

半年度报告—2018年3月31日（未经审核）

摩根亚洲总收益 债券基金



内地与香港互认基金系列

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之股份类别之资产。

内容	页
投资组合	1 - 5
投资组合持有变动表	6
财务状况表	7
综合收益表	7
可赎回份额持有人应占净资产变动表	8
现金流量表	8
财务报表之附注	9 - 15

投资组合

截至二零一八年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比
上市投资(94.0%)				百慕大(0.7%)			
(I) 可换股(5.7%)				GCL New Energy 7.1%			
中国(2.3%)				30/01/21-RegS 美元 15,900,000 15,637,297 0.5			
China Railway Con CB				Gome Retail Hldgs			
1.5%12/21-RegS 人民币 235,000,000 35,061,502 1.1				5%10/03/20-RegS 美元 8,400,000 8,373,167 0.2			
CRRG Group CB 0%				开曼群岛(13.4%)			
05/02/21-RegS 美元 23,000,000 23,583,510 0.7				Azure Orbit IV 3.75%			
Kunlun Energy CB				25/01/23-RegS 美元 25,000,000 24,724,479 0.8			
1.625% 07/19-RegS 人民币 100,000,000 16,460,961 0.5				CAR Inc 6% 11/02/21-RegS 美元 7,900,000 7,996,775 0.2			
香港(0.6%)				CAR Inc 6.125%			
Bagan Capital CB0%				04/02/20-RegS 美元 14,700,000 14,973,685 0.5			
23/09/21 美元 5,800,000 5,660,394 0.2				CDBL Funding Two 3%			
Cosmos Boom Inv CB				01/08/22-RegS 美元 25,200,000 24,504,480 0.8			
0.5%06/20-RegS 美元 13,200,000 13,112,550 0.4				CIFI Hldgs 5.5%			
日本(0.6%)				23/01/22-RegS 美元 15,000,000 14,438,575 0.4			
Tohoku Elec Power CB				CIFI Hldgs Group			
0% 03/12/20 日元 2,000,000,000 18,641,279 0.6				7.75% 05/06/20 美元 6,000,000 6,406,125 0.2			
马来西亚(0.2%)				CK Hutchison Cap VRN			
Cahaya Capit				4% Perp-RegS 美元 36,200,000 36,071,690 1.1			
EB(Tenaga)				ENN Energy Hldgs			
0%9/21-RegS 美元 6,300,000 6,550,425 0.2				3.25% 07/22-RegS 美元 18,400,000 18,012,476 0.6			
新加坡(1.1%)				Fantasia Hldgs 8.375%			
CapitaLand Ltd CB				08/03/21-RegS 美元 25,300,000 25,186,993 0.8			
1.85%19/6/20-RegS 新加坡元 17,750,000 13,175,724 0.4				FWD Ltd 5%			
CapitaLand Ltd CB				24/09/24-RegS 美元 16,800,000 17,398,267 0.5			
2.8% 8/06/25-RegS 新加坡元 32,250,000 24,403,194 0.7				FWD Ltd VRN 0%			
台湾(0.4%)				Perp-RegS 美元 20,000,000 14,602,000 0.4			
Zhen Ding Technology				Greenland HK Hldgs			
CB 0% 26/06/19 美元 14,900,000 15,006,088 0.4				3.875%07/19-RegS 美元 29,150,000 28,920,266 0.9			
维京群岛(0.5%)				KWG Property Hldg			
Shanghai Port				6% 15/09/22-RegS 美元 17,400,000 16,839,430 0.5			
EB(PSBOC) 0%8/21-RegS 美元 7,800,000 8,113,404 0.3				Logan Property			
Shanghai Port				Hldgs5.25%02/23-RegS 美元 20,100,000 18,690,236 0.6			
EB(PSBOC) 0%8/22-RegS 美元 7,000,000 7,285,670 0.2				Overseas Chinese			
				VRN4.3% Perp -RegS 美元 19,400,000 19,483,312 0.6			
				OVPH Ltd 5.875%			
				Perp-RegS 美元 17,100,000 17,267,331 0.5			
				Semiconductor Mfg			
				4.125%10/19-RegS 美元 11,600,000 11,897,564 0.4			
				Shimao Property			
				8.375% 10/2/22-RegS 美元 17,906,000 19,465,563 0.6			
(II) 债务证券(88.0%)				Sun Hung Kai Prop			
澳大利亚(1.2%)				4.45% Perp-RegS 美元 15,200,000 14,154,937 0.4			
ICBC Ltd Sydney				Sunny Optical Tech			
3.65% 27/10/18-RegS 人民币 30,000,000 4,812,661 0.1				3.75% 1/23-RegS 美元 4,800,000 4,781,220 0.1			
NSW Treasury 4%				Times China 6.25%			
20/04/23 澳元 21,900,000 18,262,410 0.6				17/01/21-RegS 美元 19,600,000 19,669,008 0.6			
Queensland No24				Well Hope Dev VRN			
5.75% 22/7/24-RegS 澳元 18,000,000 16,324,311 0.5				3.875% Perp-RegS 美元 18,800,000 18,142,849 0.6			
				WTT Investment 5.5%			
				21/11/22-RegS 美元 19,200,000 19,152,267 0.6			
				Yankuang Grp			
				Cayman4.75%			
				11/20-RegS 美元 13,000,000 12,948,614 0.4			
				Yuzhou Properties			
				6.375% 03/21-RegS 美元 9,800,000 9,832,871 0.3			

