

重要资料：请务必仔细阅读本公告。如阁下对本公告的内容有任何疑问，应寻求独立专业意见。

敬啟者：

摩根亚洲总收益债券基金

阁下所持摩根亚洲总收益债券基金截至2016年3月31日期间之最新未经审核财务报告现可于中国内地代理人的网站 (www.cifm.com) 下载。

阁下亦可于正常办公时间在中国内地代理人的营业场所免费查阅财务报告之印刷本。

投资者可通过以下途径咨询有关详情：

上投摩根基金管理有限公司

客服电话：400-889-4888

网址：www.cifm.com

基金的管理人就本公告内容之准确性承担责任。

特此公告。

基金管理人：摩根基金（亚洲）有限公司

中国内地代理人：上投摩根基金管理有限公司

2016年5月31日

半年度报告—2016年3月31日（未经审核）

摩根亚洲总收益 债券基金



内地香港互认基金系列

中国内地代理人:

上投摩根
基金 管 理

基金管理人:

摩根
资 产 管 理

此（等）报告并不构成购买组成本文件内容的任何基金单位之邀请。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，本经审核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	5
财务状况表	6
综合收益表	6
可赎回份额持有人应占净资产变动表	7
现金流量表	7
财务报表之附注	8 - 15

投资组合

(续)

截至二零一六年三月三十一日 (未经审计)

	份额数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		份额数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
上市投资 (89.2%)							
(I) 可换股 (2.3%)							
中国 (0.6%)							
Franshion Cap				Agile Property			
EB(FPC)6.8% Perp-RegS	美元 1,000,000	1,102,781	0.0	9.875% 20/03/17-RegS	美元 13,800,000	14,464,355	0.6
Hengan Intl Grp CB 0% 27/6/18-RegS	港元 96,000,000	13,004,132	0.6	Alibaba Group Hldg	美元 10,000,000	10,267,500	0.5
				3.6% 28/11/24			
				CAR Inc 6% 11/02/21-RegS	美元 7,900,000	8,124,755	0.4
				CAR Inc 6.125% 04/02/20-RegS	美元 14,700,000	15,286,060	0.7
香港 (0.4%)				China Overs Fin V	美元 3,500,000	3,644,837	0.2
China Daye Non-Fer CB	人民币 10,000,000	1,546,856	0.1	3.95% 15/11/22			
0.5% 30/05/18				China Overs Fin VI	美元 9,000,000	10,539,900	0.5
PB Issuer CB (Pac Basin)1.75% 04/16	美元 5,000,000	5,016,069	0.2	5.95% 5/24-RegS	美元 6,000,000	6,398,325	0.3
Shine Power EB(BJ Enter)0%7/19-RegS	港元 26,000,000	3,269,044	0.1	CIFI Hldgs Group	美元 4,500,000	4,743,638	0.2
				7.75% 05/06/20			
马来西亚 (0.4%)				Country Garden 7.5% 09/03/20-RegS	美元 600,000	626,540	0.0
Cahaya Capit	美元 8,000,000	7,820,000	0.4	Country Garden 7.5% 10/01/23-RegS	美元 7,200,000	7,862,355	0.4
EB(Tenaga) 0%9/21-RegS				Country Garden	美元 6,000,000	6,102,925	0.3
				7.875% 27/05/19-RegS	美元 2,000,000	2,287,133	0.1
新加坡 (0.6%)				ENN Energy Hldgs	美元 24,550,000	24,968,578	1.1
CapitalLand Ltd CB	新加坡元 6,000,000	4,246,901	0.2	3.25% 10/19-RegS	美元 16,800,000	17,935,867	0.8
1.85%19/6/20-RegS				ENN Energy Hldgs 6% 13/05/21-RegS	美元 8,300,000	8,425,197	0.4
CapitalLand Ltd CB 2.8% 8/06/25-RegS	新加坡元 13,000,000	9,292,615	0.4	Formosa Group	美元 1,650,000	1,750,513	0.1
				3.375% 22/04/25-RegS			
台湾 (0.3%)				FWD Ltd 5% 24/09/24-RegS	美元 6,700,000	7,078,243	0.3
Asia Cement CB 0% 13/05/18	美元 6,000,000	5,947,500	0.3	Greenland HK Hldgs	美元 400,000	434,992	0.0
				4.375% 8/17-RegS	美元 10,500,000	11,352,206	0.5
				Hutch Wham Intl 12 VRN 6% Perp-RegS	人民币 5,000,000	764,382	0.0
		51,245,898	2.3	Hutch Wham Intl 14 3.625%10/24-RegS	美元 3,200,000	3,097,849	0.1
		-----	-----	KWG Property 13.25% 22/03/17			
(II) 债务证券 (86.0%)				KWG Property 8.25% 05/08/19-RegS	美元 400,000	434,992	0.0
				Lai Fung Hldgs	美元 10,500,000	11,352,206	0.5
澳大利亚 (3.8%)				6.875% 25/04/18-RegS	人民币 5,000,000	764,382	0.0
China Const Bk	人民币 26,000,000	3,987,073	0.2	Longfor Prop 6.75% 28/05/18-RegS	人民币 4,000,000	639,909	0.0
Sydney 3.8% 9/17-RegS				MCE Finance 5% 15/02/21-RegS	美元 3,200,000	3,097,849	0.1
CNOOC Fin (2015)	美元 32,100,000	32,355,796	1.4	New World China	美元 22,700,000	24,400,198	1.1
2.625% 05/05/20				5.375% 6/11/19-RegS	美元 11,600,000	12,105,204	0.5
NSW Treasury 4% 20/04/23	澳元 37,700,000	32,316,188	1.4	Semiconductor Manu	美元 17,906,000	19,833,531	0.9
Queensland Try No24 5.75% 7/24-RegS	澳元 18,000,000	16,969,685	0.8	8.375% 10/2/22-RegS			
				Shimao Property	美元 17,906,000	19,833,531	0.9
百慕大 (0.6%)				8.375% 10/2/22-RegS			
China Electronics 4.7% 16/1/17-RegS	人民币 4,800,000	745,713	0.0				
Kunlun Energy 2.875% 13/05/20-RegS	美元 12,200,000	12,515,988	0.6				
开曼群岛 (11.0%)							
Agile Property 9% 21/05/20-RegS	美元 7,700,000	8,423,415	0.4				

