

半年度报告—2017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	6
财务状况表	7
综合收益表	7
可赎回份额持有人应占净资产变动表	8
现金流量表	8
财务报表之附注	9 - 15

投资组合

截至二零一七年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比
上市投资 (94.6%)				CapitalLand Ltd CB			
(I) 可换股 (9.8%)				1.85% 19/6/20-RegS	新加坡元 11,750,000	8,217,521	0.3
百慕大 (0.5%)				CapitalLand Ltd CB			
Haitong Intl Secs CB				2.8% 8/06/25-RegS	新加坡元 32,250,000	22,993,565	0.7
25/10/21-RegS	港元 108,000,000	14,158,610	0.5	台湾 (0.4%)			
中国 (2.3%)				Siliconware Prec Ind			
Asia View EB (Yuexiu)				CB0%10/19-RegS	美元 5,250,000	5,814,375	0.2
1.5% 8/19-RegS	美元 9,000,000	10,086,750	0.3	United Microelec CB			
CRRC Group CB 0%				0%18/05/20-RegS	美元 4,800,000	4,787,760	0.2
05/02/21-RegS	美元 20,000,000	21,012,400	0.7	泰国 (0.1%)			
Franshion Cap				Bangkok Dusit Med CB			
EB(FPC)6.8% Perp-RegS	美元 1,000,000	1,135,231	0.0	0%18/9/19-RegS	泰铢 110,000,000	3,465,260	0.1
Kunlun Energy CB							
1.625% 07/19-RegS	人民币 142,000,000	22,780,088	0.8			300,662,772	9.8
Semiconductor Mfg CB						-----	-----
0% 7/7/22-RegS	美元 12,750,000	15,300,000	0.5	(II) 债务证券 (85.2%)			
香港 (2.1%)				澳大利亚 (2.0%)			
ASM Pacific Tech CB				China Const Bk			
2% 03/19-RegS	港元 32,000,000	4,931,752	0.2	Sydney3.8% 9/17-RegS	人民币 26,000,000	3,761,248	0.1
Baosteel Hong Kong CB				CNOOC Fin (2015)			
0% 12/18-RegS	美元 19,300,000	19,782,500	0.6	2.625% 05/05/20	美元 22,100,000	22,289,369	0.7
China Overs Fin V CB				NSW Treasury 4%			
0% 5/1/23-RegS	美元 20,200,000	20,593,900	0.7	20/04/23	澳元 21,900,000	18,322,294	0.6
Shine Power EB(BJ				Queensland No24			
Enter)0% 7/19-RegS	港元 144,000,000	18,696,005	0.6	5.75% 22/7/24-RegS	澳元 18,000,000	16,507,219	0.6
日本 (2.4%)				开曼群岛 (8.0%)			
Kansai Paint CB 0%				Agile Group 9%			
17/06/19-RegS	日元 1,490,000,000	14,394,553	0.5	21/05/20-RegS	美元 7,700,000	8,709,085	0.3
Kyushu Electric Power				Alibaba Group Hldg			
CB 0% 31/3/20	日元 740,000,000	6,943,103	0.2	3.6% 28/11/24	美元 13,000,000	13,300,560	0.4
Kyushu Electric Power				CAR Inc 6% 11/02/21-RegS	美元 7,900,000	8,307,245	0.3
CB 0% 31/3/22	日元 740,000,000	6,911,758	0.2	CAR Inc 6.125%			
Suzuki Motor CB 0%				04/02/20-RegS	美元 14,700,000	15,442,615	0.5
31/03/21-RegS	日元 900,000,000	10,104,101	0.3	China Overs Fin V			
Takashimaya Co CB				3.95% 15/11/22	美元 3,500,000	3,653,237	0.1
0% 11/12/20	日元 1,200,000,000	11,159,472	0.4	China Overs Fin VI			
Tohoku Elec Power CB				5.95% 5/24-RegS	美元 12,000,000	13,877,400	0.4
0% 03/12/20	日元 2,000,000,000	18,237,817	0.6	CIFI Hldgs Group			
Yamaguchi CB FRN				7.75% 05/06/20	美元 6,000,000	6,623,325	0.2
26/03/20-RegS	美元 6,900,000	7,133,501	0.2	Country Garden			
马来西亚 (0.7%)				4.75% 28/09/23-RegS	美元 18,500,000	18,132,364	0.6
Cahaya Capit				Country Garden 7.5%			
EB(Tenaga)				09/03/20-RegS	美元 4,500,000	4,826,213	0.2
0% 9/21-RegS	美元 22,100,000	21,276,775	0.7	Country Garden 7.5%			
菲律宾 (0.1%)				10/01/23-RegS	美元 400,000	431,913	0.0
AYC Fin EB (Ayala)				Country Garden			
0.5% 2/5/19-RegS	美元 4,000,000	4,078,333	0.1	7.875% 27/05/19-RegS	美元 7,200,000	7,711,875	0.2
新加坡 (1.2%)				Formosa Group			
CapitalLand Ltd 1.95%				3.375% 22/04/25-RegS	美元 24,550,000	24,453,028	0.8
17/10/23-RegS	新加坡元 9,000,000	6,667,642	0.2				

投资组合 (续)

截至二零一七年三月三十一日 (未经审计)

(续)

