1
HSBC Holdings Plc Var 03Nov2028	美元 1,300,000	1,424,430	0.1
Imperial Brands Fin Plc Ser Regs (Reg) (Reg S) 3.125% 26Jul2024	美元 2,080,000	2,027,368	0.2
National Grid Plc Ser EMTN (Reg S) (Br) 0.553% 18Sep2029	欧元 1,000,000	880,125	0.1
Standard Chartered Plc Ser EMTN (Reg S) (Br) Var 23Sep2031	欧元 1,525,000	1,435,013	0.1
Thames Water Util Fin Ser EMTN (Reg S) (Br) 4.375% 18Jan2031	欧元 1,300,000	1,424,938	0.1
UK (Gilts) (Reg) (Reg S) 3.25% 31Jan2033	英镑 9,300,000	11,328,950	1.0
UK (Gilts) (Reg) (Reg S) 3.75% 22Oct2053	英镑 13,000,000	15,858,452	1.4
美国(30.8%)			
American Honda Finance 0.3% 07Jul2028	欧元 1,500,000	1,374,619	0.1
Athene Global Funding Ser 144A (Reg) 1.73% 02Oct2026	美元 2,000,000	1,756,319	0.2
Brambles Usa Inc Ser Regs (Reg) (Reg S) 4.125% 23Oct2025	美元 2,700,000	2,689,520	0.2
General Motors Finl Co Ser EMTN (Reg) (Reg S) 5.15% 15Aug2026	英镑 2,204,000	2,705,844	0.2
Global Payments Inc (Reg) 5.95% 15Aug2052	美元 1,000,000	961,340	0.1
Goldman Sachs Group Inc Ser EMTN (Reg) (Reg S) Var 16Dec2025	英镑 2,000,000	2,300,453	0.2
Goldman Sachs Group Inc Var 21Oct2027	美元 2,040,000	1,841,642	0.2

（续）

	单位数目	公平值 美元	占资产净值百分比
Goodman US Fin Three Ser Regs (Reg) 3.7% 15Mar2028	美元 2,000,000	1,851,954	0.2
Magallanes Inc Ser 144A 5.05% 15Mar2042	美元 3,250,000	2,728,645	0.2
Morgan Stanley (Reg) Var 29Oct2027	欧元 3,000,000	2,854,721	0.3
Synchrony Financial (Reg) 4.875% 13Jun2025	美元 1,700,000	1,600,016	0.1
Take-Two Interactive Sof (Reg) 4% 14Apr2032	美元 1,000,000	937,942	0.1
US Treasury 2.375% 15Feb2042	美元 10,000,000	8,078,354	0.7
US Treasury 3% 15Aug2052	美元 9,500,000	8,385,040	0.8
US Treasury 3.375% 15Aug2042	美元 10,500,000	9,907,495	0.9
US Treasury 3.5% 15Feb2033	美元 89,350,000	89,913,247	8.0
US Treasury 3.5% 31Jan2028	美元 20,000,000	20,019,152	1.8
US Treasury 3.625% 15Feb2053	美元 28,250,000	28,176,457	2.5
US Treasury 3.875% 30Nov2027	美元 9,000,000	9,213,567	0.8
US Treasury 4% 29Feb2028	美元 20,000,000	20,437,535	1.8
US Treasury 4.25% 31Dec2024	美元 23,000,000	23,269,986	2.1
US Treasury Bill 0% 23May2023	美元 25,000,000	24,840,850	2.2
US Treasury Bill 0% 25May2023	美元 25,000,000	24,833,525	2.2
US Treasury Bill 0% 30May2023	美元 50,000,000	49,632,950	4.4
US Treasury Note 7.625% 15Feb2025	美元 5,000,000	5,366,338	0.5
维京群岛(0.2%)			
Cheung Kong Infra Fin Bv (Reg) (Reg S) 1% 12Dec2024	欧元 2,530,000	2,590,738	0.2
		926,909,350	82.9
(II) 集体投资计划(12.9%)			
卢森堡(12.9%)			
JPMF-JPM Global Corporate Bond 'X' (dist)-USD*#	1,507,163	144,446,473	12.9
		144,446,473	12.9

投资组合（续）

截至二零二三年三月三十一日 ***（未经审计）***

	单位数目	公平值 美元	占资产净值百分比
(III) 衍生性产品(-0.4%)			
远期外汇合约(-0.3%)		(3,906,240)	(0.3)
期货(-0.1%)			
US 5Yr Note (CBT)			
30/06/2023	490	(484,508)	(0.0)
Euro-BUXL 30Y Bnd			
08/06/2023	35	350,597	0.0
Euro-BTP Future			
08/06/2023	(140)	(631,564)	(0.1)
		(4,671,715)	(0.4)
总上市投资		1,066,684,108	95.4
其他净资产		51,677,043	4.6
截至二零二三年三月三十一日可赎回份额持有人应占净资产		1,118,361,151	100.0
总投资，按成本		1,079,158,486	

* 由管理人的关联人士发行和管理

\# 在香港未获认可及并非供香港公众投资

投资组合持有变动表 （续）

截至二零二三年三月三十一日止期间 ***（未经审计）***

	持有占资产净值百分比	
	31.3.2023	30.9.2022
上市投资		
债务证券		
美国	30.8	28.0
中国	8.5	9.2
德国	7.8	3.0
意大利	4.8	4.1
加拿大	4.5	6.5
国际	3.7	2.1
法国	3.4	3.7
日本	3.1	13.0
英国	3.1	0.9
澳大利亚	2.8	4.7
西班牙	2.5	4.4
墨西哥	2.4	0.1
新西兰	0.6	0.4
爱尔兰	0.5	0.7
沙特阿拉伯	0.5	0.2
南非	0.5	-
开曼群岛	0.4	0.4
卢森堡	0.3	0.4
葡萄牙	0.3	0.3
新加坡	0.3	0.2
瑞士	0.3	0.1
韩国	0.3	-
印度	0.2	0.5
印度尼西亚	0.2	0.4
以色列	0.2	0.2
维京群岛	0.2	0.1
荷兰	0.2	-
罗马尼亚	0.2	-
香港	0.1	0.4
摩洛哥	0.1	0.1
土耳其	0.1	-
匈牙利	-	0.3
冰岛	-	0.2
捷克共和国	-	0.2
集体投资计划		
卢森堡	12.9	4.9
衍生性产品		
远期外汇合约	(0.3)	0.6
期货	(0.1)	0.0
总上市投资	95.4	90.3
其他净资产	4.6	9.7
可赎回份额持有人应占净资产	100.0	100.0