投资组合 (续)
截至二零一六年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	份额数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比		份额数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比
开曼群岛 (11.0%) (续)				Dah Sing Bank VRN 4.875% 02/22- RegS	新加坡元 1,750,000	1,325,790	0.1
Sinostrong Intl 4% 28/05/18	人民币 27,300,000	4,189,247	0.2	Hero Asia Inv 2.875% 03/10/17-RegS	美元 13,100,000	13,399,926	0.6
Tencent Hldgs 3.8% 11/02/25-RegS	美元 7,900,000	8,188,218	0.4	HNA Group Intl 8% 13/11/17-RegS	人民币 34,200,000	5,195,350	0.2
中国 (5.7%)				ICBCIL Finance 3.25% 17/03/20-RegS	美元 16,000,000	16,236,067	0.7
Bank of China 5% 13/11/24-RegS	美元 28,800,000	30,492,159	1.4	MCC Hldgs HK 2.5% 28/08/17-RegS	美元 12,100,000	12,188,464	0.5
Bank of Comm VRN 5% Perp-RegS	美元 9,155,000	9,481,834	0.4	Poly Property 4.75% 16/05/18-RegS	美元 9,980,000	10,323,756	0.5
Beijing Capital (HK) 4.7% 6/17-RegS	人民币 4,000,000	626,757	0.0	Wheelock Finance 2.75% 2/07/17- RegS	美元 12,700,000	12,923,838	0.6
China Const Bk 3.875% 13/5/25- RegS	美元 25,200,000	25,763,518	1.2	Wheelock Finance 3% 19/03/18-RegS	美元 1,600,000	1,621,893	0.1
China Const Bk VRN 4.9% 11/24-RegS	人民币 9,400,000	1,424,911	0.1	Wing Lung Bank VRN 3.5% 11/22-RegS	美元 1,000,000	1,013,947	0.0
China Govt Bond 3.48% 29/06/27- RegS	人民币 9,500,000	1,481,750	0.1	Zhejiang Prov Energy 2.3% 9/17-RegS	美元 9,600,000	9,606,987	0.4
China Govt Bond 4.29% 22/05/29- RegS	人民币 5,500,000	925,961	0.0	印度 (7.5%)			
China Govt Bond 4.5% 22/05/34- RegS	人民币 4,500,000	762,272	0.0	Bharat Petroleum 4% 08/05/25-RegS	美元 15,700,000	16,076,800	0.7
China New Town Fin 5.5% 6/5/18-RegS	人民币 51,000,000	7,914,289	0.4	Export-Imp Bk IN 9.45% 22/01/19	印度卢比 950,000,000	15,157,584	0.7
ICBC Macau VRN 3.875% 10/09/24- RegS	美元 12,100,000	12,275,063	0.5	Export-Imp Bk IN NoQ17 9.28% 10/18	印度卢比 650,000,000	10,511,172	0.5
Lenovo Group 4.95% 10/06/20	人民币 50,000,000	7,793,359	0.3	Export-Imp Bk IN NoQ20 9.7%21/11/18	印度卢比 250,000,000	4,057,332	0.2
People's Bk of CN 3.1% 10/16-RegS	人民币 148,870,000	23,409,682	1.1	Export-Imp Bk IN NoQ21 9.63% 11/18	印度卢比 250,000,000	4,052,199	0.2
Shenzhen Qianhai 4.55% 10/17-RegS	人民币 25,500,000	4,025,440	0.2	Housing Dev Fin 9.75% 10/16 SerL- 02	印度卢比 750,000,000	11,880,488	0.5
香港 (7.6%)				Housing Dev Fin 9.75% 12/16 SerL- 25	印度卢比 500,000,000	7,848,682	0.4
Bank of East VRN 4.25% 11/24-RegS	美元 21,200,000	21,580,187	1.0	ICICI Bank 4% 24/11/17-RegS	人民币 31,000,000	4,822,581	0.2
China CITIC Bk 6.875% 24/6/20- RegS	美元 2,000,000	2,273,131	0.1	India Govt Bond 8.19% 16/01/20	印度卢比 220,000,000	3,456,049	0.2
China CITIC Bk VRN 3.875% 28/9/22	美元 1,400,000	1,410,403	0.1	India Govt Bond 8.27% 09/06/20	印度卢比 752,000,000	11,988,833	0.5
China CITIC Bk VRN 6% 05/24-RegS	美元 4,500,000	4,838,340	0.2	India Govt Bond 8.4% 28/07/24	印度卢比 1,140,000,000	18,137,974	0.8
China CITIC Bk VRN 7.25%Perp-RegS	美元 9,200,000	10,015,784	0.5	NTPC Ltd 4.375% 26/11/24-RegS	美元 9,100,000	9,691,159	0.4
China Const Bk VRN 4.25% 08/24-RegS	美元 13,100,000	13,428,919	0.6	Oil India 3.875% 17/04/19-RegS	美元 8,500,000	8,943,789	0.4
CITIC Ltd 6.875% 21/01/18	美元 2,400,000	2,627,902	0.1	Oil India 5.375% 17/04/24-RegS	美元 2,000,000	2,233,971	0.1
CITIC Ltd VRN 8.625% Perp-RegS	美元 10,600,000	12,214,866	0.5	ONGC Videsh 3.25% 15/07/19-RegS	美元 8,400,000	8,614,212	0.4
CRCC Yupeng VRN 3.95% Perp-RegS	美元 16,500,000	17,019,475	0.8	Power Finance 9.32% 17/09/19	印度卢比 250,000,000	4,092,839	0.2

投资组合 (续)

(续)

截至二零一六年三月三十一日 (未经审计)

