

年度报告 - 2017年9月30日 (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 - 未经审计	1 - 6
投资组合持有变动表 - 未经审计	7
财务状况报表	8
综合收益表	8
可赎回份额持有人应占净资产变动表	9
现金流量表	9
财务报表之附注	10 - 47
独立核数师报告	48 - 49
管理人及受托人的责任声明	50
受托人对份额持有人的报告	50
业绩纪录 - 未经审计	50 - 51
经营与管理	52

投资组合

(续)

截至二零一七年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资 产净 值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资 产净 值百 分比
上市投资 (94.7%)				台湾 (1.1%)			
(I) 可换股 (10.3%)				Advanced Semi Eng CB 0%27/3/18- RegS	美元 25,000,000	25,500,000	0.7
百慕大 (0.5%)				United Microelec CB 0%18/05/20-RegS	美元 15,800,000	17,449,678	0.4
Haitong Intl Secs CB 0%10/21-RegS	港元 134,000,000	17,757,784	0.5	维京群岛 (1.1%)			
中国 (2.4%)				Shanghai Port EB(PSBOC) 0%8/21-RegS	美元 19,600,000	19,689,768	0.5
Asia View EB (Yuexiu) 1.5%8/19-RegS	美元 4,000,000	4,505,833	0.1	Shanghai Port EB(PSBOC) 0%8/22-RegS	美元 22,800,000	22,826,448	0.6
China Railway Con CB 1.5%12/21-RegS	人民币 175,000,000	25,745,945	0.7			390,047,322	10.3
CRRC Group CB 0% 05/02/21-RegS	美元 20,000,000	20,655,000	0.6			-----	-----
Kunlun Energy CB 1.625% 07/19-RegS	人民币 118,000,000	20,321,181	0.5	(II) 债务证券 (84.9%)			
Strategic Intl EB(35Bio)0%7/22- RegS	欧元 13,900,000	18,143,540	0.5	澳大利亚 (1.6%)			
香港 (1.8%)				CNOOC Fin (2015) 2.625% 05/05/20	美元 22,100,000	22,463,453	0.6
Bagan Capital CB 0% 23/09/21	美元 5,800,000	6,259,650	0.2	ICBC Ltd Sydney 3.65% 27/10/18- RegS	人民币 20,000,000	3,026,004	0.1
Baosteel Hong Kong CB 0% 12/18-RegS	美元 14,500,000	15,029,250	0.4	NSW Treasury 4% 20/04/23	澳元 21,900,000	18,684,559	0.5
China Overs Fin V CB 0% 5/1/23-RegS	美元 34,000,000	36,116,500	0.9	Queensland No24 5.75% 22/7/24- RegS	澳元 18,000,000	16,694,125	0.4
Cosmos Boom Inv CB 0.5%06/20-RegS	美元 9,800,000	9,723,865	0.3	开曼群岛 (10.0%)			
日本 (1.3%)				Agile Group 9% 21/05/20-RegS	美元 12,280,000	13,643,080	0.3
Kansai Paint CB 0% 17/06/19-RegS	日元 1,490,000,000	14,980,744	0.4	CAR Inc 6% 11/02/21-RegS	美元 7,900,000	8,252,208	0.2
Kyushu Electric Power CB 0% 31/3/20	日元 740,000,000	6,753,120	0.2	CAR Inc 6.125% 04/02/20-RegS	美元 14,700,000	15,334,274	0.4
Takashimaya Co CB 0% 11/12/20	日元 750,000,000	6,926,798	0.2	CDBL Funding Two 3% 01/08/22-RegS	美元 25,200,000	25,172,280	0.6
Tohoku Elec Power CB 0% 03/12/20	日元 2,000,000,000	17,814,063	0.4	China Overs Fin V 3.95% 15/11/22	美元 3,500,000	3,701,153	0.1
Yamaguchi CB FRN 26/03/20-RegS	美元 4,000,000	4,184,941	0.1	China Overs Fin VI 5.95% 5/24-RegS	美元 12,000,000	14,080,617	0.4
马来西亚 (1.0%)				CIFI Hldgs Group 7.75% 05/06/20	美元 6,000,000	6,520,933	0.2
Cahaya Capit EB(Tenaga) 0%9/21-RegS	美元 37,900,000	37,388,350	1.0	CK Hutchison Cap VRN 4% Perp-RegS	美元 21,200,000	21,924,922	0.6
菲律宾 (0.2%)				Country Garden 4.75% 28/09/23-RegS	美元 18,500,000	18,759,848	0.5
AYC Fin EB (Ayala) 0.5% 2/5/19-RegS	美元 6,000,000	6,586,137	0.2	Country Garden 7.5% 10/01/23-RegS	美元 400,000	425,250	0.0
新加坡 (0.9%)				ENN Energy Hldgs 3.25% 07/22-RegS	美元 18,400,000	18,589,494	0.5
CapitaLand Ltd 1.95% 17/10/23-RegS	新加坡元 4,000,000	3,067,630	0.1	Formosa Group 3.375% 22/04/25- RegS	美元 14,550,000	14,848,366	0.4
CapitaLand Ltd CB 1.85%19/6/20-RegS	新加坡元 11,750,000	8,603,179	0.2	FWD Ltd 5% 24/09/24-RegS	美元 16,800,000	17,887,333	0.5
CapitaLand Ltd CB 2.8% 8/06/25-RegS	新加坡元 32,250,000	24,017,918	0.6				

投资组合 (续)

截至二零一七年九月三十日 (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)			China Dev Bank No1705 3.88% 4/20-1B				
FWD Ltd VRN 0% Perp-RegS	美元 20,000,000	15,017,000	0.4	人民币 202,700,000	30,780,622	0.8	
Greenland HK Hldgs 3.875%07/19-RegS	美元 29,150,000	28,672,851	0.7	China Govt Bond 3.09% 22/11/18-RegS	人民币 10,000,000	1,516,349	0.0
Greenland HK Hldgs 5.5% 01/18-RegS	人民币 10,000,000	1,520,069	0.0	China Govt Bond 3.16% 27/06/23-RegS	人民币 9,000,000	1,312,432	0.0
HPHT Fin (17) 2.75% 11/09/22-RegS	美元 3,800,000	3,770,086	0.1	China Govt Bond 3.25% 04/07/21-RegS	人民币 124,000,000	18,525,701	0.5
KWG Property 8.25% 05/08/19-RegS	美元 10,500,000	11,064,620	0.3	China Govt Bond 3.36% 21/05/22-RegS	人民币 6,000,000	895,932	0.0
Logan Property Hldgs5.25%02/23 RegS	美元 27,600,000	27,654,280	0.7	China Govt Bond 3.4% 30/11/20-RegS	人民币 50,000,000	7,507,522	0.2
Overseas Chinese VRN4.3% Perp -RegS	美元 19,400,000	19,500,880	0.5	China Govt Bond 3.48% 29/06/27-RegS	人民币 9,500,000	1,371,769	0.0
OVPH Ltd 5.875% Perp-RegS	美元 17,100,000	18,033,589	0.5	China Govt Bond 3.5% 30/12/18	人民币 40,000,000	6,076,487	0.2
Semiconductor Mfg 4.125%10/19-RegS	美元 11,600,000	12,073,135	0.3	China Govt Bond 3.99% 26/06/20-RegS	人民币 70,000,000	10,735,326	0.3
Shimao Property 4.75% 03/07/22-RegS	美元 6,500,000	6,746,097	0.2	China Govt Bond 4.1% 26/06/22-RegS	人民币 50,000,000	7,651,860	0.2
Shimao Property 8.375% 10/2/22-RegS	美元 17,906,000	20,026,332	0.5	China Govt Bond 4.29% 22/05/29-RegS	人民币 5,500,000	851,235	0.0
Sun Hung Kai Prop 4.45% Perp-RegS	美元 15,200,000	15,380,458	0.4	China Govt Bond 4.5% 22/05/34-RegS	人民币 4,500,000	712,686	0.0
Times Property 6.25% 23/01/20-RegS	美元 9,800,000	10,160,694	0.3	China Govt Bond No1716 3.46%7/20-1B	人民币 39,000,000	5,891,810	0.2
Wynn Macau 4.875% 01/10/24-RegS	美元 10,500,000	10,673,141	0.3	China Life Ins VRN 4% 03/07/75-RegS	美元 14,750,000	15,251,172	0.4
Yuzhou Prop 6% 25/01/22-RegS	美元 3,000,000	3,146,850	0.1	China New Town Fin 5.5% 6/5/18-RegS	人民币 51,000,000	7,860,555	0.2
中国 (8.5%)				Franshion Dev 6.75% 15/04/21-RegS	美元 15,000,000	17,198,625	0.5
Bank of China 5% 13/11/24-RegS	美元 21,800,000	23,844,113	0.6	ICBC Dubai 2.5% 07/06/21-RegS	美元 11,800,000	11,756,832	0.3
Bank of China Macau 3.5% 04/27-RegS	美元 11,800,000	12,132,793	0.3	ICBC Macau VRN 3.875% 10/09/24-RegS	美元 12,100,000	12,293,726	0.3
Bank of China NY 3.6% 12/07/18-RegS	人民币 13,000,000	1,956,711	0.1	Lenovo Group 4.95% 10/06/20	人民币 40,000,000	6,160,949	0.2
CCB Life Ins VRN 4.5% 21/4/77-RegS	美元 15,600,000	16,394,820	0.4	Postal Saving Bk VRN 4.5% Perp-RegS	美元 26,500,000	26,433,750	0.7
China Const Bk 3.875% 13/5/25-RegS	美元 28,200,000	29,157,508	0.8	Qianhai 4.55% 10/17-RegS	人民币 25,500,000	3,910,891	0.1
China Const Bk 5G3.25% 22/8/18-RegS	人民币 5,000,000	747,333	0.0	Shanghai HK Intl Inv 3.875%4/20-RegS	美元 4,600,000	4,719,507	0.1
China Const Bk VRN 4.9% 11/24-RegS	人民币 19,400,000	2,996,114	0.1	Tianjin Infra Con 2.75% 06/19-RegS	美元 29,600,000	29,789,358	0.8
China Dev Bank No1507 4.18% 4/18-1B	人民币 18,500,000	2,848,752	0.1				
China Dev Bank No1608 2.72% 3/19-1B	人民币 32,000,000	4,796,760	0.1				

投资组合 (续)

截至二零一七年九月三十日 (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		
香港 (6.4%)			Export-Imp Bk IN NoQ21 9.63% 11/18 印度卢比 250,000,000	4,243,714	0.1		
Bank of East Asia VRN5.625%Perp RegS	美元 7,500,000	7,868,109	0.2	ICICI Bank 4% 24/11/17-RegS	人民币 31,000,000	4,706,753	0.1
Bank of East Asia VRN 4% 11/26-RegS	美元 22,800,000	23,261,117	0.6	ICICI Bank/Dubai 4% 18/03/26-RegS	美元 28,000,000	28,480,324	0.8
Bank of East Asia VRN 4.25% 24-RegS	美元 21,200,000	22,002,744	0.6	India Govt Bond 7.8% 11/04/21	印度卢比 2,800,000,000	46,085,562	1.2
Bank of East Asia VRN 5.5%Perp-RegS	美元 5,000,000	5,225,653	0.1	India Govt Bond 8.19% 16/01/20	印度卢比 220,000,000	3,547,630	0.1
China Const Bk VRN 4.25% 08/24-RegS	美元 13,100,000	13,470,603	0.4	India Govt Bond 8.27% 09/06/20	印度卢比 752,000,000	12,315,657	0.3
China Oil & Gas 4.625% 04/22-RegS	美元 19,400,000	20,243,590	0.5	India Govt Bond 8.4% 28/07/24	印度卢比 1,140,000,000	19,041,141	0.5
Chong Hing Bk VRN 3.876% 07/27-RegS	美元 9,400,000	9,478,944	0.3	JSW Steel 5.25% 13/04/22-RegS	美元 15,200,000	16,011,617	0.4
CITIC Ltd 3.7% 14/06/26-RegS	美元 5,000,000	5,085,986	0.1	NTPC Ltd 4.25% 26/02/26-RegS	美元 12,000,000	12,521,183	0.3
CITIC Ltd VRN 8.625% Perp-RegS	美元 10,600,000	11,621,906	0.3	NTPC Ltd 4.375% 26/11/24-RegS	美元 9,100,000	9,806,988	0.3
CNAC (HK) 3.5% 19/07/22-RegS	美元 17,000,000	17,208,250	0.5	Oil India 5.375% 17/04/24-RegS	美元 2,000,000	2,273,272	0.1
CRCC Yupeng VRN 3.95% Perp-RegS	美元 16,500,000	16,922,785	0.4	Power Finance 9.32% 17/09/19	印度卢比 250,000,000	3,991,842	0.1
Hero Asia Inv 2.875% 03/10/17-RegS	美元 13,100,000	13,286,220	0.4	Power Finance No123A 8.5% 28/11/17	印度卢比 600,000,000	9,863,930	0.3
ICBC Asia VRN 4.25% Perp-RegS	美元 22,000,000	22,067,406	0.6	Reliance Ind 4.125% 28/01/25-RegS	美元 5,000,000	5,254,844	0.1
ICBCIL Finance 3.25% 17/03/20-RegS	美元 16,000,000	16,193,822	0.4	Tata Motors 4.625% 30/04/20-RegS	美元 14,900,000	15,735,880	0.4
ICBCIL Finance 3.625% 19/05/26-RegS	美元 13,000,000	13,148,742	0.4	UPL Corp 3.25% 13/10/21-RegS	美元 22,900,000	23,279,377	0.6
MCC Hldg (HK) 2.95% 31/05/20-RegS	美元 4,700,000	4,750,447	0.1	印度尼西亚 (11.3%)			
MCC Hldg HK Corp 2.95% 05/20-RegS	美元 9,000,000	9,069,330	0.2	APL Realty Hldgs 5.95%02/06/24-RegS	美元 16,800,000	17,067,423	0.4
Weichai Intl HK VRN 3.75% Perp-RegS	美元 11,300,000	11,279,330	0.3	Indonesia Eximbank NoOB 9% 13/03/18	印尼盾 130,000,000,000	9,802,361	0.3
Wing Lung Bank VRN 3.5% 11/22-RegS	美元 1,000,000	1,014,300	0.0	Indonesia Govt 8.375% 09/26	印尼盾 85,000,000,000	7,141,929	0.2
印度 (8.1%)			Indonesia Govt NoFR53 8.25% 15/7/21	印尼盾 441,800,000,000	35,644,670	0.9	
Adani Ports & Sp 4% 30/07/27-RegS	美元 12,100,000	12,182,414	0.3	Indonesia Govt NoFR59 7% 15/05/27	印尼盾 225,000,000,000	17,846,652	0.5
Axis Bank Dubai 2.875% 1/06/21-RegS	美元 10,200,000	10,271,230	0.3	Indonesia Govt NoFR61 7% 15/05/22	印尼盾 409,200,000,000	32,314,320	0.8
Bharat Petroleum 4% 08/05/25-RegS	美元 22,240,000	23,183,841	0.6	Indonesia Govt NoFR69 7.875%15/4/19	印尼盾 484,900,000,000	38,444,326	1.0
Bharti Airtel 4.375% 10/06/25-RegS	美元 15,000,000	15,383,844	0.4	Indonesia Retail 8.5% 15/10/17	印尼盾 304,000,000,000	22,686,043	0.6
Export-Imp Bk IN 9.45% 22/01/19	印度卢比 950,000,000	15,914,026	0.4	Indonesia Retail 9% 15/10/18	印尼盾 100,000,000,000	7,677,223	0.2
Export-Imp Bk IN NoQ17 9.28% 10/18	印度卢比 650,000,000	11,053,623	0.3	Indosat Tbk NoOB 10% 12/12/17	印尼盾 35,000,000,000	2,631,244	0.1
Export-Imp Bk IN NoQ20 9.7%21/11/18	印度卢比 250,000,000	4,255,238	0.1				

投资组合 (续)

截至二零一七年九月三十日 (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
荷兰 (续)				Housing & Dev 3.1% 24/07/24-RegS 新加坡元 4,000,000 3,127,928 0.1			
Greenko Dutch 4.875% 24/07/22-RegS	美元 13,400,000	13,737,987	0.3	OCBC 4.25% 19/06/24-RegS	美元 1,600,000	1,690,867	0.0
Indo Energy Fin II 6.375% 1/23-RegS	美元 6,000,000	6,146,188	0.1	OCBC VRN 4% 15/10/24-RegS	美元 17,400,000	18,148,973	0.5
Listrindo Capital 4.95% 9/26-RegS	美元 7,400,000	7,556,048	0.2	Oil India Intl 4% 21/04/27-RegS	美元 10,000,000	10,282,778	0.3
Minejesa Capital 4.625% 08/30-RegS	美元 10,000,000	10,265,021	0.3	Olam Intl 4.5% 12/04/21-RegS	美元 15,800,000	16,400,005	0.4
Royal Capital VRN 5.5% Perp-RegS	美元 6,000,000	6,478,833	0.2	Parkway Pantai VRN 4.25% Perp-RegS	美元 21,600,000	22,143,360	0.6
Samvardhana Mothers4.875%12/21-R egS	美元 21,200,000	22,534,938	0.6	Public Utilities Board 3.52% 10/20 RH Intl Singapore 3.5% 2/5/19-RegS	新加坡元 10,000,000	7,861,462	0.2
新西兰 (0.7%)				Theta Cap 7% 11/04/22-RegS 美元 31,010,000 33,159,165 0.9			
New Zealand Govt 2.75% 15/4/37-RegS	纽元 8,000,000	5,220,484	0.1	United Over Bk 3.5% 9/26-RegS	美元 32,400,000	32,994,810	0.9
New Zealand Govt No319 5% 15/03/19	纽元 30,600,000	23,144,044	0.6	United Over Bk VRN 3.75% 09/24-RegS	美元 8,000,000	8,160,800	0.2
巴基斯坦 (0.4%)				斯里兰卡 (0.8%)			
Islamic Rep Pakistan 7.25%4/19-RegS	美元 5,000,000	5,407,653	0.1	Rep of Sri Lanka 5.75%18/01/22-Reg S	美元 20,400,000	21,810,858	0.6
Islamic Rep Pakistan 8.25%9/25-RegS	美元 5,000,000	5,963,146	0.2	Rep of Sri Lanka 6.125% 3/6/25-RegS	美元 6,500,000	7,004,247	0.2
Islamic Rep Pakistan6.75%12/19-Re gS	美元 3,000,000	3,208,875	0.1	泰国 (2.3%)			
菲律宾 (1.0%)				Krung Thai Bk VRN 5.2% 12/24-RegS 美元 26,000,000 27,413,678 0.7			
BDO Unibank 2.95% 06/03/23-RegS	美元 11,000,000	10,958,185	0.3	PTTEP Treasury VRN 4.6% Perp-RegS	美元 18,200,000	18,709,701	0.5
Philippine Govt No1060 3.625% 09/25	比索 400,000,000	7,459,283	0.2	Thailand Govt 2.125% 17/12/26	泰铢 717,000,000	21,351,279	0.5
Philippine Govt No5-73 3.375% 08/20	比索 400,000,000	7,829,262	0.2	Thailand Govt 3.85% 12/12/25	泰铢 315,000,000	10,732,619	0.3
Philippines Rep of 3.9% 26/11/22	比索 134,000,000	2,639,543	0.0	Thailand Govt IL 1.2% 14/07/21-RegS	泰铢 346,000,000	10,996,615	0.3
Philippines Rep of 6.25% 14/01/36	比索 467,000,000	10,465,022	0.3	美国 (0.1%)			
俄罗斯 (0.5%)				Reliance Hldgs USA 5.4% 02/22-RegS 美元 3,000,000 3,320,400 0.1			
Russian Feder 4.875% 16/09/23-RegS	美元 16,000,000	17,473,300	0.5	维京群岛 (14.9%)			
新加坡 (6.2%)				Beijing Cap Polar 2.875% 04/18-RegS 美元 17,000,000 17,242,675 0.5			
Alam Synergy 6.625% 24/04/22-RegS	美元 9,600,000	9,805,367	0.2	Beijing Gas SG 2.75% 31/05/22-RegS	美元 12,000,000	11,996,600	0.3
BOC Aviation 3% 30/03/20-RegS	美元 10,700,000	10,987,652	0.3	Bluestar Fin Hldgs 3.125% 9/19-RegS	美元 11,700,000	11,941,159	0.3
BOC Aviation 3.875% 27/04/26-RegS	美元 29,200,000	30,519,151	0.8	CCCI Treasure VRN 3.5% Perp-RegS	美元 11,900,000	12,253,496	0.3
BOC Aviation 4.2% 05/11/18-RegS	人民币 44,000,000	6,741,244	0.2	Central Plaza VRN 7.125% Perp-RegS	美元 12,900,000	13,961,697	0.4
DBS Group Hldgs VRN 3.6% Perp	美元 16,400,000	16,489,380	0.4	Central Plaza VRN 8.375% Perp-RegS	美元 3,400,000	3,617,588	0.1
Housing & Dev 3.008% 26/03/21-RegS	新加坡元 5,000,000	3,836,538	0.1				

