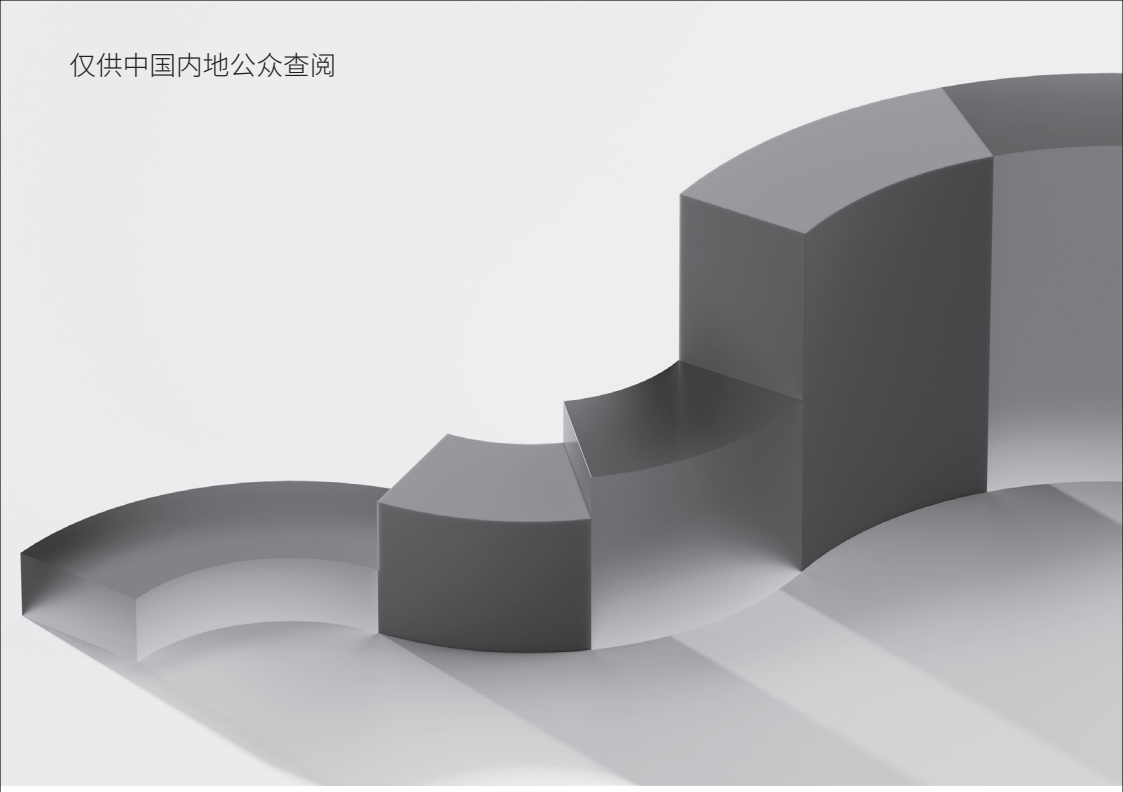
仅供中国内地公众查阅



半年度报告 — 2023年3月31日（未经审核）

摩根亚洲股息基金

内地与香港互认基金系列

摩根
资产管理

此（等）报告并不构成购买组成本文件内容的任何基金单位之邀请。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 – 2

投资组合持有变动表 3

金融衍生工具详情 4 – 16

财务状况表 17

综合收益表 17 – 18

可赎回份额持有人应占净资产变动表 18

现金流量表 19

财务报表之附注 20 – 32

投资组合

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
上市投资(99.7%)			
(I) 股票(99.3%)			
澳大利亚(17.5%)			
Australia & New Zealand Banking Group Ltd	579,738	8,903,250	0.7
Australian Stock Exchange Ltd	203,670	8,869,247	0.7
BHP Group Ltd	545,740	17,263,007	1.3
Brambles Ltd	3,552,990	31,958,230	2.5
Commonwealth Bank of Australia	163,018	10,734,706	0.8
Insurance Australia Group Limited	1,617,900	5,082,030	0.4
Macquarie Group Ltd	33,646	3,958,394	0.3
Medibank Private Ltd	4,611,305	10,377,096	0.8
Q B E Insurance Group Limited	1,871,100	18,283,739	1.4
Rio Tinto Limited	325,800	26,215,095	2.0
Santos Ltd	6,349,300	29,341,861	2.3
Telstra Group Ltd	3,731,900	10,547,637	0.8
Transurban Group	678,100	6,453,578	0.5
Westpac Banking Corp	678,657	9,845,131	0.8
Woolworths Group Ltd	1,140,900	28,960,064	2.2
中国(23.9%)			
中国建设银行股份有限公司 H 股	36,432,000	23,622,938	1.8
中国招商银行股份有限公司 H 股	4,310,500	22,019,382	1.7
中国海外发展有限公司	3,061,500	7,394,447	0.6
中国太平洋保险（集团）股份有限公司 H 股	4,397,600	11,680,324	0.9
华润置地有限公司	2,660,000	12,131,033	0.9
中国长江电力股份有限公司 A 股(C1)	6,471,550	20,025,401	1.6
福耀玻璃工业集团股份有限公司 H 股	4,170,400	18,169,247	1.4
海尔智家股份有限公司 H 股	5,238,001	16,481,458	1.3
内蒙古伊利实业集团股份有限公司 A 股(C1)	5,753,214	24,395,846	1.9
顾家家居股份有限公司 A 股(C1)	1,711,575	10,113,977	0.8
江苏宁沪高速公路股份有限公司 H 股	7,514,000	7,006,730	0.5

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产净值百分比
美的集团股份有限公司 A 股(C2)	3,222,964	25,254,131	2.0
国电南瑞科技股份有限公司 A 股(C1)	1,734,584	6,847,607	0.5
中国人民财产保险股份有限公司 H 股	9,716,000	9,914,096	0.8
中国平安保险（集团）股份有限公司 H 股	2,442,500	15,899,687	1.2
中国平安保险（集团）股份有限公司 A 股(C1)	641,509	4,259,725	0.3
申洲国际集团控股有限公司	935,300	9,817,734	0.8
康师傅控股有限公司	12,972,000	21,614,629	1.7
万华化学集团股份有限公司 A 股(C1)	502,500	7,015,814	0.5
宜宾五粮液股份有限公司 A 股(C2)	916,547	26,292,686	2.0
紫金矿业集团股份有限公司 H 股	5,602,000	9,362,893	0.7
香港(13.6%)			
友邦保险控股有限公司	3,052,200	32,135,788	2.5
中银香港（控股）有限公司	7,702,000	23,989,185	1.9
长江基建集团有限公司	1,264,000	6,875,560	0.5
中电控股有限公司	2,283,500	16,493,666	1.3
香港电讯信托与香港电讯有限公司合订单位	8,600,000	11,415,614	0.9
香港交易及结算所有限公司	432,535	19,185,942	1.5
昆仑能源有限公司	17,332,000	13,556,581	1.0
敏华控股有限公司	5,574,400	4,594,471	0.4
网易股份有限公司	2,086,600	36,681,863	2.8
新鸿基地产发展有限公司	479,000	6,712,145	0.5
信义玻璃控股有限公司	2,560,000	4,585,201	0.3
印度(2.8%)			
Infosys Technologies Ltd Sponsored ADR	1,727,200	30,122,368	2.3
Power Grid Corp of India	2,089,408	5,738,197	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
印度尼西亚(6.0%)			
Bank Central Asia	36,901,600	21,533,829	1.7
Bank Rakyat Indonesia Persero	94,533,600	29,820,530	2.3
Telkom Indonesia Persero	95,496,400	25,857,173	2.0
韩国(12.3%)			
BGF Retail Co Ltd	54,806	7,649,307	0.6
Hana Financial Holdings	260,600	8,147,191	0.6
Hyundai Motor Co Ltd Pref	31,419	2,312,048	0.2
KB Financial Group	232,146	8,496,952	0.7
Kiwoom Securities Co Ltd	92,427	7,170,663	0.6
LG Chem Limited Preference Shares	35,922	8,567,639	0.7
LG Chemical	8,014	4,382,969	0.3
Samsung Electronics Co Ltd	1,766,900	86,862,234	6.7
Samsung Fire and Marine Insurance Company Limited	73,703	11,662,494	0.9
SK Telecom Company Limited	362,065	13,432,991	1.0
马来西亚(0.6%)			
CIMB Group Holdings BHD	5,905,305	7,106,441	0.6
新加坡(4.8%)			
DBS Group Holdings Ltd	900,721	22,356,281	1.7
Singapore Exchange Limited	3,387,000	23,946,298	1.8
United Overseas Bank Ltd	725,100	16,230,285	1.3
台湾(13.8%)			
智邦科技股份有限公司	1,556,000	16,302,291	1.3
研华股份有限公司	746,383	9,094,609	0.7
日月光投资控股股份有限公司	1,522,000	5,623,614	0.4
可成科技股份有限公司	127,000	792,512	0.1
儒鸿企业股份有限公司	530,000	8,616,471	0.7
亿丰综合工业股份有限公司	755,000	8,108,548	0.6
统一超商股份有限公司	1,386,000	12,267,904	0.9
台湾积体电路制造股份有限公司	5,680,000	99,431,479	7.7
联华电子股份有限公司	3,892,000	6,762,026	0.5
纬颖科技服务股份有限公司	322,000	11,897,529	0.9
泰国(3.0%)			
Advanced Information Service PCL	1,719,400	10,659,827	0.8
Bangkok Bank PCL (F)	1,392,000	6,167,217	0.5
SCB X PCL	4,865,700	14,585,006	1.2
Tisco Financial Group PCL	2,309,500	6,787,681	0.5
英国(1.0%)			
RIO Tinto PLC	181,334	12,282,247	1.0
		1,283,113,717	99.3
(II) 衍生性产品(0.4%)			
远期外汇合约(0.4%)		4,818,640	0.4
总上市投资		1,287,932,357	99.7
其他净资产		4,663,619	0.3
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		1,292,595,976	100.0
总投资，按成本		1,265,175,900	