	份额数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比		份额数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比
印度 (7.5%) (续)							
Power Finance				Rep of Indonesia			
No123A 8.5%	印度卢比			5.875% 01/24-RegS	美元 5,000,000	5,706,330	0.3
28/11/17	600,000,000	9,367,933	0.4	Theta Cap 6.125%			
Tata Motors 4.625%				14/11/20-RegS	美元 893,000	883,248	0.0
30/04/20-RegS	美元 14,900,000	15,837,624	0.7				
印度尼西亚 (14.4%)				英属泽西岛 (0.6%)			
Indonesia Eximbank	印尼盾			West China Cement			
NoOB 9% 13/03/18	130,000,000,000	9,943,627	0.5	6.5% 11/9/19-RegS	美元 12,700,000	13,378,709	0.6
Indonesia Govt				韩国 (3.8%)			
NoFR54 9.5%	印尼盾			KEB Hana Bank 4.25%			
15/07/31	87,500,000,000	7,430,876	0.3	10/24-RegS	美元 7,500,000	7,945,750	0.3
Indonesia Govt				KEB Hana Bank			
NoFR53 8.25%	印尼盾			4.375% 30/09/24-			
15/7/21	73,500,000	5,849,247	0.3	RegS	美元 7,400,000	7,771,429	0.3
Indonesia Govt				Korea Land No42 3.5%			
NoFR69	印尼盾			27/08/20	韩元 5,000,000,000	5,378,192	0.2
7.875%15/4/19	364,900,000,000	28,813,963	1.3	Korea Try No2106 ILB			
Indonesia Govt				1.5% 10/06/21	韩元 6,850,000,000	6,582,179	0.3
NoFR71 9%	印尼盾			Korea Try No2306 ILB			
15/03/29	119,000,000,000	9,590,517	0.4	1.125% 10/6/23	韩元 7,000,000,000	6,292,604	0.3
Indonesia Retail 8.5%	印尼盾			Korea Western Power			
15/10/17	504,000,000,000	38,866,079	1.7	2.625%9/19-RegS	美元 10,200,000	10,414,498	0.5
Indonesia Retail 9%	印尼盾			Shinhan Bank 3.875%			
15/10/18	100,000,000,000	7,818,102	0.4	24/03/26-RegS	美元 8,000,000	8,094,889	0.4
Indosat Tbk NoOB	印尼盾			Woori Bank 4.75%			
10% 12/12/17	35,000,000,000	2,697,997	0.1	30/04/24-RegS	美元 15,800,000	16,951,118	0.8
Indosat Tbk NoOB	印尼盾			Woori Bank 5%			
8.55% 14/06/16	80,000,000,000	6,093,212	0.3	10/06/45-RegS	美元 13,000,000	13,140,472	0.6
Indosat Tbk NoOB	印尼盾			Woori Bank VRN			
9.25% 04/06/18	100,000,000,000	7,595,735	0.3	6.208% 02/05/37-			
MPM Global Pte				RegS	美元 1,500,000	1,596,925	0.1
6.75% 19/9/19-	美元 8,800,000	8,700,450	0.4	马来西亚 (3.9%)			
RegS				AmBank M 3.125%			
Pelabuhan Indonesia				03/07/19-RegS	美元 10,600,000	10,879,582	0.5
4.25% 5/25-RegS	美元 9,600,000	9,364,840	0.4	Cagamas Bhd 4.1%			
Pertamina Persero				18/11/20	林吉特 15,000,000	3,900,863	0.2
4.3% 20/5/23-RegS	美元 45,000,000	44,732,999	2.0	Cagamas Bhd NoP8			
Pertamina Persero				6.35% 08/08/23	林吉特 55,000,000	16,005,509	0.7
4.875% 05/22-	美元 8,000,000	8,311,017	0.4	Cagamas Global 3.7%			
RegS				22/09/17-RegS	人民币 54,400,000	8,263,854	0.4
Pertamina Persero				Danainfra Nasional			
5.625% 05/43-	美元 1,800,000	1,631,745	0.1	4.41% 24/07/24	林吉特 15,000,000	3,909,282	0.2
RegS				Malayan Bkg VRN			
Pertamina Persero				3.8% 28/04/21	新加坡元 1,500,000	1,132,280	0.0
6% 03/05/42-RegS	美元 800,000	754,387	0.0	Malaysia Govt Inv			
Pertamina Persero				No0116 4.39% 7/23	林吉特 30,000,000	8,001,933	0.4
6.45%30/5/44-	美元 25,000,000	24,962,708	1.1	Malaysia Govt Inv			
RegS				No0613 3.716%3/21	林吉特 42,000,000	10,779,180	0.5
Perusahaan Penerb				Malaysian Govt No0315			
4.325% 5/25-RegS	美元 6,300,000	6,378,103	0.3	3.659% 10/20	林吉特 60,000,000	15,806,926	0.7
Perusahaan Penerb				Putrajaya Hldgs 4.55%			
4.35% 09/24-RegS	美元 14,300,000	14,345,164	0.6	19/09/23	林吉特 20,000,000	5,185,211	0.2
Perusahaan Penerb	印尼盾			Telekom Malaysia			
NoSR07 8.25% 3/18	153,000,000,000	11,747,695	0.5	4.82% 21/03/24	林吉特 10,000,000	2,634,301	0.1
Rep of Indonesia							
4.75% 8/1/26-RegS	美元 50,000,000	53,282,082	2.4				
Rep of Indonesia							
5.125%15/1/45-RegS	美元 6,000,000	6,045,071	0.3				

投资组合 (续)

(续)

截至二零一六年三月三十一日 (未经审计)