投资组合 (续)

截至二零一七年九月三十日 (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
维京群岛 (续)				Sino-Ocean Land 6%			
China Railway XunJie 3.25% 7/26-RegS	美元 10,000,000	9,893,375	0.3	30/07/24-RegS	美元 3,800,000	4,270,883	0.1
China Rein Fin 3.375% 09/03/22-RegS	美元 18,500,000	18,436,406	0.5	Sino-Ocean VRN 4.9% Perp-RegS	美元 12,100,000	12,112,234	0.3
Chinalco Cap Hold 4.25% 04/22-RegS	美元 9,100,000	9,476,184	0.2	Skyland Mining 3.25% 06/07/20-RegS	美元 16,100,000	16,243,670	0.4
Chinalco Capital 4% 25/8/21-RegS	美元 8,500,000	8,639,825	0.2	Studio City Fin 8.5% 01/12/20-RegS	美元 10,000,000	10,620,833	0.3
Dianjian Haixing VRN 4.05%Perp-RegS	美元 17,100,000	17,743,131	0.5	Value Success Intl 4.75% 11/18-RegS	人民币 1,000,000	154,696	0.0
Eastern Creation II 2.75%09/20-RegS	美元 7,000,000	7,027,874	0.2	Wisdom Glory VRN 5.25% Perp-RegS	美元 17,700,000	18,194,715	0.5
Fortune Star 5.25% 23/03/22-RegS	美元 17,300,000	17,237,143	0.4	Yunnan Energy Invest 5.5%10/17-RegS	人民币 30,000,000	4,601,568	0.1
Franshion Brill 5.75% 19/03/19-RegS	美元 8,000,000	8,358,933	0.2			3,235,813,845	84.9
Franshion Brill4% Perp-RegS Re-Tap	美元 11,000,000	11,118,556	0.3			-----	----
Greenland Glb Inv 3.5% 6/09/19-RegS	美元 18,100,000	17,719,548	0.5	(III) 衍生性产品 (-0.5%)			
HKT Capital No2 3.625% 2/04/25-RegS	美元 10,997,000	11,350,821	0.3	远期外汇合约 (-0.6%)		(22,785,845)	(0.6)
HKT Capital No4 3 14/07/26-RegS	美元 47,800,000	46,364,407	1.2	期货 (0.1%)			
Huarong Fin II VRN 2.875% Perp-RegS	美元 10,600,000	10,264,591	0.3	US 10Yr Note (CBT) Fut 12/17	(2,344)	2,984,938	0.1
Huarong Finance II 2.056% 2019-RegS	美元 12,800,000	12,868,018	0.3	US 5Yr Note (CBT) Fut 12/17	(1,000)	781,250	0.0
Huarong Finance II 5.5% 01/25-RegS	美元 5,000,000	5,451,542	0.1			(19,019,657)	(0.5)
King Power Cap 5.625% 03/11/24-RegS	美元 19,400,000	22,299,815	0.6	总上市投资		3,606,841,510	94.7
Minmetals Bounteous 3.46%07/21-RegS	美元 17,800,000	17,938,049	0.5	其他净资产		202,996,521	5.3
Minmetals Bounteous 4.2% 07/26-RegS	美元 10,000,000	10,512,167	0.3			-----	----
Nan Fung Tsy 3.875% 03/10/27-RegS	美元 19,500,000	19,169,475	0.5	截至二零一七年九月三十日可赎回份额持 有人应占净资产		3,809,838,031	100.0
NWD (MTN) 5.25% 26/02/21-RegS	美元 16,725,000	17,941,813	0.5			-----	----
NWD Fin (BVI) 5.75% Perp-RegS	美元 13,300,000	13,886,013	0.4	总投资, 按成本		3,573,263,093	
Proven Honour Cap 4.125% 05/26-RegS	美元 28,000,000	29,310,808	0.8			-----	----
Proven Honour Cap 4.125% 19/05/25	美元 12,400,000	13,077,350	0.3			-----	----
Radiant Access 4.6% Perp-RegS	美元 10,300,000	10,310,243	0.3			-----	----
RKI Overseas Fin 5% 09/08/19-RegS	美元 28,900,000	29,439,627	0.8			-----	----
SDSC Intl Finance 3.625% 11/19-RegS	美元 12,600,000	12,953,386	0.3			-----	----
Sino-Ocean Land 4.45% 04/02/20-RegS	美元 20,000,000	20,696,917	0.5			-----	----

投资组合持有变动表

截至二零一七年九月三十日止年度 (未经审计)

	持有占资产净值 百分比	
	2017	2016
上市投资		
可换股		
中国	2.4	2.1
香港	1.8	1.8
日本	1.3	2.3
台湾	1.1	0.2
维京群岛	1.1	-
马来西亚	1.0	0.5
新加坡	0.9	1.0
百慕大	0.5	-
菲律宾	0.2	-
债务证券		
维京群岛	14.9	15.3
印度尼西亚	11.3	11.5
开曼群岛	10.0	8.4
中国	8.5	5.2
印度	8.1	10.7
香港	6.4	5.5
新加坡	6.2	6.5
韩国	5.0	3.7
马来西亚	3.9	6.3
荷兰	2.4	1.7
泰国	2.3	2.0
澳大利亚	1.6	2.7
菲律宾	1.0	0.8
斯里兰卡	0.8	1.3
新西兰	0.7	2.3
毛里求斯	0.5	-
俄罗斯	0.5	0.4
巴基斯坦	0.4	0.1
英属泽西岛	0.3	0.3
美国	0.1	0.7
百慕大	-	0.3
国际	-	0.2
蒙古	-	0.0
集合投资计划		
香港	-	0.9
跨国性	-	0.9
衍生性产品		
期货	0.1	(0.0)
远期外汇合约	(0.6)	0.1
总上市投资	<u>94.7</u>	<u>95.7</u>
其他净资产	<u>5.3</u>	<u>4.3</u>
截至九月三十日可赎回份额持有人应占净资产	<u><u>100.0</u></u>	<u><u>100.0</u></u>

财务状况报表

截至二零一七年九月三十日

	2017 美元	2016 美元
资产		
银行现金	187,823,385	186,118,724
应收经纪款项	31,674,306	1,828,616
分配应收款项	105,375,076	50,806,997
保证金	1,853,818	6,349,757
衍生性产品 [附注 4(i)(a)]	26,044,811	15,213,340
投资 [附注 4(i)(a)]	3,625,861,167	3,754,953,195
利息和其他应收款项	161,558	16,418
总资产	<u>3,978,794,121</u>	<u>4,015,287,047</u>
负债		
应付经纪款项	80,419,769	33,664,838
赎回应付款项	28,383,039	26,534,648
应付收益分配 [附注 6]	9,950,415	11,599,586
衍生性产品 [附注 4(i)(a)]	45,064,468	12,840,112
其他应付款项	5,138,399	5,975,676
总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)	<u>168,956,090</u>	<u>90,614,860</u>
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	<u>3,809,838,031</u>	<u>3,924,672,187</u>

由受托人及管理人于二零一八年一月十九日批准

签署人:

汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司, 受托人

摩根基金(亚洲)有限公司, 管理人

综合收益表

截至二零一七年九月三十日止年度

	2017 美元	2016 美元
收入		
投资及衍生性产品净收益 [附注 5]	135,920,264	210,686,039
存款利息	1,036,566	594,832
汇兑净(亏损)/收益	(210,508)	3,760,532
其他收入 [附注 13]	229,325	133,049
	<u>136,975,647</u>	<u>215,174,452</u>
支出		
管理费用 [附注 8(e)]	33,736,314	25,964,215
托管费用及银行费用	885,988	505,956
受托人费用 [附注 9]	860,470	667,729
基金注册登记机构费用 [附注 8(h)]	513,302	518,513
法律及专业费用	223,186	149,543
交易成本	143,398	334,525
印刷及出版支出	25,587	17,594
核数师费用	24,000	13,600
估值费用 [附注 8(e)]	17,220	17,290
其他经营费用	13,942	6,943
	<u>36,443,407</u>	<u>28,195,908</u>
净经营利润	<u>100,532,240</u>	<u>186,978,544</u>
财务成本		
收益分配 [附注 6]	(123,474,429)	(130,696,805)
已付利息	-	(12)
	<u>(123,474,429)</u>	<u>(130,696,817)</u>
除税前(亏损)/利润	<u>(22,942,189)</u>	<u>56,281,727</u>
税项 [附注 7]	(4,751,498)	(4,909,779)
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>(27,693,687)</u>	<u>51,371,948</u>

可赎回份额持有人应占净资产变动表
截至二零一七年九月三十日止年度

	2017 美元	2016 美元
年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 [附注 3]	2,620,029,238	3,635,897,044
赎回可赎回份额 [附注 3]	(2,707,169,707)	(1,991,712,205)
净(赎回)/分配	(87,140,469)	1,644,184,839
	3,837,531,718	3,873,300,239
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之(减少)/增加	(27,693,687)	51,371,948
年末可赎回份额持有人应占净资产	3,809,838,031	3,924,672,187

现金流量表
截至二零一七年九月三十日止年度

	2017 美元	2016 美元
经营业务		
购入投资及衍生性产品	(1,549,385,875)	(2,030,444,680)
出售投资及衍生性产品所得款项	1,852,700,293	495,461,034
保证金之减少/(增加)	4,495,939	(5,035,412)
已收利息	1,009,311	594,384
已付交易费用	(144,591)	(333,127)
已付基金注册登记机构费用	(545,701)	(430,518)
已付受托人费用	(866,366)	(634,128)
已付税项	(5,329,822)	(3,201,119)
已付管理费用	(33,967,741)	(24,616,085)
其他	(1,984,450)	3,003,557
经营业务所产生/(运用)之现金净额	265,980,997	(1,565,636,094)
融资活动		
已付利息	-	(12)
分配可赎回份额所得款项	2,565,461,159	3,602,510,521
赎回可赎回份额付款	(2,705,321,316)	(1,977,681,667)
已付收益分配	(125,123,600)	(131,720,145)
融资活动所(运用)/产生之现金净额	(264,983,757)	1,493,108,697
现金及现金等价物之增加/(减少)	997,240	(72,527,397)
年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收益	707,421	183,099
年末现金及现金等价物	187,823,385	186,118,724
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	187,823,385	186,118,724

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(“证监会”)认可。

本基金之投资目标为通过一个主要投资于亚洲债券及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,管理人可决定发行不同产品类别(分别称为“类别”),虽然各类别之资产将作共同投资,但各类别可应用特定的收费结构、货币或收益分配政策。由于各类别有不同的收费结构,因此每类别应占之资产净值可能不同。

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

2 主要会计政策

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

(a) 财务报表之编制基础

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

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

于二零一六年十月一日生效的新准则及对现有准则的修订

没有于二零一六年十月一日开始的财政年度首次生效的新准则或对现有准则的修订对本基金造成重大影响。

于二零一六年十月一日生效且未获本基金提早采纳的新准则、修订及诠释

香港财务报告准则第9号“金融工具”,针对金融资产和金融负债的分类、计量和确认。此则取代了香港会计准则第39号“金融工具:确认及计量”中有关金融工具分类和计量的指引。香港财务报告准则第9号保留但简化了混合计量模式,并就金融资产设定三项主要计量类别:摊销成本、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益,和以公允价值计量且其变动计入损益。此分类基准视乎主体管理金融资产的经营模式,以及金融资产的合同现金流量特点。在权益工具中的投资需要按公允价值透过损益计量,而由初始不可撤销选项在其他综合收益计量的公允价值变动入账。目前有新的预期信贷损失模型,取代在香港会计准则第39号中使用的减值亏损模型。对于金融负债,就指定为按公允价值透过损益表计量的负债,除了在其他综合收益中确认本身信贷风险的变动外,分类和计量并无任何变动。

此项准则将于二零一八年一月一日或之后开始的会计期间起生效。允许提早采纳。管理层已作出评估,认为不会对本基金财务报表产生任何重大影响。

没有其他于二零一六年十月一日之后的财政年度生效的准则、诠释或修订预期会对本基金造成重大影响。

(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现金流量的权利已终止或本基金已转移差不多所有风险和回报时，即终止确认投资及衍生性产品。

公允价值估计

公允价值指在计量日期，于一项有序交易中由市场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。

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

公允价值次分层间的转拨

在公允价值次分层之间的转拨视为于报告期间开始时已发生。

(c) **金融工具抵销**

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

(d) **收入及支出**

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

投资利息收入乃作为投资及衍生性产品净收益/亏损的一部分，在综合收益表确认。

银行现金及短期存款利息收入乃按实际利息法在综合收益表确认。

支出乃按应计基准在综合收益表确认。

(e) **外币交易**

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

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

(f) **现金及现金等价物**

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

(g) **保证金**

为衍生性产品交易而存放在经纪处的保证金采用实际利率法以摊销成本列账。

(h) **应收/应付经纪款项**

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

(i) **销售份额所得款项及赎回份额支付款项**

每份额资产净值于每个交易日计算。认购/申购或赎回份额的价格将通过参考相关交易日营业时间结束时每份额资产净值计算。这是按照信托契约的条文计算，因而可能与财务报表中的会计政策不同。

可赎回份额持有人有权选择赎回份额，此等份额在财务状况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。

(j) **应付可赎回份额持有人的收益分配**

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

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

2017

	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:					
年初	34,628,581.509	19,228,840.760	673,223.404	481,081,632.716	10,074,754.563
总分配	21,675,357.155	11,473,295.495	207,471.310	412,244,272.273	10,532,337.932
总赎回	(32,148,454.537)	(15,675,549.589)	(445,271.986)	(430,741,871.552)	(11,920,248.119)
年末	<u>24,155,484.127</u>	<u>15,026,586.666</u>	<u>435,422.728</u>	<u>462,584,033.437</u>	<u>8,686,844.376</u>
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净资产	<u>219,559,065</u>	<u>137,199,992</u>	<u>4,157,347</u>	<u>4,487,647,800</u>	<u>78,391,549</u>
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	<u>9.09</u>	<u>9.13</u>	<u>9.55</u>	<u>9.70</u>	<u>9.02</u>
	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:					
年初	1,842,512.706	539,722,511.305	2,234,241.020	81,430,764.575	345,986,634.110
总分配	828,282.694	258,552,159.072	4,873,434.041	53,778,808.383	240,311,250.340
总赎回	(1,081,005.879)	(307,844,076.951)	(5,947,906.098)	(62,713,688.179)	(255,493,795.540)
年末	<u>1,589,789.521</u>	<u>490,430,593.426</u>	<u>1,159,768.963</u>	<u>72,495,884.779</u>	<u>330,804,088.910</u>
	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	<u>19,181,758</u>	<u>4,570,432,055</u>	<u>14,067,443</u>	<u>803,248,157</u>	<u>3,796,281,190</u>
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	<u>12.07</u>	<u>9.32</u>	<u>12.13</u>	<u>11.08</u>	<u>11.48</u>

	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:			
年初	77,499,861.830	40,714,981.090	1,788,057.380
总分配	52,551,036.590	27,533,054.400	1,670,314.000
总赎回	(35,895,507.740)	(9,181,916.220)	(542,706.780)
年末	<u>94,155,390.680</u>	<u>59,066,119.270</u>	<u>2,915,664.600</u>
	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应占净 资产 ²	<u>948,303,236</u>	<u>640,043,722</u>	<u>29,438,715</u>
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	<u>10.07</u>	<u>10.84</u>	<u>10.10</u>

2016

	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:					
年初	24,150,892.841	15,771,899.487	93,571.235	259,609,204.830	10,791,750.092
总分配	37,451,581.455	12,392,594.422	955,047.411	483,065,084.953	9,763,621.801
总赎回	(26,973,892.787)	(8,935,653.149)	(375,395.242)	(261,592,657.067)	(10,480,617.330)
年末	<u>34,628,581.509</u>	<u>19,228,840.760</u>	<u>673,223.404</u>	<u>481,081,632.716</u>	<u>10,074,754.563</u>
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净 资产 ²	<u>321,280,527</u>	<u>179,196,989</u>	<u>6,555,386</u>	<u>4,722,528,266</u>	<u>92,826,121</u>
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	<u>9.28</u>	<u>9.32</u>	<u>9.74</u>	<u>9.82</u>	<u>9.21</u>