金融衍生工具详情
截至二零二三年三月三十一日 *(未经审计)*

截至二零二三年三月三十一日，本基金持有之金融衍生工具如下：

(a) 远期外汇合约

以下为截至二零二三年三月三十一日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／（亏损）美元
截至二零二三年三月三十一日				
未平仓合约：				
美元 305,352	离岸人民币 2,103,049	2023 年 4 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	914
美元 278,397	离岸人民币 1,917,401	2023 年 4 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	833
美元 343,592	澳元 514,028	2023 年 4 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	690
美元 9,869	离岸人民币 67,830	2023 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	9
美元 1,109	纽元 1,777	2023 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	3
美元 2,396	离岸人民币 16,468	2023 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	2
澳元 26,525	美元 17,774	2023 年 4 月 4 日	法国巴黎银行	7
美元 568,116	离岸人民币 3,907,644	2023 年 4 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	997
美元 70,472	离岸人民币 484,721	2023 年 4 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	124
美元 8,919	离岸人民币 61,425	2023 年 4 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	27
美元 2,447	纽元 3,931	2023 年 4 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	13
美元 1,104	加元 1,499	2023 年 4 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	4
美元 1,098	离岸人民币 7,564	2023 年 4 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	3
美元 1,098	澳元 1,642	2023 年 4 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	2
澳元 11,052,843	美元 7,436,602	2023 年 4 月 5 日	Citibank N.A., 伦敦	33,154
日元 2,918,869,034	美元 22,324,922	2023 年 4 月 5 日	美国道富银行	384,018
日元 237,597,443	欧元 1,705,022	2023 年 4 月 5 日	美林国际，伦敦	66,694
美元 9,500,587	欧元 8,845,893	2023 年 4 月 5 日	美国道富银行	111,600
美元 3,996,987	欧元 3,764,208	2023 年 4 月 5 日	巴克莱银行, 伦敦	93,303
美元 48,302,031	日元 6,433,830,557	2023 年 4 月 5 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	60,557
美元 44,884,076	加元 60,820,795	2023 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	58,705
美元 2,485,133	欧元 2,336,980	2023 年 4 月 5 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	54,293
美元 2,121,338	欧元 1,996,834	2023 年 4 月 5 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	48,475
美元 2,180,893	欧元 2,047,309	2023 年 4 月 5 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	43,768
美元 1,918,765	欧元 1,803,278	2023 年 4 月 5 日	加拿大皇家银行	40,725
美元 2,008,674	欧元 1,859,006	2023 年 4 月 5 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	11,373
美元 5,199,974	南非兰特 92,461,734	2023 年 4 月 5 日	摩根士丹利国际股份有限公司	9,978
美元 9,830,244	澳元 14,680,222	2023 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	2,907
澳元 297,000	美元 199,176	2023 年 4 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	231
离岸人民币 61,816,435	美元 9,074,197	2023 年 4 月 6 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	69,736
纽元 70,788	美元 44,290	2023 年 4 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	0
美元 94,287,698	离岸人民币 648,306,180	2023 年 4 月 6 日	高盛国际，伦敦	147,507
美元 7,979,946	离岸人民币 55,128,418	2023 年 4 月 6 日	加拿大皇家银行	50,308
美元 1,498,258	离岸人民币 10,397,549	2023 年 4 月 6 日	美林国际，伦敦	16,296
美元 2,355,555	离岸人民币 16,192,718	2023 年 4 月 6 日	摩根士丹利国际股份有限公司	3,149
美元 1,684,284	离岸人民币 11,564,528	2023 年 4 月 6 日	法国巴黎银行	257
美元 503,709	离岸人民币 3,458,536	2023 年 4 月 6 日	法国巴黎银行	77
美元 8,200	离岸人民币 56,394	2023 年 4 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	14

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／（亏损） 美元
美元 1,394	离岸人民币 9,586	2023 年 4 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	2
美元 1,102	离岸人民币 7,578	2023 年 4 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	2
美元 1,970	澳元 2,941	2023 年 4 月 6 日	法国巴黎银行	0
美元 9,936	离岸人民币 68,194	2023 年 4 月 11 日	法国巴黎银行	2
澳元 1,872,052	美元 1,261,546	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	6,927
澳元 215,720	美元 145,962	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,390
澳元 189,187	美元 127,782	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	992
澳元 536,127	美元 360,129	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	825
澳元 170,440	美元 114,902	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	676
澳元 182,271	美元 122,830	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	674
澳元 40,138	美元 27,194	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	294
澳元 112,947	美元 75,956	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	261
澳元 45,235	美元 30,386	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	70
澳元 287,864	美元 192,960	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	38
澳元 363,098	美元 243,353	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	11
澳元 2,005	美元 1,354	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	11
澳元 1,631	美元 1,100	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	7
澳元 1,626	美元 1,096	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	6
澳元 1,645	美元 1,106	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	4
澳元 1,656	美元 1,110	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	0
离岸人民币 20,467,525	美元 2,998,078	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	13,421
离岸人民币 4,495,908	美元 660,852	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	5,241
离岸人民币 3,567,742	美元 522,602	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	2,339
离岸人民币 1,218,225	美元 179,066	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	1,420
离岸人民币 13,289,084	美元 1,938,727	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	859
离岸人民币 281,786	美元 41,276	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	185
离岸人民币 125,278	美元 18,415	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	146
离岸人民币 172,923	美元 25,330	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	113
离岸人民币 78,310	美元 11,511	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	91
离岸人民币 623,396	美元 90,968	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	62
离岸人民币 29,999	美元 4,394	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	20
离岸人民币 24,435	美元 3,579	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	16
离岸人民币 169,490	美元 24,727	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	11
离岸人民币 157,978	美元 23,047	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	10
离岸人民币 8,305	美元 1,221	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	10
离岸人民币 97,317	美元 14,201	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	10
离岸人民币 7,567	美元 1,112	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	9
离岸人民币 7,602	美元 1,113	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	5
离岸人民币 7,602	美元 1,113	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	5
离岸人民币 47,496	美元 6,931	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	5
离岸人民币 55,452	美元 8,090	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	4
离岸人民币 17,078	美元 2,492	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	1
离岸人民币 7,647	美元 1,116	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	1
离岸人民币 7,498	美元 1,094	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	0
离岸人民币 7,498	美元 1,094	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	0
离岸人民币 7,498	美元 1,094	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	0
纽元 48,112	美元 30,227	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	124
美元 276,957,976	离岸人民币 1,915,985,306	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,438,696
美元 100,950,510	离岸人民币 698,371,993	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	888,899
美元 41,358,404	加元 56,400,427	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	327,055
美元 10,106,914	离岸人民币 70,294,560	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	143,721

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 16,327,739	纽元 26,324,194	2023 年 4 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	142,703
美元 7,448,302	离岸人民币 51,841,140	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	111,382
美元 16,100,305	离岸人民币 110,971,546	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	82,011
美元 13,570,297	离岸人民币 93,584,036	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	76,503
美元 8,555,527	离岸人民币 59,186,825	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	75,334
美元 18,435,498	离岸人民币 126,751,699	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	47,944
美元 8,548,385	离岸人民币 58,945,550	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	47,292
美元 3,780,632	离岸人民币 26,230,150	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	44,354
美元 49,748,484	澳元 74,284,221	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	35,612
美元 3,489,122	离岸人民币 24,143,990	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	31,651
美元 6,360,346	离岸人民币 43,820,430	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	29,725
美元 4,238,136	离岸人民币 29,183,186	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	17,473
美元 1,476,229	离岸人民币 10,230,031	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	15,556
美元 1,219,750	离岸人民币 8,452,677	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	12,853
美元 2,689,409	离岸人民币 18,513,970	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	10,373
美元 3,214,255	离岸人民币 22,112,657	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	10,302
美元 1,167,496	离岸人民币 8,076,692	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	10,280
美元 444,602	加元 613,261	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	8,658
美元 949,837	离岸人民币 6,570,613	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	8,316
美元 379,815	加元 523,226	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	6,900
美元 507,495	澳元 765,412	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	5,472
美元 3,035,009	离岸人民币 20,848,190	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	5,157
美元 299,030	加元 411,323	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	4,978
美元 316,085	离岸人民币 2,200,000	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	4,728
美元 532,925	离岸人民币 3,686,573	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	4,666
美元 1,624,032	离岸人民币 11,166,170	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	4,264
美元 3,237,283	离岸人民币 22,227,239	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	3,982
美元 7,578,276	离岸人民币 51,995,318	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	3,890
美元 270,880	离岸人民币 1,884,001	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3,852
美元 202,373	加元 278,564	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	3,513
美元 964,162	离岸人民币 6,633,009	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	3,090
美元 327,427	加元 447,049	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	2,986
美元 738,529	离岸人民币 5,084,055	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	2,848
美元 361,980	澳元 544,261	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,775
美元 924,977	离岸人民币 6,361,489	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	2,681
美元 241,955	加元 330,764	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,512
美元 239,698	加元 327,466	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,332
美元 2,028,619	离岸人民币 13,927,160	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	2,296
美元 189,925	离岸人民币 1,317,709	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	2,228
美元 152,299	纽元 246,748	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,086
美元 244,182	澳元 367,447	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	2,076
美元 120,684	纽元 196,151	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	2,043
美元 2,209,478	离岸人民币 15,165,130	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	1,962
美元 1,898,394	离岸人民币 13,029,606	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	1,636
美元 286,103	离岸人民币 1,973,048	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	1,615
美元 293,909	离岸人民币 2,025,769	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	1,497
美元 73,852	加元 101,898	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,461
美元 688,973	离岸人民币 4,733,999	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,358
美元 90,340	加元 123,977	2023 年 4 月 20 日	加拿大皇家银行	1,291
美元 133,037	澳元 200,358	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	1,239
美元 128,226	离岸人民币 887,295	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	1,163