单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
开曼群岛 (续)			Tianjin Infra Con 2.75% 06/19-RegS 美元 29,600,000 29,739,819 1.0		
FWD Ltd 5% 24/09/24-RegS 美元 16,800,000	17,810,707	0.6	香港 (6.7%)		
Greenland HK Hldgs 3.875%07/19-RegS 美元 34,150,000	34,187,186	1.1	Bank of East Asia VRN 4% 11/26-RegS 美元 22,800,000 23,012,167 0.8		
Greenland HK Hldgs 4.375% 8/17-RegS 美元 8,300,000	8,375,812	0.3	Bank of East Asia VRN 4.25% 11/24- RegS 美元 21,200,000 21,769,927 0.7		
Hutch Wham Intl 12 VRN 6% Perp-RegS 美元 1,650,000	1,696,310	0.0	Bank of East Asia VRN 5.5%Perp- RegS 美元 5,000,000 5,102,417 0.2		
KWG Property 8.25% 05/08/19-RegS 美元 10,500,000	11,242,481	0.4	China CITIC Bk VRN 3.875% 28/9/22 美元 1,400,000 1,405,657 0.0		
OVPH Ltd 5.875% Perp-RegS 美元 7,100,000	7,431,466	0.2	China CITIC Bk VRN 6% 05/24-RegS 美元 4,500,000 4,837,935 0.2		
Semiconductor Mfg 4.125%10/19-RegS 美元 11,600,000	12,152,184	0.4	China CITIC Bk VRN 7.25%Perp-RegS 美元 12,200,000 13,380,011 0.4		
Shimao Property 8.375% 10/2/22- RegS 美元 17,906,000	20,214,034	0.7	China Const Bk VRN 4.25% 08/24-RegS 美元 13,100,000 13,510,139 0.4		
Tencent Hldgs 3.8% 11/02/25-RegS 美元 7,900,000	8,128,968	0.3	CITIC Ltd 3.7% 14/06/26-RegS 美元 5,000,000 5,011,000 0.2		
中国 (5.1%)			CITIC Ltd 6.875% 21/01/18 美元 2,400,000 2,526,262 0.1		
Bank of China 5% 13/11/24-RegS 美元 21,800,000	23,633,501	0.8	CITIC Ltd VRN 8.625% Perp-RegS 美元 10,600,000 11,909,586 0.4		
Bank of China NY 3.6% 12/07/18- RegS 人民币 13,000,000	1,873,396	0.1	CRCC Yupeng VRN 3.95% Perp-RegS 美元 16,500,000 16,992,250 0.6		
Bank of Comm VRN 5% Perp-RegS 美元 12,155,000	12,900,102	0.4	Hero Asia Inv 2.875% 03/10/17-RegS 美元 13,100,000 13,332,461 0.4		
Beijing Capital (HK) 4.7% 6/17-RegS 人民币 4,000,000	586,815	0.0	HNA Group Intl 8% 13/11/17-RegS 人民币 34,200,000 5,140,853 0.2		
China Const Bk 3.875% 13/5/25- RegS 美元 28,200,000	29,109,783	1.0	ICBCIL Finance 3.25% 17/03/20-RegS 美元 16,000,000 16,150,467 0.5		
China Const Bk VRN 4.9% 11/24-RegS 人民币 9,400,000	1,392,745	0.0	ICBCIL Finance 3.625% 19/05/26- RegS 美元 13,000,000 12,872,501 0.4		
China Dev Bank No1507 4.18% 4/18-1B 人民币 18,500,000	2,809,274	0.1	MCC Hldgs HK 2.5% 28/08/17-RegS 美元 12,100,000 12,139,459 0.4		
China Govt Bond 3.48% 29/06/27- RegS 人民币 9,500,000	1,272,077	0.0	Wheelock Finance 2.75% 2/07/17- RegS 美元 12,700,000 12,810,808 0.4		
China Govt Bond 4.29% 22/05/29- RegS 人民币 5,500,000	791,581	0.0	Wheelock Finance 3% 19/03/18-RegS 美元 1,600,000 1,614,773 0.1		
China Govt Bond 4.5% 22/05/34-RegS 人民币 4,500,000	653,909	0.0	Wing Lung Bank VRN 3.5% 11/22-RegS 美元 1,000,000 1,016,197 0.0		
China Life Ins VRN 4% 03/07/75-RegS 美元 9,750,000	9,918,079	0.3	Zhejiang Prov Energy 2.3% 9/17-RegS 美元 9,600,000 9,608,907 0.3		
China New Town Fin 5.5% 6/5/18-RegS 人民币 51,000,000	7,546,576	0.3	印度 (11.3%)		
ICBC Dubai 2.5% 07/06/21-RegS 美元 11,800,000	11,690,981	0.4	Axis Bank Dubai 2.875% 1/06/21- RegS 美元 42,200,000 42,104,346 1.4		
ICBC Macau VRN 3.875% 10/09/24- RegS 美元 12,100,000	12,321,043	0.4	Bharat Petroleum 4% 08/05/25-RegS 美元 22,240,000 22,857,160 0.7		
Lenovo Group 4.95% 10/06/20 人民币 50,000,000	7,375,819	0.2	Bharti Airtel 4.375% 10/06/25-RegS 美元 15,000,000 15,225,167 0.5		
Shenzhen Qianhai 4.55% 10/17-RegS 人民币 25,500,000	3,768,733	0.1	Export-Imp Bk IN 3.125% 07/21-RegS 美元 5,000,000 5,071,500 0.2		
			Export-Imp Bk IN 9.45% 22/01/19 印度卢比 950,000,000 15,431,234 0.5		

投资组合 (续)