	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:					
年初	2,814,534.808	651,910,409.424	2,877,139.286	54,291,404.491	-
总分配	1,119,068.535	390,875,479.311	368,591.008	73,488,386.828	391,944,292.740
总赎回	(2,091,090.637)	(503,063,377.430)	(1,011,489.274)	(46,349,026.744)	(45,957,658.630)
年末	<u>1,842,512.706</u>	<u>539,722,511.305</u>	<u>2,234,241.020</u>	<u>81,430,764.575</u>	<u>345,986,634.110</u>
	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	<u>21,105,857</u>	<u>5,166,107,748</u>	<u>26,539,869</u>	<u>919,519,116</u>	<u>3,763,109,762</u>
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	<u>11.45</u>	<u>9.57</u>	<u>11.88</u>	<u>11.29</u>	<u>10.88</u>
	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:					
年初	-	-	-		
总分配	86,052,694.750	41,225,432.400	1,935,066.840		
总赎回	(8,552,832.920)	(510,451.310)	(147,009.460)		
年末	<u>77,499,861.830</u>	<u>40,714,981.090</u>	<u>1,788,057.380</u>		
	人民币	美元	美元		
可赎回份额持有人应占净 资产	<u>799,689,319</u>	<u>432,075,847</u>	<u>18,403,254</u>		
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	<u>10.32</u>	<u>10.61</u>	<u>10.29</u>		

4 财务风险管理

(I) 财务风险因素

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

本基金于集体投资计划中持有的单位数目占集体投资计划的净资产值总额的百分比将根据集体投资计划的分配与赎回数量随时变化。本基金有可能会在任何时点持有集体投资计划的大多数已发行的份额。

(a) 市场风险

(i) 市场价格风险

本基金主要投资债务证券，此等债券须承担利率风险。利率风险请参阅附注 4(I)(a)(ii)。

(ii) 利率风险

利率风险指金融工具的价值或未来现金流量因市场利率变动而波动不定的风险。本基金须承担现行市场利率水平波动对其投资、衍生性产品及现金存款造成影响的风险。

下表按剩余到期日分类，概述截至九月三十日本基金须承担现行市场利率水平波动影响风险的金融资产及负债。

	1年以内 美元	1至5年 美元	5年以上 美元	非计息类 美元	总额 美元
2017					
银行现金	187,823,385	-	-	-	187,823,385
保证金	1,853,818	-	-	-	1,853,818
衍生性产品	3,766,188	-	-	-	3,766,188
投资（注*）	148,326,816	1,620,894,848	1,856,639,503	-	3,625,861,167
总利率敏感性缺口	<u>341,770,207</u>	<u>1,620,894,848</u>	<u>1,856,639,503</u>	<u>-</u>	<u>3,819,304,558</u>
2016					
银行现金	186,118,724	-	-	-	186,118,724
保证金	6,349,757	-	-	-	6,349,757
衍生性产品	(753,844)	-	-	-	(753,844)
投资（注*）	131,111,012	1,692,683,606	1,862,173,677	68,984,900	3,754,953,195
总利率敏感性缺口	<u>322,825,649</u>	<u>1,692,683,606</u>	<u>1,862,173,677</u>	<u>68,984,900</u>	<u>3,946,667,832</u>

注：

* 投资的票面息率波动范围为年率 0.00% - 10.00%（二零一六年：年率 0.00% - 13.25%）。

截至九月三十日，本基金投资及衍生性产品之公平值如下：

	2017		2016	
	投资之公平值 美元	占资产净值百分比	投资之公平值 美元	占资产净值百分比
上市投资				
资产				
可换股	390,047,322	10.3	310,970,055	7.9
债务证券				
- 维京群岛	566,697,831	14.9	600,496,905	15.3
- 印度尼西亚	430,615,962	11.3	449,810,912	11.5
- 开曼群岛	382,579,840	10.0	329,241,275	8.4
- 中国	324,080,000	8.5	202,858,889	5.2
- 印度	309,403,930	8.1	420,048,274	10.7
- 香港	243,199,284	6.4	213,961,670	5.5
- 新加坡	237,488,411	6.2	254,948,405	6.5
- 韩国	189,301,052	5.0	145,367,621	3.7
- 马来西亚	147,264,916	3.9	245,461,448	6.3
- 其他	405,182,619	10.6	512,802,841	12.8
	3,235,813,845	84.9	3,374,998,240	85.9
集合投资计划	-	-	68,984,900	1.8
衍生性产品				
- 期货	3,766,188	0.1	-	-
- 远期外汇合约	22,278,623	0.6	15,213,340	0.4
	26,044,811	0.7	15,213,340	0.4
	3,651,905,978	95.9	3,770,166,535	96.0
负债				
衍生性产品				
- 期货	-	-	(753,844)	(0.0)
- 远期外汇合约	(45,064,468)	(1.2)	(12,086,268)	(0.3)
	(45,064,468)	(1.2)	(12,840,112)	(0.3)
总上市投资	3,606,841,510	94.7	3,757,326,423	95.7

有关衍生性产品合约的风险亦请参阅附注 12。

投资管理主要通过本基金的修正久定期监控本基金的利率风险敏感度。修正久期计量某项债券和可换股的价格相对于利率变动的敏感度。于二零一七年九月三十日，投资管理人估计本基金的修正久期为 3.45（二零一六年：3.98）。为了披露相关敏感度，采用的利率合理变动百分比为二十五个基点，不包括不大可能出现或“最恶劣”情况或“压力测试”下之变动，也不代表投资管理人对本基金未来回报的预测。若利率上升二十五个基点，其他变量保持稳定，则将致使本基金的资产净值减少约 32,859,853 美元（二零一六年：39,050,488 美元）。若利率下降二十五个基点，则将致使本基金的资产净值增加相同金额。

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

(iii) 汇兑风险

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

本基金订立了若干远期外汇合约，以对冲若干外汇承担以维持有限的非美元风险承担。年末未平仓远期外汇合约请参阅附注 12(a)。

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

汇兑风险承担净值（注*）	美元 等值	与美元比较之合 理变动百分比 (注**)	估计对资产净值 的影响 美元
2017			
澳元	178,549,885	+2.5	4,463,747
加元	110,128,764	+5.1	5,616,567
人民币（境内）	1,387,354,690	+0.4	5,549,419
人民币（境外）	90,442,778	+0.4	361,771
欧元	18,143,540	+5.2	943,464
港元	31,887,121	-0.7	(223,210)
印度卢比	106,948,703	+1.9	2,032,025
印尼盾	151,331,898	-3.1	(4,691,289)
日元	1,271,675	-10.0	(127,168)
韩元	5,387,066	-3.8	(204,709)
林吉特	69,846,220	-2.1	(1,466,771)
纽元	60,674,686	-0.6	(364,048)
比索	28,393,110	-4.5	(1,277,690)
新加坡元	30,051,485	+0.4	120,206
英镑	5,651,266	+3.3	186,492
泰铢	31,586,004	+3.9	1,231,854
	<u>2,307,648,891</u>		<u>12,150,660</u>
2016			
澳元	300,410,932	+9.0	27,036,984
加元	136,473,947	+2.0	2,729,479
人民币（境内）	20,798,650	-4.7	(977,537)
人民币（境外）	1,473,994,807	-4.6	(67,803,761)
港元	130,513,197	-0.1	(130,513)
印度卢比	172,920,668	-1.4	(2,420,889)
印尼盾	193,726,977	+12.3	23,828,418
日元	7,777,886	+18.3	1,423,353
韩元	18,975,028	+7.6	1,442,102
林吉特	167,820,709	+6.3	10,572,705
纽元	152,575,033	+13.7	20,902,780
比索	30,901,453	-3.6	(1,112,452)
新加坡元	8,867,589	+4.3	381,306
英镑	8,542,169	-14.2	(1,212,988)
泰铢	49,515,943	+4.7	2,327,249
	<u>2,873,814,988</u>		<u>16,986,236</u>

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

注：

* 资产及负债汇兑风险承担净值包括货币及非货币资产及负债。

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

(b) 信贷风险

信贷风险指交易对手无法于到期日支付全数金额的风险。

截至九月三十日，在信用增级前本基金的最高信贷风险承担列示如下：

	2017 美元	2016 美元
银行现金	187,823,385	186,118,724
应收经纪款项	31,674,306	1,828,616
分配应收款项	105,375,076	50,806,997
保证金	1,853,818	6,349,757
经纪发行的衍生性产品	22,278,623	15,213,340
投资-债务证券	3,235,813,845	3,374,998,240
利息和其他应收款项	161,558	16,418
	<u>3,584,980,611</u>	<u>3,635,332,092</u>

所有上市投资交易均由经核准的经纪按照货银交付原则进行结算。由于本基金的托管银行只会在收取款项后始交付有关投资，所以违约风险甚低。就购买而言，本基金的托管银行会在收到投资后即时付款。若任何一方不能履行其责任，交易将告失效。

本基金主要投资债务证券，因此，本基金须承担信贷风险，即发行机构可能无法于到期时偿还本金及利息。本基金通过参考信贷评级机构提供的信贷评级及信贷展望（如有）以及内部信贷分析，持续管理并监控债务证券之信贷风险。

下表概述截至九月三十日按照信贷评级的债务证券。

	2017 占资产净值百分比	2016 占资产净值百分比
标准普尔(AAA)/穆迪(Aaa)/惠誉(AAA)	0.5	3.8
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	1.2	3.5
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	17.8	19.5
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	37.7	32.1
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	11.8	8.6
标准普尔(B)/穆迪(B)/惠誉(B)	2.7	3.3
标准普尔(CCC)/穆迪(Caa)/惠誉(CCC)	-	0.1
未评级	13.3	22.9
	<u>85.0</u>	<u>93.8</u>

截至九月三十日，按照发行机构的信贷评级，下表概述上述未评级债务证券。

	2017 占资产净值百分比	2016 占资产净值百分比
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	0.3	0.3
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	1.4	1.1
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	3.9	5.7
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	-	2.0
未评级	7.7	13.8
	<u>13.3</u>	<u>22.9</u>

下表概述本基金截至九月三十日存放金融资产的银行/经纪/托管的信贷评级。

	2017 交易对手风险承担 美元	2016 交易对手风险承担 美元
银行结余		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	91,287,775	186,118,724
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	96,535,610	-
存放经纪之保证金及经纪发行的投资及衍生性产品		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	2,669,432	9,320,589
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	21,463,009	12,242,508
托管机构的投资余额		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	<u>3,625,861,167</u>	<u>3,754,953,195</u>

(c) **流动性风险**

本基金须面对份额每日赎回的风险，而其大多数投资资产均在活跃市场交易，并可随时出售。管理人亦可将任何一个交易日之赎回份额总数限制为本基金已发行份额的百分之十或更高。

在投资限制和指南的规限下，本基金有能力订立借款安排。

下表概述本基金的金融负债，按九月三十日距离约定到期日的尚余期间分为有关期限组别。下表所载金额乃约定未折现现金流量。

	2017		2016	
	1个月以内 美元	1至12个月 美元	1个月以内 美元	1至12个月 美元
应付经纪款项	80,419,769	-	33,664,838	-
赎回应付款项	28,383,039	-	26,534,648	-
应付收益分配	9,950,415	-	11,599,586	-
衍生性产品	31,832,974	13,231,494	10,333,751	2,506,361
其他应付款项	5,138,399	-	5,975,676	-
可赎回份额持有人应占净资产	<u>3,809,838,031</u>	-	<u>3,924,672,187</u>	-
总金融负债	<u>3,965,562,627</u>	<u>13,231,494</u>	<u>4,012,780,686</u>	<u>2,506,361</u>

投资管理通过投资于预期一般在一个月內变现到期的资产和借入短期银行借款以偿还金融负债来管理本基金的流动性风险。

(d) 受总抵销安排及类似协议规限的对销与金额

截至二零一七年及二零一六年九月三十日，本基金受制于与若干衍生品交易对手的总净额结算协议。该等交易对手持有本基金的所有衍生资产及负债，本基金持有之抵押品及保证金是为了就该等衍生性产品仓位提供抵押而持有。

若发生违约，本基金及其交易对手有权按净额结算该等交易。违约事件可能包括付款或交付失败、违反协议或破产。

下表按金融工具类型概述截至九月三十日本基金受抵销和总净额结算协议及类似协议规限的金融资产及负债。

	财务状况表中列示的经确认金融资产总额 美元	受总抵销安排及类似协议规限的相关金额		净额 美元
		金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	
<u>2017</u>				
<u>资产</u>				
保证金	453,818	-	-	453,818
衍生性产品	6,660,945	(1,045,313)	-	5,615,632
按公允价值透过损益列账的金融资产	<u>7,114,763</u>	<u>(1,045,313)</u>	<u>-</u>	<u>6,069,450</u>

	财务状况表中列示的经确认金融负债总额 美元	受总抵销安排及类似协议规限的相关金额		净额 美元
		金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	
<u>负债</u>				
衍生性产品	1,872,544	(1,045,313)	-	827,231
按公允价值透过损益列账的金融负债	<u>1,872,544</u>	<u>(1,045,313)</u>	<u>-</u>	<u>827,231</u>

	财务状况表中列示的经确认金融资产总额 美元	受总抵销安排及类似协议规限的相关金额		净额 美元
		金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	
2016				
资产				
保证金	6,349,757	-	(753,844)	5,595,913
衍生性产品	15,213,340	(870,026)	-	14,343,314
按公允价值透过损益列账的金融资产	<u>21,563,097</u>	<u>(870,026)</u>	<u>(753,844)</u>	<u>19,939,227</u>
负债				
衍生性产品	12,840,112	(870,026)	(753,844)	11,216,242
按公允价值透过损益列账的金融负债	<u>12,840,112</u>	<u>(870,026)</u>	<u>(753,844)</u>	<u>11,216,242</u>

(II) 资本风险管理

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

为了维持资本结构，本基金的政策执行如下：

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

(III) 公允价值估计

截至二零一七年及二零一六年九月三十日，管理人认为资产及负债的账目价值与公允价值相若。

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

- 第一层次—相同资产或负债在活跃市场中的报价（未经调整）。
- 第二层次—直接（即按照价格）或间接（即源于价格）地使用除第一层次中的资产或负债的市场报价以外的其他可观察输入值。
- 第三层次—资产或负债使用了非基于可观察市场数据（即不可观察的输入值）。

下表概述本基金截至九月三十日的投资及衍生性产品（按类别）按公平价值次计量之公平值：

上市投资	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总额 美元
<u>2017</u>				
<u>资产</u>				
可换股	-	390,047,322	-	390,047,322
债务证券	-	3,235,813,845	-	3,235,813,845
衍生性产品	3,766,188	22,278,623	-	26,044,811
按公平值透过损益列账的总金融资产	<u>3,766,188</u>	<u>3,648,139,790</u>	-	<u>3,651,905,978</u>
<u>负债</u>				
衍生性产品	-	45,064,468	-	45,064,468
按公平值透过损益列账的总金融负债	-	<u>45,064,468</u>	-	<u>45,064,468</u>
<u>2016</u>				
<u>资产</u>				
可换股	-	310,970,055	-	310,970,055
债务证券	-	3,374,998,240	-	3,374,998,240
集合投资计划	68,984,900	-	-	68,984,900
衍生性产品	-	15,213,340	-	15,213,340
按公平值透过损益列账的总金融资产	<u>68,984,900</u>	<u>3,701,181,635</u>	-	<u>3,770,166,535</u>
<u>负债</u>				
衍生性产品	753,844	12,086,268	-	12,840,112
按公平值透过损益列账的总金融负债	<u>753,844</u>	<u>12,086,268</u>	-	<u>12,840,112</u>

由于投资价值是基于活跃市场的报价，因此分类为第一层次，并包括活跃上市股票证券及交易所交易衍生性产品。本基金没有调整这些工具的报价。

于非活跃市场交易的金融投资但以市场报价、交易商/经纪报价或其他报价来源作为可观察输入值，此等投资分类为第二层次。

被分类为第三层次的投资，由于其交易次数疏落，故此有显著的不可观察输入值。

在截至二零一七年及二零一六年九月三十日止年度，各个层级之间并无转拨。

下表概述截至九月三十日，在公平值级次内未按公平值计量但已披露公平值的本基金资产及负债（按类别）。

	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总额 美元
2017				
资产				
银行现金	187,823,385	-	-	187,823,385
应收经纪款项	-	31,674,306	-	31,674,306
分配应收款项	-	105,375,076	-	105,375,076
保证金	1,853,818	-	-	1,853,818
利息和其他应收款项	-	161,558	-	161,558
总资产	189,677,203	137,210,940	-	326,888,143
负债				
应付经纪款项	-	80,419,769	-	80,419,769
赎回应付款项	-	28,383,039	-	28,383,039
应付收益分配	-	9,950,415	-	9,950,415
其他应付款项	-	5,138,399	-	5,138,399
可赎回份额持有人应占净资产	3,809,838,031	-	-	3,809,838,031
总负债	3,809,838,031	123,891,622	-	3,933,729,653
2016				
资产				
银行现金	186,118,724	-	-	186,118,724
应收经纪款项	-	1,828,616	-	1,828,616
分配应收款项	-	50,806,997	-	50,806,997
保证金	6,349,757	-	-	6,349,757
利息和其他应收款项	-	16,418	-	16,418
总资产	192,468,481	52,652,031	-	245,120,512
负债				
应付经纪款项	-	33,664,838	-	33,664,838
赎回应付款项	-	26,534,648	-	26,534,648
应付收益分配	-	11,599,586	-	11,599,586
其他应付款项	-	5,975,676	-	5,975,676
可赎回份额持有人应占净资产	3,924,672,187	-	-	3,924,672,187
总负债	3,924,672,187	77,774,748	-	4,002,446,935

银行现金及保证金包括库存现金、银行存款及其他短期投资。

应收经纪款项及其他应收款项包括应付本基金的交易结算及其他责任清偿之合约金额。应付经纪款项及其他应付款项包括本基金结算交易及清偿费用之合约金额及责任。

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。可赎回金额按照根据信托契约的规定计算的可赎回份额持有人应占净资产（“信托契约 NAV”）厘定。这些份额在活跃市场中进行交易。因此，第一层次被视作可赎回份额持有人应占净资产（或“资产净值”或“净资产”或“NAV”）的适当分类。

5 投资及衍生性产品净收益

	2017 美元	2016 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益／亏损之变动	(65,181,232)	148,733,032
投资及衍生性产品销售之实现收益	201,101,496	61,953,007
	<u>135,920,264</u>	<u>210,686,039</u>

6 收益分配

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。

	2017 美元	2016 美元
净经营利润	100,532,240	186,978,544
调整：		
投资及衍生性产品净收益	(135,920,264)	(210,686,039)
利息收入包括于投资及衍生性产品净收益（票面利率）	136,937,668	107,604,380
汇兑净亏损／（收益）	210,508	(3,760,532)
交易成本	143,398	334,525
已付利息	-	(12)
税项	(4,751,498)	(4,909,779)
资本利得税	762,515	1,516,440
收益可分配金额	<u>97,914,567</u>	<u>77,077,527</u>