投资组合持有变动表

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		
股票		
中国	23.9	18.2
澳大利亚	17.5	22.1
台湾	13.8	12.3
香港	13.6	15.7
韩国	12.3	10.3
印度尼西亚	6.0	5.9
新加坡	4.8	9.4
泰国	3.0	2.0
印度	2.8	3.1
英国	1.0	0.8
马来西亚	0.6	0.5
衍生性产品		
远期外汇合约	0.4	(1.3)
总上市投资	99.7	99.0
其他净资产	0.3	1.0
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：

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 163,713	加元 222,396	2023 年 4 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	619
美元 33,141	离岸人民币 228,250	2023 年 4 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	99
美元 24,853	离岸人民币 171,168	2023 年 4 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	74
美元 24,598	离岸人民币 169,413	2023 年 4 月 3 日	Citibank N.A., 伦敦	74
美元 1,106	欧元 1,020	2023 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	3
美元 1,103	离岸人民币 7,579	2023 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	1
美元 1,103	离岸人民币 7,579	2023 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	1
澳元 453,292	美元 303,740	2023 年 4 月 4 日	法国巴黎银行	126
美元 60,313	离岸人民币 414,849	2023 年 4 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	106
美元 1,699	离岸人民币 11,701	2023 年 4 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	5
美元 1,560	离岸人民币 10,744	2023 年 4 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	5
美元 1,099	英镑 892	2023 年 4 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	5
美元 2,141	澳元 3,203	2023 年 4 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	4
美元 1,100	欧元 1,015	2023 年 4 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	3
澳元 164,277	美元 110,168	2023 年 4 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	128
美元 365,118	离岸人民币 2,506,949	2023 年 4 月 6 日	法国巴黎银行	56
美元 24,147	离岸人民币 165,795	2023 年 4 月 6 日	法国巴黎银行	4
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 757,186	加元 1,024,684	2023 年 4 月 6 日	法国巴黎银行	1
美元 21,028	澳元 31,394	2023 年 4 月 6 日	法国巴黎银行	1
美元 8,651	英镑 6,996	2023 年 4 月 6 日	法国巴黎银行	0
美元 1,102	离岸人民币 7,567	2023 年 4 月 11 日	法国巴黎银行	0
美元 1,102	离岸人民币 7,567	2023 年 4 月 11 日	法国巴黎银行	0
澳元 832,622	美元 563,863	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	5,853
澳元 830,771	美元 559,058	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,288
澳元 449,878	美元 303,393	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	1,892
澳元 238,610	美元 161,661	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	1,749
澳元 94,801	美元 64,042	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	508
澳元 117,911	美元 79,458	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	436
澳元 81,740	美元 55,210	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	429
澳元 236,363	美元 158,770	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	364

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 1,403,606	美元 940,862	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	187
澳元 31,952	美元 21,532	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	118
澳元 870,688	美元 583,548	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	26
澳元 4,196	美元 2,828	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	15
澳元 1,631	美元 1,105	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	12
澳元 1,635	美元 1,104	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	9
澳元 1,631	美元 1,100	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	7
澳元 1,631	美元 1,100	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	7
澳元 3,488	美元 2,343	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	5
澳元 1,645	美元 1,106	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	4
澳元 5,474	美元 3,670	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	2
离岸人民币 1,624,553	美元 238,793	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	1,894
离岸人民币 1,842,465	美元 269,884	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	1,208
离岸人民币 521,209	美元 76,347	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	342
离岸人民币 281,616	美元 41,395	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	328
离岸人民币 2,192,185	美元 319,890	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	217
离岸人民币 1,123,589	美元 163,919	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	73
离岸人民币 46,471	美元 6,831	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	54
离岸人民币 16,474	美元 2,422	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	19
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 9,370	美元 1,372	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	6
离岸人民币 47,713	美元 6,961	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	3
离岸人民币 29,257	美元 4,269	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	3
离岸人民币 17,862	美元 2,606	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
纽元 1,769	美元 1,111	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	5
新加坡元 69,087	美元 52,013	2023 年 4 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	21
	离岸人民币			
美元 215,077,870	1,487,900,962	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,893,823
美元 64,025,758	英镑 53,260,766	2023 年 4 月 20 日	渣打银行，伦敦	1,853,017
美元 50,799,432	加元 69,275,150	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	401,713
美元 18,060,876	欧元 16,904,475	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	323,433
美元 29,428,279	纽元 47,445,375	2023 年 4 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	257,201
	离岸人民币			
美元 11,524,225	79,742,913	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	104,207
美元 99,493,832	澳元 148,563,757	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	71,221
	离岸人民币			
美元 7,098,793	49,120,738	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	64,190
美元 5,152,377	新加坡元 6,923,754	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	58,174
美元 1,158,768	英镑 969,817	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	40,808
	离岸人民币			
美元 3,287,640	22,743,773	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	28,949
	离岸人民币			
美元 2,827,978	19,517,546	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	18,149
美元 487,363	英镑 407,312	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	16,445