截至二零一七年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
印度 (续)							
Export-Imp Bk IN NoQ17 9.28% 10/18	印度卢比 650,000,000	10,738,848	0.4	Indonesia Retail 8.5% 15/10/17	印尼盾 304,000,000,000	23,207,136	0.8
Export-Imp Bk IN NoQ20 9.7%21/11/18	印度卢比 250,000,000	4,126,522	0.1	Indonesia Retail 9% 15/10/18	印尼盾 100,000,000,000	7,810,527	0.3
Export-Imp Bk IN NoQ21 9.63% 11/18	印度卢比 250,000,000	4,115,492	0.1	Indosat Tbk NoOB 10% 12/12/17	印尼盾 35,000,000,000	2,694,716	0.1
ICICI Bank 4% 24/11/17-RegS	人民币 31,000,000	4,528,709	0.2	Indosat Tbk NoOB 9.25% 04/06/18	印尼盾 100,000,000,000	7,672,465	0.2
ICICI Bank/Dubai 4% 18/03/26-RegS	美元 28,000,000	27,959,556	0.9	Lembaga Pembiayaan 7.25% 05/09/17	印尼盾 90,000,000,000	6,811,723	0.2
India Govt Bond 7.59% 11/01/26	印度卢比 2,000,000,000	32,804,420	1.1	Lembaga Pembiayaan 7.95% 25/08/19	印尼盾 90,000,000,000	6,807,127	0.2
India Govt Bond 7.8% 11/04/21	印度卢比 2,800,000,000	46,343,265	1.5	MPM Global Pte 6.75% 19/9/19- RegS	美元 8,800,000	9,244,730	0.3
India Govt Bond 8.19% 16/01/20	印度卢比 220,000,000	3,580,706	0.1	Pelabuhan Indonesia 4.25% 5/25-RegS	美元 9,600,000	9,757,960	0.3
India Govt Bond 8.27% 09/06/20	印度卢比 752,000,000	12,437,312	0.4	Pertamina Persero 4.3% 20/5/23-RegS	美元 45,000,000	47,219,249	1.5
India Govt Bond 8.4% 28/07/24	印度卢比 1,140,000,000	19,243,736	0.6	Pertamina Persero 4.875% 05/22-RegS	美元 8,000,000	8,651,017	0.3
NTPC Ltd 4.25% 26/02/26-RegS	美元 18,000,000	18,514,800	0.6	Pertamina Persero 5.625% 05/43-RegS	美元 1,800,000	1,898,685	0.1
NTPC Ltd 4.375% 26/11/24-RegS	美元 9,100,000	9,584,234	0.3	Pertamina Persero 6% 03/05/42-RegS	美元 800,000	873,067	0.0
Oil India 5.375% 17/04/24-RegS	美元 2,000,000	2,236,971	0.1	Pertamina Persero 6.45%30/5/44- RegS	美元 25,000,000	28,882,708	0.9
Power Finance 9.32% 17/09/19	印度卢比 250,000,000	4,216,205	0.1	Perusahaan Penerb 4.325% 5/25-RegS	美元 6,300,000	6,577,183	0.2
Power Finance No123A 8.5% 28/11/17	印度卢比 600,000,000	9,595,581	0.3	Perusahaan Penerb 4.35% 09/24-RegS	美元 14,300,000	14,887,849	0.5
Reliance Ind 4.125% 28/01/25-RegS	美元 5,000,000	5,145,917	0.2	Perusahaan Penerb NoSR07 8.25% 3/18	印尼盾 153,000,000,000	11,764,731	0.4
Tata Motors 4.625% 30/04/20-RegS	美元 14,900,000	15,726,619	0.5	Perusahaan Penerb 3.4% 03/22-RegS	美元 7,600,000	7,640,153	0.2
UPL Corp 3.25% 13/10/21-RegS	美元 14,700,000	14,793,447	0.5	Rep of Indonesia 4.75% 8/1/26-RegS	美元 50,000,000	53,956,666	1.8
印度尼西亚 (12.8%)				Rep of Indonesia 5.875% 01/24-RegS	美元 5,000,000	5,754,580	0.2
Indonesia Eximbank NoOB 9% 13/03/18	印尼盾 130,000,000,000	9,961,089	0.3	英属洋群岛 (0.4%)			
Indonesia Eximbk 3.875% 04/24- RegS	美元 2,800,000	2,795,800	0.1	West China Cement 6.5% 11/9/19-RegS	美元 12,700,000	13,192,019	0.4
Indonesia Govt NoFR53 8.25% 15/7/21	印尼盾 441,800,000,000	35,442,813	1.2	韩国 (4.4%)			
Indonesia Govt NoFR54 9.5% 15/07/31	印尼盾 87,500,000,000	7,753,192	0.2	Busan Bank 3.625% 25/07/26-RegS	美元 25,700,000	24,805,551	0.8
Indonesia Govt NoFR69 7.875%15/4/19	印尼盾 484,900,000,000	38,624,832	1.3	Hyundai Cap 3% 06/03/22-RegS	美元 9,300,000	9,300,806	0.3
Indonesia Govt NoFR71 9% 15/03/29	印尼盾 219,000,000,000	18,598,402	0.6	KEB Hana Bank 4.25% 10/24-RegS	美元 7,500,000	7,849,000	0.3
Indonesia Govt NoFR73 8.75% 15/5/31	印尼盾 200,000,000,000	17,180,812	0.6	KEB Hana Bank 4.375% 30/09/24- RegS	美元 7,400,000	7,646,369	0.3
				Korea Land No42 3.5% 27/08/20	韩元 5,000,000,000	5,317,625	0.2
				Korea Try No2106 1LB 1.5% 10/06/21	韩元 6,850,000,000	6,937,329	0.2
				Korea Try No2306 1LB 1.125% 10/6/23	韩元 7,000,000,000	6,667,908	0.2

投资组合 (续)