投资组合 (续)
截至二零一八年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比
中国 (9.1%)				China Govt Bond No1716 3.46%7/20- IB	人民币 39,000,000	6,341,460	0.2
Bank of China HK 4.25% 11/12/18	人民币 26,000,000	4,177,446	0.1	China Life Ins VRN 4% 03/07/75-RegS	美元 17,000,000	16,979,411	0.5
Bank of China NY 3.6% 12/07/18- RegS	人民币 13,000,000	2,079,677	0.1	China Minmetals VRN 3.75% Perp-RegS	美元 20,000,000	19,341,583	0.6
Bank of China Paris 4.5% 11/20-RegS	人民币 43,000,000	6,885,675	0.2	China New Town Fin 15/04/21-RegS	人民币 51,000,000	8,294,332	0.3
CCB Life Ins VRN 4.5% 21/4/77-RegS	美元 15,600,000	15,764,970	0.5	5.5% 7/5/18-RegS Franshion Dev 6.75% 15/04/21-RegS	美元 15,000,000	16,642,688	0.5
China Const Bk 3.875% 13/5/25- RegS	美元 28,200,000	28,638,843	0.9	Haitian (BVI) Intl 3.875%12/20-RegS	美元 17,900,000	17,872,439	0.5
China Const Bk SG3.25% 22/8/18- RegS	人民币 5,000,000	794,061	0.0	ICBC Macau VRN 3.875% 10/09/24- RegS	美元 12,100,000	12,120,183	0.4
China Const Bk VRN 4.9% 11/24-RegS	人民币 19,400,000	3,152,507	0.1	Lenovo Group 4.95% 10/06/20	人民币 40,000,000	6,461,142	0.2
China Dev Bank No1608 2.72% 3/19-IB	人民币 15,000,000	2,360,343	0.1	Postal Saving Bk VRN 4.5% Perp-RegS	美元 26,500,000	25,681,813	0.8
China Dev Bank No1705 3.88% 4/20-IB	人民币 202,700,000	33,086,959	1.0	香港 (9.6%)			
China Dev Bank No1709 4.14% 9/20-IB	人民币 54,000,000	8,721,217	0.3	Bank of East Asia VRN5.625%Perp- RegS	美元 7,500,000	7,646,906	0.2
China Govt Bond 2.8% 21/05/18-RegS	人民币 10,000,000	1,605,572	0.1	Bank of East Asia VRN 4% 11/26-RegS	美元 22,800,000	22,793,287	0.7
China Govt Bond 3.09% 22/11/18- RegS	人民币 10,000,000	1,604,070	0.1	Bank of East Asia VRN 4.25% 24-RegS	美元 21,200,000	21,627,887	0.7
China Govt Bond 3.16% 27/06/23- RegS	人民币 9,000,000	1,392,561	0.0	Bank of East Asia VRN 5.5%Perp-RegS	美元 5,000,000	5,084,167	0.2
China Govt Bond 3.25% 04/07/21- RegS	人民币 124,000,000	19,584,436	0.6	China Oil & Gas 4.625% 04/22- RegS	美元 19,400,000	19,100,513	0.6
China Govt Bond 3.36% 21/05/22- RegS	人民币 6,000,000	952,134	0.0	Chong Hing Bk VRN 3.876% 07/27-RegS	美元 9,400,000	9,233,206	0.3
China Govt Bond 3.4% 30/11/20-RegS	人民币 50,000,000	7,986,604	0.2	Chong Hing Bk VRN 6.5% Perp-RegS	美元 9,400,000	9,599,881	0.3
China Govt Bond 3.48% 29/06/27- RegS	人民币 9,500,000	1,453,738	0.0	CITIC Ltd VRN 8.625% Perp-RegS	美元 10,600,000	11,271,466	0.3
China Govt Bond 3.5% 30/12/18	人民币 40,000,000	6,419,540	0.2	CNAC (HK) 3.5% 19/07/22-RegS	美元 17,000,000	16,586,003	0.5
China Govt Bond 3.99% 26/06/20- RegS	人民币 70,000,000	11,324,058	0.3	CRCC Yupeng VRN 3.95% Perp-RegS	美元 16,500,000	16,590,145	0.5
China Govt Bond 4.1% 26/06/22-RegS	人民币 50,000,000	8,150,168	0.3	HK Intl (Qingdao) 4.25% 12/22-RegS	美元 18,400,000	18,361,922	0.6
China Govt Bond 4.29% 22/05/29- RegS	人民币 5,500,000	899,589	0.0	Huasing Intl Hldgs 4.5% 03/21-RegS	美元 17,300,000	17,242,910	0.5
China Govt Bond 4.5% 22/05/34-RegS	人民币 4,500,000	744,261	0.0	ICBC Asia VRN 4.25% Perp-RegS	美元 22,000,000	21,363,803	0.7
				ICBCIL Finance 3.25% 17/03/20-RegS	美元 16,000,000	15,936,067	0.5
				ICBCIL Finance 3.625% 19/05/26- RegS	美元 13,000,000	12,583,251	0.4
				Lenovo Group 4.75% 29/03/23-RegS	美元 17,000,000	16,802,729	0.5