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2017 美元	2016 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)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2017 美元	2016 美元
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)	
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 0.0326	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)	2017年4月28日	2017年5月10日	澳元 0.0357	25,698,158.442	(686,096)	
加元对冲类别 (每月派息)	2017年4月28日	2017年5月10日	加元 0.0270	16,074,296.049	(317,418)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2017年4月28日	2017年5月10日	英镑 0.0248	554,795.636	(17,801)	
港元类别 (每月派息)	2017年4月28日	2017年5月10日	港元 0.0326	421,149,282.501	(1,765,269)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2017年4月28日	2017年5月10日	纽元 0.0378	10,277,713.020	(266,723)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2017年4月28日	2017年5月10日	人民币 0.0529	391,540,438.739	(3,002,441)	
美元类别 (每月派息)	2017年4月28日	2017年5月10日	美元 0.0375	62,323,195.313	(2,337,120)	
PRC人民币对冲份额(每月派息)	2017年4月28日	2017年5月10日	人民币 0.0571	64,752,116.390	(535,960)	
PRC美元份额 (每月派息)	2017年4月28日	2017年5月10日	美元 0.0342	1,600,019.490	(54,721)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2017年5月31日	2017年6月8日	澳元 0.0363	28,545,829.866	(771,409)	
加元对冲类别 (每月派息)	2017年5月31日	2017年6月8日	加元 0.0270	17,653,441.889	(352,886)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2017年5月31日	2017年6月8日	英镑 0.0245	545,446.333	(17,252)	
港元类别 (每月派息)	2017年5月31日	2017年6月8日	港元 0.0326	418,764,408.957	(1,751,916)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2017年5月31日	2017年6月8日	纽元 0.0378	11,056,328.847	(296,625)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2017年5月31日	2017年6月8日	人民币 0.0565	393,739,793.215	(3,191,773)	
美元类别 (每月派息)	2017年5月31日	2017年6月8日	美元 0.0375	62,405,951.227	(2,340,223)	
PRC人民币对冲份额(每月派息)	2017年5月31日	2017年6月8日	人民币 0.0610	71,286,982.090	(643,446)	
PRC美元份额 (每月派息)	2017年5月31日	2017年6月8日	美元 0.0342	1,902,259.380	(65,057)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2017年6月30日	2017年7月10日	澳元 0.0351	28,952,144.341	(779,492)	
加元对冲类别 (每月派息)	2017年6月30日	2017年7月10日	加元 0.0256	17,563,692.307	(346,216)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2017年6月30日	2017年7月10日	英镑 0.0227	508,891.732	(15,005)	
港元类别 (每月派息)	2017年6月30日	2017年7月10日	港元 0.0326	421,263,481.837	(1,759,211)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2017年6月30日	2017年7月10日	纽元 0.0363	9,920,989.472	(263,689)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2017年6月30日	2017年7月10日	人民币 0.0632	401,099,607.418	(3,738,615)	
美元类别 (每月派息)	2017年6月30日	2017年7月10日	美元 0.0375	63,323,530.000	(2,374,632)	
PRC人民币对冲份额(每月派息)	2017年6月30日	2017年7月10日	人民币 0.0682	74,531,330.980	(749,661)	
PRC美元份额 (每月派息)	2017年6月30日	2017年7月10日	美元 0.0342	2,224,505.740	(76,078)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2017年7月31日	2017年8月8日	澳元 0.0344	25,451,521.864	(698,981)	
加元对冲类别 (每月派息)	2017年7月31日	2017年8月8日	加元 0.0258	16,589,953.605	(342,266)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2017年7月31日	2017年8月8日	英镑 0.0224	483,621.471	(14,282)	
港元类别 (每月派息)	2017年7月31日	2017年8月8日	港元 0.0326	432,412,168.491	(1,804,912)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2017年7月31日	2017年8月8日	纽元 0.0356	8,538,761.786	(227,909)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2017年7月31日	2017年8月8日	人民币 0.0512	419,061,049.096	(3,187,534)	
美元类别 (每月派息)	2017年7月31日	2017年8月8日	美元 0.0375	63,132,096.870	(2,367,454)	
PRC人民币对冲份额(每月派息)	2017年7月31日	2017年8月8日	人民币 0.0553	80,146,503.800	(658,442)	
PRC美元份额 (每月派息)	2017年7月31日	2017年8月8日	美元 0.0342	2,512,374.200	(85,923)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2017年8月31日	2017年9月8日	澳元 0.0343	23,869,729.987	(649,377)	
加元对冲类别 (每月派息)	2017年8月31日	2017年9月8日	加元 0.0267	16,044,441.770	(341,684)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2017年8月31日	2017年9月8日	英镑 0.0225	474,026.460	(13,743)	
港元类别 (每月派息)	2017年8月31日	2017年9月8日	港元 0.0329	449,998,315.051	(1,891,655)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2017 美元	2016 美元
纽元对冲类别 (每月派息)	2017年8月31日	2017年9月8日	纽元 0.0359	8,167,992.857	(210,012)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2017年8月31日	2017年9月8日	人民币 0.0431	463,502,819.481	(3,027,318)	
美元类别 (每月派息)	2017年8月31日	2017年9月8日	美元 0.0375	64,906,906.531	(2,434,009)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2017年8月31日	2017年9月8日	人民币 0.0465	86,969,757.650	(612,844)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2017年8月31日	2017年9月8日	美元 0.0342	2,835,685.340	(96,980)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2017年9月29日	2017年10月11日	澳元 0.0341	24,166,594.566	(646,615)	
加元对冲类别 (每月派息)	2017年9月29日	2017年10月11日	加元 0.0285	14,934,979.621	(340,341)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2017年9月29日	2017年10月11日	英镑 0.0224	435,422.728	(13,086)	
港元类别 (每月派息)	2017年9月29日	2017年10月11日	港元 0.0328	461,218,855.481	(1,936,827)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2017年9月29日	2017年10月11日	纽元 0.0358	8,769,537.930	(226,954)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2017年9月29日	2017年10月11日	人民币 0.0450	485,787,228.974	(3,288,740)	
美元类别 (每月派息)	2017年9月29日	2017年10月11日	美元 0.0375	72,336,653.702	(2,712,625)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2017年9月29日	2017年10月11日	人民币 0.0485	93,951,035.010	(685,511)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2017年9月29日	2017年10月11日	美元 0.0342	2,915,664.600	(99,716)	
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	620,930,021.709	(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)	
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)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	澳元 0.0459	27,666,793.813	(969,129)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	加元 0.0328	14,614,023.946	(382,676)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2017 美元	2016 美元
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	英镑 0.0336	185,490.796		(9,130)
港元类别 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	港元 0.0347	321,383,292.523		(1,437,632)
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	纽元 0.0478	9,233,609.863		(308,626)
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	人民币 0.0467	507,652,290.675		(3,655,046)
美元类别 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	美元 0.0400	60,433,007.282		(2,417,320)
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	人民币 0.0503	47,609,445.470		(369,208)
PRC 美元份额 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	美元 0.0365	202.180		(7)
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	澳元 0.0446	31,753,119.856		(1,025,958)
加元对冲类别 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	加元 0.0331	15,411,488.615		(389,970)
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	英镑 0.0337	253,236.051		(12,421)
港元类别 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	港元 0.0347	337,579,926.353		(1,507,955)
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	纽元 0.0482	9,093,915.654		(296,550)
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	人民币 0.0472	531,679,365.823		(3,810,685)
美元类别 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	美元 0.0400	62,288,818.294		(2,491,553)
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	人民币 0.0508	61,313,748.300		(472,969)
PRC 美元份额 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	美元 0.0365	712,542.040		(26,008)
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	澳元 0.0436	33,852,154.353		(1,098,995)
加元对冲类别 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	加元 0.0329	15,968,937.719		(404,541)
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	英镑 0.0319	483,524.126		(20,619)
港元类别 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	港元 0.0347	352,729,402.638		(1,577,699)
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	纽元 0.0475	9,003,412.962		(304,581)
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	人民币 0.0442	543,100,377.906		(3,601,170)
美元类别 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	美元 0.0400	65,791,999.265		(2,631,680)
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	人民币 0.0476	68,789,130.390		(491,211)
PRC 美元份额 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	美元 0.0365	1,127,554.310		(41,156)
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	澳元 0.0437	33,850,826.324		(1,124,328)
加元对冲类别 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	加元 0.0325	16,849,016.526		(419,917)
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	英镑 0.0313	544,020.569		(22,608)
港元类别 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	港元 0.0347	403,411,642.440		(1,803,927)
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	纽元 0.0474	9,390,935.536		(321,028)
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	人民币 0.0459	538,678,573.936		(3,725,352)
美元类别 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	美元 0.0400	71,332,819.881		(2,853,313)
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	人民币 0.0494	74,859,841.670		(557,187)
PRC 美元份额 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	美元 0.0365	1,460,263.910		(53,300)
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	澳元 0.0377	34,098,354.334		(966,123)
加元对冲类别 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	加元 0.0275	17,697,151.694		(370,925)
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	英镑 0.0254	606,108.509		(20,163)
港元类别 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	港元 0.0304	455,146,962.623		(1,783,797)
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	纽元 0.0421	9,858,584.724		(301,116)
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	人民币 0.0397	549,228,107.951		(3,257,834)
美元类别 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	美元 0.0350	78,017,997.378		(2,730,630)
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	人民币 0.0428	79,543,329.780		(508,667)
PRC 美元份额 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	美元 0.0319	1,763,882.090		(56,268)
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	澳元 0.0362	34,716,450.198		(961,717)
加元对冲类别 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	加元 0.0276	19,144,280.657		(402,041)
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	英镑 0.0237	673,223.404		(20,726)
港元类别 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	港元 0.0304	479,425,502.700		(1,879,142)
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	纽元 0.0406	10,088,824.294		(297,866)
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	人民币 0.0550	540,004,699.232		(4,450,510)
美元类别 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	美元 0.0350	81,230,893.837		(2,843,081)
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	人民币 0.0592	77,495,866.050		(687,464)
PRC 美元份额 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	美元 0.0319	1,788,057.380		(57,039)
可赎回份额持有人之总收益分配					(123,474,429)	(130,696,805)

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

7 税项

由于本基金根据香港证券及期货条例第 104 条获认可为集体投资计划，根据香港税务条例第 26A(1A)条，本基金获豁免缴纳香港利得税，因此并无税项拨备。

于截至二零一七年及二零一六年九月三十日止年度，已就某些已收利息收入和资本收益缴付海外预提税。

8 与受托人及其关联人以及管理人及其关联人士之交易

以下是本基金与受托人及其关联人以及管理人及其关联人士之间于年度内订立的重大关联方交易摘要。基金的关联人士是根据香港证券及期货事务监察委员会所颁布的单位信托及互惠基金守则（“证监会守则”）中的定义。所有交易均为按一般商业条款下进行的正常业务流程。

(a) 以下为与管理人及其关联人士之投资交易：

公司名称	投资买卖总价值 美元	占本基金本年度之总交易价值百分比	支付佣金 美元	占本基金本年度支付之总佣金百分比	平均佣金率 百分比
<u>2017</u>					
JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l.	60,335,600	1.86	-	-	-
J.P. Morgan Securities plc London	32,391,650	1.00	-	-	-
<u>2016</u>					
JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l.	33,184,100	0.87	-	-	-
J.P. Morgan Securities plc London	37,598,293	0.99	-	-	-

截至二零一七年九月三十日止年度，本基金未与管理人及其关联人士签订远期外汇合同。截至二零一六年九月三十日止年度，本基金与管理人及其关联人士签订远期外汇合同。

(b) 与管理人及其关联人士之年末结余：

	2017 美元	2016 美元
银行现金	22,985,034	21,188,234
应收款项	28,966	1,716
应付款项	(3,088,641)	(25,834,745)

截至二零一七年九月三十日，由管理人或其关联人士发行和管理的集体投资计划的投资为零（二零一六年：33,104,900 美元）。

于本年度内，存放于管理人关联人士的银行现金的利息收入为 93,223 美元（二零一六年：31,598 美元）。

- (c) 本基金可能利用受托人及其关联人以及管理人及其关联人士的券商、托管人、代理人及银行服务。本基金可能收取存款利息，并为该等服务支付利息费用、交易成本、托管费用及银行费用。所有该等交易均于正常业务过程中按一般商业条款订立。
- (d) 于本年度内，扣除支付给代理机构的佣金后，管理人取得本基金销售及赎回收益为 109,977 美元（二零一六年：1,584,516 美元）。

- (e) 支付给摩根基金（亚洲）有限公司之管理费为每年本基金资产净值的百分之一。此管理费于每个交易日累计，并于每月月底支付。

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

- (f) 本基金允许管理人及其关联人士认购/申购及赎回本基金份额。所有交易均为按一般商业条款下进行的正常业务流程。
- (g) 有关支付给受托人的费用，请参阅附注 9。
- (h) 摩根基金（亚洲）有限公司，即登记代理人及管理人，根据本基金份额持有人的数量及发生交易的数量收取注册费。与受托人商定的收费率为本基金资产净值的年率介乎百分之零点零一至百分之零点五不等。基金注册登记机构费用于每季季末支付。

9 受托人费用

受托人费用按本基金资产净值的首 4,000 万美元，以本基金资产净值的年率百分之零点零六计算；资产净值介乎 4,000 万美元至 7,000 万美元，按年率百分之零零四计算；超过 7,000 万美元时，按年率百分之零零二五计算。受托人费用于每个交易日累计，并于每月月底支付。

10 借款

截至二零一七年九月三十日止年度，本基金并无银行借款。截至二零一六年九月三十日止年度，本基金从香港上海汇丰银行有限公司（受托人的关联人）借入无抵押短期借款。所有银行借款的久期均在 7 天内。所有交易均为按一般商业条款下进行的正常业务流程。

11 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。投资管理人不直接支付这些服务，但会代表本基金与经纪约定金额。本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。

12 衍生性产品

- (a) 以下为截至九月三十日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
2017			
未平仓合约：			
澳元 101,584	美元 80,681	2017 年 10 月 3 日	968
加元 465,371	美元 377,105	2017 年 10 月 3 日	5,017
纽元 364,885	美元 265,144	2017 年 10 月 3 日	1,369
美元 1,420	纽元 1,970	2017 年 10 月 3 日	4
澳元 15,187	美元 11,955	2017 年 10 月 4 日	37
加元 21,026	美元 16,999	2017 年 10 月 4 日	186
美元 3,987	纽元 5,519	2017 年 10 月 4 日	2
美元 3,980	纽元 5,519	2017 年 10 月 5 日	9
澳元 819,625	美元 644,338	2017 年 10 月 6 日	1,260
美元 540,487	纽元 747,982	2017 年 10 月 6 日	229
美元 20,017	澳元 25,553	2017 年 10 月 6 日	32
人民币 4,464,613,147	美元 683,045,233	2017 年 10 月 10 日	11,664,739
人民币 21,472,255	美元 3,284,784	2017 年 10 月 10 日	55,825
人民币 19,260,638	美元 2,946,703	2017 年 10 月 10 日	50,322
人民币 17,679,948	美元 2,701,926	2017 年 10 月 10 日	43,248

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／(亏损) 美元
人民币 10,619,004	美元 1,622,928	2017年10月10日	26,061
人民币 6,973,879	美元 1,068,808	2017年10月10日	20,089
人民币 8,894,558	美元 1,353,870	2017年10月10日	16,322
人民币 6,136,709	美元 938,816	2017年10月10日	15,988
人民币 3,759,734	美元 578,738	2017年10月10日	13,356
人民币 5,994,787	美元 914,786	2017年10月10日	13,301
人民币 5,832,749	美元 890,360	2017年10月10日	13,242
人民币 12,002,086	美元 1,816,712	2017年10月10日	11,860
人民币 18,420,057	美元 2,778,726	2017年10月10日	8,751
人民币 8,099,832	美元 1,225,481	2017年10月10日	7,442
人民币 43,603,168	美元 6,559,215	2017年10月10日	2,249
人民币 9,456,384	美元 1,423,260	2017年10月10日	1,226
人民币 286,760	美元 43,824	2017年10月10日	701
人民币 392,500	美元 59,384	2017年10月10日	361
人民币 106,551	美元 16,284	2017年10月10日	261
人民币 18,609	美元 2,864	2017年10月10日	66
人民币 7,192	美元 1,107	2017年10月10日	25
人民币 9,072	美元 1,388	2017年10月10日	24
人民币 7,141	美元 1,094	2017年10月10日	21
人民币 19,328	美元 2,924	2017年10月10日	18
人民币 7,182	美元 1,096	2017年10月10日	16
人民币 7,259	美元 1,105	2017年10月10日	13
美元 599,258,708	人民币 4,026,938,220	2017年10月10日	6,307,721
美元 20,477,892	人民币 136,982,948	2017年10月10日	121,409
美元 4,481,708	人民币 30,087,714	2017年10月10日	42,847
美元 3,444,758	人民币 23,131,345	2017年10月10日	33,706
美元 2,943,074	人民币 19,777,060	2017年10月10日	30,978
美元 3,694,046	人民币 24,754,132	2017年10月10日	28,448
美元 4,021,221	人民币 26,908,850	2017年10月10日	25,295
美元 3,202,032	人民币 21,452,321	2017年10月10日	23,940
美元 4,709,203	人民币 31,474,607	2017年10月10日	23,901
美元 2,316,192	人民币 15,464,514	2017年10月10日	9,338
美元 1,133,594	人民币 7,600,098	2017年10月10日	9,299
美元 1,751,517	人民币 11,687,153	2017年10月10日	5,978
美元 893,926	人民币 5,981,215	2017年10月10日	5,521
美元 3,506,548	人民币 23,343,785	2017年10月10日	3,850
美元 363,899	人民币 2,422,348	2017年10月10日	370
美元 6,852	人民币 46,000	2017年10月10日	66
美元 7,050	人民币 47,170	2017年10月10日	44
美元 278,669	加元 348,530	2017年10月10日	21
美元 1,918	人民币 12,881	2017年10月10日	19
美元 1,754	人民币 11,703	2017年10月10日	6
美元 3,925	人民币 26,126	2017年10月11日	4
美元 1,560	人民币 10,381	2017年10月11日	1
澳元 2,522,419	美元 2,032,671	2017年10月24日	53,833
澳元 1,307,878	美元 1,050,691	2017年10月24日	24,661
澳元 942,465	美元 760,204	2017年10月24日	20,841
澳元 551,108	美元 442,589	2017年10月24日	10,245
澳元 679,373	美元 542,668	2017年10月24日	9,700
澳元 890,050	美元 707,827	2017年10月24日	9,582
澳元 540,780	美元 433,443	2017年10月24日	9,201
澳元 451,852	美元 361,166	2017年10月24日	6,688
澳元 419,870	美元 335,838	2017年10月24日	6,450
澳元 413,648	美元 329,868	2017年10月24日	5,360
澳元 518,991	美元 412,222	2017年10月24日	5,074
澳元 379,732	美元 302,888	2017年10月24日	4,988
澳元 321,684	美元 256,421	2017年10月24日	4,060
澳元 354,670	美元 281,994	2017年10月24日	3,756
澳元 255,708	美元 202,824	2017年10月24日	2,220
澳元 102,227	美元 81,798	2017年10月24日	1,601
澳元 418,547	美元 328,553	2017年10月24日	203
澳元 63,984	美元 50,355	2017年10月24日	159