截至二零一七年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比
韩国 (续)				Islamic Rep Pakistan 8.25% 9/25-RegS 美元 5,000,000 5,583,542 0.2			
Shinhan Bank 3.875% 24/03/26-RegS	美元 16,000,000	16,007,538	0.5	Islamic Rep Pakistan 6.75% 12/19-RegS 美元 3,000,000 3,198,188 0.1			
Woori Bank 4.75% 30/04/24-RegS	美元 15,800,000	16,680,938	0.5	菲律宾 (0.9%)			
Woori Bank 5% 10/06/45-RegS	美元 13,000,000	13,441,422	0.4	Philippine Govt No1060 3.625% 09/25 比索 400,000,000 7,413,470 0.2			
Woori Bank VRN 4.5% Perp-RegS	美元 19,300,000	19,095,517	0.6	Philippine Govt No5-73 3.375% 08/20 比索 400,000,000 7,793,825 0.3			
Woori Bank VRN 6.208% 02/05/37- RegS	美元 1,500,000	1,540,615	0.1	Philippines Rep of 3.9% 26/11/22 比索 134,000,000 2,634,722 0.1			
马来西亚 (3.4%)				Philippines Rep of 6.25% 14/01/36 比索 467,000,000 10,405,436 0.3			
Cagamas Bhd 4.1% 18/11/20	林吉特 15,000,000	3,421,349	0.1	俄罗斯 (0.6%)			
Cagamas Bhd NoP8 6.35% 08/08/23	林吉特 55,000,000	13,953,838	0.4	Russian Feder 4.875% 16/09/23-RegS 美元 16,000,000 17,207,467 0.6			
Cagamas Global 3.7% 22/09/17-RegS	人民币 54,400,000	7,855,450	0.3	新加坡 (7.0%)			
Danainfra Nasional 4.41% 24/07/24	林吉特 15,000,000	3,436,205	0.1	Alam Synergy 6.625% 24/04/22-RegS 美元 9,600,000 9,978,013 0.3			
Malayan Banking VRN 3.905 29/10/26	美元 36,000,000	36,952,064	1.2	BOC Aviation 3% 30/03/20-RegS 美元 10,700,000 10,759,563 0.3			
Malaysia Govt Inv No0613 3.716% 3/21	林吉特 42,000,000	9,426,002	0.3	BOC Aviation 3.875% 27/04/26-RegS 美元 29,200,000 29,606,874 1.0			
Malaysian Govt No0315 3.659% 10/20	林吉特 70,000,000	16,029,181	0.5	BOC Aviation 4.2% 05/11/18-RegS 人民币 44,000,000 6,461,697 0.2			
Putrajaya Hldgs 4.55% 19/09/23	林吉特 20,000,000	4,565,422	0.1	DBS Group Hldgs VRN 3.6% Perp 美元 16,400,000 16,190,900 0.5			
RHB Bank 2.503% 06/10/21-RegS	美元 8,100,000	7,979,528	0.3	Housing & Dev 3.008% 26/03/21- RegS 新加坡元 5,000,000 3,699,780 0.1			
Telekom Malaysia 4.82% 21/03/24	林吉特 10,000,000	2,324,534	0.1	Housing & Dev 3.1% 24/07/24-RegS 新加坡元 4,000,000 3,020,733 0.1			
荷兰 (2.2%)				OCBC 4.25% 19/06/24-RegS 美元 1,600,000 1,670,736 0.1			
Bharti Airtel 5.125% 11/03/23-RegS	美元 24,000,000	25,293,350	0.8	OCBC VRN 4% 15/10/24-RegS 美元 17,400,000 18,170,047 0.6			
Indo Energy Fin II 6.375% 1/23-RegS	美元 6,000,000	5,790,850	0.2	Olam Intl 4.5% 12/04/21-RegS 美元 15,800,000 16,345,890 0.5			
Listrindo Capital 4.95% 9/26-RegS	美元 7,400,000	7,251,297	0.3	Public Utilities Board 3.52% 10/20 新加坡元 10,000,000 7,681,964 0.2			
Royal Capital VRN 5.5% Perp-RegS	美元 6,000,000	6,322,910	0.2	RH Intl Singapore 3.5% 2/5/19-RegS 美元 5,000,000 5,177,417 0.2			
Samvardhana Mothers 4.875% 12/21-RegS	美元 21,200,000	22,199,668	0.7	Theta Cap 7% 11/04/22-RegS 美元 31,010,000 33,610,189 1.1			
新西兰 (1.4%)				United Over Bk 3.5% 9/26-RegS 美元 32,400,000 32,667,480 1.1			
New Zealand Govt 2.75% 15/4/37-RegS	纽元 14,600,000	8,813,425	0.3	United Over Bk VRN 2.88% 08/03/27 美元 12,200,000 11,911,104 0.4			
New Zealand Govt No319 5% 15/03/19	纽元 45,600,000	33,681,212	1.1	United Over Bk VRN 3.75% 09/24-RegS 美元 8,000,000 8,168,433 0.3			
巴基斯坦 (0.5%)				斯里兰卡 (0.9%)			
Islamic Rep Pakistan 7.25% 4/19-RegS	美元 5,000,000	5,465,660	0.2	Rep of Sri Lanka 5.75% 18/01/22- RegS 美元 20,400,000 21,253,117 0.7			

投资组合 (续)

(续)

截至二零一七年三月三十一日 (未经审计)

	单位数目	占资产		单位数目	占资产		
		公允价值 美元	净值 百分比		公允价值 美元	净值 百分比	
斯里兰卡 (续)							
Rep of Sri Lanka 6.125% 3/6/25-RegS	美元 6,500,000	6,654,937	0.2	美元 5,000,000	5,451,056	0.2	
国际 (0.3%)							
Asian Dev Bank 3.25% 20/07/17	纽元 12,000,000	8,466,641	0.3	King Power Cap 5.625% 03/11/24-RegS	美元 14,400,000	16,325,010	0.5
泰国 (1.2%)				Minmetals Bounteous 3.46%07/21-RegS	美元 17,800,000	17,855,934	0.6
Krung Thai Bk VRN 5.2% 12/24-RegS	美元 26,000,000	27,348,533	0.9	NWD (MTN) 5.25% 26/02/21-RegS	美元 16,725,000	17,929,200	0.6
Thailand Govt IL 1.2% 14/07/21-RegS	泰铢 346,000,000	10,705,648	0.3	NWD Fin (BVI) 5.75% Perp-RegS	美元 13,300,000	13,529,037	0.4
美国 (0.6%)				Proven Honour Cap 4.125% 05/26-RegS	美元 28,000,000	28,647,617	0.9
China Merchant 2.375% 14/05/18-RegS	美元 15,000,000	15,141,063	0.5	Proven Honour Cap 4.125% 19/05/25	美元 12,400,000	12,747,071	0.4
Reliance Hldgs USA 5.4% 02/22-RegS	美元 3,000,000	3,293,100	0.1	RKI Overseas Fin 4.7% 06/09/21-RegS	美元 15,500,000	15,495,264	0.5
维京群岛 (15.5%)				RKI Overseas Fin 5% 09/08/19-RegS	美元 31,900,000	32,806,314	1.1
Beijing Cap Polar 2.875% 04/18-RegS	美元 17,000,000	17,252,875	0.6	SDSC Intl Finance 3.625% 11/19-RegS	美元 12,600,000	13,018,915	0.4
Bluestar Fin Hldgs 3.125% 9/19-RegS	美元 11,700,000	11,744,736	0.4	Sino-Ocean Land 4.45% 04/02/20-RegS	美元 10,000,000	10,340,694	0.3
CCCI Treasure VRN 3.5% Perp-RegS	美元 11,900,000	12,182,658	0.4	Sino-Ocean Land 6% 30/07/24-RegS	美元 800,000	878,907	0.0
Central Plaza VRN 7.125% Perp-RegS	美元 22,700,000	24,841,745	0.8	Studio City Fin 8.5% 01/12/20-RegS	美元 10,000,000	10,823,833	0.4
Central Plaza VRN 8.375% Perp-RegS	美元 3,400,000	3,699,129	0.1	Value Success Intl 4.75% 11/18-RegS	人民币 1,000,000	147,959	0.0
Chalco HK Inv VRN 4.25% Perp-RegS	美元 5,800,000	5,903,635	0.2	Yunnan Energy Invest 5.5%10/17-RegS	人民币 30,000,000	4,426,544	0.1
Chalco HK Inv VRN 6.25% Perp-RegS	美元 16,100,000	16,584,811	0.5			2,614,932,763	85.2
Chinalco Capital 4% 25/8/21-RegS	美元 8,500,000	8,511,144	0.3			-----	-----
Dianjian Haixing VRN 4.05% Perp-RegS	美元 17,100,000	17,800,459	0.6	(III) 衍生性产品 (-0.4%)			
Fortune Star 5.25% 23/03/22-RegS	美元 8,900,000	9,070,101	0.3	远期外汇合约 (-0.4%)		(11,355,470)	(0.4)
Franshion Brill 5.375% 10/18-RegS	美元 400,000	425,214	0.0	期货 (-0.0%)			
Franshion Brill 5.75% 19/03/19-RegS	美元 23,000,000	24,241,457	0.8	US 10Yr Note (CBT) Fut 06/17	(1,879)	(807,382)	(0.0)
Greenland Glb Inv 3.5% 6/09/19-RegS	美元 24,100,000	23,863,284	0.8	US 5Yr Note (CBT) Fut 06/17	(1,000)	(203,125)	(0.0)
HKT Capital No2 3.625% 2/04/25-RegS	美元 10,997,000	11,195,221	0.4			(12,365,977)	(0.4)
HKT Capital No4 3% 14/07/26-RegS	美元 47,800,000	45,237,919	1.5	总上市投资		2,903,229,558	94.6
HLP Finance 4.45% 16/04/21-RegS	美元 11,000,000	11,728,964	0.4	其他净资产		165,360,835	5.4
Huarong Fin II VRN 2.875% Perp-RegS	美元 10,600,000	10,127,108	0.3				
Huarong Finance II 2.056% 2019-RegS	美元 20,600,000	20,666,750	0.7	截至二零一七年三月三十一日可赎回份额持有人应占净资产		3,068,590,393	100.0
				总投资, 按成本		2,891,505,047	