	份额数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比		份额数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比
蒙古 (0.2%)				斯里兰卡 (1.1%)			
Mongolia 7.5%				Natl Savings Bk 5.15%			
30/06/18-RegS	人民币 40,000,000	5,321,294	0.2	10/09/19-RegS	美元 5,500,000	5,183,735	0.2
荷兰 (1.4%)				Natl Savings Bk			
Bharti Airtel 5.125%				8.875% 18/9/18-RegS	美元 3,200,000	3,355,844	0.2
11/03/23-RegS	美元 21,000,000	22,514,931	1.0	Rep of Sri Lanka			
Indo Energy Fin II				6.125% 3/6/25-RegS	美元 11,500,000	10,784,085	0.5
6.375% 1/23-RegS	美元 6,000,000	2,907,250	0.1	SriLankan Airlines			
Royal Capital VRN 5.5%				5.3% 06/19-RegS	美元 4,400,000	4,247,039	0.2
Perp-RegS	美元 6,000,000	6,076,250	0.3				
新西兰 (2.0%)				国际 (0.4%)			
New Zealand Govt				Asian Dev Bank 3.25%	纽元		
No319 5% 15/03/19	纽元 25,000,000	18,859,961	0.9	20/07/17	12,000,000	8,462,897	0.4
New Zealand Govt No521				泰国 (3.1%)			
6% 15/05/21	纽元 30,000,000	25,038,484	1.1	Krung Thai Bk VRN	美元		
巴基斯坦 (0.2%)				5.2% 12/24-RegS	26,000,000	27,153,533	1.2
Islamic Rep Pakistan				Thailand Govt 3.625%	泰铢		
8.25% 9/25-RegS	美元 5,000,000	5,328,792	0.2	16/06/23	110,000,000	3,595,629	0.2
菲律宾 (0.6%)				Thailand Govt 3.65%	泰铢		
Philippines Rep of 3.9%				17/12/21	337,000,000	10,821,339	0.5
26/11/22	比索 134,000,000	2,917,676	0.1	Thailand Govt 3.65%	泰铢		
Philippines Rep of				20/06/31	120,320,000	4,110,446	0.2
6.25% 14/01/36	比索 467,000,000	11,494,840	0.5	Thailand Govt 3.875%	泰铢		
新加坡 (4.6%)				13/06/19	720,000,000	22,312,858	1.0
Alam Synergy Pte 9%				美国 (0.7%)			
29/01/19-RegS	美元 7,350,000	7,334,565	0.3	China Merchant			
BOC Aviation Pte 3%				2.375% 14/05/18-RegS	美元		
30/03/20-RegS	美元 10,700,000	10,802,898	0.5		15,000,000	15,204,813	0.7
BOC Aviation Pte				维京群岛 (12.8%)			
3.875% 9/5/19-RegS	美元 10,721,000	11,259,112	0.5	Beijing Cap Polar	美元		
BOC Aviation Pte 4.2%				2.875% 04/18-RegS	17,000,000	17,287,725	0.8
05/11/18-RegS	人民币 44,000,000	6,827,192	0.3	Bestgain Real Est	人民币		
CapitalLand Try 4.076%				4.05% 12/16-RegS	3,900,000	609,572	0.0
20/09/22	美元 2,000,000	2,125,617	0.1	CCCI Treasure VRN	美元		
Housing & Dev 3.008%	新加坡元			3.5% Perp-RegS	10,400,000	10,549,789	0.5
26/03/21-RegS	10,000,000	7,860,838	0.3	Central Plaza VRN	美元		
Housing & Dev Board				7.125% Perp-RegS	22,700,000	24,323,050	1.1
3.1% 07/24-RegS	新加坡元 4,000,000	3,181,379	0.1	Chalco HK Inv VRN			
OCBC 4.25% 19/06/24-RegS	美元 1,600,000	1,702,896	0.1	6.25% Perp-RegS	美元 16,100,000	16,763,521	0.8
OCBC VRN 4% 15/10/24-RegS	美元 14,400,000	15,224,480	0.7	Chinalco Fin 3.625%	美元 8,675,000	9,053,465	0.4
Public Utilities Board	新加坡元			11/12/19-RegS			
3.52% 10/20	10,000,000	8,097,782	0.4	Dianjian Haixing VRN	美元 17,100,000	17,868,859	0.8
RH Intl Singapore 3.5%				4.05%Perp-RegS			
2/5/19-RegS	美元 10,600,000	11,054,563	0.5	Double Rosy 3.625%	美元		
Theta Cap 7% 11/04/22-RegS	美元 7,800,000	7,796,100	0.3	18/11/19-RegS	22,400,000	23,087,524	1.0
United Over Bk VRN				Eastern Creation II			
3.45% 01/04/21	新加坡元 2,250,000	1,699,856	0.1	2.625% 20/11/17	美元 9,600,000	9,766,800	0.5
United Over Bk VRN				Franshion Brill 5.375%	美元 400,000	429,854	0.0
3.75% 09/24-RegS	美元 8,000,000	8,257,633	0.4	10/18-RegS			
				Franshion Brill 5.75%	美元		
				19/03/19-RegS	23,000,000	24,526,657	1.1
				HKT Capital No2			
				3.625% 2/04/25-RegS	美元		
					10,997,000	11,404,164	0.5

投资组合 (续)

截至二零一六年三月三十一日 (未经审计)

投资组合持有变动表

截至二零一六年三月三十一日止期间 (未经审计)

份额数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比	持有占资产净值 百分比	
			二零一六年三 月三十一日	二零一五年九 月三十日
维京群岛 (12.8%) (续)				
HLP Finance 4.45% 16/04/21-RegS	美元 11,000,000	11,785,064	0.5	
King Power Cap 5.625% 03/11/24-RegS	美元 11,400,000	12,502,166	0.6	
NWD (MTN) 5.25% 26/02/21-RegS	美元 16,725,000	17,932,545	0.8	
Proven Honour Cap 4.125% 19/05/25	美元 12,400,000	12,797,291	0.6	
SDSC Intl Finance 3.625% 11/19-RegS	美元 12,600,000	13,118,455	0.6	
Shanghai Electric Grp 3% 8/19-RegS	美元 9,000,000	9,204,750	0.4	
Sino-Ocean Land 4.45% 04/02/20- RegS	美元 10,000,000	10,231,194	0.5	
Sino-Ocean Land 6% 30/07/24-RegS	美元 800,000	833,707	0.0	
Sinopec Group Over 2.5%28/4/20-RegS	美元 20,300,000	20,576,982	0.9	
Studio City Fin 8.5% 01/12/20-RegS	美元 5,000,000	5,169,667	0.2	
Value Success Intl 4% 21/11/16-RegS	人民币 3,000,000	470,585	0.0	
Value Success Intl 4.75% 11/18-RegS	人民币 1,000,000	157,465	0.0	
Yunnan Energy Invest 5.5%10/17-RegS	人民币 30,000,000	4,619,509	0.2	
		1,914,797,403	86.0	
		-----	-----	
(III) 衍生性产品 (0.9%)				
远期外汇合约 (1.0%)		21,400,130	1.0	
期货 (0.1%) US 10Yr Note (CBT) Fut 06/16	(1,100)	(1,973,438)	(0.1)	
		19,426,692	0.9	
		-----	-----	
总上市投资		1,985,469,993	89.2	
其他净资产		241,451,452	10.8	
截至二零一六年三月三十 一日可赎回份额持有人 应占净资产		2,226,921,445	100.0	
总投资, 按成本		1,952,331,867		
		-----	-----	
		-----	-----	
上市投资				
可换股				
				中国 0.6 1.6
				新加坡 0.6 0.9
				香港 0.4 0.4
				马来西亚 0.4 0.3
				台湾 0.3 0.3
				韩国 - 0.1
债务证券				
				印度尼西亚 14.4 9.3
				维京群岛 12.8 14.8
				开曼群岛 11.0 12.6
				香港 7.6 8.1
				印度 7.5 7.0
				中国 5.7 4.6
				新加坡 4.6 5.1
				马来西亚 3.9 2.7
				澳大利亚 3.8 3.7
				韩国 3.8 4.8
				泰国 3.1 1.7
				新西兰 2.0 1.1
				荷兰 1.4 1.8
				斯里兰卡 1.1 1.7
				美国 0.7 0.7
				菲律宾 0.6 0.6
				英属泽西岛 0.6 0.6
				百慕大 0.6 0.9
				国际 0.4 0.3
				巴基斯坦 0.2 0.2
				蒙古 0.2 0.3
				英国 - 0.5
				墨西哥 - 0.4
				秘鲁 - 0.1
衍生性产品				
				远期外汇合约 1.0 0.9
				期货 (0.1) (0.0)
总上市投资				89.2 88.1
其他净资产				10.8 11.9
可赎回份额持有人应占净资产				100.0 100.0

财务状况表

截至二零一六年三月三十一日 (未经审计)