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／(亏损) 美元
澳元 49,935	美元 39,250	2017年10月24日	76
澳元 1,413	美元 1,138	2017年10月24日	30
澳元 1,377	美元 1,106	2017年10月24日	26
澳元 1,383	美元 1,109	2017年10月24日	24
澳元 1,380	美元 1,104	2017年10月24日	21
澳元 1,369	美元 1,094	2017年10月24日	20
澳元 1,374	美元 1,095	2017年10月24日	17
澳元 100,824	美元 79,108	2017年10月24日	12
澳元 1,385	美元 1,090	2017年10月24日	3
加元 2,436,561	美元 1,998,700	2017年10月24日	50,075
加元 1,383,626	美元 1,139,160	2017年10月24日	32,613
加元 1,233,491	美元 1,013,529	2017年10月24日	27,052
加元 4,125,693	美元 3,324,363	2017年10月24日	24,864
加元 938,372	美元 763,874	2017年10月24日	13,416
加元 594,402	美元 487,606	2017年10月24日	12,236
加元 538,254	美元 440,329	2017年10月24日	9,864
加元 382,918	美元 315,335	2017年10月24日	9,098
加元 553,416	美元 448,607	2017年10月24日	6,015
加元 481,265	美元 389,977	2017年10月24日	5,088
加元 181,625	美元 149,605	2017年10月24日	4,351
加元 247,661	美元 201,418	2017年10月24日	3,353
加元 163,902	美元 134,212	2017年10月24日	3,133
加元 469,979	美元 378,879	2017年10月24日	3,016
加元 137,188	美元 112,007	2017年10月24日	2,292
加元 260,865	美元 210,462	2017年10月24日	1,836
加元 206,022	美元 166,338	2017年10月24日	1,573
加元 125,837	美元 101,973	2017年10月24日	1,335
加元 341,481	美元 274,225	2017年10月24日	1,128
加元 175,122	美元 140,520	2017年10月24日	467
加元 4,504	美元 3,651	2017年10月24日	49
加元 1,346	美元 1,108	2017年10月24日	32
加元 1,336	美元 1,100	2017年10月24日	32
加元 1,341	美元 1,100	2017年10月24日	28
加元 1,336	美元 1,096	2017年10月24日	27
加元 1,344	美元 1,094	2017年10月24日	19
加元 1,363	美元 1,102	2017年10月24日	12
加元 1,358	美元 1,096	2017年10月24日	10
加元 1,360	美元 1,092	2017年10月24日	4
人民币 480,715,725	美元 73,500,000	2017年10月24日	1,271,659
人民币 241,155,500	美元 36,500,000	2017年10月24日	265,983
人民币 184,982,000	美元 28,000,000	2017年10月24日	206,145
人民币 10,789,618	美元 1,659,585	2017年10月24日	38,427
人民币 15,483,555	美元 2,360,912	2017年10月24日	34,482
人民币 9,123,023	美元 1,391,464	2017年10月24日	20,714
人民币 8,411,464	美元 1,284,409	2017年10月24日	20,572
人民币 6,167,167	美元 942,743	2017年10月24日	16,115
人民币 8,384,105	美元 1,275,452	2017年10月24日	15,726
人民币 6,233,373	美元 952,084	2017年10月24日	15,509
人民币 8,814,643	美元 1,338,711	2017年10月24日	14,296
人民币 5,991,291	美元 913,577	2017年10月24日	13,375
人民币 7,999,588	美元 1,215,186	2017年10月24日	13,235
人民币 5,828,448	美元 888,074	2017年10月24日	12,340
人民币 6,876,860	美元 1,043,800	2017年10月24日	10,541
人民币 3,875,905	美元 592,772	2017年10月24日	10,411
人民币 6,554,089	美元 993,510	2017年10月24日	8,747
人民币 2,723,342	美元 417,058	2017年10月24日	7,871
人民币 5,056,611	美元 766,257	2017年10月24日	6,493
人民币 9,121,451	美元 1,376,573	2017年10月24日	6,059
人民币 2,419,090	美元 368,594	2017年10月24日	5,122
人民币 1,331,834	美元 204,854	2017年10月24日	4,743
人民币 1,741,808	美元 266,261	2017年10月24日	4,552
人民币 1,713,524	美元 261,651	2017年10月24日	4,191
人民币 1,637,799	美元 249,801	2017年10月24日	3,719

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／(亏损) 美元
人民币 1,444,001	美元 220,556	2017年10月24日	3,593
人民币 1,584,047	美元 240,977	2017年10月24日	2,971
人民币 1,233,398	美元 188,067	2017年10月24日	2,747
人民币 1,281,442	美元 194,617	2017年10月24日	2,078
人民币 6,591,631	美元 991,851	2017年10月24日	1,448
人民币 1,383,633	美元 208,812	2017年10月24日	919
人民币 9,500,583	美元 1,428,284	2017年10月24日	805
人民币 453,447	美元 68,826	2017年10月24日	695
人民币 3,425,911	美元 515,365	2017年10月24日	616
人民币 254,773	美元 38,702	2017年10月24日	421
人民币 2,153,708	美元 323,986	2017年10月24日	387
人民币 132,972	美元 20,364	2017年10月24日	384
人民币 3,880,540	美元 583,435	2017年10月24日	378
人民币 1,673,482	美元 251,811	2017年10月24日	368
人民币 148,817	美元 22,692	2017年10月24日	332
人民币 4,683,559	美元 703,966	2017年10月24日	254
人民币 183,923	美元 27,871	2017年10月24日	236
人民币 2,378,288	美元 357,543	2017年10月24日	202
人民币 65,229	美元 9,888	2017年10月24日	87
人民币 18,624	美元 2,852	2017年10月24日	54
人民币 565,118	美元 84,941	2017年10月24日	31
人民币 303,641	美元 45,652	2017年10月24日	30
人民币 7,313	美元 1,125	2017年10月24日	26
人民币 7,192	美元 1,106	2017年10月24日	26
人民币 7,141	美元 1,094	2017年10月24日	21
人民币 7,218	美元 1,103	2017年10月24日	19
人民币 7,199	美元 1,099	2017年10月24日	18
人民币 7,915	美元 1,207	2017年10月24日	18
人民币 7,182	美元 1,095	2017年10月24日	16
人民币 7,198	美元 1,098	2017年10月24日	16
人民币 7,216	美元 1,099	2017年10月24日	15
人民币 7,244	美元 1,100	2017年10月24日	12
人民币 7,245	美元 1,101	2017年10月24日	12
人民币 7,244	美元 1,100	2017年10月24日	12
人民币 7,206	美元 1,094	2017年10月24日	11
人民币 7,233	美元 1,096	2017年10月24日	10
人民币 7,226	美元 1,095	2017年10月24日	9
人民币 7,231	美元 1,091	2017年10月24日	5
人民币 39,569	美元 5,950	2017年10月24日	4
人民币 53,608	美元 8,058	2017年10月24日	3
人民币 12,010	美元 1,806	2017年10月24日	1
人民币 14,215	美元 2,137	2017年10月24日	1
英镑 338,522	美元 459,413	2017年10月24日	4,914
英镑 191,800	美元 258,916	2017年10月24日	1,406
英镑 2,150	美元 2,920	2017年10月24日	33
印度盾 126,875,000,000	美元 9,423,977	2017年10月24日	15,082
印度卢比 5,161,463,500	美元 79,388,810	2017年10月24日	604,560
纽元 5,083,535,000	美元 45,399,366	2017年10月24日	196,316
纽元 531,842	美元 385,863	2017年10月24日	1,554
纽元 227,355	美元 165,784	2017年10月24日	1,497
纽元 449,991	美元 326,656	2017年10月24日	1,493
纽元 289,906	美元 210,937	2017年10月24日	1,452
纽元 118,148	美元 86,642	2017年10月24日	1,268
纽元 302,765	美元 219,788	2017年10月24日	1,010
纽元 117,083	美元 85,597	2017年10月24日	993
纽元 49,076	美元 36,239	2017年10月24日	777
纽元 83,170	美元 60,413	2017年10月24日	314
纽元 35,524	美元 25,976	2017年10月24日	306
纽元 190,735	美元 137,909	2017年10月24日	84
纽元 183,274	美元 132,465	2017年10月24日	30
纽元 5,846	美元 4,237	2017年10月24日	13
纽元 1,515	美元 1,108	2017年10月24日	13
纽元 1,489	美元 1,088	2017年10月24日	13

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／(亏损) 美元
纽元 1,507	美元 1,094	2017年10月24日	5
纽元 1,522	美元 1,104	2017年10月24日	4
纽元 1,524	美元 1,101	2017年10月24日	0
美元 5,987,373	英镑 4,551,125	2017年10月24日	122,880
美元 262,728	纽元 366,402	2017年10月24日	2,035
美元 846,190	纽元 1,173,000	2017年10月24日	1,420
美元 287,086	纽元 398,567	2017年10月24日	919
美元 812,661	人民币 5,414,443	2017年10月24日	870
美元 258,711	纽元 358,950	2017年10月24日	666
美元 279,439	纽元 387,548	2017年10月24日	604
美元 61,140	纽元 85,209	2017年10月24日	432
美元 355,942	人民币 2,371,500	2017年10月24日	381
美元 476,073	纽元 659,177	2017年10月24日	249
美元 10,144	英镑 7,730	2017年10月24日	234
美元 956,556	加元 1,196,216	2017年10月24日	111
美元 91,739	纽元 127,053	2017年10月24日	69
美元 2,143	英镑 1,624	2017年10月24日	37
韩元 14,791,400,000	美元 12,997,373	2017年10月25日	78,282
人民币 13,693,595	美元 2,090,072	2017年11月8日	34,502
人民币 10,732,233	美元 1,631,333	2017年11月8日	20,298
人民币 6,742,499	美元 1,027,194	2017年11月8日	15,065
人民币 6,872,684	美元 1,046,298	2017年11月8日	14,627
人民币 10,248,930	美元 1,552,050	2017年11月8日	13,564
人民币 6,424,017	美元 974,996	2017年11月8日	10,675
人民币 8,208,614	美元 1,242,746	2017年11月8日	10,536
人民币 5,869,802	美元 890,523	2017年11月8日	9,396
人民币 4,264,809	美元 646,740	2017年11月8日	6,542
人民币 12,758,514	美元 1,917,671	2017年11月8日	2,467
人民币 1,474,072	美元 222,284	2017年11月8日	1,009
人民币 257,542	美元 38,991	2017年11月8日	331
人民币 7,205	美元 1,100	2017年11月8日	18
人民币 7,198	美元 1,097	2017年11月8日	16
人民币 7,198	美元 1,097	2017年11月8日	16
人民币 7,198	美元 1,094	2017年11月8日	14
人民币 7,206	美元 1,093	2017年11月8日	11
人民币 7,233	美元 1,095	2017年11月8日	10
人民币 28,821	美元 4,332	2017年11月8日	6
人民币 7,231	美元 1,090	2017年11月8日	5
澳元 394,799	美元 316,691	2017年11月21日	7,090
澳元 2,750	美元 2,206	2017年11月21日	49
加元 2,842	美元 2,342	2017年11月21日	68
纽元 156,008	美元 113,062	2017年11月21日	393
		未实现总收益	22,278,623