投资组合持有变动表

截至二零一七年三月三十一日止期间 (未经审计)

	持有占资产净值 百分比	
	二零一七年 三月三十一日	二零一六年 九月三十日
上市投资		
可换股		
日本	2.4	2.3
中国	2.3	2.1
香港	2.1	1.8
新加坡	1.2	1.0
马来西亚	0.7	0.5
百慕大	0.5	-
台湾	0.4	0.2
菲律宾	0.1	-
泰国	0.1	-
债务证券		
维京群岛	15.5	15.3
印度尼西亚	12.8	11.5
印度	11.3	10.7
开曼群岛	8.0	8.4
新加坡	7.0	6.5
香港	6.7	5.5
中国	5.1	5.2
韩国	4.4	3.7
马来西亚	3.4	6.3
荷兰	2.2	1.7
澳大利亚	2.0	2.7
新西兰	1.4	2.3
泰国	1.2	2.0
菲律宾	0.9	0.8
斯里兰卡	0.9	1.3
美国	0.6	0.7
俄罗斯	0.6	0.4
巴基斯坦	0.5	0.1
英属泽西岛	0.4	0.3
国际	0.3	0.2
百慕大	-	0.3
蒙古	-	0.0
集合投资计划		
香港	-	0.9
跨国性	-	0.9
衍生性产品		
远期外汇合约	(0.4)	0.1
期货	(0.0)	(0.0)
总上市投资	<u>94.6</u>	<u>95.7</u>
其他净资产	<u>5.4</u>	<u>4.3</u>
可赎回份额持有人应占净资产	<u><u>100.0</u></u>	<u><u>100.0</u></u>

财务状况表

截至二零一七年三月三十一日 (未经审计)

	二零一七年 三月三十一日 美元	二零一六年 九月三十日 美元
资产		
银行现金	28,340,133	186,118,724
短期存款	149,042,821	-
应收经纪款项	-	1,828,616
分配应收款项	23,054,454	50,806,997
保证金	4,158,342	6,349,757
衍生性产品	4,560,813	15,213,340
投资	2,915,595,535	3,754,953,195
利息和其他应收款项	6,655	16,418
总资产	<u>3,124,758,753</u>	<u>4,015,287,047</u>
负债		
应付经纪款项	2,795,744	33,664,838
赎回应付款项	22,423,680	26,534,648
应付收益分配 [附注 5]	9,337,677	11,599,586
衍生性产品	16,926,790	12,840,112
其他应付款项	4,684,469	5,975,676
负债 (不包括可赎回 份额持有人应占净 资产)	<u>56,168,360</u>	<u>90,614,860</u>
可赎回份额持有人应 占净资产 [附注 3]	<u>3,068,590,393</u>	<u>3,924,672,187</u>

综合收益表

截至二零一七年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零一六年 十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元	二零一五年 十月一日至 二零一六年 三月三十一日 美元
收入		
投资及衍生性产品净 (亏损) / 收益[附注 4]	(22,596,845)	114,114,865
存款利息	536,063	272,219
汇兑净 (亏损) / 收益	(1,487,625)	2,614,134
其他收入	60,246	117,049
	<u>(23,488,161)</u>	<u>117,118,267</u>
支出		
管理费用	17,121,448	10,937,459
受托人费用	438,221	282,257
代管费用及银行费用	281,001	176,086
基金注册登记机构费用	250,373	181,645
法律及专业费用	135,140	91,676
交易成本	106,649	139,137
印刷及出版支出	17,758	4,884
核数师酬金	14,725	7,118
估值费用	8,610	8,540
其他经营费用	9,464	4,033
	<u>18,383,389</u>	<u>11,832,835</u>
净经营 (亏损) / 利润	<u>(41,871,550)</u>	<u>105,285,432</u>
财务成本		
收益分配[附注 5]	(66,241,954)	(68,466,241)
已付利息	-	(12)
	<u>(66,241,954)</u>	<u>(68,466,253)</u>
除税前 (亏损) / 利润	<u>(108,113,504)</u>	<u>36,819,179</u>
税项	(2,698,533)	(1,885,317)
可赎回份额持有人应占净资产 及总综合收益之 (减少) / 增加	<u>(110,812,037)</u>	<u>34,933,862</u>