投资组合 (续)

截至二零一八年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	占资产			单位数目	占资产	
		公平值 美元	净值 百分比			公平值 美元	净值 百分比
香港 (续)							
MCC Hldg (HK) 2.95% 31/05/20-RegS	美元 13,700,000	13,603,377	0.4	Indonesia Govt NoFR64	印尼盾		
Vanke Real Estate 3.975% 11/19-RegS	美元 23,600,000	22,712,394	0.7	6.125%15/5/28	100,000,000,000	7,146,397	0.2
Weichai Intl HK VRN 3.75% Perp-RegS	美元 19,300,000	18,232,228	0.6	Indonesia Govt NoFR69	印尼盾		
Wing Lung Bank VRN 3.75% 11/27-RegS	美元 14,700,000	14,464,678	0.4	7.875%15/4/19	484,900,000,000	37,458,761	1.2
Wing Lung Bank VRN 4.793%11/22-RegS	美元 1,000,000	1,020,355	0.0	Indonesia Retail 9% 15/10/18	100,000,000,000	7,451,547	0.2
				Indosat Tbk No0B 9.25% 04/06/18	100,000,000,000	7,357,141	0.2
				Lembaga Pembiayaan 7.95% 25/08/19	90,000,000,000	6,677,492	0.2
				Pelabuhan Indonesia 4.25% 5/25-RegS	美元 9,600,000	9,597,160	0.3
印度 (8.0%)				Pelabuhan Indonesia 5.375%5/45-RegS	美元 15,000,000	15,028,469	0.5
Adani Ports & Sp 4% 30/07/27-RegS	美元 12,100,000	11,404,721	0.3	Perusahaan Penerbit 4.55% 3/26-RegS	美元 20,000,000	20,457,583	0.6
Adani Transmission 4% 03/08/26-RegS	美元 20,000,000	18,821,111	0.6	Saka Energi Indon 4.45% 05/24-RegS	美元 10,800,000	10,786,725	0.3
Bharat Petroleum 4% 08/05/25-RegS	美元 22,240,000	22,211,088	0.7				
Export-Imp Bk IN 9.45% 22/01/19	印度卢比 950,000,000	15,040,901	0.5	英属泽西岛 (0.4%)			
Export-Imp Bk IN NoQ17 9.28% 10/18	印度卢比 650,000,000	10,479,788	0.3	West China Cement 6.5% 11/9/19-RegS	美元 12,700,000	13,033,904	0.4
Export-Imp Bk IN NoQ20	印度卢比 250,000,000	4,017,354	0.1				
Export-Imp Bk IN NoQ21 9.63% 11/18	印度卢比 250,000,000	4,008,439	0.1	韩国 (3.7%)			
India Govt Bond 7.8% 11/04/21	印度卢比 3,300,000,000	53,432,599	1.6	Busan Bank 3.625% 25/07/26-RegS	美元 25,700,000	24,137,351	0.8