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 419,816	英镑 348,669	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	11,457
美元 1,328,200	离岸人民币 9,185,926	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	11,329
美元 700,552	英镑 575,411	2023 年 4 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	11,180
美元 394,814	英镑 327,970	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	10,856
美元 589,459	加元 811,382	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	10,232
美元 749,157	英镑 613,728	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	9,969
美元 1,158,698	澳元 1,743,621	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	9,849
美元 955,175	英镑 779,379	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	8,846
美元 743,534	加元 1,015,789	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	7,234
美元 596,534	加元 816,279	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	6,777
美元 548,640	加元 750,015	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	5,695
美元 333,341	加元 458,518	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	5,549
美元 237,517	欧元 223,454	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	5,499
美元 1,400,682	离岸人民币 9,642,337	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	5,402
美元 656,335	澳元 986,844	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	5,032
美元 919,979	加元 1,251,471	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	4,981
美元 605,709	加元 826,149	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,896
美元 400,288	离岸人民币 2,777,211	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	4,696
美元 802,270	离岸人民币 5,532,091	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	4,441
美元 1,090,332	澳元 1,632,425	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	3,694
美元 1,286,617	离岸人民币 8,847,865	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	3,614
美元 3,165,028	离岸人民币 21,728,998	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	3,582
美元 266,459	欧元 248,228	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	3,499
美元 131,519	欧元 124,150	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	3,499
美元 603,905	加元 821,293	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	3,111
美元 183,201	纽元 297,763	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	3,102
美元 69,994	英镑 59,075	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	3,076
美元 528,921	纽元 850,182	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3,019
美元 121,105	欧元 113,930	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	2,798
美元 215,204	澳元 325,190	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	2,734
美元 331,022	纽元 533,379	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,701
美元 175,427	离岸人民币 1,221,000	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	2,624
美元 209,992	欧元 195,393	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,505
美元 197,524	欧元 183,896	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,471
美元 410,530	离岸人民币 2,831,133	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	2,317
美元 83,481	英镑 69,334	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	2,279
美元 792,057	英镑 642,173	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,254
美元 210,803	离岸人民币 1,460,833	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	2,221
美元 314,783	加元 428,798	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	2,141
美元 2,466,845	离岸人民币 16,931,161	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	2,125
美元 110,313	欧元 103,215	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,937
美元 606,758	澳元 908,161	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,877
美元 307,880	纽元 494,922	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	1,781
美元 70,718	纽元 115,363	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	1,462
美元 222,877	澳元 334,709	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	1,440

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 179,284	纽元 288,741	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	1,375
美元 112,901	澳元 170,413	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	1,307
美元 93,214	新加坡元 125,542	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	1,264
美元 300,385	加元 408,041	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,197
美元 144,667	澳元 217,535	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	1,122
美元 418,180	纽元 669,865	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	939
美元 209,797	离岸人民币 1,445,103	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	934
美元 28,089	英镑 23,432	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	894
美元 107,955	欧元 100,000	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	800
美元 36,518	英镑 30,151	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	776
美元 58,677	澳元 88,653	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	737
美元 81,524	澳元 122,636	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	665
美元 224,361	英镑 181,917	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	654
美元 312,215	纽元 500,000	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	624
美元 55,599	新加坡元 74,695	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	614
美元 133,674	澳元 200,364	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	606
美元 394,647	英镑 319,547	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	604
美元 62,575	澳元 94,240	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	583
美元 41,345	纽元 67,000	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	575
美元 93,982	纽元 151,119	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	570
美元 70,847	离岸人民币 489,706	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	564
美元 605,301	离岸人民币 4,154,590	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	538
美元 622,342	澳元 929,384	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	516
美元 74,949	新加坡元 100,261	2023 年 4 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	503
美元 105,986	离岸人民币 730,204	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	495
美元 118,986	离岸人民币 819,323	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	491
美元 106,444	离岸人民币 733,196	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	474
美元 33,247	新加坡元 44,778	2023 年 4 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	451
美元 85,289	加元 115,963	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	419
美元 64,675	纽元 103,985	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	386
美元 29,630	欧元 27,588	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	373
美元 126,589	离岸人民币 870,610	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	367
美元 31,230	新加坡元 41,972	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	357
美元 44,329	离岸人民币 306,411	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	353
美元 168,849	离岸人民币 1,160,277	2023 年 4 月 20 日	渣打银行，伦敦	347
美元 672,983	离岸人民币 4,617,408	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	345
美元 174,837	纽元 279,986	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	344
美元 48,917	离岸人民币 337,603	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	314
美元 74,430	离岸人民币 512,259	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	270
美元 31,500	欧元 29,199	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	256
美元 35,318	澳元 53,043	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	231
美元 41,958	离岸人民币 289,196	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	214
美元 102,933	离岸人民币 707,319	2023 年 4 月 20 日	渣打银行，伦敦	211
美元 68,406	离岸人民币 470,537	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	209
美元 16,528	纽元 26,735	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	200

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 60,569	新加坡元 80,734	2023 年 4 月 20 日	加拿大皇家银行	188
美元 24,199	纽元 38,971	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	184
美元 20,359	离岸人民币 140,803	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	174
美元 130,839	离岸人民币 898,383	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	167
美元 46,102	离岸人民币 317,295	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	167
美元 133,144	离岸人民币 914,166	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	164
美元 13,889	加元 19,000	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	154
美元 123,901	离岸人民币 850,637	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	142
美元 43,437	离岸人民币 298,784	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	133
美元 112,037	欧元 103,131	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	122
美元 6,395	加元 8,815	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	120
美元 81,681	离岸人民币 560,847	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	104
美元 3,350	英镑 2,782	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	91
美元 77,060	离岸人民币 529,053	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	88
美元 3,839	纽元 6,277	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	88
美元 51,227	离岸人民币 351,892	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	87
美元 21,572	离岸人民币 148,504	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	83
美元 29,239	离岸人民币 201,033	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	77
美元 97,638	离岸人民币 670,071	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	74
美元 2,516	欧元 2,379	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	70
美元 19,767	离岸人民币 135,933	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	56
美元 48,477	离岸人民币 332,811	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	55
美元 65,677	离岸人民币 450,726	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	50
美元 7,343	加元 10,000	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	48
美元 2,431	英镑 2,000	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	43
美元 2,511	离岸人民币 17,465	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	36
美元 2,466	加元 3,384	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	36
美元 4,967	加元 6,768	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	35
美元 2,136	加元 2,936	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	34
美元 37,920	离岸人民币 260,265	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	33
美元 12,462	欧元 11,488	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	33
美元 3,666	离岸人民币 25,367	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	33
美元 22,628	澳元 33,813	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	32
美元 2,328	纽元 3,773	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	32
美元 21,295	澳元 31,819	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	30
美元 2,888	离岸人民币 20,013	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	30
美元 6,139	离岸人民币 42,293	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	29
美元 2,383	离岸人民币 16,488	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	22
美元 1,275	离岸人民币 8,874	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	19
美元 1,557	离岸人民币 10,801	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	18
美元 15,741	离岸人民币 108,044	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	14
美元 1,967	澳元 2,955	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	13
美元 1,636	离岸人民币 11,264	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	7
美元 2,260	离岸人民币 15,540	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	6
美元 5,241	离岸人民币 35,971	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	4