可赎回份额持有人应占净资产变动表
截至二零一七年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零一六年 十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元	二零一五年 十月一日至 二零一六年 三月三十一日 美元
期初可赎回份额持有人应占净资产	3,924,672,187	2,229,115,400
分配可赎回份额	865,788,086	891,886,975
赎回可赎回份额	(1,611,057,843)	(929,014,792)
净赎回	(745,269,757)	(37,127,817)
	3,179,402,430	2,191,987,583
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之(减少)/增加	(110,812,037)	34,933,862
期末可赎回份额持有人应占净资产	3,068,590,393	2,226,921,445

现金流量表
截至二零一七年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零一六年 十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元	二零一五年 十月一日至 二零一六年 三月三十一日 美元
经营业务		
购入投资及衍生性产品	(276,974,726)	(225,221,908)
出售投资及衍生性产品所得款项	1,079,434,268	392,765,366
保证金之减少/(增加)	2,191,415	(1,953,776)
已收利息	531,125	271,576
已付交易费用	(108,932)	(140,022)
已付基金注册登记机构费用	(305,993)	(189,125)
已付受托人费用	(452,158)	(284,244)
已付税项	(3,253,097)	(1,761,068)
已付管理费用	(17,683,869)	(10,982,292)
其他	(1,505,137)	(1,120,582)
经营业务所产生之现金净额	781,872,896	151,383,925
融资活动		
已付利息	-	(12)
分配可赎回份额所得款项	893,540,629	862,743,496
赎回可赎回份额付款	(1,615,168,811)	(925,903,598)
已付收益分配	(68,503,863)	(71,212,665)
融资活动所运用之现金净额	(790,132,045)	(134,372,779)
现金及现金等价物之(减少)/增加	(8,259,149)	17,011,146
期初现金及现金等价物	186,118,724	258,463,022
现金及现金等价物之汇兑(亏损)/收益	(476,621)	3,677,718
期末现金及现金等价物	177,382,954	279,151,886
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	28,340,133	279,151,886
短期存款	149,042,821	-
	177,382,954	279,151,886

财务报表之附注

1 本基金

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

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主动管理组合，致力提供具竞争力的总回报（包括资本增长及定息收益）。

根据二零一二年二月二十七日的增补信托契约，经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) 中期财务报表之财务政策

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二零一六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参与者出售一项资产而应收取或转让一项负债而应支付的价格。在活跃市场中买卖的金融资产和负债的公允价值，按最后成交价之公允价值计算。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行政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，则以最后成交价计算。

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日入账。

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）

二零一七年三月三十一日

	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:	25,177,403.329	15,734,143.831	560,294.173	422,638,627.403	8,732,957.345
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净资产	228,465,077	143,390,123	5,334,436	4,069,226,784	78,692,158
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.07	9.11	9.52	9.63	9.01

	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 人民币对冲份额 (累计) 份额
已发行份额数目:	1,441,178.282	381,873,463.720	4,288,572.232	62,838,342.936	225,086,051.840
	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	16,796,861	3,554,445,979	50,853,261	694,553,099	2,492,096,473
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	11.65	9.31	11.86	11.05	11.07
	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:	61,973,652.430	44,141,524.470	1,547,309.280		
	人民币	美元	美元		
可赎回份额持有人应占净资产	622,502,221	467,583,045	15,585,481		
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	10.04	10.59	10.07		
<u>二零一六年九月三十日</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:	34,628,581.509	19,228,840.760	673,223.404	481,081,632.716	10,074,754.563
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净资产	321,280,527	179,196,989	6,555,386	4,722,528,266	92,826,121
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.28	9.32	9.74	9.82	9.21

	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 人民币对冲份额 (累计) 份额
已发行份额数目:	1,842,512.706	539,722,511.305	2,234,241.020	81,430,764.575	345,986,634.110
	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	21,105,857	5,166,107,748	26,539,869	919,519,116	3,763,109,762
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	11.45	9.57	11.88	11.29	10.88
	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:	77,499,861.830	40,714,981.090	1,788,057.380		
	人民币	美元	美元		
可赎回份额持有人应占净资产	799,689,319	432,075,847	18,403,254		
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	10.32	10.61	10.29		

4 投资及衍生性产品净(亏损)/收益

	二零一六年 十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元	二零一五年 十月一日至 二零一六年 三月三十一日 美元
投资及衍生性产品价值的未实现损益的变化	(87,035,138)	83,111,509
投资及衍生性产品的销售的实现收益	64,438,293	31,003,356
	<u>(22,596,845)</u>	<u>114,114,865</u>

5 收益分配

基金经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。

	二零一六年 十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元	二零一五年 十月一日至 二零一六年 三月三十一日 美元
净经营（亏损）/ 利润	(41,871,550)	105,285,432
调整：		
投资及衍生性产品净亏损 /（收益）	22,596,845	(114,114,865)
利息收入包括于投资及衍生性产品净（亏损）/ 收益（票面利率）	69,576,613	47,765,348
汇兑净亏损 /（收益）	1,487,625	(2,614,134)
交易成本	106,649	139,137
已付利息	-	(12)
税项	(2,698,533)	(1,885,317)
资本利得税	654,516	462,368
可收益分配金额	49,852,165	35,037,957