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 169,119	澳元 253,995	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	1,104
美元 1,239,154	离岸人民币 8,505,144	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	1,100
美元 291,280	澳元 436,099	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	987
美元 51,717	纽元 84,228	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	983
美元 1,273,466	离岸人民币 8,739,558	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	971
美元 64,867	纽元 105,118	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	902
美元 145,725	加元 198,367	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	887
美元 111,578	澳元 167,740	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	839
美元 58,534	加元 80,283	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	803
美元 35,439	纽元 57,885	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	779
美元 167,257	离岸人民币 1,151,706	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	690
美元 40,591	加元 55,831	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	673
美元 81,437	纽元 131,220	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	665
美元 44,165	离岸人民币 307,392	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	661
美元 581,274	离岸人民币 3,990,647	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	658
美元 98,999	澳元 148,673	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	639
美元 208,793	纽元 334,680	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	609
美元 230,454	离岸人民币 1,584,503	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	605
美元 71,628	澳元 107,749	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	584
美元 96,009	纽元 154,336	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	555
美元 52,475	纽元 84,732	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	540
美元 66,815	澳元 100,470	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	518
美元 93,163	离岸人民币 642,407	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	516
美元 40,326	澳元 60,927	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	507
美元 217,979	纽元 349,192	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	503
美元 49,567	纽元 80,000	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	487
美元 44,801	纽元 72,360	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	473
美元 233,592	离岸人民币 1,605,030	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	460
美元 88,649	纽元 142,409	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	453
美元 496,206	离岸人民币 3,405,707	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	428
美元 147,521	离岸人民币 1,014,271	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	384
美元 43,608	离岸人民币 301,661	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	382
美元 37,221	纽元 60,052	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	353
美元 73,885	离岸人民币 509,041	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	345
美元 24,513	澳元 37,000	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	284
美元 69,925	加元 94,967	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	264
美元 81,419	离岸人民币 560,128	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	261
美元 64,900	离岸人民币 446,774	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	250
美元 93,832	纽元 150,305	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	211
美元 9,138	纽元 14,941	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	210
美元 22,900	纽元 36,879	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	174
美元 34,533	澳元 51,761	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	157
美元 258,291	离岸人民币 1,772,162	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	133
美元 44,627	离岸人民币 306,921	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	129
美元 78,526	澳元 117,338	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	112
美元 137,953	离岸人民币 946,744	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	105
美元 84,731	离岸人民币 581,767	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	104
美元 56,695	离岸人民币 389,450	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	96

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 4,366	加元 6,005	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	72
美元 6,404	加元 8,755	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	66
美元 14,101	离岸人民币 97,150	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	66
美元 51,156	离岸人民币 351,204	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	58
美元 8,021	加元 10,928	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	56
美元 43,504	离岸人民币 298,590	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	37
美元 2,948	澳元 4,455	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	37
美元 18,634	离岸人民币 128,039	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	37
美元 2,463	加元 3,378	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	34
美元 3,846	离岸人民币 26,603	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	34
美元 10,322	离岸人民币 71,010	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	33
美元 8,203	离岸人民币 56,472	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	32
美元 1,579	加元 2,177	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	30
美元 32,770	离岸人民币 224,921	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	29
美元 15,715	纽元 25,155	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	24
美元 6,840	离岸人民币 47,026	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	18
美元 3,934	离岸人民币 27,050	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	10
美元 1,347	加元 1,835	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	9
美元 3,109	离岸人民币 21,383	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	9
美元 6,832	离岸人民币 46,902	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	8
美元 3,488	离岸人民币 23,966	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	7
美元 4,029	离岸人民币 27,675	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	7
美元 2,198	离岸人民币 15,118	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	6
美元 1,503	离岸人民币 10,352	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	6
美元 7,449	离岸人民币 51,118	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	6
美元 4,865	离岸人民币 33,390	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	4
欧元 255,669,051	美元 278,310,744	2023 年 5 月 3 日	法国巴黎银行	54,355
英镑 30,198,022	美元 37,418,231	2023 年 5 月 3 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	55,878
美元 3,068,890	欧元 2,820,352	2023 年 5 月 3 日	美国道富银行	629
美元 2,649,497	离岸人民币 18,158,667	2023 年 5 月 4 日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,402
美元 682,890	离岸人民币 4,686,836	2023 年 5 月 4 日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,319
澳元 27,078	美元 18,187	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	20
纽元 1,758	美元 1,100	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	0
美元 1,341,598	离岸人民币 9,193,240	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	2,236
美元 3,263,793	离岸人民币 22,332,776	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	729
美元 4,983,159	澳元 7,428,082	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	446
美元 173,398	离岸人民币 1,188,205	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	289
美元 15,109	离岸人民币 103,533	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	25
美元 100,298	离岸人民币 686,300	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	22
美元 739,446	加元 1,000,000	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	15
			未实现总收益	6,200,956
澳元 107,749	美元 71,581	2023 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	(587)
离岸人民币 1,584,503	美元 230,094	2023 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	(656)
离岸人民币 11,166,170	美元 1,621,496	2023 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	(4,626)
纽元 72,360	美元 44,799	2023 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	(474)
美元 1,110	澳元 1,656	2023 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	(0)
加元 10,928	美元 8,019	2023 年 4 月 4 日	法国巴黎银行	(56)