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 1,401	离岸人民币 9,631	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	4
美元 1,272	离岸人民币 8,747	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	3
美元 1,132	离岸人民币 7,783	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	3
澳元 378,250	美元 254,055	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	281
加元 52,071	美元 38,510	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	5
加元 1,494	美元 1,105	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	0
纽元 2,069,710	美元 1,295,013	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	37
美元 1,116,918	离岸人民币 7,663,038	2023 年 5 月 19 日	高盛国际，伦敦	3,236
美元 1,357,027	离岸人民币 9,294,199	2023 年 5 月 19 日	高盛国际，伦敦	1,565
美元 344,054	英镑 278,456	2023 年 5 月 19 日	美林国际，伦敦	582
美元 151,670	纽元 243,203	2023 年 5 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	497
美元 1,892,547	离岸人民币 12,949,918	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	423
美元 253,480	离岸人民币 1,736,959	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	422
美元 319,954	加元 433,192	2023 年 5 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	375
美元 262,035	加元 354,720	2023 年 5 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	267
美元 59,854	离岸人民币 410,574	2023 年 5 月 19 日	美国道富银行	162
美元 72,076	离岸人民币 493,979	2023 年 5 月 19 日	美国道富银行	132
美元 36,089	离岸人民币 247,553	2023 年 5 月 19 日	美国道富银行	98
美元 45,613	离岸人民币 312,610	2023 年 5 月 19 日	美国道富银行	83
美元 644,396	澳元 960,569	2023 年 5 月 19 日	摩根士丹利国际股份有限公司	64
美元 17,192	离岸人民币 117,951	2023 年 5 月 19 日	高盛国际，伦敦	50
美元 20,883	离岸人民币 143,028	2023 年 5 月 19 日	高盛国际，伦敦	24
美元 97,928	欧元 89,911	2023 年 5 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	23
美元 74,565	澳元 111,149	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	7
美元 148,517	英镑 120,000	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	4
美元 1,129	离岸人民币 7,733	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	2
			未实现总收益	5,400,166
澳元 122,636	美元 81,471	2023 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	(668)
离岸人民币 9,631	美元 1,399	2023 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 8,747	美元 1,270	2023 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 201,033	美元 29,193	2023 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	(83)
欧元 100,000	美元 107,848	2023 年 4 月 3 日	法国巴黎银行	(803)
离岸人民币 450,726	美元 65,581	2023 年 4 月 4 日	法国巴黎银行	(63)
离岸人民币 670,071	美元 97,496	2023 年 4 月 4 日	法国巴黎银行	(94)
欧元 11,488	美元 12,450	2023 年 4 月 4 日	法国巴黎银行	(33)
英镑 181,917	美元 224,280	2023 年 4 月 4 日	法国巴黎银行	(660)
美元 38,483	加元 52,071	2023 年 4 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
美元 253,645	澳元 378,250	2023 年 4 月 4 日	Citibank N.A., 伦敦	(294)
离岸人民币 870,610	美元 126,439	2023 年 4 月 6 日	Citibank N.A., 伦敦	(378)
美元 1,294,951	纽元 2,069,710	2023 年 4 月 6 日	法国巴黎银行	(8)
澳元 111,149	美元 74,460	2023 年 4 月 11 日	法国巴黎银行	(6)
离岸人民币 7,733	美元 1,125	2023 年 4 月 11 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币 1,736,959	美元 252,676	2023 年 4 月 11 日	Citibank N.A., 伦敦	(436)

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 120,000	美元 148,393	2023 年 4 月 11 日	法国巴黎银行	(8)
纽元 33,000	美元 20,647	2023 年 4 月 11 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 12,949,918	美元 1,886,890	2023 年 4 月 12 日	法国巴黎银行	(347)
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 1,107	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
澳元 1,654	美元 1,107	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
澳元 1,642	美元 1,098	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
澳元 3,203	美元 2,142	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
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	(7)
澳元 1,736	美元 1,156	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(8)
澳元 1,687	美元 1,120	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(9)
澳元 8,589	美元 5,746	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(10)
澳元 1,634	美元 1,081	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(14)
澳元 2,344	美元 1,551	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(20)
澳元 4,851	美元 3,225	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(26)
澳元 4,475	美元 2,961	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(38)
澳元 14,114	美元 9,416	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(43)
澳元 46,596	美元 31,183	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(45)
澳元 6,711	美元 4,446	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(52)
澳元 72,978	美元 48,839	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(70)
澳元 28,086	美元 18,670	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(153)
澳元 227,902	美元 152,476	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(261)
澳元 66,422	美元 44,227	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(288)
澳元 74,333	美元 49,492	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(325)
澳元 39,152	美元 25,905	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(334)
澳元 112,713	美元 74,955	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(584)
澳元 130,040	美元 86,343	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(807)
澳元 134,015	美元 88,697	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,118)
澳元 1,515,656	美元 1,012,168	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(3,600)
澳元 794,506	美元 528,490	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(3,975)
澳元 769,558	美元 508,666	2023 年 4 月 20 日	高盛国际，伦敦	(7,079)
澳元 2,435,890	美元 1,625,058	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(7,437)
澳元 1,732,152	美元 1,146,421	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	(14,440)
澳元 2,690,424	美元 1,783,845	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(19,234)
加元 1,499	美元 1,101	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(6)
加元 1,496	美元 1,100	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(6)
加元 1,506	美元 1,102	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(10)
加元 2,020	美元 1,479	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(14)
加元 1,510	美元 1,101	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(15)
加元 1,498	美元 1,092	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(15)
加元 1,505	美元 1,097	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(16)

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 4,242	美元 3,118	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(18)
加元 1,518	美元 1,104	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(18)
加元 4,891	美元 3,591	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(24)
加元 6,279	美元 4,590	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(51)
加元 7,333	美元 5,364	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(56)
加元 16,417	美元 11,961	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(173)
加元 69,768	美元 50,985	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(581)
加元 144,862	美元 106,455	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(612)
加元 222,396	美元 163,752	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(621)
加元 387,390	美元 285,120	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,199)
加元 124,733	美元 90,941	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,249)
加元 91,448	美元 66,295	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,294)
加元 165,024	美元 120,304	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,665)
加元 457,160	美元 336,052	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,835)
加元 282,568	美元 206,546	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(2,300)
加元 389,182	美元 284,114	2023 年 4 月 20 日	加拿大皇家银行	(3,529)
加元 304,093	美元 221,080	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(3,674)
加元 370,408	美元 269,911	2023 年 4 月 20 日	加拿大皇家银行	(3,857)
加元 430,643	美元 313,252	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5,036)
加元 636,176	美元 464,532	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(5,665)
加元 690,009	美元 504,188	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(5,797)
加元 654,858	美元 477,990	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(6,015)
加元 1,134,418	美元 828,095	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(10,352)
加元 1,140,796	美元 826,808	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(16,353)
加元 1,243,432	美元 902,621	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(16,397)
离岸人民币 13,134	美元 1,913	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 7,579	美元 1,104	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 7,579	美元 1,104	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 7,579	美元 1,104	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 7,573	美元 1,103	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(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 23,164	美元 3,376	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 20,537	美元 2,993	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(2)
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 7,555	美元 1,099	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(3)
离岸人民币 17,035	美元 2,480	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(4)
离岸人民币 12,675	美元 1,843	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
离岸人民币 11,701	美元 1,701	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
离岸人民币 10,744	美元 1,562	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
离岸人民币 7,599	美元 1,103	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(5)
离岸人民币 7,599	美元 1,103	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(5)
离岸人民币 7,599	美元 1,103	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(5)
离岸人民币 16,135	美元 2,347	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(6)

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 15,388	美元 2,238	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 7,609	美元 1,100	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(10)
离岸人民币 7,668	美元 1,107	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(12)
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 94,680	美元 13,794	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(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 11,871	美元 1,715	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(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 7,636	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 23,654	美元 3,430	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(19)
离岸人民币 36,066	美元 5,234	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(26)
离岸人民币 149,520	美元 21,776	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(28)
离岸人民币 13,279	美元 1,908	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(29)
离岸人民币 38,810	美元 5,628	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(31)
离岸人民币 265,677	美元 38,710	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(32)
离岸人民币 119,568	美元 17,402	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(34)
离岸人民币 112,642	美元 16,382	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(44)
离岸人民币 33,620	美元 4,858	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(44)
离岸人民币 134,261	美元 19,533	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(46)
离岸人民币 248,882	美元 36,246	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(47)
离岸人民币 63,082	美元 9,147	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(52)
离岸人民币 255,728	美元 37,238	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(54)
离岸人民币 397,095	美元 57,834	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(72)
离岸人民币 169,413	美元 24,632	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(72)
离岸人民币 171,168	美元 24,887	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(73)
离岸人民币 227,537	美元 33,098	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(82)
离岸人民币 439,355	美元 63,986	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(83)
离岸人民币 413,759	美元 60,249	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(87)
离岸人民币 212,069	美元 30,834	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(91)
离岸人民币 228,250	美元 33,187	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(96)
离岸人民币 270,043	美元 39,279	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(99)
离岸人民币 169,379	美元 24,593	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(106)
离岸人民币 78,877	美元 11,382	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(120)
离岸人民币 493,382	美元 71,798	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(149)
离岸人民币 455,756	美元 66,293	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(168)
离岸人民币 452,046	美元 65,744	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(175)
离岸人民币 1,349,395	美元 196,591	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(183)
离岸人民币 401,954	美元 58,427	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(187)
离岸人民币 126,393	美元 18,231	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(200)
离岸人民币 367,747	美元 53,414	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(212)
离岸人民币 288,160	美元 41,785	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(236)
离岸人民币 788,084	美元 114,683	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(238)
离岸人民币 2,749,018	美元 400,633	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(240)