纽元 85,209	美元 61,165	2017年10月3日	(432)
美元 1,102	加元 1,363	2017年10月3日	(12)
美元 50,368	澳元 63,984	2017年10月3日	(160)
美元 166,307	加元 206,022	2017年10月3日	(1,582)
纽元 358,950	美元 258,811	2017年10月4日	(674)
美元 1,091	加元 1,360	2017年10月4日	(4)
美元 39,259	澳元 49,935	2017年10月4日	(75)
加元 1,196,216	美元 956,422	2017年10月6日	(92)
纽元 387,548	美元 279,537	2017年10月6日	(621)
美元 79,124	澳元 100,824	2017年10月6日	(17)
美元 140,502	加元 175,122	2017年10月6日	(471)
人民币 7,327	美元 1,100	2017年10月10日	(1)
人民币 7,341	美元 1,099	2017年10月10日	(4)
人民币 7,348	美元 1,099	2017年10月10日	(6)
人民币 7,353	美元 1,099	2017年10月10日	(7)
人民币 7,353	美元 1,099	2017年10月10日	(7)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／(亏损) 美元
人民币 7,355	美元 1,096	2017年10月10日	(11)
人民币 34,199	美元 5,122	2017年10月10日	(21)
人民币 227,175	美元 34,041	2017年10月10日	(121)
人民币 124,191	美元 18,536	2017年10月10日	(139)
人民币 117,255	美元 17,461	2017年10月10日	(172)
人民币 7,536,629	美元 1,131,918	2017年10月10日	(1,426)
人民币 1,656,394	美元 247,524	2017年10月10日	(1,562)
人民币 2,735,123	美元 409,633	2017年10月10日	(1,670)
人民币 4,219,827	美元 632,324	2017年10月10日	(2,246)
人民币 3,203,808	美元 479,353	2017年10月10日	(2,430)
人民币 5,377,188	美元 803,771	2017年10月10日	(4,841)
人民币 4,620,261	美元 689,608	2017年10月10日	(5,179)
人民币 4,965,128	美元 740,905	2017年10月10日	(5,742)
人民币 9,709,139	美元 1,445,819	2017年10月10日	(14,224)
人民币 12,305,600	美元 1,832,873	2017年10月10日	(17,621)
美元 1,808	人民币 12,010	2017年10月10日	(2)
美元 5,956	人民币 39,569	2017年10月10日	(5)
美元 655	人民币 4,303	2017年10月10日	(8)
美元 2,607	人民币 17,219	2017年10月10日	(17)
美元 85,011	人民币 565,118	2017年10月10日	(29)
美元 7,419	人民币 49,056	2017年10月10日	(42)
美元 4,727	人民币 31,074	2017年10月10日	(54)
美元 4,177	人民币 27,373	2017年10月10日	(61)
美元 5,168	人民币 33,949	2017年10月10日	(62)
美元 4,340	人民币 28,434	2017年10月10日	(65)
美元 5,152	人民币 33,713	2017年10月10日	(82)
美元 30,261	人民币 200,003	2017年10月10日	(185)
美元 16,262	人民币 106,551	2017年10月10日	(239)
美元 704,549	人民币 4,683,559	2017年10月10日	(244)
美元 1,706,825	人民币 11,285,310	2017年10月10日	(9,764)
美元 1,627,760	人民币 10,752,935	2017年10月10日	(10,758)
美元 3,438,872	人民币 22,794,360	2017年10月10日	(11,102)
美元 2,363,901	人民币 15,623,623	2017年10月10日	(14,455)
美元 1,264,442	人民币 8,311,964	2017年10月10日	(14,510)
美元 1,084,587	人民币 7,046,371	2017年10月10日	(24,977)
美元 4,881,456	人民币 32,263,243	2017年10月10日	(29,781)
美元 2,025,552	人民币 13,255,222	2017年10月10日	(32,269)
美元 2,506,519	人民币 16,423,319	2017年10月10日	(36,826)
美元 2,786,022	人民币 18,210,553	2017年10月10日	(47,572)
美元 3,655,057	人民币 23,952,303	2017年10月10日	(53,176)
美元 2,646,986	人民币 17,196,613	2017年10月10日	(61,016)
美元 5,723,183	人民币 37,598,064	2017年10月10日	(69,284)
美元 4,069,829	人民币 26,549,698	2017年10月10日	(77,366)
美元 2,138	人民币 14,215	2017年10月12日	(1)
美元 8,063	人民币 53,608	2017年10月12日	(3)
澳元 25,553	美元 20,013	2017年10月24日	(33)
澳元 551,205	美元 432,207	2017年10月24日	(213)
澳元 40,000,000	美元 31,198,000	2017年10月24日	(182,000)
加元 348,530	美元 278,701	2017年10月24日	(34)
人民币 10,381	美元 1,558	2017年10月24日	(2)
人民币 26,126	美元 3,921	2017年10月24日	(4)
人民币 49,154	美元 7,377	2017年10月24日	(9)
人民币 58,910,368	美元 8,840,755	2017年10月24日	(10,627)
英镑 6,672	美元 8,957	2017年10月24日	(1)
英镑 6,246	美元 8,374	2017年10月24日	(12)
英镑 11,803	美元 15,316	2017年10月24日	(531)
纽元 5,519	美元 3,985	2017年10月24日	(2)
纽元 1,970	美元 1,419	2017年10月24日	(4)
纽元 1,534	美元 1,100	2017年10月24日	(9)
纽元 5,519	美元 3,979	2017年10月24日	(9)
纽元 113,672	美元 81,968	2017年10月24日	(172)
纽元 747,982	美元 540,293	2017年10月24日	(198)
纽元 155,380	美元 111,917	2017年10月24日	(361)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／(亏损) 美元
纽元 142,067	美元 102,270	2017年10月24日	(388)
纽元 266,557	美元 191,145	2017年10月24日	(1,470)
纽元 1,165,799	美元 835,881	2017年10月24日	(6,525)
纽元 38,000,000	美元 27,371,248	2017年10月24日	(87,552)
新加坡元 27,780,800	美元 20,303,224	2017年10月24日	(159,946)
美元 2,041	人民币 13,414	2017年10月24日	(25)
美元 11,952	澳元 15,187	2017年10月24日	(37)
美元 8,731	纽元 12,000	2017年10月24日	(59)
美元 397,868	人民币 2,647,000	2017年10月24日	(152)
美元 402,057	人民币 2,674,868	2017年10月24日	(153)
美元 17,001	加元 21,026	2017年10月24日	(186)
美元 11,248	加元 13,750	2017年10月24日	(252)
美元 396,765	人民币 2,638,882	2017年10月24日	(269)
美元 32,268	澳元 40,686	2017年10月24日	(350)
美元 314,772	人民币 2,092,386	2017年10月24日	(388)
美元 737,835	人民币 4,907,335	2017年10月24日	(501)
美元 20,939	加元 25,435	2017年10月24日	(597)
美元 231,296	纽元 319,124	2017年10月24日	(697)
美元 594,936	人民币 3,954,717	2017年10月24日	(734)
美元 32,811	加元 40,000	2017年10月24日	(821)
美元 227,700	纽元 313,852	2017年10月24日	(911)
美元 80,661	澳元 101,584	2017年10月24日	(968)
美元 88,859	纽元 121,520	2017年10月24日	(1,049)
美元 644,202	澳元 819,625	2017年10月24日	(1,206)
美元 265,033	纽元 364,885	2017年10月24日	(1,368)
美元 164,282	人民币 1,083,700	2017年10月24日	(1,456)
美元 357,153	纽元 492,010	2017年10月24日	(1,627)
美元 381,097	纽元 525,020	2017年10月24日	(1,718)
美元 217,221	英镑 160,453	2017年10月24日	(1,796)
美元 257,884	加元 320,038	2017年10月24日	(1,935)
美元 238,849	人民币 1,573,500	2017年10月24日	(2,431)
美元 85,479	加元 103,781	2017年10月24日	(2,480)
美元 88,752	加元 107,800	2017年10月24日	(2,539)
美元 161,148	加元 198,151	2017年10月24日	(2,678)
美元 145,323	澳元 181,707	2017年10月24日	(2,775)
美元 171,920	澳元 215,545	2017年10月24日	(2,826)
美元 636,571	人民币 4,217,605	2017年10月24日	(2,872)
美元 178,463	加元 219,240	2017年10月24日	(3,126)
美元 702,341	人民币 4,653,367	2017年10月24日	(3,169)
美元 381,891	人民币 2,519,795	2017年10月24日	(3,292)
美元 371,089	纽元 508,906	2017年10月24日	(3,355)
美元 247,224	人民币 1,621,226	2017年10月24日	(3,637)
美元 207,876	人民币 1,354,805	2017年10月24日	(4,320)
美元 193,947	加元 236,879	2017年10月24日	(4,504)
美元 222,815	加元 272,921	2017年10月24日	(4,547)
美元 358,807	加元 442,751	2017年10月24日	(4,718)
美元 377,166	加元 465,371	2017年10月24日	(4,987)
美元 458,235	人民币 3,016,550	2017年10月24日	(4,999)
美元 599,341	人民币 3,954,575	2017年10月24日	(5,167)
美元 186,192	加元 226,194	2017年10月24日	(5,294)
美元 326,149	人民币 2,135,128	2017年10月24日	(5,349)
美元 616,896	人民币 4,069,408	2017年10月24日	(5,468)
美元 240,052	澳元 298,917	2017年10月24日	(5,552)
美元 404,245	人民币 2,652,790	2017年10月24日	(5,666)
美元 478,209	人民币 3,143,100	2017年10月24日	(5,960)
美元 567,117	人民币 3,733,818	2017年10月24日	(6,112)
美元 641,045	人民币 4,223,108	2017年10月24日	(6,524)
美元 356,897	澳元 446,529	2017年10月24日	(6,596)
美元 284,317	澳元 353,741	2017年10月24日	(6,809)
美元 682,425	人民币 4,492,988	2017年10月24日	(7,355)
美元 489,538	澳元 614,392	2017年10月24日	(7,549)
美元 698,524	纽元 955,513	2017年10月24日	(8,074)
美元 484,792	人民币 3,170,923	2017年10月24日	(8,366)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／(亏损) 美元
美元 649,087	加元 801,023	2017年10月24日	(8,472)
美元 688,478	人民币 4,525,124	2017年10月24日	(8,581)
美元 369,424	澳元 459,923	2017年10月24日	(8,616)
美元 681,219	人民币 4,470,385	2017年10月24日	(9,549)
美元 881,643	人民币 5,803,839	2017年10月24日	(9,619)
美元 695,894	人民币 4,563,531	2017年10月24日	(10,228)
美元 714,018	纽元 973,713	2017年10月24日	(10,417)
美元 432,934	加元 527,784	2017年10月24日	(10,840)
美元 823,504	澳元 1,035,875	2017年10月24日	(10,862)
美元 527,455	纽元 714,266	2017年10月24日	(11,331)
美元 857,315	人民币 5,622,023	2017年10月24日	(12,612)
美元 480,315	澳元 596,086	2017年10月24日	(12,688)
美元 585,193	人民币 3,804,000	2017年10月24日	(13,653)
美元 900,197	澳元 1,128,860	2017年10月24日	(14,609)
美元 763,945	人民币 4,965,965	2017年10月24日	(17,823)
美元 1,300,847	人民币 8,527,867	2017年10月24日	(19,545)
美元 955,210	人民币 6,225,454	2017年10月24日	(19,850)
美元 1,135,329	澳元 1,419,268	2017年10月24日	(21,918)
美元 1,228,275	人民币 8,019,600	2017年10月24日	(23,346)
美元 1,454,184	人民币 9,522,000	2017年10月24日	(23,517)
美元 1,361,918	人民币 8,907,849	2017年10月24日	(23,528)
美元 1,333,333	澳元 1,669,323	2017年10月24日	(23,754)
美元 1,564,862	人民币 10,246,720	2017年10月24日	(25,307)
美元 1,533,330	人民币 10,029,000	2017年10月24日	(26,490)
美元 1,006,300	澳元 1,247,689	2017年10月24日	(27,493)
美元 1,903,038	人民币 12,475,606	2017年10月24日	(28,593)
美元 2,040,474	人民币 13,381,022	2017年10月24日	(29,991)
美元 1,946,603	人民币 12,732,319	2017年10月24日	(33,594)
美元 1,966,345	人民币 12,838,575	2017年10月24日	(37,375)
美元 2,022,502	澳元 2,523,352	2017年10月24日	(42,941)
美元 24,124,514	印度卢比 1,550,000,000	2017年10月24日	(466,794)
美元 54,176,404	纽元 74,306,881	2017年10月24日	(482,452)
美元 34,393,276	人民币 225,155,237	2017年10月24日	(564,042)
美元 137,045,188	人民币 887,999,368	2017年10月24日	(3,626,403)
美元 121,522,291	加元 147,057,527	2017年10月24日	(3,913,123)
美元 176,423,768	澳元 217,973,696	2017年10月24日	(5,424,442)
美元 564,119,405	人民币 3,655,273,737	2017年10月24日	(14,927,369)
印尼盾 365,715,000,000	美元 27,000,000	2017年11月2日	(107,554)
人民币 30,966	美元 4,640	2017年11月8日	(9)
人民币 2,422,348	美元 363,199	2017年11月8日	(424)
美元 1,292	人民币 8,511	2017年11月8日	(14)
美元 15,283	人民币 101,685	2017年11月8日	(18)
美元 1,480	人民币 9,720	2017年11月8日	(21)
美元 1,698	人民币 11,153	2017年11月8日	(24)
美元 10,382	人民币 68,041	2017年11月8日	(169)
美元 16,258	人民币 106,551	2017年11月8日	(264)
美元 1,420,232	人民币 9,456,384	2017年11月8日	(719)
美元 1,189,294	人民币 7,913,158	2017年11月8日	(1,439)
美元 6,548,099	人民币 43,603,168	2017年11月8日	(2,753)
美元 1,672,130	人民币 11,089,123	2017年11月8日	(7,538)
美元 1,197,848	人民币 7,911,920	2017年11月8日	(10,198)
美元 1,111,776	人民币 7,325,390	2017年11月8日	(12,175)
美元 2,085,943	人民币 13,773,902	2017年11月8日	(18,358)
美元 1,522,658	人民币 10,017,545	2017年11月8日	(18,948)
美元 1,373,135	人民币 8,998,768	2017年11月8日	(22,363)
美元 2,558,377	人民币 16,870,750	2017年11月8日	(25,935)
美元 1,620,300	人民币 10,619,004	2017年11月8日	(26,320)
美元 2,720,714	人民币 17,930,884	2017年11月8日	(29,140)
美元 2,282,877	人民币 14,995,064	2017年11月8日	(32,011)
美元 2,942,646	人民币 19,260,638	2017年11月8日	(51,510)
美元 3,496,611	人民币 22,950,597	2017年11月8日	(51,568)
美元 3,593,402	人民币 23,543,140	2017年11月8日	(59,428)
美元 682,104,987	人民币 4,464,613,147	2017年11月8日	(11,939,980)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 147,282	纽元 203,025	2017年11月21日	(658)
美元 515,199	纽元 710,921	2017年11月21日	(1,773)
美元 220,448	加元 267,148	2017年11月21日	(6,761)
美元 315,619	加元 383,082	2017年11月21日	(9,200)
美元 439,365	澳元 547,123	2017年11月21日	(10,317)
美元 769,492	澳元 959,392	2017年11月21日	(17,147)
印尼盾 527,708,200,000	美元 38,654,278	2018年1月8日	(169,999)
美元 28,180,657	印尼盾 375,000,000,000	2018年1月8日	(596,759)
		未实现总亏损	(44,397,239)
<hr/>			
已平仓但未结算之合约			
泰铢 100,000,000	美元 2,966,215	2017年10月24日	
美元 3,010,597	泰铢 100,000,000	2017年10月24日	(44,383)
泰铢 281,750,700	美元 8,357,331	2017年10月24日	
美元 8,483,912	泰铢 281,750,700	2017年10月24日	(126,580)
林吉特 90,510,000	美元 21,053,734	2017年10月25日	
美元 21,550,000	林吉特 90,510,000	2017年10月25日	(496,266)
		未实现总亏损	(45,064,468)
<hr/>			
		未实现净亏损	(22,785,845)

2016

未平仓合约:

人民币 10,337,491	美元 1,551,517	2016年10月11日	2,458
人民币 13,583,899	美元 2,036,519	2016年10月11日	990
人民币 11,682,766	美元 1,751,056	2016年10月11日	409
人民币 7,299	美元 1,094	2016年10月11日	1
人民币 16,262	美元 2,438	2016年10月11日	1
美元 387,180,711	人民币 2,587,241,788	2016年10月11日	513,982
美元 387,397,217	人民币 2,587,242,000	2016年10月11日	297,509
美元 20,261,263	人民币 135,405,980	2016年10月11日	29,141
美元 4,259,541	人民币 28,543,953	2016年10月11日	17,731
美元 3,767,697	人民币 25,256,907	2016年10月11日	17,016
美元 2,713,566	人民币 18,208,209	2016年10月11日	14,910
美元 2,515,488	人民币 16,871,817	2016年10月11日	12,731
美元 2,124,399	人民币 14,246,217	2016年10月11日	10,378
美元 2,774,822	人民币 18,583,536	2016年10月11日	9,896
美元 1,929,504	人民币 12,930,843	2016年10月11日	8,165
美元 2,428,034	人民币 16,255,856	2016年10月11日	7,884
美元 2,553,584	人民币 17,083,339	2016年10月11日	6,332
美元 2,777,876	人民币 18,575,011	2016年10月11日	5,565
美元 1,522,353	人民币 10,194,241	2016年10月11日	5,240
美元 2,403,068	人民币 16,068,355	2016年10月11日	4,753
美元 1,873,342	人民币 12,529,778	2016年10月11日	4,228
美元 996,584	人民币 6,675,088	2016年10月11日	3,669
美元 2,098,373	人民币 14,021,097	2016年10月11日	2,670
美元 2,429,388	人民币 16,229,379	2016年10月11日	2,563
美元 1,420,052	人民币 9,493,674	2016年10月11日	2,562
美元 1,309,348	人民币 8,753,348	2016年10月11日	2,330
美元 3,113,171	人民币 20,786,852	2016年10月11日	1,711
美元 429,572	人民币 2,876,201	2016年10月11日	1,423

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／(亏损) 美元
美元 1,176,241	人民币 7,854,407	2016年10月11日	731
美元 23,758	人民币 159,350	2016年10月11日	120
美元 9,926	人民币 66,578	2016年10月11日	51
美元 9,963	人民币 66,706	2016年10月11日	32
美元 7,643	人民币 51,184	2016年10月11日	27
美元 11,139	人民币 74,487	2016年10月11日	22
美元 4,166	人民币 27,938	2016年10月11日	20
美元 4,060	人民币 27,218	2016年10月11日	18
美元 9,540	人民币 63,749	2016年10月11日	13
美元 5,551	人民币 37,118	2016年10月11日	11
美元 5,547	人民币 37,085	2016年10月11日	10
美元 5,214	人民币 34,860	2016年10月11日	9
美元 1,295	人民币 8,696	2016年10月11日	8
美元 4,312	人民币 28,829	2016年10月11日	8
美元 1,377	人民币 9,220	2016年10月11日	4
美元 1,592	人民币 10,637	2016年10月11日	2
澳元 2,970,655	美元 2,282,533	2016年10月17日	9,684
澳元 1,432,496	美元 1,098,524	2016年10月17日	2,521
澳元 915,524	美元 702,003	2016年10月17日	1,535
澳元 4,515	美元 3,467	2016年10月17日	13
澳元 4,097	美元 3,141	2016年10月17日	7
加元 635,921	美元 495,354	2016年10月17日	11,433
加元 720,218	美元 559,018	2016年10月17日	10,948
加元 728,159	美元 563,187	2016年10月17日	9,075
加元 789,577	美元 606,215	2016年10月17日	5,365
加元 372,150	美元 288,460	2016年10月17日	5,263
加元 321,030	美元 248,859	2016年10月17日	4,562
加元 518,647	美元 398,533	2016年10月17日	3,854
加元 703,018	美元 536,885	2016年10月17日	1,904
加元 240,219	美元 184,517	2016年10月17日	1,716
加元 51,864	美元 40,133	2016年10月17日	666
加元 43,883	美元 33,911	2016年10月17日	517
加元 241,802	美元 184,356	2016年10月17日	350
加元 249,704	美元 190,197	2016年10月17日	178
加元 25,196	美元 19,345	2016年10月17日	172
加元 22,521	美元 17,217	2016年10月17日	79
加元 674,769	美元 513,538	2016年10月17日	54
加元 1,422	美元 1,107	2016年10月17日	26
加元 1,419	美元 1,100	2016年10月17日	20
加元 514,534	美元 391,567	2016年10月17日	18
加元 1,415	美元 1,094	2016年10月17日	17
加元 18,907	美元 14,404	2016年10月17日	16
加元 1,433	美元 1,096	2016年10月17日	5
加元 19,375	美元 14,745	2016年10月17日	1
加元 1,432	美元 1,091	2016年10月17日	1
英镑 102,786	美元 136,977	2016年10月17日	3,418
英镑 78,068	美元 102,282	2016年10月17日	841
英镑 24,046	美元 31,816	2016年10月17日	571
英镑 44,376	美元 58,190	2016年10月17日	528
英镑 19,749	美元 26,083	2016年10月17日	421
英镑 11,890	美元 15,834	2016年10月17日	384
英镑 13,613	美元 17,854	2016年10月17日	165
英镑 2,820	美元 3,698	2016年10月17日	33
英镑 840	美元 1,118	2016年10月17日	27
英镑 834	美元 1,100	2016年10月17日	16
英镑 841	美元 1,099	2016年10月17日	6
纽元 3,128,092	美元 2,323,416	2016年10月17日	49,919
纽元 632,635	美元 470,718	2016年10月17日	10,919
纽元 514,799	美元 377,779	2016年10月17日	3,623
纽元 957,129	美元 698,054	2016年10月17日	2,412
纽元 431,426	美元 315,374	2016年10月17日	1,813
纽元 510,966	美元 372,764	2016年10月17日	1,394
纽元 343,996	美元 251,123	2016年10月17日	1,107

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
纽元 145,560	美元 106,343	2016年10月17日	551
纽元 269,120	美元 196,138	2016年10月17日	542
纽元 161,848	美元 117,953	2016年10月17日	322
纽元 71,705	美元 52,412	2016年10月17日	296
纽元 17,213	美元 12,732	2016年10月17日	221
纽元 505,253	美元 367,356	2016年10月17日	137
纽元 16,071	美元 11,742	2016年10月17日	62
纽元 171,751	美元 124,885	2016年10月17日	57
纽元 1,485	美元 1,105	2016年10月17日	26
纽元 1,476	美元 1,096	2016年10月17日	24
纽元 3,372	美元 2,475	2016年10月17日	24
纽元 24,877	美元 18,103	2016年10月17日	23
纽元 1,505	美元 1,113	2016年10月17日	19
纽元 2,739	美元 2,007	2016年10月17日	17
纽元 2,696	美元 1,971	2016年10月17日	11
纽元 1,506	美元 1,104	2016年10月17日	9
纽元 1,503	美元 1,098	2016年10月17日	5
纽元 1,509	美元 1,100	2016年10月17日	3
美元 239,810,028	澳元 317,961,878	2016年10月17日	3,463,284
美元 558,972,689	人民币 3,744,558,045	2016年10月17日	1,909,743
美元 64,455,620	纽元 89,299,066	2016年10月17日	447,188
美元 124,229,615	人民币 832,172,697	2016年10月17日	418,216
美元 2,527,307	澳元 3,371,393	2016年10月17日	52,156
美元 1,758,645	澳元 2,344,158	2016年10月17日	34,877
美元 1,937,018	澳元 2,564,113	2016年10月17日	24,790
美元 3,431,888	澳元 4,515,541	2016年10月17日	22,957
美元 1,175,916	澳元 1,565,775	2016年10月17日	22,063
美元 1,444,111	澳元 1,915,132	2016年10月17日	21,161
美元 1,208,856	澳元 1,603,762	2016年10月17日	18,185
美元 2,791,403	加元 3,691,344	2016年10月17日	17,622
美元 1,886,606	纽元 2,618,733	2016年10月17日	16,698
美元 851,095	澳元 1,133,616	2016年10月17日	16,238
美元 1,791,873	澳元 2,357,600	2016年10月17日	11,929
美元 836,766	澳元 1,108,560	2016年10月17日	11,395
美元 2,208,630	人民币 14,820,444	2016年10月17日	11,266
美元 745,629	澳元 986,138	2016年10月17日	8,867
美元 910,481	澳元 1,201,557	2016年10月17日	8,831
美元 5,836,579	人民币 39,017,328	2016年10月17日	7,666
美元 1,628,108	人民币 10,916,941	2016年10月17日	7,098
美元 2,551,541	人民币 17,081,250	2016年10月17日	6,991
美元 299,099	澳元 399,534	2016年10月17日	6,586
美元 6,806,772	人民币 45,483,871	2016年10月17日	6,069
美元 1,665,133	澳元 2,183,783	2016年10月17日	5,681
美元 963,318	人民币 6,469,068	2016年10月17日	5,659
美元 2,014,347	人民币 13,479,904	2016年10月17日	4,753
美元 2,211,657	人民币 14,795,540	2016年10月17日	4,507
美元 1,214,466	人民币 8,137,641	2016年10月17日	4,439
美元 1,050,207	人民币 7,039,856	2016年10月17日	4,265
美元 1,148,422	人民币 7,693,024	2016年10月17日	3,886
美元 891,339	人民币 5,974,942	2016年10月17日	3,624
美元 734,263	人民币 4,925,151	2016年10月17日	3,456
美元 876,535	纽元 1,210,620	2016年10月17日	3,346
美元 967,123	人民币 6,478,892	2016年10月17日	3,324
美元 507,314	人民币 3,408,984	2016年10月17日	3,304
美元 751,975	人民币 5,039,057	2016年10月17日	2,806
美元 2,056,660	人民币 13,749,129	2016年10月17日	2,765
美元 212,631	澳元 280,867	2016年10月17日	2,261
美元 1,240,822	澳元 1,624,626	2016年10月17日	2,180
美元 1,052,756	加元 1,386,220	2016年10月17日	2,125
美元 683,597	人民币 4,575,736	2016年10月17日	1,784
美元 840,627	人民币 5,622,524	2016年10月17日	1,548
美元 545,948	人民币 3,654,843	2016年10月17日	1,496
美元 309,678	加元 408,581	2016年10月17日	1,243