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 51,118	美元 7,438	2023 年 4 月 4 日	法国巴黎银行	(7)
离岸人民币 946,744	美元 137,752	2023 年 4 月 4 日	法国巴黎银行	(133)
离岸人民币 8,739,558	美元 1,271,611	2023 年 4 月 4 日	法国巴黎银行	(1,228)
纽元 349,192	美元 217,970	2023 年 4 月 4 日	法国巴黎银行	(505)
美元 18,158	澳元 27,078	2023 年 4 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	(21)
澳元 8,248,874	美元 5,503,380	2023 年 4 月 5 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(21,906)
加元 3,134,751	美元 2,274,146	2023 年 4 月 5 日	Citibank N.A., 伦敦	(42,240)
加元 57,686,045	美元 42,530,541	2023 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	(95,854)
欧元 1,908,841	美元 2,049,998	2023 年 4 月 5 日	加拿大皇家银行	(24,200)
欧元 2,208,059	美元 2,366,385	2023 年 4 月 5 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(32,952)
欧元 1,376,313	美元 1,462,152	2023 年 4 月 5 日	加拿大皇家银行	(33,387)
欧元 2,398,537	美元 2,562,310	2023 年 4 月 5 日	美国道富银行	(44,005)
欧元 3,042,437	美元 3,249,188	2023 年 4 月 5 日	美国道富银行	(56,806)
欧元 3,519,308	美元 3,739,687	2023 年 4 月 5 日	多伦多道明银行	(84,488)
欧元 10,961,461	美元 11,824,162	2023 年 4 月 5 日	美林国际，伦敦	(86,858)
欧元 12,879,218	美元 13,699,239	2023 年 4 月 5 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(295,667)
欧元 17,350,824	美元 18,556,685	2023 年 4 月 5 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(297,188)
欧元 31,073,841	美元 32,814,025	2023 年 4 月 5 日	美林国际，伦敦	(951,649)
欧元 193,308,742	美元 205,604,145	2023 年 4 月 5 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(4,450,354)
英镑 2,296,371	美元 2,813,662	2023 年 4 月 5 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(25,861)
英镑 15,811,898	美元 19,108,837	2023 年 4 月 5 日	巴克莱银行, 伦敦	(442,986)
英镑 12,089,753	美元 14,456,098	2023 年 4 月 5 日	美国道富银行	(493,197)
日元 3,277,364,080	美元 24,089,604	2023 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	(546,079)
墨西哥比索 69,665,925	美元 3,797,413	2023 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	(58,533)
墨西哥比索 344,108,788	美元 18,651,852	2023 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	(394,257)
美元 22,902,871	墨西哥比索 413,774,713	2023 年 4 月 5 日	巴克莱银行, 伦敦	(815)
美元 3,097,898	澳元 4,621,494	2023 年 4 月 5 日	加拿大皇家银行	(2,315)
美元 37,396,476	英镑 30,198,022	2023 年 4 月 5 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(55,836)
美元 277,873,550	欧元 255,669,051	2023 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	(56,656)
南非兰特 92,461,734	美元 5,000,222	2023 年 4 月 5 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(209,731)
加元 94,967	美元 69,911	2023 年 4 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	(264)
离岸人民币 21,383	美元 3,106	2023 年 4 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	(9)
离岸人民币 306,921	美元 44,574	2023 年 4 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	(133)
离岸人民币 6,361,489	美元 923,879	2023 年 4 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,765)
离岸人民币 23,000,000	美元 3,345,682	2023 年 4 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	(4,602)
离岸人民币 14,454,723	美元 2,086,580	2023 年 4 月 6 日	加拿大皇家银行	(18,960)
离岸人民币 52,537,161	美元 7,567,568	2023 年 4 月 6 日	法国巴黎银行	(85,232)
离岸人民币 269,117,833	美元 39,111,121	2023 年 4 月 6 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(89,798)
离岸人民币 309,098,711	美元 44,545,716	2023 年 4 月 6 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(478,998)
纽元 142,409	美元 88,648	2023 年 4 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	(452)
美元 1,100	纽元 1,758	2023 年 4 月 6 日	法国巴黎银行	(0)
澳元 7,428,082	美元 4,976,154	2023 年 4 月 11 日	法国巴黎银行	(423)
加元 1,000,000	美元 738,979	2023 年 4 月 11 日	法国巴黎银行	(21)
离岸人民币 103,533	美元 15,061	2023 年 4 月 11 日	Citibank N.A., 伦敦	(26)
离岸人民币 1,188,205	美元 172,849	2023 年 4 月 11 日	Citibank N.A., 伦敦	(299)
离岸人民币 9,193,240	美元 1,337,344	2023 年 4 月 11 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,315)
纽元 30,431	美元 19,039	2023 年 4 月 11 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 686,300	美元 99,999	2023 年 4 月 12 日	法国巴黎银行	(18)
离岸人民币 22,332,776	美元 3,254,036	2023 年 4 月 12 日	法国巴黎银行	(599)
澳元 1,659	美元 1,110	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
澳元 1,654	美元 1,106	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／（亏损）美元
澳元 1,642	美元 1,098	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
澳元 2,380	美元 1,593	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
澳元 2,608	美元 1,745	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
澳元 1,646	美元 1,098	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(5)
澳元 1,646	美元 1,098	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(5)
澳元 1,664	美元 1,108	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(7)
澳元 1,664	美元 1,108	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(7)
澳元 1,637	美元 1,089	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(9)
澳元 1,637	美元 1,089	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(9)
澳元 1,656	美元 1,100	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(9)
澳元 1,656	美元 1,100	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(9)
澳元 1,663	美元 1,104	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(10)
澳元 1,651	美元 1,093	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(14)
澳元 15,245	美元 10,202	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(15)
澳元 6,343	美元 4,223	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(28)
澳元 9,923	美元 6,620	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(30)
澳元 15,681	美元 10,428	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(81)
澳元 39,524	美元 26,315	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(173)
澳元 111,302	美元 74,362	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(230)
澳元 304,659	美元 203,883	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(294)
澳元 79,174	美元 52,569	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(492)
澳元 61,387	美元 40,618	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(523)
澳元 514,028	美元 343,804	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(689)
澳元 434,232	美元 289,984	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(1,031)
澳元 157,634	美元 104,329	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,315)
澳元 432,431	美元 288,488	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(1,320)
澳元 1,958,914	美元 1,302,178	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(10,655)
加元 1,499	美元 1,104	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
加元 1,509	美元 1,106	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(10)
加元 1,514	美元 1,105	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(14)
加元 1,498	美元 1,092	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(15)
加元 1,509	美元 1,095	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(21)
加元 1,504	美元 1,091	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(21)
加元 5,252	美元 3,860	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(22)
加元 3,356	美元 2,440	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(41)
加元 6,377	美元 4,636	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(77)
加元 89,436	美元 65,840	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(262)
加元 33,929	美元 24,800	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(276)
加元 81,232	美元 59,745	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(294)
加元 80,943	美元 59,518	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(307)
加元 129,204	美元 94,980	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	(514)
加元 49,435	美元 35,940	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(597)
加元 179,171	美元 131,678	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(747)
加元 192,063	美元 141,023	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(930)
加元 184,328	美元 134,595	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,641)
加元 416,000	美元 305,706	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,759)
加元 217,976	美元 159,104	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(2,002)
加元 273,039	美元 199,327	2023 年 4 月 20 日	加拿大皇家银行	(2,476)
加元 333,578	美元 243,745	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(2,802)
加元 328,557	美元 239,837	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2,998)
加元 368,887	美元 269,641	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(3,003)

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 359,912	美元 262,213	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(3,798)
加元 820,375	美元 598,122	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(8,216)
离岸人民币 7,528	美元 1,097	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 7,528	美元 1,097	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 7,528	美元 1,097	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 13,963	美元 2,035	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 7,580	美元 1,104	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 7,580	美元 1,104	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 7,580	美元 1,104	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 20,426	美元 2,977	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 16,468	美元 2,399	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 10,367	美元 1,509	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(3)
离岸人民币 7,593	美元 1,104	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 7,555	美元 1,099	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(3)
离岸人民币 7,555	美元 1,099	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(3)
离岸人民币 7,555	美元 1,099	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(3)
离岸人民币 7,593	美元 1,104	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 7,564	美元 1,100	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币 7,610	美元 1,105	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(5)
离岸人民币 12,978	美元 1,887	2023 年 4 月 20 日	高盛国际，伦敦	(5)
离岸人民币 7,676	美元 1,113	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(6)
离岸人民币 7,676	美元 1,113	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(6)
离岸人民币 7,608	美元 1,103	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(6)
离岸人民币 35,157	美元 5,120	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(7)
离岸人民币 67,830	美元 9,883	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(8)
离岸人民币 11,466	美元 1,663	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(9)
离岸人民币 25,145	美元 3,657	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(10)
离岸人民币 7,609	美元 1,100	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(10)
离岸人民币 7,609	美元 1,100	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(10)
离岸人民币 7,609	美元 1,100	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(10)
离岸人民币 115,892	美元 16,890	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(10)
离岸人民币 7,658	美元 1,105	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(12)
离岸人民币 16,483	美元 2,392	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(12)
离岸人民币 36,692	美元 5,338	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(13)
离岸人民币 7,675	美元 1,106	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(13)
离岸人民币 7,675	美元 1,106	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(13)
离岸人民币 31,394	美元 4,565	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(14)
离岸人民币 22,241	美元 3,229	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	(14)
离岸人民币 8,447	美元 1,217	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(14)
离岸人民币 9,804	美元 1,415	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(15)
离岸人民币 174,377	美元 25,413	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(15)
离岸人民币 7,636	美元 1,098	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
离岸人民币 7,636	美元 1,098	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(16)
离岸人民币 7,654	美元 1,100	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(17)
离岸人民币 50,782	美元 7,387	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(18)
离岸人民币 20,016	美元 2,900	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(19)
离岸人民币 178,860	美元 26,058	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(24)
离岸人民币 61,425	美元 8,931	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(26)
离岸人民币 47,361	美元 6,879	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(27)
离岸人民币 16,202	美元 2,329	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(33)