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 2,301,752	美元 335,377	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(274)
离岸人民币 738,945	美元 107,469	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(287)
离岸人民币 138,395	美元 19,887	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(295)
离岸人民币 898,631	美元 130,690	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(352)
离岸人民币 516,328	美元 74,926	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(367)
离岸人民币 511,213	美元 74,157	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(390)
离岸人民币 872,999	美元 126,881	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(423)
离岸人民币 271,659	美元 39,073	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(542)
离岸人民币 788,069	美元 114,326	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(593)
离岸人民币 909,015	美元 131,911	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(646)
离岸人民币 301,231	美元 43,274	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(652)
离岸人民币 1,408,089	美元 204,651	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(682)
离岸人民币 960,143	美元 139,279	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(733)
离岸人民币 1,278,712	美元 185,504	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(963)
离岸人民币 480,836	美元 69,076	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(1,041)
离岸人民币 1,747,639	美元 253,750	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,098)
离岸人民币 590,789	美元 84,945	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(1,206)
离岸人民币 741,287	美元 106,838	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,259)
离岸人民币 3,658,988	美元 532,152	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,417)
离岸人民币 2,195,280	美元 318,326	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,799)
离岸人民币 952,261	美元 136,918	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(1,944)
离岸人民币 7,791,319	美元 1,133,927	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2,235)
离岸人民币 1,063,462	美元 152,788	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(2,291)
离岸人民币 3,033,262	美元 439,884	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(2,438)
离岸人民币 1,723,965	美元 248,773	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(2,622)
离岸人民币 8,462,672	美元 1,231,183	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(2,878)
离岸人民币 14,120,078	美元 2,055,433	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(3,614)
离岸人民币 2,907,107	美元 420,112	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(3,814)
离岸人民币 2,515,245	美元 361,609	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5,174)
离岸人民币 14,829,200	美元 2,157,116	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5,338)
离岸人民币 13,888,009	美元 2,019,240	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(5,965)
离岸人民币 26,185,148	美元 3,806,224	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(12,199)
离岸人民币 8,265,343	美元 1,192,208	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(13,078)
离岸人民币 23,990,671	美元 3,484,559	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(13,857)
离岸人民币 9,061,637	美元 1,302,113	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(19,292)
离岸人民币 17,699,356	美元 2,545,688	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(35,303)
欧元 1,020	美元 1,107	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(3)
欧元 1,015	美元 1,101	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
欧元 1,021	美元 1,104	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
欧元 1,026	美元 1,107	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(9)
欧元 1,227	美元 1,315	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(20)
欧元 3,166	美元 3,418	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(25)
欧元 8,471	美元 9,013	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(198)
欧元 17,488	美元 18,500	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(519)
欧元 96,870	美元 104,675	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	(675)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／（亏损） 美元
欧元 171,423	美元 185,645	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(784)
欧元 88,562	美元 95,425	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(889)
欧元 94,183	美元 100,245	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(2,183)
欧元 95,385	美元 100,770	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2,966)
欧元 157,456	美元 167,694	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(3,546)
欧元 273,962	美元 294,001	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3,944)
欧元 298,721	美元 319,512	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(5,359)
欧元 203,214	美元 215,059	2023 年 4 月 20 日	加拿大皇家银行	(5,945)
英镑 892	美元 1,099	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
英镑 892	美元 1,099	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(5)
英镑 906	美元 1,111	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(10)
英镑 902	美元 1,104	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(12)
英镑 909	美元 1,106	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(18)
英镑 914	美元 1,108	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(23)
英镑 914	美元 1,108	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(23)
英镑 918	美元 1,106	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(30)
英镑 906	美元 1,090	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(30)
英镑 929	美元 1,108	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(42)
英镑 914	美元 1,087	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(44)
英镑 1,957	美元 2,341	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(79)
英镑 40,731	美元 50,232	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(149)
英镑 4,033	美元 4,834	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(154)
英镑 6,206	美元 7,521	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(156)
英镑 31,080	美元 38,161	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(282)
英镑 19,603	美元 23,922	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(326)
英镑 15,706	美元 18,910	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(517)
英镑 26,146	美元 31,781	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(559)
英镑 25,401	美元 30,856	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(563)
英镑 40,915	美元 49,588	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,021)
英镑 47,684	美元 57,414	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,566)
英镑 306,476	美元 376,871	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(2,212)
英镑 280,625	美元 344,140	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(2,968)
英镑 105,245	美元 126,480	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(3,699)
英镑 533,146	美元 655,582	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3,871)
英镑 118,977	美元 142,359	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(4,805)
英镑 293,040	美元 354,364	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	(8,101)
英镑 493,722	美元 599,425	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(11,265)
英镑 323,048	美元 388,062	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(11,520)
英镑 862,405	美元 1,047,985	2023 年 4 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	(18,733)
英镑 930,010	美元 1,122,341	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(27,999)
英镑 884,356	美元 1,050,726	2023 年 4 月 20 日	高盛国际，伦敦	(43,142)
纽元 1,761	美元 1,099	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(2)
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)