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损)
			美元
美元 328,787	加元 433,668	2016年10月17日	1,224
美元 660,174	加元 869,076	2016年10月17日	1,173
美元 1,044,072	纽元 1,438,135	2016年10月17日	1,165
美元 484,429	人民币 3,241,646	2016年10月17日	1,124
美元 801,989	人民币 5,360,945	2016年10月17日	1,005
美元 809,437	澳元 1,059,211	2016年10月17日	965
美元 211,063	人民币 1,413,939	2016年10月17日	725
美元 152,471	人民币 1,022,060	2016年10月17日	619
美元 445,861	人民币 2,980,658	2016年10月17日	600
美元 570,575	人民币 3,813,263	2016年10月17日	598
美元 117,738	纽元 162,755	2016年10月17日	552
美元 421,341	澳元 551,309	2016年10月17日	465
美元 1,247,829	纽元 1,717,490	2016年10月17日	443
美元 742,176	澳元 970,510	2016年10月17日	361
美元 327,459	纽元 451,029	2016年10月17日	348
美元 275,799	英镑 212,514	2016年10月17日	342
美元 69,101	人民币 463,500	2016年10月17日	325
美元 42,149	英镑 32,521	2016年10月17日	110
美元 77,435	人民币 517,653	2016年10月17日	102
美元 110,863	人民币 740,800	2016年10月17日	99
美元 33,319	人民币 222,897	2016年10月17日	68
美元 3,338	澳元 4,428	2016年10月17日	50
美元 33,899	人民币 226,603	2016年10月17日	42
美元 10,748	人民币 72,000	2016年10月17日	36
美元 5,850	人民币 39,291	2016年10月17日	35
美元 1,741	澳元 2,318	2016年10月17日	33
美元 7,491	人民币 50,200	2016年10月17日	28
美元 4,557	人民币 30,600	2016年10月17日	27
美元 3,849	人民币 25,830	2016年10月17日	20
美元 13,188	英镑 10,163	2016年10月17日	17
美元 3,348	人民币 22,465	2016年10月17日	17
美元 4,492	人民币 30,100	2016年10月17日	16
美元 3,087	人民币 20,700	2016年10月17日	13
美元 3,061	人民币 20,519	2016年10月17日	12
美元 263,050	加元 345,687	2016年10月17日	10
美元 2,724	人民币 18,253	2016年10月17日	10
美元 1,369	人民币 9,200	2016年10月17日	9
美元 3,288	人民币 22,000	2016年10月17日	8
美元 2,988	人民币 20,000	2016年10月17日	8
美元 1,243	人民币 8,336	2016年10月17日	6
美元 5,985	人民币 40,000	2016年10月17日	6
美元 2,612	人民币 17,471	2016年10月17日	5
美元 1,663	人民币 11,120	2016年10月17日	3
美元 1,211	人民币 8,101	2016年10月17日	2
美元 521	人民币 3,484	2016年10月17日	1
新加坡元 68,125,000	美元 50,000,000	2016年10月19日	29,340
美元 775,613,301	人民币 5,206,885,991	2016年11月9日	3,085,740
美元 3,076,913	人民币 20,648,305	2016年11月9日	11,075
美元 3,439,622	人民币 23,034,737	2016年11月9日	5,247
美元 1,364,959	人民币 9,156,704	2016年11月9日	4,440
美元 1,080,467	人民币 7,250,703	2016年11月9日	3,887
美元 900,768	人民币 6,041,890	2016年11月9日	2,806
美元 1,079,623	人民币 7,235,146	2016年11月9日	2,403
美元 1,027,507	人民币 6,880,434	2016年11月9日	1,469
美元 78,343	人民币 524,645	2016年11月9日	118
美元 24,451	人民币 164,003	2016年11月9日	76
美元 1,666,211	人民币 11,141,761	2016年11月9日	47
美元 9,940	人民币 66,706	2016年11月9日	36
美元 5,521	人民币 37,085	2016年11月9日	25
美元 14,190	人民币 95,031	2016年11月9日	22
美元 7,467	人民币 50,000	2016年11月9日	11
美元 12,928	人民币 86,500	2016年11月9日	8
美元 1,517	人民币 10,165	2016年11月9日	3

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／(亏损) 美元
澳元 174,727	美元 133,899	2016年11月17日	302
澳元 45,036	美元 34,443	2016年11月17日	8
加元 27,610	美元 21,082	2016年11月17日	67
加元 49,478	美元 37,669	2016年11月17日	9
人民币 43,218	美元 6,461	2016年11月17日	1
纽元 154,881	美元 112,727	2016年11月17日	284
纽元 6,078	美元 4,417	2016年11月17日	4
纽元 149,688	美元 108,675	2016年11月17日	2
美元 560,184,028	人民币 3,760,239,211	2016年11月17日	1,880,893
美元 244,915,038	澳元 321,884,768	2016年11月17日	1,199,074
美元 120,108,253	人民币 806,227,487	2016年11月17日	403,280
美元 132,713,431	加元 174,583,059	2016年11月17日	170,556
美元 1,617,054	加元 2,143,268	2016年11月17日	14,291
美元 998,993	加元 1,324,145	2016年11月17日	8,878
美元 2,545,817	人民币 17,081,250	2016年11月17日	7,415
美元 1,645,098	人民币 11,038,544	2016年11月17日	4,896
美元 683,970	人民币 4,591,470	2016年11月17日	2,344
美元 1,146,924	人民币 7,687,464	2016年11月17日	2,162
美元 882,028	人民币 5,914,097	2016年11月17日	1,984
美元 544,724	人民币 3,654,843	2016年11月17日	1,587
美元 352,010	人民币 2,361,974	2016年11月17日	1,048
美元 112,895	纽元 156,145	2016年11月17日	467
美元 717,313	澳元 938,527	2016年11月17日	285
美元 680,734	澳元 890,525	2016年11月17日	162
美元 85,310	英镑 65,667	2016年11月17日	76
美元 594,413	人民币 3,976,914	2016年11月17日	34
美元 572,813	人民币 3,832,399	2016年11月17日	33
美元 6,115	人民币 41,000	2016年11月17日	14
美元 2,979	人民币 20,000	2016年11月17日	10
美元 4,625	人民币 31,000	2016年11月17日	9
美元 5,531	人民币 37,008	2016年11月17日	1
美元 7,279	人民币 48,699	2016年11月17日	0
林吉特 80,813,900	美元 19,900,000	2016年11月30日	362,273
林吉特 81,576,070	美元 19,900,000	2016年11月30日	178,009
美元 14,852,220	印度卢比 1,000,000,000	2016年11月30日	35,692
		未实现总收益	15,213,340

人民币 7,336	美元 1,097	2016年10月11日	(3)
人民币 20,234	美元 3,028	2016年10月11日	(4)
人民币 7,360	美元 1,098	2016年10月11日	(5)
人民币 7,364	美元 1,098	2016年10月11日	(6)
人民币 7,357	美元 1,097	2016年10月11日	(6)
人民币 23,041	美元 3,446	2016年10月11日	(7)
人民币 12,118	美元 1,809	2016年10月11日	(7)
人民币 29,345	美元 4,388	2016年10月11日	(10)
人民币 57,900	美元 8,665	2016年10月11日	(12)
人民币 17,917	美元 2,673	2016年10月11日	(12)
人民币 37,085	美元 5,539	2016年10月11日	(18)
人民币 66,706	美元 9,969	2016年10月11日	(27)
人民币 61,636	美元 9,190	2016年10月11日	(46)
人民币 83,077	美元 12,389	2016年10月11日	(60)
人民币 162,512	美元 24,290	2016年10月11日	(62)
人民币 112,512	美元 16,789	2016年10月11日	(71)
人民币 6,454,996	美元 966,244	2016年10月11日	(1,029)
人民币 10,940,711	美元 1,637,007	2016年10月11日	(2,444)
人民币 15,434,684	美元 2,309,994	2016年10月11日	(2,873)
人民币 7,250,703	美元 1,083,583	2016年10月11日	(2,925)
人民币 16,226,386	美元 2,428,245	2016年10月11日	(3,257)
人民币 11,658,378	美元 1,743,583	2016年10月11日	(3,410)
人民币 13,260,743	美元 1,982,748	2016年10月11日	(4,356)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
人民币 27,682,433	美元 4,142,681	2016年10月11日	(5,494)
人民币 9,030,692	美元 1,347,657	2016年10月11日	(5,580)
人民币 19,571,705	美元 2,927,017	2016年10月11日	(5,776)
人民币 6,610,097	美元 984,058	2016年10月11日	(6,456)
人民币 9,058,797	美元 1,350,322	2016年10月11日	(7,126)
人民币 12,509,427	美元 1,866,594	2016年10月11日	(7,927)
人民币 20,648,305	美元 3,085,961	2016年10月11日	(8,159)
人民币 15,668,123	美元 2,339,466	2016年10月11日	(8,381)
人民币 27,620,498	美元 4,128,396	2016年10月11日	(10,498)
人民币 17,146,538	美元 2,556,807	2016年10月11日	(12,578)
人民币 22,277,663	美元 3,324,222	2016年10月11日	(14,056)
人民币 27,161,963	美元 4,055,471	2016年10月11日	(14,713)
人民币 30,712,690	美元 4,587,414	2016年10月11日	(14,841)
人民币 21,072,662	美元 3,142,582	2016年10月11日	(15,128)
人民币 21,645,847	美元 3,227,070	2016年10月11日	(16,531)
人民币 27,051,929	美元 4,035,313	2016年10月11日	(18,382)
人民币 28,072,061	美元 4,185,631	2016年10月11日	(20,930)
人民币 5,206,885,991	美元 777,640,442	2016年10月11日	(2,604,409)
美元 4,008	人民币 26,741	2016年10月11日	(1)
美元 1,793	人民币 11,950	2016年10月11日	(3)
美元 1,528,240	人民币 10,193,055	2016年10月11日	(824)
美元 4,291,998	人民币 28,633,388	2016年10月11日	(1,323)
美元 1,799,321	人民币 11,988,351	2016年10月11日	(2,883)
澳元 1,453	美元 1,110	2016年10月17日	(1)
澳元 1,442	美元 1,102	2016年10月17日	(2)
澳元 3,750	美元 2,859	2016年10月17日	(10)
澳元 1,456	美元 1,103	2016年10月17日	(11)
澳元 1,455	美元 1,099	2016年10月17日	(15)
澳元 1,454	美元 1,091	2016年10月17日	(22)
澳元 3,164	美元 2,392	2016年10月17日	(28)
澳元 19,733	美元 14,794	2016年10月17日	(303)
澳元 1,052,548	美元 804,851	2016年10月17日	(454)
澳元 26,269	美元 19,602	2016年10月17日	(497)
澳元 68,622	美元 51,845	2016年10月17日	(658)
澳元 40,663	美元 30,445	2016年10月17日	(666)
澳元 35,593	美元 26,556	2016年10月17日	(676)
澳元 1,161,982	美元 888,096	2016年10月17日	(937)
澳元 496,796	美元 377,605	2016年10月17日	(2,494)
澳元 1,314,074	美元 1,001,863	2016年10月17日	(3,535)
澳元 3,605,857	美元 2,754,156	2016年10月17日	(4,685)
澳元 1,041,857	美元 791,948	2016年10月17日	(5,177)
澳元 535,203	美元 403,473	2016年10月17日	(6,011)
澳元 667,040	美元 503,572	2016年10月17日	(6,780)
澳元 1,055,672	美元 799,824	2016年10月17日	(7,871)
澳元 846,360	美元 639,406	2016年10月17日	(8,144)
澳元 1,110,139	美元 839,476	2016年10月17日	(9,892)
澳元 1,928,529	美元 1,461,422	2016年10月17日	(14,096)
澳元 1,056,577	美元 793,262	2016年10月17日	(15,125)
澳元 1,017,211	美元 762,831	2016年10月17日	(15,437)
澳元 1,274,393	美元 957,156	2016年10月17日	(17,882)
澳元 2,093,243	美元 1,578,478	2016年10月17日	(23,062)
澳元 2,100,819	美元 1,583,538	2016年10月17日	(23,799)
澳元 6,312,292	美元 4,736,019	2016年10月17日	(93,515)
澳元 321,884,768	美元 245,086,603	2016年10月17日	(1,187,433)
加元 1,454	美元 1,102	2016年10月17日	(4)
加元 1,451	美元 1,097	2016年10月17日	(7)
加元 10,141	美元 7,708	2016年10月17日	(9)
加元 3,311	美元 2,510	2016年10月17日	(10)
加元 5,241	美元 3,974	2016年10月17日	(15)
加元 160,283	美元 121,734	2016年10月17日	(238)
加元 87,843	美元 66,582	2016年10月17日	(264)
加元 668,667	美元 508,328	2016年10月17日	(512)
加元 205,999	美元 156,140	2016年10月17日	(620)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／(亏损) 美元
加元 319,406	美元 242,170	2016年10月17日	(890)
加元 174,583,059	美元 132,686,087	2016年10月17日	(167,622)
人民币 7,346	美元 1,099	2016年10月17日	(1)
人民币 9,799	美元 1,466	2016年10月17日	(2)
人民币 7,361	美元 1,100	2016年10月17日	(2)
人民币 7,346	美元 1,099	2016年10月17日	(2)
人民币 10,083	美元 1,507	2016年10月17日	(3)
人民币 18,544	美元 2,774	2016年10月17日	(3)
人民币 7,336	美元 1,096	2016年10月17日	(3)
人民币 7,350	美元 1,098	2016年10月17日	(3)
人民币 7,366	美元 1,099	2016年10月17日	(4)
人民币 10,904	美元 1,629	2016年10月17日	(4)
人民币 7,366	美元 1,099	2016年10月17日	(4)
人民币 7,360	美元 1,098	2016年10月17日	(5)
人民币 7,332	美元 1,094	2016年10月17日	(5)
人民币 11,018	美元 1,643	2016年10月17日	(7)
人民币 20,784	美元 3,106	2016年10月17日	(7)
人民币 10,858	美元 1,620	2016年10月17日	(7)
人民币 71,694	美元 10,720	2016年10月17日	(19)
人民币 293,972	美元 43,967	2016年10月17日	(66)
人民币 410,323	美元 61,323	2016年10月17日	(138)
人民币 174,942	美元 26,035	2016年10月17日	(169)
人民币 872,838	美元 130,559	2016年10月17日	(180)
人民币 657,645	美元 98,321	2016年10月17日	(185)
人民币 1,438,982	美元 215,328	2016年10月17日	(211)
人民币 876,418	美元 130,956	2016年10月17日	(319)
人民币 625,166	美元 93,259	2016年10月17日	(382)
人民币 1,069,084	美元 159,733	2016年10月17日	(400)
人民币 1,312,834	美元 195,974	2016年10月17日	(670)
人民币 1,040,872	美元 155,215	2016年10月17日	(693)
人民币 2,698,103	美元 403,205	2016年10月17日	(932)
人民币 1,309,933	美元 195,211	2016年10月17日	(999)
人民币 1,666,882	美元 248,475	2016年10月17日	(1,200)
人民币 5,917,678	美元 885,164	2016年10月17日	(1,220)
人民币 3,654,843	美元 546,217	2016年10月17日	(1,226)
人民币 5,483,443	美元 820,115	2016年10月17日	(1,227)
人民币 8,698,976	美元 1,301,708	2016年10月17日	(1,275)
人民币 2,641,577	美元 394,078	2016年10月17日	(1,593)
人民币 2,867,546	美元 427,919	2016年10月17日	(1,599)
人民币 2,869,859	美元 428,155	2016年10月17日	(1,709)
人民币 11,348,569	美元 1,697,848	2016年10月17日	(2,007)
人民币 2,742,005	美元 408,210	2016年10月17日	(2,504)
人民币 3,294,389	美元 490,927	2016年10月17日	(2,526)
人民币 8,213,143	美元 1,227,456	2016年10月17日	(2,756)
人民币 10,117,823	美元 1,512,667	2016年10月17日	(2,839)
人民币 4,971,523	美元 741,189	2016年10月17日	(3,474)
人民币 10,631,856	美元 1,588,634	2016年10月17日	(3,868)
人民币 11,715,603	美元 1,750,782	2016年10月17日	(4,049)
人民币 7,600,473	美元 1,133,802	2016年10月17日	(4,641)
人民币 9,100,134	美元 1,358,426	2016年10月17日	(4,645)
人民币 12,413,708	美元 1,854,749	2016年10月17日	(4,649)
人民币 4,941,692	美元 735,433	2016年10月17日	(4,762)
人民币 6,873,423	美元 1,024,737	2016年10月17日	(4,804)
人民币 9,496,861	美元 1,417,201	2016年10月17日	(5,294)
人民币 17,081,250	美元 2,552,797	2016年10月17日	(5,731)
人民币 8,675,156	美元 1,293,637	2016年10月17日	(5,778)
人民币 8,579,111	美元 1,278,851	2016年10月17日	(6,178)
人民币 10,969,121	美元 1,636,317	2016年10月17日	(6,701)
人民币 11,898,762	美元 1,775,179	2016年10月17日	(7,086)
人民币 12,126,201	美元 1,809,021	2016年10月17日	(7,312)
人民币 10,008,236	美元 1,489,953	2016年10月17日	(9,139)
人民币 14,284,495	美元 2,128,726	2016年10月17日	(10,889)
人民币 15,206,508	美元 2,266,059	2016年10月17日	(11,660)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／(亏损) 美元
人民币 3,760,239,211	美元 561,564,409	2016年10月17日	(1,666,054)
英镑 1,680	美元 2,178	2016年10月17日	(5)
纽元 12,879	美元 9,359	2016年10月17日	(1)
纽元 3,038	美元 2,206	2016年10月17日	(2)
纽元 1,503	美元 1,087	2016年10月17日	(5)
纽元 569,205	美元 413,308	2016年10月17日	(390)
纽元 190,710	美元 138,099	2016年10月17日	(509)
纽元 160,977	美元 116,462	2016年10月17日	(536)
纽元 145,645	美元 104,950	2016年10月17日	(905)
美元 121,583	纽元 167,264	2016年10月17日	(16)
美元 110,933	纽元 152,555	2016年10月17日	(57)
美元 2,295	英镑 1,722	2016年10月17日	(57)
美元 68,988	纽元 94,823	2016年10月17日	(71)
美元 11,781	纽元 16,077	2016年10月17日	(97)
美元 13,937	英镑 10,631	2016年10月17日	(123)
美元 70,313	纽元 96,502	2016年10月17日	(175)
美元 81,389	纽元 111,569	2016年10月17日	(300)
美元 76,108	加元 99,559	2016年10月17日	(346)
美元 200,462	加元 262,938	2016年10月17日	(372)
美元 74,899	纽元 102,470	2016年10月17日	(424)
美元 14,323	英镑 10,657	2016年10月17日	(475)
美元 207,049	纽元 284,195	2016年10月17日	(496)
美元 92,526	纽元 126,604	2016年10月17日	(510)
美元 34,424	英镑 26,100	2016年10月17日	(510)
美元 115,181	纽元 157,763	2016年10月17日	(519)
美元 137,226	纽元 187,863	2016年10月17日	(687)
美元 29,336	英镑 22,019	2016年10月17日	(725)
美元 414,304	澳元 540,504	2016年10月17日	(764)
美元 149,207	纽元 204,109	2016年10月17日	(861)
美元 981,373	加元 1,288,327	2016年10月17日	(986)
美元 66,548	英镑 50,414	2016年10月17日	(1,040)
美元 154,946	英镑 118,262	2016年10月17日	(1,276)
美元 86,191	加元 111,445	2016年10月17日	(1,384)
美元 184,664	纽元 251,642	2016年10月17日	(1,772)
美元 108,287	纽元 146,487	2016年10月17日	(1,822)
美元 554,974	纽元 760,944	2016年10月17日	(1,921)
美元 879,145	澳元 1,146,450	2016年10月17日	(1,997)
美元 117,314	纽元 158,116	2016年10月17日	(2,397)
美元 535,474	加元 700,312	2016年10月17日	(2,553)
美元 130,042	英镑 98,039	2016年10月17日	(2,649)
美元 305,611	英镑 233,133	2016年10月17日	(2,677)
美元 882,863	澳元 1,150,393	2016年10月17日	(2,698)
美元 690,500	加元 903,778	2016年10月17日	(2,745)
美元 1,296,795	澳元 1,691,321	2016年10月17日	(2,766)
美元 174,815	纽元 236,401	2016年10月17日	(3,000)
美元 129,930	纽元 174,640	2016年10月17日	(3,003)
美元 205,551	加元 266,000	2016年10月17日	(3,131)
美元 359,262	加元 467,909	2016年10月17日	(3,194)
美元 346,831	加元 451,298	2016年10月17日	(3,403)
美元 398,499	加元 518,810	2016年10月17日	(3,696)
美元 235,948	加元 303,984	2016年10月17日	(4,622)
美元 1,422,652	澳元 1,853,226	2016年10月17日	(4,750)
美元 237,967	纽元 320,689	2016年10月17日	(4,893)
美元 219,449	加元 281,677	2016年10月17日	(5,099)
美元 438,389	加元 565,394	2016年10月17日	(8,136)
美元 367,196	加元 471,433	2016年10月17日	(8,445)
美元 455,016	加元 586,800	2016年10月17日	(8,474)
美元 2,083,560	加元 2,725,567	2016年10月17日	(9,465)
美元 458,525	英镑 344,491	2016年10月17日	(10,890)
美元 618,577	加元 797,949	2016年10月17日	(11,354)
美元 785,395	加元 1,014,972	2016年10月17日	(13,024)
美元 7,393,801	英镑 5,645,511	2016年10月17日	(58,007)
美元 125,953,218	加元 164,147,146	2016年10月17日	(1,040,881)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／(亏损) 美元
人民币 163,675,000	美元 24,321,654	2016年10月19日	(191,234)
人民币 442,926,000	美元 65,808,781	2016年10月19日	(526,305)
日元 2,547,687,500	美元 25,000,000	2016年10月19日	(174,255)
日元 5,095,875,000	美元 50,000,000	2016年10月19日	(353,451)
纽元 25,000,000	美元 17,647,250	2016年10月19日	(522,750)
美元 15,334,000	澳元 20,000,000	2016年10月19日	(34,011)
人民币 14,636	美元 2,185	2016年11月9日	(4)
人民币 23,504	美元 3,509	2016年11月9日	(6)
人民币 15,772	美元 2,352	2016年11月9日	(7)
人民币 59,562	美元 8,878	2016年11月9日	(29)
人民币 5,582,632	美元 834,827	2016年11月9日	(59)
人民币 2,836,803	美元 424,096	2016年11月9日	(149)
人民币 1,398,669	美元 208,659	2016年11月9日	(513)
人民币 2,113,037	美元 315,240	2016年11月9日	(766)
人民币 2,876,201	美元 428,216	2016年11月9日	(1,922)
人民币 14,361,315	美元 2,144,171	2016年11月9日	(3,572)
人民币 14,299,414	美元 2,133,873	2016年11月9日	(4,613)
人民币 9,857,235	美元 1,469,128	2016年11月9日	(5,028)
人民币 11,324,583	美元 1,688,488	2016年11月9日	(5,110)
澳元 1,435	美元 1,097	2016年11月17日	(0)
澳元 343,040	美元 262,212	2016年11月17日	(77)
澳元 1,715,939	美元 1,311,714	2016年11月17日	(293)
加元 17,570	美元 13,256	2016年11月17日	(117)
加元 320,544	美元 241,813	2016年11月17日	(2,169)
人民币 7,358	美元 1,100	2016年11月17日	(0)
人民币 7,339	美元 1,097	2016年11月17日	(0)
人民币 43,218	美元 6,459	2016年11月17日	(1)
人民币 7,349	美元 1,097	2016年11月17日	(2)
人民币 7,343	美元 1,094	2016年11月17日	(4)
人民币 20,141	美元 3,000	2016年11月17日	(10)
人民币 201,476	美元 30,047	2016年11月17日	(69)
人民币 8,278,107	美元 1,237,198	2016年11月17日	(168)
人民币 884,996	美元 132,095	2016年11月17日	(189)
人民币 8,820,629	美元 1,318,182	2016年11月17日	(278)
人民币 1,053,108	美元 157,089	2016年11月17日	(323)
人民币 1,021,985	美元 152,410	2016年11月17日	(350)
人民币 2,133,453	美元 318,367	2016年11月17日	(530)
人民币 1,602,175	美元 238,650	2016年11月17日	(834)
人民币 6,296,799	美元 939,278	2016年11月17日	(1,934)
人民币 6,802,468	美元 1,014,464	2016年11月17日	(2,333)
人民币 4,512,805	美元 672,201	2016年11月17日	(2,349)
英镑 848	美元 1,102	2016年11月17日	(0)
英镑 848	美元 1,102	2016年11月17日	(0)
纽元 91,081	美元 65,854	2016年11月17日	(270)
美元 300,020	澳元 392,317	2016年11月17日	(54)
美元 636,205	加元 835,761	2016年11月17日	(65)
美元 146,784	纽元 201,694	2016年11月17日	(355)
美元 1,319,616	纽元 1,816,080	2016年11月17日	(1,144)
美元 943,080	澳元 1,230,693	2016年11月17日	(2,094)
美元 1,144,615	加元 1,498,994	2016年11月17日	(3,654)
印尼盾 336,875,000,000	美元 25,000,000	2016年11月30日	(732,972)
印度卢比 1,539,452,500	美元 22,900,000	2016年11月30日	(18,751)
印度卢比 2,016,268,000	美元 29,800,000	2016年11月30日	(217,389)
美元 15,515,152	林吉特 64,000,000	2016年11月30日	(42,394)
美元 11,663,224	林吉特 48,000,000	2016年11月30日	(58,662)
印尼盾 618,274,200,000	美元 46,746,877	2016年12月2日	(468,886)
韩元 14,791,400,000	美元 13,385,519	2016年12月2日	(32,542)
美元 19,230,769	印尼盾 250,000,000,000	2016年12月2日	(139,477)
		未实现总亏损	(12,086,268)
		未实现净收益	3,127,072