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 95,943	美元 13,951	2023 年 4 月 20 日	高盛国际，伦敦	(40)
离岸人民币 514,058	美元 74,917	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(45)
离岸人民币 117,173	美元 17,041	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(45)
离岸人民币 189,225	美元 27,545	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(48)
离岸人民币 82,304	美元 11,950	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(52)
离岸人民币 455,067	美元 66,306	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(54)
离岸人民币 43,489	美元 6,276	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(66)
离岸人民币 391,928	美元 57,079	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(74)
离岸人民币 194,985	美元 28,357	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(76)
离岸人民币 448,592	美元 65,331	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(84)
离岸人民币 108,011	美元 15,662	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(89)
离岸人民币 147,775	美元 21,456	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(93)
离岸人民币 288,673	美元 41,997	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(98)
离岸人民币 238,749	美元 34,713	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(103)
离岸人民币 136,118	美元 19,740	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(109)
离岸人民币 136,487	美元 19,793	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(110)
离岸人民币 159,216	美元 23,096	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(121)
离岸人民币 135,931	美元 19,696	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(126)
离岸人民币 356,988	美元 51,929	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(129)
离岸人民币 686,359	美元 99,959	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(129)
离岸人民币 186,061	美元 26,990	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(142)
离岸人民币 97,864	美元 14,105	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(166)
离岸人民币 432,878	美元 62,956	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(168)
离岸人民币 272,925	美元 39,629	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	(170)
离岸人民币 212,781	美元 30,854	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(174)
离岸人民币 280,093	美元 40,668	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(176)
离岸人民币 467,626	美元 68,010	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(181)
离岸人民币 91,510	美元 13,156	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(188)
离岸人民币 1,005,378	美元 146,419	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(189)
离岸人民币 354,441	美元 51,481	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(205)
离岸人民币 176,649	美元 25,528	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(232)
离岸人民币 147,528	美元 21,263	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(251)
离岸人民币 982,506	美元 143,022	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(251)
离岸人民币 168,397	美元 24,300	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(256)
离岸人民币 2,195,890	美元 319,952	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(261)
离岸人民币 422,581	美元 61,322	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(300)
离岸人民币 156,038	美元 22,418	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(336)
离岸人民币 452,471	美元 65,617	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(364)
离岸人民币 2,976,130	美元 433,587	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(404)
离岸人民币 1,090,513	美元 158,573	2023 年 4 月 20 日	高盛国际，伦敦	(450)
离岸人民币 589,063	美元 85,417	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(483)
离岸人民币 678,438	美元 98,377	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(556)
离岸人民币 1,697,240	美元 246,834	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(664)
离岸人民币 1,046,574	美元 151,872	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(743)
离岸人民币 1,917,401	美元 278,785	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(819)
离岸人民币 2,103,049	美元 305,777	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(898)
离岸人民币 7,956,950	美元 1,159,369	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(946)
离岸人民币 1,272,152	美元 184,468	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,042)
离岸人民币 3,326,532	美元 483,957	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,131)
离岸人民币 2,705,495	美元 393,364	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,162)
离岸人民币 8,736,803	美元 1,272,850	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,186)

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 3,160,307	美元 459,612	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,237)
离岸人民币 7,333,941	美元 1,068,087	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,377)
离岸人民币 644,435	美元 92,586	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,388)
离岸人民币 4,134,418	美元 601,409	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,488)
离岸人民币 876,665	美元 126,350	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,489)
离岸人民币 1,618,194	美元 234,467	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,505)
离岸人民币 4,201,611	美元 610,961	2023 年 4 月 20 日	高盛国际，伦敦	(1,735)
离岸人民币 3,386,296	美元 491,694	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	(2,109)
离岸人民币 3,054,761	美元 443,126	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(2,332)
离岸人民币 4,067,433	美元 590,780	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,349)
离岸人民币 3,176,597	美元 460,799	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(2,425)
离岸人民币 4,135,133	美元 600,404	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(2,598)
离岸人民币 5,600,235	美元 813,161	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	(3,488)
离岸人民币 3,759,748	美元 544,766	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(3,496)
离岸人民币 2,346,248	美元 338,570	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(3,569)
离岸人民币 1,887,676	美元 271,385	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(3,883)
离岸人民币 10,277,238	美元 1,494,254	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(4,414)
离岸人民币 2,077,046	美元 298,410	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(4,474)
离岸人民币 13,310,740	美元 1,936,499	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(4,526)
离岸人民币 3,622,265	美元 523,460	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(4,753)
离岸人民币 15,892,829	美元 2,311,836	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5,721)
离岸人民币 9,941,204	美元 1,443,420	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(6,246)
离岸人民币 3,531,105	美元 507,656	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(7,264)
离岸人民币 89,421,456	美元 13,031,993	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(7,803)
离岸人民币 15,558,369	美元 2,259,797	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(8,987)
离岸人民币 17,207,580	美元 2,497,056	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(12,223)
离岸人民币 59,379,057	美元 8,643,696	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(15,196)
离岸人民币 13,289,532	美元 1,920,494	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(17,438)
纽元 1,761	美元 1,099	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(2)
纽元 1,777	美元 1,109	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(3)
纽元 1,763	美元 1,097	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(6)
纽元 1,782	美元 1,108	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
纽元 1,751	美元 1,087	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(8)
纽元 1,772	美元 1,097	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(12)
纽元 1,775	美元 1,099	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(12)
纽元 3,931	美元 2,447	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
纽元 1,798	美元 1,102	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(23)
纽元 18,402	美元 11,490	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(24)
纽元 1,791	美元 1,096	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(25)
纽元 41,363	美元 25,829	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(51)
纽元 102,638	美元 64,089	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(129)
纽元 42,801	美元 26,620	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(159)
纽元 32,265	美元 19,995	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(192)
纽元 59,928	美元 37,283	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(213)
纽元 85,557	美元 53,212	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(319)
纽元 331,491	美元 207,078	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(329)
纽元 106,011	美元 65,973	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(355)
纽元 73,555	美元 45,645	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(376)
纽元 130,044	美元 80,864	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(501)
纽元 157,511	美元 98,016	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(535)
纽元 157,739	美元 97,939	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(755)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／（亏损） 美元
纽元 249,101	美元 154,336	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,520)
纽元 186,589	美元 114,565	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,180)
美元 7,740	离岸人民币 53,061	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(3)
美元 9,314	澳元 13,891	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(4)
美元 17,785	澳元 26,525	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(8)
美元 51,283	离岸人民币 351,560	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(17)
美元 115,467	离岸人民币 791,405	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(61)
美元 20,263	澳元 30,000	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(157)
美元 47,595	澳元 70,772	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(165)
美元 613,915	离岸人民币 4,208,571	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(204)
美元 30,059	离岸人民币 204,489	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(240)
美元 51,293	澳元 76,116	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(282)
美元 56,602	离岸人民币 385,056	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(452)
美元 745,526	离岸人民币 5,109,018	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(508)
美元 2,173,512	离岸人民币 14,900,080	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(723)
美元 288,342	澳元 429,037	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(808)
美元 195,939	离岸人民币 1,337,520	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(896)
美元 82,855	澳元 122,293	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(896)
美元 386,887	澳元 575,940	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(901)
美元 160,868	澳元 238,359	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,124)
美元 4,774,881	离岸人民币 32,726,824	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(2,524)
美元 10,477,871	离岸人民币 71,803,643	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(7,175)
美元 2,325,222	离岸人民币 15,818,060	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(18,569)
美元 6,383,012	离岸人民币 43,571,853	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(29,190)
澳元 14,680,222	美元 9,840,256	2023 年 5 月 3 日	法国巴黎银行	(2,789)
加元 60,820,795	美元 44,902,865	2023 年 5 月 3 日	法国巴黎银行	(58,521)
欧元 2,089,295	美元 2,253,886	2023 年 5 月 3 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(19,990)
墨西哥比索 413,774,713	美元 22,776,043	2023 年 5 月 3 日	巴克莱银行, 伦敦	(2,374)
南非兰特 92,461,734	美元 5,187,006	2023 年 5 月 3 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(9,983)
离岸人民币 9,706,618	美元 1,414,011	2023 年 5 月 4 日	巴克莱银行, 伦敦	(3,012)
离岸人民币 648,306,180	美元 94,493,152	2023 年 5 月 4 日	高盛国际，伦敦	(150,016)
日元 6,433,830,557	美元 48,532,268	2023 年 5 月 8 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(86,934)
澳元 2,941	美元 1,973	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 7,578	美元 1,106	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 7,578	美元 1,106	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 9,586	美元 1,399	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 68,194	美元 9,966	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	(3)
离岸人民币 56,394	美元 8,229	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
离岸人民币 484,721	美元 70,733	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(122)
离岸人民币 3,458,536	美元 505,428	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	(128)
离岸人民币 11,564,528	美元 1,690,031	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	(429)
离岸人民币 3,907,644	美元 570,221	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(984)
美元 19,042	纽元 30,431	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	(1)
美元 44,293	纽元 70,788	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
美元 199,485	澳元 297,000	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(223)
			未实现总亏损	(10,107,196)
			未实现净亏损	(3,906,240)