India Govt Bond 8.12% 10/12/20	印度卢比 500,000,000	8,065,308	0.2	Heungkuk Life VRN 4.475% 11/47-RegS	美元 16,700,000	16,115,929	0.5
India Govt Bond 8.19% 16/01/20	印度卢比 220,000,000	3,508,038	0.1	Hyundai Cap 3% 06/03/22-RegS	美元 9,300,000	9,093,230	0.3
India Govt Bond 8.27% 09/06/20	印度卢比 752,000,000	12,151,489	0.4	Industrial Bk KR VRN 3.9% Perp-RegS	美元 6,800,000	6,580,020	0.2
India Govt Bond 8.4% 28/07/24	印度卢比 1,140,000,000	18,485,667	0.6	Korea Land No42 3.5% 27/08/20	韩元 5,000,000,000	5,488,695	0.2
JSW Steel 5.25% 13/04/22-RegS	美元 15,200,000	15,593,617	0.5	Korea Treasury No1909 2.75% 10/9/19	韩元 14,500,000,000	13,765,709	0.4
NTPC Ltd 4.25% 26/02/26-RegS	美元 12,000,000	11,943,000	0.4	Korea Try No2106 ILB 1.5% 10/06/21	韩元 6,850,000,000	7,269,582	0.2
Power Fin Corp 3.75% 06/12/27-RegS	美元 27,100,000	25,655,118	0.8	Korea Try No2306 ILB 1.125% 10/6/23	韩元 7,000,000,000	7,027,439	0.2
Power Finance 9.32% 17/09/19	印度卢比 250,000,000	4,112,170	0.1	Woori Bank VRN 4.5% Perp-RegS	美元 19,300,000	18,914,483	0.6
UPL Corp 3.25% 13/10/21-RegS	美元 22,900,000	22,809,704	0.7	Woori Bank VRN 5.25% Perp-RegS	美元 10,700,000	10,811,637	0.3
印度尼西亚 (6.3%)				马来西亚 (4.2%)			
APL Realty Hldgs 5.95%02/06/24- RegS	美元 16,800,000	16,208,360	0.5	Cagamas Bhd 4.1% 18/11/20	林吉特 15,000,000	3,930,626	0.1
Indonesia Govt NoFR53 8.25% 15/7/21	印尼盾 441,800,000,000	34,725,315	1.1	Cagamas Bhd NoP8 6.35% 08/08/23	林吉特 55,000,000	14,424,498	0.5
Indonesia Govt NoFR61 7% 15/05/22	印尼盾 409,200,000,000	31,315,033	1.0	Danainfra Nasional 4.41% 24/07/24	林吉特 15,000,000	3,910,839	0.1
				GOHL Capital 4.25% 24/01/27-RegS	美元 14,400,000	14,306,800	0.5
				Malaysia Govt Inv No0613 3.716%3/21	林吉特 42,000,000	10,857,226	0.3