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 1,769	美元 1,096	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(11)
纽元 1,775	美元 1,099	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(12)
纽元 1,772	美元 1,097	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(12)
纽元 1,767	美元 1,092	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(13)
纽元 1,794	美元 1,107	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(15)
纽元 1,780	美元 1,098	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(15)
纽元 21,940	美元 13,706	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(22)
纽元 1,798	美元 1,102	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(23)
纽元 4,950	美元 3,055	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(43)
纽元 18,720	美元 11,643	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(70)
纽元 16,881	美元 10,462	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(99)
纽元 305,785	美元 191,168	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(154)
纽元 1,023,401	美元 640,096	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(222)
纽元 307,578	美元 192,046	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(399)
纽元 428,173	美元 267,359	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(539)
纽元 60,963	美元 37,369	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(774)
纽元 163,920	美元 101,561	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,000)
纽元 263,849	美元 164,067	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,017)
纽元 241,521	美元 149,697	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,418)
纽元 122,232	美元 75,050	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(1,428)
纽元 465,209	美元 289,490	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(1,580)
纽元 264,452	美元 162,447	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3,015)
纽元 740,507	美元 459,773	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3,545)
纽元 812,513	美元 501,502	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(6,869)
纽元 738,549	美元 452,155	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	(9,938)
新加坡元 1,870	美元 1,389	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(18)
新加坡元 37,008	美元 27,782	2023 年 4 月 20 日	高盛国际，伦敦	(69)
新加坡元 38,928	美元 29,187	2023 年 4 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	(109)
新加坡元 42,086	美元 31,394	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	(278)
新加坡元 37,593	美元 27,900	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(391)
新加坡元 64,416	美元 47,992	2023 年 4 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	(485)
新加坡元 110,782	美元 82,501	2023 年 4 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	(869)
新加坡元 122,686	美元 91,124	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(1,205)
新加坡元 115,651	美元 85,653	2023 年 4 月 20 日	高盛国际，伦敦	(1,381)
美元 1,497	离岸人民币 10,221	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
美元 1,862	离岸人民币 12,710	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(9)
美元 1,204	澳元 1,782	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(10)
美元 36,077	离岸人民币 247,320	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(12)
美元 31,115	新加坡元 41,330	2023 年 4 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	(12)
美元 6,785	澳元 10,046	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(53)
美元 22,854	纽元 36,375	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(95)
美元 203,824	离岸人民币 1,397,000	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(108)
美元 59,460	澳元 88,515	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(138)
美元 303,928	澳元 453,292	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(139)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／（亏损） 美元
美元 41,349	澳元 61,484	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(143)
美元 61,974	新加坡元 82,140	2023 年 4 月 20 日	巴克莱银行, 伦敦	(159)
美元 291,006	离岸人民币 1,994,234	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(198)
美元 39,859	离岸人民币 271,483	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	(270)
美元 223,821	欧元 205,262	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(590)
美元 84,307	离岸人民币 573,945	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(611)
美元 2,344,212	离岸人民币 16,070,280	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(780)
美元 138,585	离岸人民币 943,452	2023 年 4 月 20 日	美国道富银行	(1,007)
美元 348,517	纽元 554,912	2023 年 4 月 20 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,321)
美元 230,186	澳元 341,324	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(1,436)
美元 525,171	离岸人民币 3,584,932	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(2,402)
美元 1,487,407	澳元 2,213,179	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(4,170)
美元 1,218,713	澳元 1,811,144	2023 年 4 月 20 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(4,913)
美元 1,808,647	澳元 2,682,850	2023 年 4 月 20 日	Citibank N.A., 伦敦	(10,644)
美元 2,596,571	离岸人民币 17,685,599	2023 年 4 月 20 日	美林国际，伦敦	(17,586)
美元 2,056,627	澳元 3,035,553	2023 年 4 月 20 日	法国巴黎银行	(22,248)
澳元 2,332	美元 1,564	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	(0)
澳元 31,394	美元 21,060	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	(3)
加元 1,488	美元 1,101	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	(0)
加元 1,024,684	美元 757,673	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	(40)
离岸人民币 7,567	美元 1,106	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 7,567	美元 1,106	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币 7,567	美元 1,106	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 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 165,795	美元 24,229	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	(6)
离岸人民币 2,506,949	美元 366,364	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	(93)
离岸人民币 414,849	美元 60,537	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(103)
英镑 6,996	美元 8,659	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	(0)
美元 33,049	新加坡元 43,871	2023 年 5 月 19 日	美国道富银行	(2)
美元 20,649	纽元 33,000	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	(2)
美元 27,093	新加坡元 35,953	2023 年 5 月 19 日	法国巴黎银行	(10)
美元 532,974	澳元 794,348	2023 年 5 月 19 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(34)
美元 110,339	澳元 164,277	2023 年 5 月 19 日	Citibank N.A., 伦敦	(124)
美元 417,310	英镑 336,965	2023 年 5 月 19 日	美林国际，伦敦	(258)
美元 117,664	欧元 107,751	2023 年 5 月 19 日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(279)
美元 184,961	纽元 295,029	2023 年 5 月 19 日	摩根士丹利国际股份有限公司	(367)
			未实现总亏损	(581,526)
			未实现净收益	4,818,640

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	4,769,561	25,815,350
应收经纪款项	1,335,849	2,786,163
分配应收款项	4,613,891	1,897,843
衍生性产品	5,400,166	1,604,195
投资	1,283,113,717	1,195,682,210
股息及其他应收款项	7,289,903	1,302,757
总资产	1,306,523,087	1,229,088,518
负债		
流动负债		
应付经纪款项	1,618,643	3,631,468
赎回应付款项	5,707,070	8,622,901
应付收益分配 [附注 6]	4,377,682	5,610,708
衍生性产品	581,526	16,987,221
应付税项	16,629	-
其他应付款项	1,625,561	1,694,762
总负债（不含可赎回份额持有人应占净资产）	13,927,111	36,547,060
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	1,292,595,976	1,192,541,458

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 [附注 4]	191,078,982	35,907,473
股息收入	17,930,099	16,528,081
存款利息	46,952	13,171
汇兑净收益／（亏损）	345,089	(311,683)
其他收入	28	-
	209,401,150	52,137,042
支出		
管理费用 [附注 5(a)]	9,043,553	9,713,972
交易成本 [附注 5(a), 5(b)]	591,393	1,222,921
托管费用及银行费用 [附注 5(a), 5(b)]	211,426	213,799
受托人费用 [附注 5(b)]	166,575	179,782
基金注册登记机构费用 [附注 5(a)]	52,222	55,544
法律及专业费用	16,745	10,583
核数师酬金	12,321	3,621
估值费用 [附注 5(a)]	8,540	8,540
印刷及出版支出	2,535	1,163
其他经营费用	3,634	11,601
	10,108,944	11,421,526

第二十至三十二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	199,292,206	40,715,516
财务成本		
收益分配 [附注 6]	(22,931,612)	(30,124,649)
利息支出 [附注 5(b)]	(36,061)	(12,906)
	(22,967,673)	(30,137,555)
除税前利润	176,324,533	10,577,961
税项	(1,391,483)	(1,795,644)
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加	174,933,050	8,782,317

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	1,192,541,458	1,297,666,248
分配可赎回份额 [附注 3]	214,870,793	589,263,531
赎回可赎回份额 [附注 3]	(289,749,325)	(406,325,774)
净（赎回）／分配	(74,878,532)	182,937,757
	1,117,662,926	1,480,604,005
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加	174,933,050	8,782,317
期末可赎回份额持有人应占净资产	1,292,595,976	1,489,386,322

第二十至三十二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	(222,646,186)	(539,115,947)
出售投资及衍生性产品所得款项	305,531,991	381,735,022
已收股息	11,943,955	12,351,300
已收利息	46,948	13,302
已付基金注册登记机构费用	(52,222)	(114,371)
已付受托人费用	(166,461)	(176,558)
已付交易成本	(595,861)	(1,144,945)
已付税项	(1,374,854)	(1,502,234)
已付管理费用	(9,010,568)	(9,505,841)
其他	(398,852)	1,262,002
经营业务所产生／（运用）之现金净额	83,277,890	(156,198,270)
融资活动		
已付利息	(36,061)	(12,906)
分配可赎回份额所得款项	212,154,745	595,374,631
赎回可赎回份额付款	(292,665,156)	(411,497,904)
已付收益分配	(24,164,638)	(28,896,321)
融资活动所（运用）／产生之现金净额	(104,711,110)	154,967,500

	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减少	(21,433,220)	(1,230,770)
期初现金及现金等价物	25,815,350	13,996,141
现金及现金等价物之汇兑收益	387,431	78,558
期末现金及现金等价物	4,769,561	12,843,929
现金及现金等价物余额分析：		
银行现金	4,769,561	12,843,929

第二十至三十二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、投资管理人预期会派发股息的公司的股票，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

(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。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。

(c) 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。

(d) 分配份额所得款项及赎回份额支付款项

每份额资产净值于每个交易日计算。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	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：					
期初	18,800,354.440	8,137,233.985	2,073,545.880	6,538,371.597	1,826,163.397
总分配	3,904,450.200	1,297,382.303	268,131.447	689,147.890	168,645.128
总赎回	(3,987,831.598)	(1,479,249.148)	(403,012.812)	(1,069,241.737)	(277,976.496)
期末	18,716,973.042	7,955,367.140	1,938,664.515	6,158,277.750	1,716,832.029

	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：					
期初	252,217,197.977	6,002,090.910	1,641,903.580	1,619,251.500	4,794,050.670
总分配	51,108,476.140	1,152,291.860	11,199.440	137,464.370	183,083.970
总赎回	(67,896,096.374)	(1,775,093.769)	(452,523.440)	(183,282.960)	(627,385.630)
期末	235,429,577.743	5,379,289.001	1,200,579.580	1,573,432.910	4,349,749.010

	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：					
期初	9,381,425.700	1,612,352.910	1,455,296.520	1,476,611.835	174,930,187.137
总分配	206,833.350	8,173.950	32,739.260	32,119.007	21,008,480.806
总赎回	(757,328.360)	(244,785.910)	(119,082.640)	(155,080.467)	(34,403,588.927)
期末	8,830,930.690	1,375,740.950	1,368,953.140	1,353,650.375	161,535,079.016