(b) 期货

以下为截至二零二三年三月三十一日之未平仓期货合约：

	标的资产	交易对手	未实现收益／（亏损） 美元
截至二零二三年三月三十一日			
Us 5Yr Note (CBT) 30/06/2023	5 年期美国国债	花旗集团全球市场公司伦敦分行	(484,508)
Euro-BUXL 30Y Bnd 08/06/2023	由联邦德国、意大利共和国、法兰西共和国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 30 年期债务工具	花旗集团全球市场公司伦敦分行	350,597
Euro-BTP Future 08/06/2023	由联邦德国、意大利共和国、法兰西共和国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 10 年期债务工具	花旗集团全球市场公司伦敦分行	(631,564)
		未实现总亏损	(765,475)
		未实现净亏损	(765,475)

财务状况表

截至二零二三年三月三十一日 *(未经审计)*

	31.3.2023 美元	30.9.2022 美元
资产		
流动资产		
银行现金	73,840,763	44,447,749
应收经纪款项	17,573,343	30,091,688
分配应收款项	18,060,985	32,535,479
保证金	2,163,563	3,034,870
衍生性产品	6,551,553	21,774,671
投资	1,071,355,823	777,597,053
股息、利息及其他应收款项	110	1,050,055
总资产	1,189,546,140	910,531,565
负债		
流动负债		
透支经纪款项	-	861,955
应付经纪款项	49,638,208	-
赎回应付款项	7,373,221	23,722,188
应付收益分配 [附注 6]	2,163,230	2,000,222
衍生性产品	11,223,268	16,181,925
其他应付款项	787,062	697,415
总负债（不含可赎回份额持有人应占净资产）	71,184,989	43,463,705
可赎回份额持有人应占净资产		
[附注 3]	1,118,361,151	867,067,860

综合收益表

截至二零二三年三月三十一日止期间 *(未经审计)*

	1.10.2022 至 31.3.2023 美元	1.10.2021 至 31.3.2022 美元
收入		
投资及衍生性产品净收益／（亏损）[附注 4]	41,207,023	(21,319,903)
存款利息	196,399	4,434
汇兑净亏损	(2,220,128)	(534,232)
其他收入	11,247	67
	39,194,541	(21,849,634)
支出		
管理费用 [附注 5(a)]	3,718,590	3,899,025
托管费用及银行费用 [附注 5(a)]	130,630	146,676
受托人费用 [附注 5(b)]	83,673	87,668
交易成本 [附注 5(a)]	51,003	50,239
基金注册登记机构费用 [附注 5(a)]	34,849	36,645
法律及专业服务费	5,183	3,014
核数师酬金	4,516	28,753
印刷及出版支出	1,763	1,022
其他经营费用	1,823	8,064
	4,032,030	4,261,106

第二十二至三十页之附注乃属本财务报表之一部分。

综合收益表(续)

截至二零二三年三月三十一日止期间 ***(未经审计)***

	1.10.2022 至 31.3.2023 美元	1.10.2021 至 31.3.2022 美元
净经营利润／（亏损）	35,162,511	(26,110,740)
财务成本		
收益分配 [附注 6]	(12,002,624)	(16,201,154)
除税前利润／（亏损）	23,159,887	(42,311,894)
税项	16,549	(49,039)
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加／（减少）	23,176,436	(42,360,933)

可赎回份额持有人应占净资产变动表

截至二零二三年三月三十一日止期间 ***(未经审计)***

	1.10.2022 至 31.3.2023 美元	1.10.2021 至 31.3.2022 美元
期初可赎回份额持有人应占净资产	867,067,860	1,118,863,350
分配可赎回份额 [附注 3]	598,817,294	124,720,048
赎回可赎回份额 [附注 3]	(370,700,439)	(374,580,185)
净分配／（赎回）	228,116,855	(249,860,137)
	1,095,184,715	869,003,213
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加／（减少）	23,176,436	(42,360,933)
期末可赎回份额持有人应占净资产	1,118,361,151	826,642,280

第二十二至三十页之附注乃属本财务报表之一部分。

现金流量表

截至二零二三年三月三十一日止期间 *(未经审计)*

	1.10.2022 至 31.3.2023 美元	1.10.2021 至 31.3.2022 美元
经营业务		
购入投资及衍生性产品	(1,491,469,805)	(454,296,154)
出售投资及衍生性产品所得款项	1,311,339,072	756,261,180
已收股息	1,049,532	5,979,339
保证金之减少	871,307	1,111,066
已收利息	196,817	4,447
返还／（已付）税项	16,549	(49,039)
已付交易成本	(50,717)	(51,013)
已付基金注册登记机构费用	(67,647)	(79,963)
已付受托人费用	(80,017)	(91,729)
透支经纪款项之（减少）／增加	(861,955)	1,433,772
已付管理费用	(3,546,688)	(4,075,296)
其他	(2,611,284)	(1,154,870)
经营业务所（运用）／产生之现金净额	(185,214,836)	304,991,740
融资活动		
分配可赎回份额所得款项	613,291,788	128,889,074
赎回可赎回份额付款	(387,049,406)	(385,303,807)
已付收益分配	(11,839,615)	(17,164,754)
融资活动所产生／（运用）之现金净额	214,402,767	(273,579,487)

(续)

	1.10.2022 至 31.3.2023 美元	1.10.2021 至 31.3.2022 美元
现金及现金等价物之增加	29,187,931	31,412,253
期初现金及现金等价物	44,447,749	25,540,063
现金及现金等价物之汇兑收益	205,083	302,119
期末现金及现金等价物	73,840,763	57,254,435
现金及现金等价物余额分析：		
银行现金	73,840,763	57,254,435

第二十二至三十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

摩根国际债券基金（“本基金”）根据一九七九年四月三十日的信托契约（经修订）（“信托契约”）成立，受香港法律监管。本基金已获香港证券及期货事务监察委员会（“证监会”）认可。

本基金的投资目标旨在通过主要投资（即至少为资产净值总额的 80%）于环球投资级别债务证券，取得比环球债券市场更高的回报。

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

(a) 中期财务报表之会计政策

编制本未经审计简明中期财务报表所使用的会计政策和计算方法与截至二零二二年九月三十日止年度财务报表所采纳的会计政策和计算方法一致。

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公平值为负数的衍生性产品合约列示为按公平值透过损益列账的负债。

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。卖空被分类为按公平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平值透过损益列账的金融资产或负债。

确认、终止确认及计量

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

公平值估计

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

债务证券的公平值按包括应计利息的报价计算。

集体投资计划的投资以基于相关基金管理人决定的各基金每份额净资产价值得出的公平值而计算，或如集体投资计划为上市或在交易所买卖，则以最后交易价计算。

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

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

结构性主体

本基金中的所有其他基金（“被投资基金”）投资将被视为对非合并结构性主体的投资。本基金所投资的被投资基金的目标是达成中长期资本增值。

(c) 证券借贷

本基金可订立以卖空为目的之证券借贷安排。短仓指提供已售，但尚未购买的证券之责任，并以投资的公平值列账。于期／年内借来的证券为资产负债表外交易，因此不包括在本基金的投资组合中。证券借贷有关的抵押品一般包括现金抵押，并分开纳入财务状况表内。

(d) 外币折算

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按期／年终汇率折算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

与现金及现金等价物有关的汇兑盈亏在综合收益表内的“汇兑净收益／亏损”中呈列。与按公平值透过损益列账的金融资产及金融负债有关的汇兑盈亏在综合收益表内的“投资及衍生性产品净收益／亏损”中呈列。