	二零一六年三 月三十一日 美元	二零一五年九 月三十日 美元
资产		
银行现金	279,151,886	258,463,022
应收经纪款项	-	16,425,191
分配应收款项	46,563,953	17,420,474
保证金	3,268,121	1,314,345
衍生性产品	38,859,277	33,315,219
投资	1,966,043,301	1,943,564,543
利息和其他应收款项	84,791	20,967
总资产	<u>2,333,971,329</u>	<u>2,270,523,761</u>
负债		
应付经纪款项	59,078,070	-
赎回应付款项	15,615,304	12,504,110
应付收益分配[附注 5]	9,876,502	12,622,926
衍生性产品	19,432,585	13,484,437
其他应付款项	3,047,423	2,796,888
负债 (不包括可赎回份额持有人应占净资产)	<u>107,049,884</u>	<u>41,408,361</u>
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	<u>2,226,921,445</u>	<u>2,229,115,400</u>

综合收益表

截至二零一六年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零一五年十 月一日至 二零一六年三 月三十一日 美元	二零一四年十 月一日至二零 一五年三月三 十一日 美元
收入		
投资及衍生性产品净收益[附注 4]	114,114,865	22,557,030
汇兑净收益 / (亏损)	2,614,134	(275,254)
存款利息	272,219	264,079
其他收入	117,049	1,500
	<u>117,118,267</u>	<u>22,547,355</u>
支出		
管理费用	10,937,459	8,230,334
受托人费用	282,257	216,112
基金注册登记机构费用	181,645	160,963
托管费用及银行费用	176,086	118,999
交易成本	139,137	15,455
法律及专业费用	91,676	17,688
估值费用	8,540	8,610
核数师酬金	7,118	6,683
印刷及出版支出	4,884	9,103
其他经营费用	4,033	4,021
	<u>11,832,835</u>	<u>8,787,968</u>
净经营利润	<u>105,285,432</u>	<u>13,759,387</u>
财务成本		
收益分配[附注 5]	(68,466,241)	(59,417,927)
已付利息	(12)	(5,454)
	<u>(68,466,253)</u>	<u>(59,423,381)</u>
除税前利润 / (亏损)	<u>36,819,179</u>	<u>(45,663,994)</u>
税项	(1,885,317)	(1,574,435)
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加 / (减少)	<u>34,933,862</u>	<u>(47,238,429)</u>

可赎回份额持有人应占净资产变动表
截至二零一六年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零一五年十月一日至 二零一六年三月三十一日 美元	二零一四年十月一日至二零 一五年三月三十一日 美元
期初可赎回份额持有人应占净资产	2,229,115,400	902,230,981
分配可赎回份额	891,886,975	2,050,864,685
赎回可赎回份额	(929,014,792)	(498,233,700)
净(赎回) / 分配	(37,127,817)	1,552,630,985
	2,191,987,583	2,454,861,966
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加 / (减少)	34,933,862	(47,238,429)
期末可赎回份额持有人应占净资产	2,226,921,445	2,407,623,537

现金流量表
截至二零一六年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零一五年十月一日至 二零一六年三月三十一日 美元	二零一四年十月一日至二零 一五年三月三十一日 美元
经营业务		
购入投资及衍生性产品	(225,221,908)	(1,242,956,610)
出售投资及衍生性产品所得款项		
项	392,765,366	38,714,254
已收利息	271,576	263,659
已付交易费用	(140,022)	(19,400)
已付基金注册登记机构费用	(189,125)	(121,031)
已付受托人费用	(284,244)	(183,779)
已付税项	(1,761,068)	(392,080)
保证金之增加	(1,953,776)	(859,514)
已付管理费用	(10,982,292)	(6,921,904)
其他	(1,120,582)	(62,743)
经营业务所产生 / (运用) 之现金净额	151,383,925	(1,212,539,148)
融资活动		
已付利息	(12)	(5,454)
分配可赎回份额所得款项	862,743,496	1,943,909,723
赎回可赎回份额付款	(925,903,598)	(494,466,808)
已付收益分配	(71,212,665)	(50,268,945)
融资活动所(运用) / 产生之现金净额	(134,372,779)	1,399,168,516
现金及现金等价物之增加	17,011,146	186,629,368
期初现金及现金等价物	258,463,022	152,061,816
现金及现金等价物之汇兑收益 / (亏损)	3,677,718	(87,330)
期末现金及现金等价物	279,151,886	338,603,854
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	279,151,886	285,602,652
短期存款	-	53,001,202
	279,151,886	338,603,854

财务报表之附注

1 本基金

摩根亚洲总收益债券基金（“本基金”）根据二零零四年十一月三十日的信托契约（经修订）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（“SFC”）核准。

本基金之投资目标为透过一个主要投资于亚洲债券和其他债务证券之积极管理组合，致力提供具竞争力的总回报（包括资本增长及定息收益）。

根据二零一二年二月二十七日的增补信托契约，管理人可决定发行不同类别（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) 中期财务报表至财务政策

编制本未经审计简明中期财务报表的会计政策及计算方法同截至二零一五年九月三十日止年度财务报表所采纳的会计政策及计算方法一致。

(b) 投资及衍生性产品

分类

本基金将其投资及衍生性产品归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。此等金融资产和负债为持作买卖用途。持作买卖用途的金融资产和负债主要是为了在短期内出售或购回或获得短期盈利而买入或产生的。

如果金额对于本基金是应收款项，则列作资产；如果金额对于本基金是应付款项，则列作负债。

确认、取消确认及计量

投资及衍生性产品之买卖于交易日确认。投资及衍生性产品先以公允价值确认，其后以公允价值列账。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的现金流量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。

公允价值估计

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

债务证券的公允价值按包括应计利息的报价计算。

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允价值而计算，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。

未平仓期权是以在估值日的长短仓最后交易价估值。最后交易价与溢价金额 / 合约价格之间的差额在综合收益表确认。

信贷违约的掉期是以庄家逐日盯市制度的报价和估值变化为基础的，如有，将会入账为综合收益表中的未实现收益或亏损。

远期外汇合约是以在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) 外币交易

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按期/年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

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

(d) 销售份额所得款项及赎回份额支付款项

每份额资产净值于每个交易日计算。认购/申购或赎回份额的价格将通过参考相关交易日营业时间结束时每份额资产净值计算。这是按照二零零四年十一月三十日的信托契约（经修订）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报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报表入账。

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）

二零一六年三月三十一日

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额 数目:	25,522,176.189	14,613,074.661	153,867.797	298,664,339.357	8,940,965.565
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额 持有人应 占净资产	233,897,087	134,326,307	1,474,978	2,890,398,232	81,367,341
可赎回份额 持有人应 占净资产 (每份 额)	9.16	9.19	9.59	9.68	9.10