1.10.2022 至 31.3.2023

	新加坡元对冲类别（每月派息）份额	美元类别（累计）份额	美元类别（每月派息）份额	美元 C 类别（每月派息）份额	美元 C 类别（每季派息）份额
已发行份额数目：					
期初	780,393.257	695,109.240	42,137,386.759	2,313,938.405	8,698,239.647
总分配	126,001.435	51,151.852	8,254,927.727	474,895.905	77,637.982
总赎回	(103,963.427)	(221,875.550)	(10,652,670.642)	(89,000.000)	(716,900.165)
期末	802,431.265	524,385.542	39,739,643.844	2,699,834.310	8,058,977.464

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	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：					
期初	15,818,277.479	7,456,412.191	1,919,678.947	4,439,007.661	1,196,639.730
总分配	4,408,026.331	1,074,972.810	331,739.922	1,773,995.540	1,306,714.465
总赎回	(3,039,159.143)	(1,618,050.622)	(559,788.575)	(1,647,417.931)	(150,804.067)
期末	17,187,144.667	6,913,334.379	1,691,630.294	4,565,585.270	2,352,550.128

	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：					
期初	161,313,873.521	4,705,292.384	1,911,295.530	1,891,564.740	7,641,018.160
总分配	93,667,254.625	995,168.357	261,216.210	107,151.010	1,378,721.110
总赎回	(42,267,748.038)	(540,921.666)	(550,625.280)	(331,573.670)	(3,062,246.770)
期末	212,713,380.108	5,159,539.075	1,621,886.460	1,667,142.080	5,957,492.500

1.10.2021 至 31.3.2022

	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：					
期初	10,422,468.550	2,137,889.830	1,822,820.030	1,342,654.039	149,221,298.724
总分配	1,062,517.790	215,092.250	205,038.790	210,325.435	30,171,530.364
总赎回	(1,681,563.550)	(613,060.590)	(424,663.870)	(189,781.795)	(24,979,480.542)
期末	9,803,422.790	1,739,921.490	1,603,194.950	1,363,197.679	154,413,348.546

	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：					
期初	1,056,230.405	452,651.110	30,511,465.339	11,819,722.942	1,026,607.148
总分配	67,226,443	210,516.709	17,989,000.534	809,272.660	9,403,622.774
总赎回	(309,352,070)	(69,315.800)	(7,444,893.965)	(10,881,357.816)	(906,607.921)
期末	814,104.778	593,852.019	41,055,571.908	1,747,637.786	9,523,622.001

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	欧元对冲类别（每月派息）欧元	英镑对冲类别（每月派息）英镑	港元类别（累计）港元
可赎回份额持有人应占净资产	152,355,784	67,554,592	17,250,158	53,924,699	24,488,982
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	8.14	8.49	8.90	8.76	14.26

31.3.2023

	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	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
可赎回份额持有人应占净资产	2,143,776,606	44,790,192	13,227,865	14,565,349	48,531,094
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	9.11	8.33	11.02	9.26	11.16

	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	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
可赎回份额持有人应占净资产	78,682,551	14,844,029	12,381,438	22,765,051	1,489,734,825
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	8.91	10.79	9.04	16.82	9.22

	新加坡元对冲类别（每月派息） 新加坡元	美元类别（累计） 美元	美元类别（每月派息） 美元	美元 C 类别（每月派息） 美元	美元 C 类别（每季派息） 美元
可赎回份额持有人应占净资产	6,940,686	7,424,532	357,994,959	25,773,958	84,527,936
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	8.65	14.16	9.01	9.55	10.49

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	欧元对冲类别（每月派息） 欧元	英镑对冲类别（每月派息） 英镑	港元类别（累计） 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） 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	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
可赎回份额持有人应占净资产	2,032,712,595	44,500,103	16,266,496	13,778,756	46,975,544
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	8.06	7.41	9.91	8.51	9.80

	PRC 人民币对冲份额（每月派息） 人民币	PRC 美元份额（累计） 美元	PRC 美元份额（每月派息） 美元	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
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

30.9.2022

	新加坡元对冲类别（每月派息）新加坡元	美元类别（累计）美元	美元类别（每月派息）美元	美元 C 类别（每月派息）美元	美元 C 类别（每季派息）美元
可赎回份额持有人应占净资产	5,996,821	8,520,838	335,998,871	19,480,421	80,422,237
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	7.68	12.26	7.97	8.42	9.25

4 投资及衍生性产品净收益

	1.10.2022至31.3.2023美元	1.10.2021至31.3.2022美元
投资及衍生性产品价值未实现收益／亏损之变动	209,617,861	(74,302)
投资及衍生性产品销售之已实现(亏损)／收益	(18,538,879)	35,981,775
	191,078,982	35,907,473

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	9,043,553	9,713,972
基金注册登记机构费用	52,222	55,544
交易成本	21,822	52,351
托管费用及银行费用	9,735	11,459
估值费用	8,540	8,540

(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，汇丰机构信托服务（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
受托人费用	166,575	179,782
托管费用及银行费用	167,042	176,883
交易成本	11,180	36,942
利息支出	36,061	12,906

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 0.0251	18,463,318.725	(296,340)	
加元对冲类别（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	加元 0.0306	7,909,448.549	(177,434)	
欧元对冲类别（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	欧元 0.0145	2,045,962.862	(29,321)	
英镑对冲类别（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	英镑 0.0261	6,445,600.026	(193,692)	
港元类别（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	港元 0.0323	246,653,513.371	(1,014,912)	
纽元对冲类别（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	纽元 0.0287	6,214,253.895	(103,612)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	人民币 0.0346	1,623,749.510	(7,665)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	人民币 0.0244	9,370,844.370	(31,193)	
PRC 美元份额（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	美元 0.0321	1,438,435.520	(46,174)	
人民币对冲类别（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	人民币 0.0252	170,345,100.135	(585,626)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	新加坡元 0.0297	780,715.619	(16,386)	
美元类别（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	美元 0.0320	40,946,758.048	(1,310,295)	
美元 C 类别（每月派息）	2022 年 10 月 31 日	2022 年 11 月 8 日	美元 0.0338	2,379,308.636	(80,421)	
澳元对冲类别（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	澳元 0.0224	18,483,541.738	(277,277)	
加元对冲类别（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	加元 0.0292	8,056,147.650	(173,519)	
欧元对冲类别（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	欧元 0.0137	1,959,379.693	(27,639)	
英镑对冲类别（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	英镑 0.0247	6,443,175.493	(189,527)	
港元类别（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	港元 0.0321	241,978,015.296	(995,131)	
纽元对冲类别（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	纽元 0.0267	6,085,798.659	(100,923)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	人民币 0.0344	1,623,947.540	(7,886)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	人民币 0.0157	9,272,053.980	(20,551)	
PRC 美元份额（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	美元 0.0321	1,398,710.940	(44,899)	
人民币对冲类别（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	人民币 0.0163	168,553,207.795	(387,859)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	新加坡元 0.0289	781,414.011	(16,480)	
美元类别（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	美元 0.0320	39,472,909.470	(1,263,132)	