(e) 分配份额所得款项及赎回份额支付款项

每份额资产净值于每个交易日计算。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。

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

1.10.2022 至 31.3.2023

	澳元对冲类别（每月派息）份额	加元对冲类别（每月派息）份额	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
已发行份额数目：					
期初	8,060,861.614	6,016,628.632	142,548,699.569	2,926,967.623	61,293,278.840
总分配	3,453,273.173	2,213,268.622	30,594,680.250	766,444.027	34,969,380.770
总赎回	(2,142,335.987)	(1,494,771.320)	(37,231,109.494)	(500,572.948)	(62,226,409.050)
期末	9,371,798.800	6,735,125.934	135,912,270.325	3,192,838.702	34,036,250.560

	PRC 人民币份（每月派息）份额	PRC 人民币对冲份额（累计）份额	PRC 人民币对冲份额（每月派息）份额	PRC 美元份额（累计）份额	PRC 美元份额（每月派息）份额
已发行份额数目：					
期初	7,999,704.740	75,868,784.020	6,589,201.510	1,908,749.630	2,071,460.200
总分配	327,693.870	246,008,947.610	1,126,168.380	282,391.340	33,833.780
总赎回	(1,054,683.940)	(67,389,681.810)	(857,763.970)	(311,591.610)	(112,836.450)
期末	7,272,714.670	254,488,049.820	6,857,605.920	1,879,549.360	1,992,457.530

	人民币对冲类别（累计）份额	人民币对冲类别（每月派息）份额	美元类别（每月派息）份额	美元类别（每半年派息）份额
已发行份额数目：				
期初	592,313.986	86,540,605.204	30,400,817.360	423,135.614
总分配	279,533.347	22,496,787.935	7,010,595.062	780,069.724
总赎回	(213,608.085)	(28,072,549.175)	(7,120,331.079)	(731,904.605)
期末	658,239.248	80,964,843.964	30,291,081.343	471,300.733

1.10.2021 至 31.3.2022

	澳元对冲类别（每月派息） 份额	加元对冲类别（每月派息） 份额	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
已发行份额数目：					
期初	10,589,900.120	6,601,970.711	184,986,181.051	3,479,860.601	8,246,314.840
总分配	513,829.560	563,757.505	14,023,913.913	251,690.873	1,480,488.650
总赎回	(2,952,283.619)	(2,182,178.421)	(53,569,765.153)	(547,793.834)	(2,311,850.610)
期末	8,151,446.061	4,983,549.795	145,440,329.811	3,183,757.640	7,414,952.880

	PRC 人民币份额（每月派息） 份额	PRC 人民币对冲份额（累计） 份额	PRC 人民币对冲份额（每月派息） 份额	PRC 美元份额（累计） 份额	PRC 美元份额（每月派息） 份额
已发行份额数目：					
期初	8,690,294.310	5,298,889.960	9,545,469.220	3,129,173.160	3,009,914.170
总分配	196,430.920	164,816.180	229,923.920	38,397.270	77,938.320
总赎回	(595,988.690)	(1,855,663.040)	(2,932,753.570)	(907,481.660)	(798,317.640)
期末	8,290,736.540	3,608,043.100	6,842,639.570	2,260,088.770	2,289,534.850

	人民币对冲类别（累计） 份额	人民币对冲类别（每月派息） 份额	美元类别（每月派息） 份额	美元类别（每半年派息） 份额
已发行份额数目：				
期初	815,348.308	108,144,383.054	44,880,967.357	745,451.394
总分配	25,965.402	21,820,940.566	4,890,643.313	221,455.409
总赎回	(209,814.058)	(33,095,033.462)	(17,310,000.149)	(484,563.835)
期末	631,499.652	96,870,290.158	32,461,610.521	482,342.968

31.3.2023

	澳元对冲类别（每月派息） 澳元	加元对冲类别（每月派息） 加元	港元类别（每月派息） 港元	纽元对冲类别（每月派息） 纽元	PRC 人民币份额（累计） 人民币
可赎回份额持有人应占净资产	78,746,065	56,828,792	1,164,494,997	26,855,856	339,979,503
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	8.40	8.44	8.57	8.41	9.99

	PRC 人民币份额（每月派息） 人民币	PRC 人民币对冲份额（累计） 人民币	PRC 人民币对冲份额（每月派息） 人民币	PRC 美元份额（累计） 美元	PRC 美元份额（每月派息） 美元
可赎回份额持有人应占净资产	64,259,800	2,680,436,408	59,237,274	18,766,394	17,246,466
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	8.84	10.53	8.64	9.98	8.66

	人民币对冲类别（累计） 人民币	人民币对冲类别（每月派息） 人民币	美元类别（每月派息） 美元	美元类别（每半年派息） 美元
可赎回份额持有人应占净资产	8,294,982	673,990,965	256,304,387	9,003,856
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	12.60	8.32	8.46	19.10

30.9.2022

	澳元对冲类别（每月派息） 澳元	加元对冲类别（每月派息） 加元	港元类别（每月派息） 港元	纽元对冲类别（每月派息） 纽元	PRC 人民币份额（累计） 人民币
可赎回份额持有人应占净资产	67,478,146	50,530,106	1,215,536,657	24,543,394	623,278,553
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	8.37	8.40	8.53	8.39	10.17

30.9.2022

	PRC 人民币份额（每月派息）	PRC 人民币对冲份额（累计）	PRC 人民币对冲份额（每月派息）	PRC 美元份额（累计）	PRC 美元份额（每月派息）
	人民币	人民币	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应占净资产	73,049,501	788,053,057	56,611,430	18,573,701	17,846,002
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	9.13	10.39	8.59	9.73	8.62

	人民币对冲类别（累计）	人民币对冲类别（每月派息）	美元类别（每月派息）	美元类别（每半年派息）
	人民币	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应占净资产	7,369,196	716,726,787	255,990,653	8,045,375
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	12.44	8.28	8.42	19.01

4 投资及衍生性产品净收益／（亏损）

	1.10.2022 至 31.3.2023	1.10.2021 至 31.3.2022
	美元	美元
投资及衍生性产品价值未实现收益／亏损之变动	95,165,203	(51,497,359)
投资及衍生性产品销售之已实现(亏损)／收益	(53,958,180)	30,177,456
	41,207,023	(21,319,903)

5 与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之交易

(a) 截至二零二三年三月三十一日及二零二二年三月三十一日止期间，支付给管理人，摩根基金（亚洲）有限公司，及其关联人士的金额如下：

	1.10.2022 至 31.3.2023 美元	1.10.2021 至 31.3.2022 美元
管理费用	3,718,590	3,899,025
托管费用及银行费用	95,969	115,352
基金注册登记机构费用	34,849	36,645
交易成本	11,845	9,064