	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 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲类别 (累计) 份额
已发行份额数目:	1,702,778.192	484,794,987.368	2,661,865.552	58,748,650.727	35,691,747.010
	人民币	人民币	美元	美元	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	18,674,255	4,576,756,469	30,539,494	653,985,795	372,458,057
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	10.97	9.44	11.47	11.13	10.44
	PRC 人民币对冲类别 (每月派息) 份额	PRC 美元类别 (累计) 份额	PRC 美元类别 (每月派息) 份额		
已发行份额数目:	32,478,359.860	667,121.990	201.460		
	人民币	美元	美元		
可赎回份额持有人应占净 资产	330,976,185	6,840,131	2,043		
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	10.19	10.25	10.14		
<u>二零一五年九月三十日</u>					
	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:	24,150,892.841	15,771,899.487	93,571.235	259,609,204.830	10,791,750.092
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净 资产	218,503,411	143,065,587	883,883	2,473,838,161	96,923,455
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	9.05	9.07	9.45	9.53	8.98

	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 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:	2,814,534.808	651,910,409.424	2,877,139.286	54,291,404.491
	人民币	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应占净 资产	29,073,814	6,075,057,512	31,831,272	595,609,359
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	10.33	9.32	11.06	10.97

4 投资及衍生性产品净收益

	二零一五年十月一 日至二零一六年三 月三十一日 美元	二零一四年十月一 日至二零一五年三月 三十一日 美元
投资和衍生性产品价值的未实现损益的变化	83,111,509	42,574,233
投资和衍生性产品的销售的实现收益 / (亏损)	31,003,356	(20,017,203)
	114,114,865	22,557,030

5 收益分配

基金管理人有意就每个会计期应占收入的至少 85% 拨作收益分配类别，在分别收取每收益分配类别的费用后，分配予该等收益分配类别的份额持有人。

	二零一五年十月一 日至二零一六年三月 三十一日 美元	二零一四年十月一 日至二零一五年三月 三十一日 美元
净经营利润	105,285,432	13,759,387
调整:		
投资及衍生性产品净收益	(114,114,865)	(22,557,030)
利息收入包括于投资及衍生性产品净收益 (票面利率)	47,765,348	33,132,088
汇兑净 (收益) / 亏损	(2,614,134)	275,254
交易成本	139,137	15,455
已付利息	(12)	(5,454)
税项	(1,885,317)	(1,574,435)
资本利得税	462,368	764,681
可分配金额	35,037,957	23,809,946

收益分配

澳元 0.0486 每份额，共 26,840,078.252 份额，澳元对冲类别(每月派息)	
到期日：二零一五年十月三十日，支付日：二零一五年十一月九日	(930,644)
加元 0.0350 每份额，共 15,723,534.392 份额，加元对冲类别(每月派息)	
到期日：二零一五年十月三十日，支付日：二零一五年十一月九日	(420,624)
人民币 0.0650 每份额，共 641,902,557.016 份额，人民币对冲类别(每月派息)	
到期日：二零一五年十月三十日，支付日：二零一五年十一月九日	(6,598,975)
英镑 0.0361 每份额，共 95,671,350 份额，英镑对冲类别(每月派息)	
到期日：二零一五年十月三十日，支付日：二零一五年十一月九日	(5,334)

二零一五年十月一日 至二零一六年三月三十一日	二零一四年十月一日 至二零一五年三月三十一日
美元	美元

港元 0.0347 每份额, 共 269,359,708.456 份额, 港元类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十月三十日, 支付日: 二零一五年十一月九日	(1,206,021)
纽元 0.0541 每份额, 共 11,305,834.876 份额, 纽元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十月三十日, 支付日: 二零一五年十一月九日	(413,839)
美元 0.0400 每份额, 共 56,664,884.781 份额, 美元类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十月三十日, 支付日: 二零一五年十一月九日	(2,266,595)
(二零一五年: 澳元 0.0571 每份额, 共 10,899,218.783 份额, 澳元对冲类别(每月派息))	
到期日: 二零一四年十月三十一日, 支付日: 二零一四年十一月十日	(547,041)
(二零一五年: 加元 0.0430 每份额, 共 7,452,151.829 份, 加元对冲类别(每月派息))	
到期日: 二零一四年十月三十一日, 支付日: 二零一四年十一月十日	(284,219)
(二零一五年: 人民币 0.0613 每份额, 共 269,502,749.333 份额, 人民币对冲类别(每月派息))	
到期日: 二零一四年十月三十一日, 支付日: 二零一四年十一月十日	(2,696,435)
(二零一五年: 港元 0.0369 每份额, 共 103,724,462.800 份额, 港元类别(每月派息))	
到期日: 二零一四年十月三十一日, 支付日: 二零一四年十一月十日	(493,531)
(二零一五年: 纽元 0.0652 每份额, 共 8,442,478.846 份额, 纽元对冲类别(每月派息))	
到期日: 二零一四年十月三十一日, 支付日: 二零一四年十一月十日	(428,195)
(二零一五年: 美元 0.0425 每份额, 共 25,783,027.441 份额, 美元类别(每月派息))	
到期日: 二零一四年十月三十一日, 支付日: 二零一四年十一月十日	(1,095,779)
澳元 0.0483 每份额, 共 26,495,033.317 份额, 澳元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十一月三十日, 支付日: 二零一五年十二月八日	(927,278)
加元 0.0349 每份额, 共 15,514,852.048 份额, 加元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十一月三十日, 支付日: 二零一五年十二月八日	(406,615)
人民币 0.0610 每份额, 共 650,362,116.817 份额, 人民币对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十一月三十日, 支付日: 二零一五年十二月八日	(6,174,116)
英镑 0.0362 每份额, 共 82,708.699 份额, 英镑对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十一月三十日, 支付日: 二零一五年十二月八日	(4,507)
港元 0.0347 每份额, 共 273,194,912.785 份额, 港元类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十一月三十日, 支付日: 二零一五年十二月八日	(1,222,900)
纽元 0.0535 每份额, 共 10,603,883.081 份额, 纽元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十一月三十日, 支付日: 二零一五年十二月八日	(373,827)
美元 0.0400 每份额, 共 55,318,474.035 份额, 美元类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十一月三十日, 支付日: 二零一五年十二月八日	(2,212,739)
(二零一五年: 澳元 0.0563 每份额, 共 13,730,714.496 份额, 澳元对冲类别(每月派息))	
到期日: 二零一四年十一月二十八日, 支付日: 二零一四年十二月八日	(659,789)
(二零一五年: 加元 0.0421 每份额, 共 9,319,920.892 份额, 加元对冲类别(每月派息))	
到期日: 二零一四年十一月二十八日, 支付日: 二零一四年十二月八日	(344,108)
(二零一五年: 人民币 0.0632 每份额, 共 382,948,213.617 份额, 人民币对冲类别(每月派息))	
到期日: 二零一四年十一月二十八日, 支付日: 二零一四年十二月八日	(3,929,523)
(二零一五年: 英镑 0.0391 每份额, 共 12,743.662 份额, 英镑对冲类别(每月派息))	
到期日: 二零一四年十一月二十八日, 支付日: 二零一四年十二月八日	(780)
(二零一五年: 港元 0.0369 每份额, 共 140,662,260.091 份额, 港元类别(每月派息))	
到期日: 二零一四年十一月二十八日, 支付日: 二零一四年十二月八日	(669,302)
(二零一五年: 纽元 0.0639 每份额, 共 9,449,446.030 份额, 纽元对冲类别(每月派息))	
到期日: 二零一四年十一月二十八日, 支付日: 二零一四年十二月八日	(473,998)
(二零一五年: 美元 0.0425 每份额, 共 35,044,857.628 份额, 美元类别(每月派息))	
到期日: 二零一四年十一月二十八日, 支付日: 二零一四年十二月八日	(1,489,407)
澳元 0.0479 每份额, 共 26,336,317.872 份额, 澳元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十二月三十一日, 支付日: 二零一六年一月十一日	(917,811)
加元 0.0331 每份额, 共 15,023,545.331 份额, 加元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十二月三十一日, 支付日: 二零一六年一月十一日	(357,987)
人民币 0.0730 每份额, 共 620,930,012.709 份额, 人民币对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十二月三十一日, 支付日: 二零一六年一月十一日	(6,900,325)
英镑 0.0330 每份额, 共 98,296.913 份额, 英镑对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十二月三十一日, 支付日: 二零一六年一月十一日	(4,781)
港元 0.0347 每份额, 共 271,240,027.831 份额, 港元类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十二月三十一日, 支付日: 二零一六年一月十一日	(1,214,432)