(b) 以下为截至九月三十日之未平仓期货合约：

	合约数多头/ (空头)	合约金额 美元	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
<u>2017</u>				
US 10 Years Note (CBT)	(2,344)	(296,717,438)	2017 年 12 月	2,984,938
US 5 Years Note (CBT)	(1,000)	(118,281,250)	2017 年 12 月	781,250
				3,766,188
<u>2016</u>				
US 10 Years Note (CBT)	(2,666)	(348,825,406)	2016 年 12 月	(753,844)

13 其他收入

本年度本基金收到管理人 169,079 美元（二零一六年：无）作为估值及/或其他操作上误差的补偿。

独立核数师报告

致摩根亚洲总收益债券基金（“贵基金”）单位持有人

财务报表的报告

意见

我们已审计的内容

摩根亚洲总收益债券基金列载于第八页至第四十七页的财务报表，包括：

- 于二零一七年九月三十日的财务状况报表；
- 截至该日止年度的综合收益表；
- 截至该日止年度的可赎回份额持有人应占净资产变动表；
- 截至该日止年度的现金流量表；及
- 财务报表附注，包括主要会计政策概要。

我们的意见

我们认为，该等财务报表已根据香港会计师公会颁布的《香港财务报告准则》真实而中肯地反映了贵基金于二零一七年九月三十日的财政状况及其截至该日止年度的财务交易及现金流量。

意见的基础

我们已根据香港会计师公会颁布的《香港审计准则》进行审计。我们在该等准则下承担的责任已在本报告“核数师就审计财务报表承担的责任”部分中作进一步阐述。

我们相信，我们所获取的审计凭证能充足及适当地为我们的审计意见提供基础。

独立性

根据香港会计师公会颁布的《专业会计师道德守则》（“守则”），我们独立于贵基金，并已履行守则中的其他专业道德责任。

其他信息

贵基金受托人及管理人（“管理层”）须对其他信息负责。其他信息包括年报内的所有信息，但不包括财务报表及我们的核数师报告。

我们对财务报表的意见不涵盖其他信息，我们亦不对该等其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解的情况存在重大抵触或者似乎存在重大错误陈述的迹象。

基于我们已执行的工作，如果我们认为其他信息存在重大错误陈述，我们需要报告该事实。在这方面，我们没有任何报告。

管理层就财务报表须承担的责任

贵基金管理层须负责根据香港会计师公会颁布的《香港财务报告准则》拟备真实而中肯的财务报表，并对其认为为使财务报表的拟备不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述所需的内部控制负责。

在拟备财务报表时，贵基金管理层负责评估贵基金持续经营的能力，并在适用情况下披露与持续经营有关的事项，以及使用持续经营为会计基础，除非管理层有意将贵基金清盘或停止经营，或别无其他实际的替代方案。

另外，贵基金管理层须负责确保财务报表已遵照二零零四年十一月三十日订立的信托契约（经修订）（“信托契约”）以及香港证券及期货事务监察委员会颁布的单位信托及互惠基金守则（“证监会守则”）附录 E 的相关披露条文适当地拟备。

核数师就审计财务报表承担的责任

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

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

- 识别和评估由于欺诈或错误而导致财务报表存在重大错误陈述的风险，设计及执行审计程序以应对这些风险，以及获取充足和适当的审计凭证，作为我们意见的基础。由于欺诈可能涉及串谋、伪造、蓄意遗漏、虚假陈述，或凌驾于内部控制之上，因此未能发现因欺诈而导致的重大错误陈述的风险高于未能发现因错误而导致的重大错误陈述的风险。
- 了解与审计相关的内部控制，以设计适当的审计程序，但目的并非对贵基金内部控制的有效性发表意见。
- 评价管理层所采用会计政策的恰当性及作出会计估计和相关披露的合理性。

独立核数师报告（续）

致摩根亚洲总收益债券基金（“贵基金”）单位持有人

核数师就审计财务报表承担的责任（续）

- 对管理层采用持续经营会计基础的恰当性作出结论。根据所获取的审计凭证，确定是否存在与事项或情况有关的重大不确定性，从而可能导致对贵基金的持续经营能力产生重大疑虑。如果我们认为存在重大不确定性，则有必要在核数师报告中提请使用者注意财务报表中的相关披露。假若有关的披露不足，则我们应当发表非无保留意见。我们的结论是基于核数师报告日止所取得的审计凭证。然而，未来事项或情况可能导致贵基金不能持续经营。
- 评价财务报表的总体列报、结构和内容，包括披露，以及财务报表是否中肯反映交易和事项。

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

根据信托契约与证监会守则相关披露条文就相关事项作出的报告

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

罗兵咸永道会计师事务所
 执业会计师
 香港
 二零一八年一月十九日

管理人及受托人的责任声明

管理人的责任

基金管理人务必遵照香港证券及期货事务监察委员会所颁布的单位信托及互惠基金守则和信托契约编制各年度会计期间的财务报表，该等财务报表真实而中肯地反映基金于该期末的财务状况及截至该日止年度的财务交易。编制该等财务报表时，管理人务必：

- 选择并贯彻地应用适当的会计政策；
- 作出审慎和合理的判断；及
- 按持续营运的基准编制财务报表，除非该假设不恰当。

管理人亦务必遵照信托契约，采取合理措施预防和监测欺诈及其他不法行为。

受托人的责任

基金受托人务必：

- 确保管理人遵照信托契约管理本基金且确保投资及借款能力符合要求；
- 确保已保留充分的会计记录及其他记录；
- （在合理可行的情况下）保护本基金的财产及附带权利；及
- 就每一个会计年度，若管理人未按照信托契约管理本基金，则须向份额持有人报告。

受托人对份额持有人的报告

本受托人谨确认管理人于截至二零一七年九月三十日止财政年度在各个重要方面均依照二零零四年十一月三十日所订立之信托契约（经修订）之条款管理本基金。

汇丰机构信托服务（亚洲）有限公司，受托人
二零一八年一月十九日

业绩记录 - 未经审计

资产净值

财务期结算日	本基金资产净值	每份额资产净值
30/9/17		
- 澳元对冲类别（每月派息）	澳元 219,559,065	澳元 9.09
- 加元对冲类别（每月派息）	加元 137,199,992	加元 9.13
- 英镑对冲类别（每月派息）	英镑 4,157,347	英镑 9.55
- 港元类别（每月派息）	港元 4,487,647,800	港元 9.70
- 纽元对冲类别（每月派息）	纽元 78,391,549	纽元 9.02
- 人民币对冲类别（累计）	人民币 19,181,758	人民币 12.07
- 人民币对冲类别（每月派息）	人民币 4,570,432,055	人民币 9.32
- 美元类别（累计）	美元 14,067,443	美元 12.13
- 美元类别（每月派息）	美元 803,248,157	美元 11.08
- PRC 人民币对冲份额（累计）	人民币 3,796,281,190	人民币 11.48
- PRC 人民币对冲份额（每月派息）	人民币 948,303,236	人民币 10.07
- PRC 美元份额（累计）	美元 640,043,722	美元 10.84
- PRC 美元份额（每月派息）	美元 29,438,715	美元 10.10
30/9/16		
- 澳元对冲类别（每月派息）	澳元 321,280,527	澳元 9.28
- 加元对冲类别（每月派息）	加元 179,196,989	加元 9.32
- 英镑对冲类别（每月派息）	英镑 6,555,386	英镑 9.74
- 港元类别（每月派息）	港元 4,722,528,266	港元 9.82
- 纽元对冲类别（每月派息）	纽元 92,826,121	纽元 9.21
- 人民币对冲类别（累计）	人民币 21,105,857	人民币 11.45
- 人民币对冲类别（每月派息）	人民币 5,166,107,748	人民币 9.57
- 美元类别（累计）	美元 26,539,869	美元 11.88
- 美元类别（每月派息）	美元 919,519,116	美元 11.29
- PRC 人民币对冲份额（累计）	人民币 3,763,109,762	人民币 10.88
- PRC 人民币对冲份额（每月派息）	人民币 799,689,319	人民币 10.32
- PRC 美元份额（累计）	美元 432,075,847	美元 10.61
- PRC 美元份额（每月派息）	美元 18,403,254	美元 10.29
30/9/15		
- 澳元对冲类别（每月派息）	澳元 218,503,411	澳元 9.05
- 加元对冲类别（每月派息）	加元 143,065,587	加元 9.07
- 英镑对冲类别（每月派息）	英镑 883,883	英镑 9.45
- 港元类别（每月派息）	港元 2,473,838,161	港元 9.53
- 纽元对冲类别（每月派息）	纽元 96,923,455	纽元 8.98
- 人民币对冲类别（累计）	人民币 29,073,814	人民币 10.33
- 人民币对冲类别（每月派息）	人民币 6,075,057,512	人民币 9.32
- 美元类别（累计）	美元 31,831,272	美元 11.06
- 美元类别（每月派息）	美元 595,609,359	美元 10.97

最高卖出价/最低买入价

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
30/9/17		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.56	澳元 8.99
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.60	加元 9.03
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.04	英镑 9.43
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.12	港元 9.51
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.50	纽元 8.93
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.11	人民币 11.20
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.86	人民币 9.20
- 美元类别 (累计)	美元 12.24	美元 11.60
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.63	美元 10.95
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.51	人民币 10.63
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.42	人民币 9.92
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.88	美元 10.36
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.38	美元 9.98
30/9/16		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.65	澳元 9.01
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.68	加元 9.03
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.11	英镑 9.41
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.20	港元 9.53
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.58	纽元 8.94
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 11.82	人民币 10.36
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.95	人民币 9.26
- 美元类别 (累计)	美元 12.29	美元 11.09
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.73	美元 10.93
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.00	人民币 10.02
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.53	人民币 10.00
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.77	美元 9.96
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.49	美元 9.96
30/9/15		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.97	澳元 9.05
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.95	加元 9.07
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.35	英镑 9.45
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.46	港元 9.53
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.90	纽元 8.98
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 10.92	人民币 10.12
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.32	人民币 9.32
- 美元类别 (累计)	美元 11.83	美元 11.06
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.04	美元 10.97
30/9/14		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.05	澳元 9.41
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.06	加元 9.42
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.54	港元 9.89
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.00	纽元 9.36
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 10.49	人民币 10.01
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.41	人民币 9.91
- 美元类别 (累计)	美元 11.61	美元 10.53
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.13	美元 11.36
30/9/13		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.46	澳元 9.29
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.46	加元 9.29
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.94	港元 9.73
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.42	纽元 9.24
- 美元类别 (累计)	美元 11.40	美元 10.28
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.58	美元 11.19
30/9/12		
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.68	港元 9.91
- 美元类别 (累计)	美元 10.87	美元 9.97
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.29	美元 10.48

最高卖出价/最低买入价 (续)

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
30/9/11		
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.96	美元 10.68
30/9/10		
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.78	美元 10.45
30/9/09		
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.82	美元 7.98
30/9/08		
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.52	美元 9.75

经营与管理

管理人及服务提供者

摩根基金（亚洲）有限公司
香港
中环干诺道中 8 号
遮打大厦 21 楼

投资管理人

JF 资产管理有限公司
香港
中环干诺道中 8 号
遮打大厦 21 楼

助理管理人

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

管理人董事

于二零一八年一月十九日
David James MUNDY
Edwin Tsun Kay CHAN
Kheng Leong CHEAH
Michael Irving FALCON
Qionghui WANG

受托人

汇丰机构信托服务
（亚洲）有限公司
香港
中环皇后大道中 1 号

基金注册登记机构

HSBC Trustee (Cayman) Limited
P.O. Box 484
HSBC House
68 West Bay Road
Grand Cayman KY1-1106
Cayman Islands

核数师

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