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 C 类别（每月派息）	2022 年 11 月 30 日	2022 年 12 月 8 日	美元 0.0338	2,453,127.736	(82,916)	
澳元对冲类别（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	澳元 0.0190	17,856,810.407	(230,082)	
加元对冲类别（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	加元 0.0268	8,048,955.657	(159,203)	
欧元对冲类别（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	欧元 0.0089	1,856,812.939	(17,637)	
英镑对冲类别（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	英镑 0.0218	6,388,908.054	(167,537)	
港元类别（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	港元 0.0320	237,177,197.041	(972,417)	
纽元对冲类别（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	纽元 0.0257	5,670,514.347	(92,168)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	人民币 0.0335	1,494,184.670	(7,235)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	人民币 0.0098	9,194,309.780	(13,023)	
PRC 美元份额（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	美元 0.0321	1,397,712.620	(44,867)	
人民币对冲类别（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	人民币 0.0101	166,176,360.639	(242,581)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	新加坡元 0.0288	795,783.669	(17,088)	
美元类别（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	美元 0.0320	38,560,803.380	(1,233,944)	
美元 C 类别（每季派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	美元 0.1123	8,400,326.942	(943,357)	
美元 C 类别（每月派息）	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 10 日	美元 0.0338	2,496,320.356	(84,376)	
澳元对冲类别（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	澳元 0.0182	18,825,377.350	(241,428)	
加元对冲类别（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	加元 0.0287	8,032,527.262	(172,768)	
欧元对冲类别（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	欧元 0.0101	1,880,844.683	(20,631)	
英镑对冲类别（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	英镑 0.0234	6,123,449.039	(176,402)	
港元类别（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	港元 0.0322	227,787,413.295	(935,728)	
纽元对冲类别（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 9 日	纽元 0.0253	5,910,318.043	(96,634)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	人民币 0.0325	1,518,139.550	(7,302)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	人民币 0.0107	9,065,479.690	(14,356)	
PRC 美元份额（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	美元 0.0321	1,389,415.160	(44,600)	
人民币对冲类别（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	人民币 0.0112	166,728,396.873	(276,367)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	新加坡元 0.0261	871,606.015	(17,308)	
美元类别（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	美元 0.0320	38,885,544.414	(1,244,336)	
美元 C 类别（每月派息）	2023 年 1 月 31 日	2023 年 2 月 8 日	美元 0.0339	2,628,882.328	(89,119)	
澳元对冲类别（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	澳元 0.0197	18,316,089.728	(243,323)	
加元对冲类别（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	加元 0.0288	8,170,764.765	(172,843)	
欧元对冲类别（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	欧元 0.0150	1,908,855.872	(30,365)	
英镑对冲类别（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	英镑 0.0257	6,113,488.893	(190,213)	
港元类别（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	港元 0.0323	229,659,223.704	(945,027)	
纽元对冲类别（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	纽元 0.0272	5,706,853.692	(96,170)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	人民币 0.0329	1,564,331.220	(7,403)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	人民币 0.0158	9,039,866.180	(20,546)	
PRC 美元份额（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	美元 0.0321	1,370,556.470	(43,995)	
人民币对冲类别（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	人民币 0.0164	162,080,410.511	(382,369)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	新加坡元 0.0252	802,682.656	(15,026)	
美元类别（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	美元 0.0320	39,873,192.735	(1,275,941)	
美元 C 类别（每月派息）	2023 年 2 月 28 日	2023 年 3 月 8 日	美元 0.0339	2,578,314.336	(87,405)	
澳元对冲类别（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	澳元 0.0198	18,707,081.462	(248,075)	
加元对冲类别（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	加元 0.0275	8,075,773.669	(164,099)	

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
欧元对冲类别（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	欧元 0.0150	1,938,664.515	(31,594)	
英镑对冲类别（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	英镑 0.0254	6,145,505.923	(193,005)	
港元类别（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	港元 0.0324	235,120,202.036	(970,439)	
纽元对冲类别（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	纽元 0.0297	5,623,114.744	(104,488)	
PRC 人民币份额（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	人民币 0.0330	1,573,277.230	(7,560)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	人民币 0.0125	8,831,241.740	(16,075)	
PRC 美元份额（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	美元 0.0321	1,370,981.850	(44,009)	
人民币对冲类别（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	人民币 0.0131	160,415,439.926	(306,007)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	新加坡元 0.0237	802,431.265	(14,304)	
美元类别（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	美元 0.0320	39,882,889.994	(1,276,251)	
美元 C 类别（每季派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	美元 0.1126	8,083,953.632	(910,253)	
美元 C 类别（每月派息）	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 13 日	美元 0.0339	2,699,834.310	(91,523)	
澳元对冲类别（每月派息）	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)

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）	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	纽元 0.0365	4,484,140.659		(111,910)
PRC 人民币份额（每月派息）	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	人民币 0.0334	1,660,992.020		(8,701)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	人民币 0.0584	9,774,689.520		(89,535)
PRC 美元份额（每月派息）	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	美元 0.0352	1,677,425.250		(59,045)
人民币对冲类别（每月派息）	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	人民币 0.0604	143,600,341.247		(1,360,404)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	新加坡元 0.0356	817,879.670		(21,533)
美元类别（每月派息）	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	美元 0.0350	30,704,122.424		(1,074,644)
美元 C 类别（每季派息）	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	美元 0.1220	1,036,816.691		(126,492)
美元 C 类别（每月派息）	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	美元 0.0367	11,758,882.180		(431,551)
澳元对冲类别（每月派息）	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	澳元 0.0312	16,403,034.997		(357,961)
加元对冲类别（每月派息）	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	加元 0.0334	7,345,515.442		(192,085)
欧元对冲类别（每月派息）	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	欧元 0.0275	1,771,264.990		(54,387)
英镑对冲类别（每月派息）	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	英镑 0.0346	4,581,222.799		(212,626)
港元类别（每月派息）	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	港元 0.0351	187,328,523.797		(843,665)
纽元对冲类别（每月派息）	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	纽元 0.0369	4,851,026.702		(117,372)
PRC 人民币份额（每月派息）	2022 年 1 月 28 日	2022 年 2 月 11 日	人民币 0.0333	1,674,464.160		(8,754)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2022 年 1 月 28 日	2022 年 2 月 11 日	人民币 0.0547	9,356,237.910		(80,346)
PRC 美元份额（每月派息）	2022 年 1 月 28 日	2022 年 2 月 11 日	美元 0.0352	1,626,483.210		(57,252)
人民币对冲类别（每月派息）	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	人民币 0.0566	148,981,499.568		(1,324,644)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	新加坡元 0.0355	851,113.446		(22,285)
美元类别（每月派息）	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	美元 0.0350	35,744,141.658		(1,251,045)
美元 C 类别（每月派息）	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	美元 0.0368	1,604,735.010		(59,054)
澳元对冲类别（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	澳元 0.0310	16,946,854.617		(379,646)
加元对冲类别（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	加元 0.0338	6,957,953.515		(184,606)
欧元对冲类别（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	欧元 0.0284	1,711,901.488		(54,673)
英镑对冲类别（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	英镑 0.0363	4,503,171.270		(219,329)
港元类别（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	港元 0.0351	199,777,385.278		(897,968)
纽元对冲类别（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	纽元 0.0375	5,176,586.920		(130,809)
PRC 人民币份额（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	人民币 0.0332	1,653,700.390		(8,701)
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	人民币 0.0573	9,725,827.860		(88,319)
PRC 美元份额（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	美元 0.0352	1,615,115.730		(56,852)
人民币对冲类别（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	人民币 0.0593	152,298,923.969		(1,430,229)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	新加坡元 0.0352	804,466.281		(20,925)
美元类别（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	美元 0.0350	39,566,506.879		(1,384,828)
美元 C 类别（每月派息）	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	美元 0.0368	1,644,973.315		(60,535)
澳元对冲类别（每月派息）	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	澳元 0.0285	17,181,177.650		(367,713)
加元对冲类别（每月派息）	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	加元 0.0329	6,913,334.379		(182,097)
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)

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
PRC 美元份额（每月派息）	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	美元 0.0351	1,603,181.650		(56,272)
人民币对冲类别（每月派息）	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	人民币 0.0612	154,417,281.152		(1,488,688)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	新加坡元 0.0346	814,104.778		(20,813)
美元类别（每月派息）	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	美元 0.0350	40,968,152.226		(1,433,885)
美元 C 类别（每季派息）	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	美元 0.1222	9,515,622.001		(1,162,809)
美元 C 类别（每月派息）	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	美元 0.0368	1,747,637.786		(64,313)
可赎回份额持有人之总收益分配					(22,931,612)	(30,124,649)