二零一五年十月一日 二零一四年十月一
至二零一六年三月三十一日 日至二零一五年三
月三十一日
美元 美元

纽元 0.0520 每份额, 共 10,104,262.131 份额, 纽元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十二月三十一日, 支付日: 二零一六年一月十一日	(359,704)
美元 0.0400 每份额, 共 54,825,057.972 份额, 美元类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年十二月三十一日, 支付日: 二零一六年一月十一日	(2,193,002)
(二零一五年: 澳元 0.0570 每份额, 共 15,789,847.780 份额, 澳元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一四年十二月三十一日, 支付日: 二零一五年一月九日	(736,533)
(二零一五年: 加元 0.0421 每份额, 共 10,435,539.487 份额, 加元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一四年十二月三十一日, 支付日: 二零一五年一月九日	(379,310)
(二零一五年: 人民币 0.0727 每份额, 共 463,315,467.569 份, 人民币对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一四年十二月三十一日, 支付日: 二零一五年一月九日	(5,417,108)
(二零一五年: 英镑 0.0384 每份额, 共 12,793,689 份额, 英镑对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一四年十二月三十一日, 支付日: 二零一五年一月九日	(766)
(二零一五年: 港元 0.0369 每份额, 共 143,389,300.559 份额, 港元类别(每月派息)	
到期日: 二零一四年十二月三十一日, 支付日: 二零一五年一月九日	(682,291)
(二零一五年: 纽元 0.0657 每份额, 共 9,864,830.682 份额, 纽元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一四年十二月三十一日, 支付日: 二零一五年一月九日	(506,570)
(二零一五年: 美元 0.0425 每份额, 共 37,857,909.726 份额, 美元类别(每月派息)	
到期日: 二零一四年十二月三十一日, 支付日: 二零一五年一月九日	(1,608,961)
澳元 0.0469 每份额, 共 25,363,107.229 份额, 澳元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年一月二十九日, 支付日: 二零一六年二月十一日	(841,414)
加元 0.0324 每份额, 共 15,194,708.421 份额, 加元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年一月二十九日, 支付日: 二零一六年二月十一日	(349,837)
人民币 0.0986 每份额, 共 517,806,528.297 份额, 人民币对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年一月二十九日, 支付日: 二零一六年二月十一日	(7,741,287)
人民币 0.1063 每份额, 共 1,897,453.890 份额, PRC 人民币对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年一月二十九日, 支付日: 二零一六年二月十五日	(30,583)
英镑 0.0337 每份额, 共 337,458.127 份额, 英镑对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年一月二十九日, 支付日: 二零一六年二月十一日	(16,132)
港元 0.0347 每份额, 共 287,344,259.506 份额, 港元类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年一月二十九日, 支付日: 二零一六年二月十一日	(1,281,130)
纽元 0.0503 每份额, 共 9,302,888.025 份额, 纽元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年一月二十九日, 支付日: 二零一六年二月十一日	(302,754)
美元 0.0400 每份额, 共 56,417,500.315 份额, 美元类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年一月二十九日, 支付日: 二零一六年二月十一日	(2,256,700)
美元 0.0365 每份额, 共 200.000 份额, PRC 美元类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年一月二十九日, 支付日: 二零一六年二月十五日	(7)
(二零一五年: 澳元 0.0573 每份额, 共 19,009,260.638 份额, 澳元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年一月三十日, 支付日: 二零一五年二月九日	(848,238)
(二零一五年: 加元 0.0416 每份额, 共 11,408,501.688 份额, 加元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年一月三十日, 支付日: 二零一五年二月九日	(374,300)
(二零一五年: 人民币 0.0714 每份额, 共 570,705,961.328 份额, 人民币对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年一月三十日, 支付日: 二零一五年二月九日	(6,484,212)
(二零一五年: 英镑 0.0389 每份额, 共 14,007.910 份额, 英镑对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年一月三十日, 支付日: 二零一五年二月九日	(818)
(二零一五年: 港元 0.0369 每份额, 共 171,447,899.907 份额, 港元类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年一月三十日, 支付日: 二零一五年二月九日	(815,961)
(二零一五年: 纽元 0.0651 每份额, 共 10,064,506.549 份额, 纽元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年一月三十日, 支付日: 二零一五年二月九日	(475,544)
(二零一五年: 美元 0.0425 每份额, 共 42,609,388.171 份额, 美元类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年一月三十日, 支付日: 二零一五年二月九日	(1,810,899)
澳元 0.0460 每份额, 共 25,613,412.880 份额, 澳元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年二月二十九日, 支付日: 二零一六年三月八日	(841,542)
加元 0.0330 每份额, 共 14,946,499.642 份额, 加元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年二月二十九日, 支付日: 二零一六年三月八日	(364,118)