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零一六年	二零一五年
					十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元	十月一日至 二零一六年 三月三十一日 美元
澳元对冲类别（每月派息）	2016 年 10 月 31 日	2016 年 11 月 8 日	澳元 0.0361	34,679,333.896	(952,651)	
加元对冲类别（每月派息）	2016 年 10 月 31 日	2016 年 11 月 8 日	加元 0.0272	19,848,410.109	(402,818)	
英镑对冲类别（每月派息）	2016 年 10 月 31 日	2016 年 11 月 8 日	英镑 0.0244	741,757.607	(22,097)	
港元类别（每月派息）	2016 年 10 月 31 日	2016 年 11 月 8 日	港元 0.0304	507,073,157.794	(1,987,791)	
纽元对冲类别（每月派息）	2016 年 10 月 31 日	2016 年 11 月 8 日	纽元 0.0408	10,631,741.006	(310,323)	
人民币对冲类别（每月派息）	2016 年 10 月 31 日	2016 年 11 月 8 日	人民币 0.0550	513,027,950.938	(4,160,535)	
美元类别（每月派息）	2016 年 10 月 31 日	2016 年 11 月 8 日	美元 0.0350	82,438,595.966	(2,885,351)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2016 年 10 月 31 日	2016 年 11 月 8 日	人民币 0.0592	74,055,723.070	(646,436)	
PRC 美元份额（每月派息）	2016 年 10 月 31 日	2016 年 11 月 8 日	美元 0.0319	1,787,474.040	(57,020)	
澳元对冲类别（每月派息）	2016 年 11 月 30 日	2016 年 12 月 8 日	澳元 0.0364	34,175,387.881	(919,118)	
加元对冲类别（每月派息）	2016 年 11 月 30 日	2016 年 12 月 8 日	加元 0.0271	20,666,602.688	(416,529)	
英镑对冲类别（每月派息）	2016 年 11 月 30 日	2016 年 12 月 8 日	英镑 0.0254	773,257.002	(24,539)	
港元类别（每月派息）	2016 年 11 月 30 日	2016 年 12 月 8 日	港元 0.0304	506,988,401.014	(1,986,998)	
纽元对冲类别（每月派息）	2016 年 11 月 30 日	2016 年 12 月 8 日	纽元 0.0394	10,703,770.321	(298,921)	
人民币对冲类别（每月派息）	2016 年 11 月 30 日	2016 年 12 月 8 日	人民币 0.0534	472,564,966.158	(3,652,504)	
美元类别（每月派息）	2016 年 11 月 30 日	2016 年 12 月 8 日	美元 0.0350	78,682,899.551	(2,753,901)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2016 年 11 月 30 日	2016 年 12 月 8 日	人民币 0.0575	69,354,053.340	(577,202)	
PRC 美元份额（每月派息）	2016 年 11 月 30 日	2016 年 12 月 8 日	美元 0.0319	1,746,695.720	(55,720)	
澳元对冲类别（每月派息）	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	澳元 0.0361	32,154,066.482	(840,508)	
加元对冲类别（每月派息）	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	加元 0.0251	18,554,287.255	(347,275)	
英镑对冲类别（每月派息）	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	英镑 0.0206	526,477.901	(13,401)	
港元类别（每月派息）	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	港元 0.0304	472,723,007.671	(1,853,541)	
纽元对冲类别（每月派息）	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	纽元 0.0382	9,745,136.069	(259,580)	
人民币对冲类别（每月派息）	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	人民币 0.0735	446,297,794.670	(4,708,594)	
美元类别（每月派息）	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	美元 0.0350	71,503,414.442	(2,502,619)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	人民币 0.0792	64,703,249.100	(735,581)	
PRC 美元份额（每月派息）	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	美元 0.0319	1,668,033.960	(53,210)	
澳元对冲类别（每月派息）	2017 年 1 月 27 日	2017 年 2 月 8 日	澳元 0.0382	29,537,381.826	(852,339)	
加元对冲类别（每月派息）	2017 年 1 月 27 日	2017 年 2 月 8 日	加元 0.0272	17,018,014.446	(352,678)	
英镑对冲类别（每月派息）	2017 年 1 月 27 日	2017 年 2 月 8 日	英镑 0.0240	534,681.718	(16,103)	
港元类别（每月派息）	2017 年 1 月 27 日	2017 年 2 月 8 日	港元 0.0326	437,140,971.642	(1,836,786)	
纽元对冲类别（每月派息）	2017 年 1 月 27 日	2017 年 2 月 8 日	纽元 0.0404	9,182,007.752	(269,813)	
人民币对冲类别（每月派息）	2017 年 1 月 27 日	2017 年 2 月 8 日	人民币 0.1081	401,155,516.254	(6,318,652)	
美元类别（每月派息）	2017 年 1 月 27 日	2017 年 2 月 8 日	美元 0.0375	66,880,409.659	(2,508,015)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2017 年 1 月 26 日	2017 年 2 月 8 日	人民币 0.1166	62,237,653.500	(1,059,790)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零一六年	二零一五年
					十月一日至 二零一七年 三月三十一日	十月一日至 二零一六年 三月三十一日
					美元	美元
PRC 美元份额 (每月派息)	2017 年 1 月 26 日	2017 年 2 月 8 日	美元 0.0342	1,629,220.700	(55,719)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2017 年 2 月 28 日	2017 年 3 月 8 日	澳元 0.0370	26,349,379.545	(749,573)	
加元对冲类别 (每月派息)	2017 年 2 月 28 日	2017 年 3 月 8 日	加元 0.0287	15,621,219.647	(338,502)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2017 年 2 月 28 日	2017 年 3 月 8 日	英镑 0.0273	555,502.482	(18,872)	
港元类别 (每月派息)	2017 年 2 月 28 日	2017 年 3 月 8 日	港元 0.0226	422,256,979.150	(1,773,355)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2017 年 2 月 28 日	2017 年 3 月 8 日	纽元 0.0386	8,337,798.789	(232,770)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2017 年 2 月 28 日	2017 年 3 月 8 日	人民币 0.0683	389,729,547.120	(3,887,875)	
美元类别 (每月派息)	2017 年 2 月 28 日	2017 年 3 月 8 日	美元 0.0375	66,495,085.473	(2,493,566)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2017 年 2 月 28 日	2017 年 3 月 8 日	人民币 0.0737	61,450,297.970	(661,484)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2017 年 2 月 28 日	2017 年 3 月 8 日	美元 0.0342	1,567,907.460	(53,622)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2017 年 3 月 31 日	2017 年 4 月 11 日	澳元 0.0368	25,152,595.535	(706,106)	
加元对冲类别 (每月派息)	2017 年 3 月 31 日	2017 年 4 月 11 日	加元 0.0276	15,726,224.242	(325,456)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2017 年 3 月 31 日	2017 年 4 月 11 日	英镑 0.0244	560,294.173	(17,095)	
港元类别 (每月派息)	2017 年 3 月 31 日	2017 年 4 月 11 日	港元 0.0326	419,807,674.434	(1,761,015)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2017 年 3 月 31 日	2017 年 4 月 11 日	纽元 0.0389	8,711,609.625	(236,895)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2017 年 3 月 31 日	2017 年 4 月 11 日	人民币 0.0594	381,557,866.874	(3,298,147)	