(b) 截至二零二三年三月三十一日及二零二二年三月三十一日止期间，支付给受托人，东亚银行（信托）有限公司，及其关联人士的金额如下：

	1.10.2022 至 31.3.2023 美元	1.10.2021 至 31.3.2022 美元
受托人费用	83,673	87,668

6 收益分配

一旦该金额不足够支付本基金宣布之收益分配时，管理人可酌情决定从资本中拨款支付该等收益分配。

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	1.10.2022 至 31.3.2023 美元	1.10.2021 至 31.3.2022 美元
澳元对冲类别（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	澳元 0.0241	8,310,141.526	(128,065)	
加元对冲类别（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	加元 0.0293	6,283,298.216	(134,966)	
港元类别（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	港元 0.0294	144,334,101.500	(540,574)	
纽元对冲类别（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	纽元 0.0277	3,025,523.586	(48,688)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	人民币 0.0319	7,979,687.880	(34,727)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	人民币 0.0214	6,217,904.230	(18,153)	
PRC 美元份额（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	美元 0.0297	2,032,842.460	(60,375)	
人民币对冲类别（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	人民币 0.0206	88,429,660.790	(248,517)	
美元类别（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	美元 0.0290	30,593,619.130	(887,214)	
澳元对冲类别（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	澳元 0.0215	8,287,164.356	(119,323)	
加元对冲类别（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	加元 0.0279	6,276,553.615	(129,170)	
港元类别（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	港元 0.0292	134,676,260.500	(503,817)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	1.10.2022 至 31.3.2023 美元	1.10.2021 至 31.3.2022 美元
纽元对冲类别（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	纽元 0.0257	3,030,318.152	(48,371)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	人民币 0.0317	7,384,246.210	(33,046)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	人民币 0.0130	6,163,723.180	(11,312)	
PRC 美元份额（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	美元 0.0297	2,036,173.550	(60,474)	
人民币对冲类别（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	人民币 0.0125	89,622,789.050	(158,153)	
美元类别（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	美元 0.0290	29,500,883.620	(855,525)	
澳元对冲类别（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	澳元 0.0181	8,166,589.554	(100,241)	
加元对冲类别（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	加元 0.0254	6,360,361.143	(119,232)	
港元类别（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	港元 0.0291	135,013,501.500	(503,385)	
纽元对冲类别（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	纽元 0.0247	3,065,565.574	(47,889)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	人民币 0.0308	7,179,929.980	(31,962)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	人民币 0.0077	6,618,403.260	(7,366)	
PRC 美元份额（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	美元 0.0297	2,035,065.360	(60,441)	
人民币对冲类别（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	人民币 0.0073	91,941,468.590	(97,006)	
美元类别（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	美元 0.0290	29,260,241.550	(848,546)	
澳元对冲类别（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	澳元 0.0190	8,743,192.339	(117,057)	
加元对冲类别（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	加元 0.0285	6,561,225.511	(140,139)	
港元类别（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	港元 0.0302	133,851,837.400	(515,698)	
纽元对冲类别（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 9 日	纽元 0.0257	2,982,406.809	(49,534)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	人民币 0.0309	7,161,936.400	(32,753)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	人民币 0.0109	6,631,511.130	(10,698)	
PRC 美元份额（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	美元 0.0307	2,016,800.520	(61,916)	
人民币对冲类别（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	人民币 0.0105	89,671,103.900	(139,348)	
美元类别（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	美元 0.0300	30,282,918.240	(908,487)	
澳元对冲类别（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	澳元 0.0204	8,937,280.739	(122,948)	
加元对冲类别（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	加元 0.0285	6,745,907.461	(141,216)	
港元类别（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	港元 0.0304	134,235,143.300	(519,874)	
纽元对冲类别（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	纽元 0.0275	3,154,578.405	(53,746)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	人民币 0.0314	7,211,908.100	(32,575)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	人民币 0.0156	6,931,345.810	(15,554)	
PRC 美元份额（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	美元 0.0307	2,015,656.860	(61,881)	
人民币对冲类别（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	人民币 0.0150	84,884,180.970	(183,158)	
美元类别（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	美元 0.0300	29,875,811.140	(896,274)	
澳元对冲类别（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	澳元 0.0203	8,495,206.891	(115,500)	
加元对冲类别（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	加元 0.0272	6,617,582.865	(133,002)	
港元类别（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	港元 0.0304	135,821,743.500	(525,988)	
纽元对冲类别（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	纽元 0.0300	3,189,399.786	(59,863)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	人民币 0.0314	7,272,680.800	(33,254)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	人民币 0.0119	6,857,604.760	(11,883)	
PRC 美元份额（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	美元 0.0307	1,992,457.530	(61,168)	
人民币对冲类别（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	人民币 0.0115	82,272,426.980	(137,774)	
美元类别（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	美元 0.0300	30,109,891.540	(903,296)	
美元类别（每半年派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	美元 0.4080	444,860.541	(181,502)	
澳元对冲类别（每月派息）	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	澳元 0.0236	9,988,641.378		(177,966)
加元对冲类别（每月派息）	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	加元 0.0253	6,263,523.647		(128,475)
港元类别（每月派息）	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	港元 0.0251	178,989,157.630		(577,659)
纽元对冲类别（每月派息）	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	纽元 0.0272	3,495,178.233		(68,568)
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 0.0243	8,734,749.010		(33,222)
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 0.0519	8,743,501.200		(71,027)
PRC 美元份额（每月派息）	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	美元 0.0256	2,954,119.550		(75,625)
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 0.0500	107,225,595.676		(839,149)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	1.10.2022 至 31.3.2023 美元	1.10.2021 至 31.3.2022 美元
美元类别（每月派息）	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	美元 0.0250	43,752,607.919		(1,093,815)
澳元对冲类别（每月派息）	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	澳元 0.0237	9,652,133.061		(162,782)
加元对冲类别（每月派息）	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	加元 0.0252	6,322,358.613		(124,544)
港元类别（每月派息）	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	港元 0.0251	173,361,866.500		(557,898)
纽元对冲类别（每月派息）	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	纽元 0.0289	3,423,509.860		(67,215)
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 0.0243	8,618,006.750		(32,765)
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 0.0476	8,336,279.640		(62,083)
PRC 美元份额（每月派息）	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	美元 0.0256	2,808,055.020		(71,886)
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 0.0458	102,522,145.321		(734,638)
美元类别（每月派息）	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	美元 0.0250	41,190,542.280		(1,029,764)
澳元对冲类别（每月派息）	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	澳元 0.0216	9,638,012.084		(151,004)
加元对冲类别（每月派息）	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	加元 0.0227	6,122,855.925		(108,691)
港元类别（每月派息）	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	港元 0.0252	167,942,032.078		(542,554)
纽元对冲类别（每月派息）	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	纽元 0.0287	3,345,359.890		(65,648)
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 0.0243	8,534,140.710		(32,527)
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 0.0483	8,042,992.580		(60,931)
PRC 美元份额（每月派息）	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	美元 0.0256	2,600,760.080		(66,579)
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 0.0465	101,688,055.236		(741,649)
美元类别（每月派息）	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	美元 0.0250	38,575,684.576		(964,392)
澳元对冲类别（每月派息）	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	澳元 0.0240	8,713,596.158		(146,273)
加元对冲类别（每月派息）	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	加元 0.0251	5,406,090.855		(106,238)
港元类别（每月派息）	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	港元 0.0251	156,054,494.112		(502,585)
纽元对冲类别（每月派息）	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	纽元 0.0289	3,267,497.471		(61,918)
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 0.0241	8,395,053.750		(31,763)
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 0.0434	7,420,993.950		(50,562)
PRC 美元份额（每月派息）	2022 年 1 月 28 日	2022 年 2 月 11 日	美元 0.0256	2,485,273.690		(63,623)
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 0.0418	98,461,449.507		(646,536)
美元类别（每月派息）	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	美元 0.0250	35,208,544.752		(880,214)
澳元对冲类别（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	澳元 0.0239	8,419,839.946		(145,422)
加元对冲类别（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	加元 0.0255	5,112,169.626		(102,328)
港元类别（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	港元 0.0251	149,501,901.537		(480,538)
纽元对冲类别（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	纽元 0.0294	3,242,494.407		(64,238)
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 0.0241	8,334,679.310		(31,833)
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 0.0455	7,307,924.140		(52,696)
PRC 美元份额（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	美元 0.0256	2,407,779.500		(61,639)
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 0.0439	99,092,160.926		(688,903)
美元类别（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	美元 0.0250	34,244,571.886		(856,114)
澳元对冲类别（每月派息）	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	澳元 0.0215	8,166,179.708		(131,846)
加元对冲类别（每月派息）	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	加元 0.0246	4,988,470.765		(98,248)
港元类别（每月派息）	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	港元 0.0252	145,534,041.287		(468,302)
纽元对冲类别（每月派息）	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	纽元 0.0290	3,188,683.507		(64,319)
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 0.0242	8,290,734.310		(31,605)
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 0.0482	6,842,637.460		(51,955)
PRC 美元份额（每月派息）	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	美元 0.0256	2,290,496.190		(58,637)
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 0.0464	96,871,283.464		(708,059)
美元类别（每月派息）	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	美元 0.0250	32,485,734.424		(812,143)
美元类别（每半年派息）	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	美元 0.3308	482,348.806		(159,561)
可赎回份额持有人之总收益分配					(12,002,624)	(16,201,154)