二零一五年十月一日 二零一四年十月一
至二零一六年三月三十一日 日至二零一五年三
月三十一日
美元 美元

人民币 0.0759 每份额, 共 488,497,028.163 份额, 人民币对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年二月二十九日, 支付日: 二零一六年三月八日	(5,659,044)
人民币 0.0818 每份额, 共 8,493,681.230 份额, PRC 人民币对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年二月二十九日, 支付日: 二零一六年三月八日	(106,045)
英镑 0.0343 每份额, 共 352,555.659 份额, 英镑对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年二月二十九日, 支付日: 二零一六年三月八日	(16,852)
港元 0.0347 每份额, 共 288,418,151.953 份额, 港元类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年二月二十九日, 支付日: 二零一六年三月八日	(1,287,026)
纽元 0.0494 每份额, 共 8,762,445.980 份额, 纽元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年二月二十九日, 支付日: 二零一六年三月八日	(285,410)
美元 0.0400 每份额, 共 52,444,866.385 份额, 美元类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年二月二十九日, 支付日: 二零一六年三月八日	(2,097,795)
美元 0.0365 每份额, 共 200.730 份额, PRC 美元类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年二月二十九日, 支付日: 二零一六年三月八日	(7)
二零一五年: 澳元 0.0522 每份额, 共 21,360,786.537 份额, 澳元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年二月二十七日, 支付日: 二零一五年三月九日	(872,792)
(二零一五年: 加元 0.0394 每份额, 共 13,425,618.575 份额, 加元对冲类别(每月派息))	
到期日: 二零一五年二月二十七日, 支付日: 二零一五年三月九日	(423,633)
二零一五年: 人民币 0.0758 每份额, 共 646,559,035.265 份额, 人民币对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年二月二十七日, 支付日: 二零一五年三月九日	(7,795,382)
(二零一五年: 英镑 0.0386 每份额, 共 29,053.383 份额, 英镑对冲类别(每月派息))	
到期日: 二零一五年二月二十七日, 支付日: 二零一五年三月九日	(1,733)
(二零一五年: 港元 0.0369 每份额, 共 190,610,524.943 份额, 港元类别(每月派息))	
到期日: 二零一五年二月二十七日, 支付日: 二零一五年三月九日	(906,914)
(二零一五年: 纽元 0.0615 每份额, 共 10,962,357.685 份额, 纽元对冲类别(每月派息))	
到期日: 二零一五年二月二十七日, 支付日: 二零一五年三月九日	(510,190)
(二零一五年: 美元 0.0425 每份额, 共 46,185,838.444 份额, 美元类别(每月派息))	
到期日: 二零一五年二月二十七日, 支付日: 二零一五年三月九日	(1,962,898)
澳元 0.0464 每份额, 共 25,729,574.016 份额, 澳元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年三月三十一日, 支付日: 二零一六年四月十一日	(918,371)
加元 0.0330 每份额, 共 14,655,199.579 份额, 加元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年三月三十一日, 支付日: 二零一六年四月十一日	(373,900)
人民币 0.0574 每份额, 共 484,042,762.396 份额, 人民币对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年三月三十一日, 支付日: 二零一六年四月十一日	(4,302,336)
人民币 0.0618 每份额, 共 31,214,890.980 份额, PRC 人民币对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年三月三十一日, 支付日: 二零一六年四月十一日	(298,716)
英镑 0.0333 每份额, 共 146,123.807 份额, 英镑对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年三月三十一日, 支付日: 二零一六年四月十一日	(6,994)
港元 0.0347 每份额, 共 297,837,091.869 份额, 港元类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年三月三十一日, 支付日: 二零一六年四月十一日	(1,332,416)
纽元 0.0494 每份额, 共 8,941,434.726 份额, 纽元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年三月三十一日, 支付日: 二零一六年四月十一日	(306,677)
美元 0.0400 每份额, 共 58,427,124.078 份额, 美元类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年三月三十一日, 支付日: 二零一六年四月十一日	(2,337,085)
美元 0.0365 每份额, 共 201.460 份额, PRC 美元类别(每月派息)	
到期日: 二零一六年三月三十一日, 支付日: 二零一六年四月十一日	(7)
二零一五年: 澳元 0.0536 每份额, 共 22,325,056.566 份额, 澳元对冲类别(每月派息)	
到期日: 二零一五年三月三十一日, 支付日: 二零一五年四月十三日	(914,160)
(二零一五年: 加元 0.0396 每份额, 共 16,417,288.971 份额, 加元对冲类别(每月派息))	
到期日: 二零一五年三月三十一日, 支付日: 二零一五年四月十三日	(513,324)
(二零一五年: 人民币 0.0751 每份额, 共 722,991,363.788 份额, 人民币对冲类别(每月派息))	
到期日: 二零一五年三月三十一日, 支付日: 二零一五年四月十三日	(8,749,762)
(二零一五年: 英镑 0.0386 每份额, 共 35,962.399 份额, 英镑对冲类别(每月派息))	
到期日: 二零一五年三月三十一日, 支付日: 二零一五年四月十三日	(2,061)
(二零一五年: 港元 0.0369 每份额, 共 212,260,160.977 份额, 港元类别(每月派息))	

	二零一五年十月一日 至二零一六年三月三十一日 美元	二零一四年十月一 日至二零一五年三 月三十一日 美元
到期日：二零一五年三月三十一日，支付日：二零一五年四月十三日) (二零一五年：纽元 0.0643 每份额，共 10,716,913.929 份额，纽元对冲类别(每月派息)		(1,010,235)
到期日：二零一五年三月三十一日，支付日：二零一五年四月十三日) (二零一五年：美元 0.0425 每份额，共 46,693,441.496 份额，美元类别(每月派息)		(516,754)
到期日：二零一五年三月三十一日，支付日：二零一五年四月十三日)		(1,984,471)
可赎回份额持有人的总收益分配	(68,466,241)	(59,417,927)

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。

6 非金钱收益 / 佣金共享安排

投资管理人与经纪签署非金钱收益 / 佣金共享安排，用以支持投资决策的产品和服务。投资管理人直接支付这些服务，但会代表本基金与经纪约定服务金额。基金将负责支付佣金。

提供的产品和服务对本基金的益处必须明显，可包括研究和咨询服务、经济政治分析、投资组合分析（包括估值和业绩考评）、市场分析、数据与行情服务、相关电脑软硬件支持、结算和托管服务及投资相关的出版物。



0316