美元类别 (每月派息)	2017 年 3 月 31 日	2017 年 4 月 11 日	美元 0.0375	62,996,029.283	(2,362,351)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2017 年 3 月 31 日	2017 年 4 月 11 日	人民币 0.0641	61,932,210.380	(577,694)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2017 年 3 月 31 日	2017 年 4 月 11 日	美元 0.0342	1,547,309.280	(52,918)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2015 年 10 月 30 日	2015 年 11 月 9 日	澳元 0.0486	26,840,078.252	(930,644)	
加元对冲类别 (每月派息)	2015 年 10 月 30 日	2015 年 11 月 9 日	加元 0.0350	15,723,534.392	(420,624)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2015 年 10 月 30 日	2015 年 11 月 9 日	英镑 0.0361	95,671.350	(5,334)	
港元类别 (每月派息)	2015 年 10 月 30 日	2015 年 11 月 9 日	港元 0.0347	269,359,708.456	(1,206,021)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2015 年 10 月 30 日	2015 年 11 月 9 日	纽元 0.0541	11,305,834.876	(413,839)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2015 年 10 月 30 日	2015 年 11 月 9 日	人民币 0.0650	641,902,557.016	(6,598,975)	
美元类别 (每月派息)	2015 年 10 月 30 日	2015 年 11 月 9 日	美元 0.0400	56,664,884.781	(2,266,595)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2015 年 11 月 30 日	2015 年 12 月 8 日	澳元 0.0483	26,495,033.317	(927,278)	
加元对冲类别 (每月派息)	2015 年 11 月 30 日	2015 年 12 月 8 日	加元 0.0349	15,514,852.048	(406,615)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2015 年 11 月 30 日	2015 年 12 月 8 日	英镑 0.0362	82,708.699	(4,507)	
港元类别 (每月派息)	2015 年 11 月 30 日	2015 年 12 月 8 日	港元 0.0347	273,194,912.785	(1,222,900)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2015 年 11 月 30 日	2015 年 12 月 8 日	纽元 0.0535	10,603,883.081	(373,827)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2015 年 11 月 30 日	2015 年 12 月 8 日	人民币 0.0610	650,362,116.817	(6,174,116)	
美元类别 (每月派息)	2015 年 11 月 30 日	2015 年 12 月 8 日	美元 0.0400	55,318,474.035	(2,212,739)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2015 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 11 日	澳元 0.0479	26,336,317.872	(917,811)	
加元对冲类别 (每月派息)	2015 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 11 日	加元 0.0331	15,023,545.331	(357,987)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2015 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 11 日	英镑 0.0330	98,296.913	(4,781)	
港元类别 (每月派息)	2015 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 11 日	港元 0.0347	271,240,027.831	(1,214,432)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2015 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 11 日	纽元 0.0520	10,104,262.131	(359,704)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2015 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 11 日	人民币 0.0730	620,930,012.709	(6,900,325)	
美元类别 (每月派息)	2015 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 11 日	美元 0.0400	54,825,057.972	(2,193,002)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 11 日	澳元 0.0469	25,363,107.229	(841,414)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 11 日	加元 0.0324	15,194,708.421	(349,837)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 11 日	英镑 0.0337	337,458.127	(16,132)	
港元类别 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 11 日	港元 0.0347	287,344,259.506	(1,281,130)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 11 日	纽元 0.0503	9,302,888.025	(302,754)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 11 日	人民币 0.0986	517,806,528.297	(7,741,287)	
美元类别 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 11 日	美元 0.0400	56,417,500.315	(2,256,700)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 15 日	人民币 0.1063	1,897,453.890	(30,583)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 15 日	美元 0.0365	200.000	(7)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	澳元 0.0460	25,613,412.880	(841,542)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	加元 0.0330	14,946,499.642	(364,118)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	英镑 0.0343	352,555.659	(16,852)	
港元类别 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	港元 0.0347	288,418,151.953	(1,287,026)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	纽元 0.0494	8,762,445.980	(285,410)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	人民币 0.0759	488,497,028.163	(5,659,044)	
美元类别 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	美元 0.0400	52,444,866.385	(2,097,795)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	人民币 0.0818	8,493,681.230	(106,045)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	美元 0.0365	200.730	(7)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016 年 3 月 31 日	2016 年 4 月 11 日	澳元 0.0464	25,729,574.016	(918,371)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016 年 3 月 31 日	2016 年 4 月 11 日	加元 0.0330	14,655,199.579	(373,900)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2016 年 3 月 31 日	2016 年 4 月 11 日	英镑 0.0333	146,123.807	(6,994)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零一六年	二零一五年
					十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元	十月一日至 二零一六年 三月三十一日 美元
港元类别 (每月派息)	2016年3月31日	2016年4月11日	港元 0.0347	297,837,091.869		(1,332,416)
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年3月31日	2016年4月11日	纽元 0.0494	8,941,434.726		(306,677)
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年3月31日	2016年4月11日	人民币 0.0574	484,042,762.396		(4,302,336)
美元类别 (每月派息)	2016年3月31日	2016年4月11日	美元 0.0400	58,427,124.078		(2,337,085)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2016年3月31日	2016年4月11日	人民币 0.0618	31,214,890.980		(298,716)
PRC 美元份额 (每月派息)	2016年3月31日	2016年4月11日	美元 0.0365	201.460		(7)
可赎回份额持有人之总收益分配					<u>(66,241,954)</u>	<u>(68,466,241)</u>

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。



0517