投资组合 (续)
截至二零一八年三月三十一日(未经审计)

(续)

		占资产				占资产	
		公平值	净值			公平值	净值
		美元	百分比			美元	百分比
单位数目				单位数目			
马来西亚 (续)				Housing & Dev			
Malaysian Govt No0111				3.008% 26/03/21-RegS	新加坡元 5,000,000	3,897,584	0.1
4.16% 15/7/21	林吉特 75,000,000	19,964,071	0.6	Housing & Dev 3.1%			
Malaysian Govt No0117				24/07/24-RegS	新加坡元 4,000,000	3,169,183	0.1
3.882% 03/22	林吉特 76,000,000	19,924,079	0.6	Medco Platinum			
Malaysian Govt No0314				6.75% 30/01/25-RegS	美元 18,400,000	17,876,980	0.6
4.048% 09/21	林吉特 149,100,000	39,944,768	1.2	Oil India Intl 4%			
Putrajaya Hldgs 4.55%				21/04/27-RegS	美元 10,000,000	9,743,389	0.3
19/09/23	林吉特 20,000,000	5,205,415	0.2	Parkway Pantai VRN			
Telekom Malaysia				4.25% Perp-RegS	美元 21,600,000	21,063,750	0.6
4.82% 21/03/24	林吉特 10,000,000	2,642,483	0.1	Public Utilities Board	新加坡元		
				3.52% 10/20	10,000,000	7,978,120	0.2
毛里求斯 (0.3%)				Theta Cap 7%			
Azure Power Energy				11/04/22-RegS	美元 31,010,000	31,729,432	1.0
5.5% 11/22-RegS	美元 10,800,000	10,984,830	0.3	United Overseas VRN			
				3.875%PERP-RegS	美元 37,000,000	36,143,269	1.1
蒙古 (0.3%)				泰国 (3.4%)			
Mongolia 5.625%				Krung Thai Bk VRN			
01/05/23-RegS	美元 4,800,000	4,847,940	0.1	5.2% 12/24-RegS	美元 26,000,000	26,909,133	0.8
Mongolia Govt Int				PTTEP Treasury VRN			
10.875% 4/21-RegS	美元 5,000,000	6,025,083	0.2	4.6% Perp-RegS	美元 18,200,000	17,919,417	0.5
				Thailand Gov 2.55%			
荷兰 (2.5%)				26/06/20			
Daimler Intl Finance				Thailand Govt 3.65%	泰铢 670,000,000	22,129,404	0.7
04/21 (New)	人民币 22,000,000	3,500,927	0.1	17/12/21	泰铢 450,000,000	15,610,403	0.5
Greenko Dutch 4.875%				Thailand Govt 3.875%			
24/07/22-RegS	美元 13,400,000	13,093,922	0.4	13/06/19	泰铢 450,000,000	15,008,885	0.5
Indo Energy Fin II				Thailand Govt IL 1.2%			
6.375% 1/23-RegS	美元 6,000,000	6,064,450	0.2	14/07/21-RegS	泰铢 346,000,000	11,948,298	0.4
Listrindo Capital 4.95%				维京群岛 (18.5%)			
9/26-RegS	美元 7,400,000	7,011,315	0.2	Baoxin Auto Fin VRN			
Minejesa Capital				5.625%Perp-RegS	美元 4,300,000	4,128,000	0.1
4.625% 08/30-RegS	美元 36,000,000	35,061,499	1.1	Beijing Cap Polar			
Royal Capital VRN				2.875% 04/18-RegS	美元 17,000,000	17,243,865	0.5
4.875% Perp-RegS	美元 17,200,000	17,271,488	0.5	Beijing Cap Polar			
				4.25% 03/21-RegS	美元 8,300,000	8,313,764	0.3
新西兰 (0.7%)				Bluestar Fin Hldgs			
New Zealand Govt				3.125% 9/19-RegS	美元 11,700,000	11,803,529	0.4
No319 5% 15/03/19	NZD30,600,000	22,795,799	0.7	CCCI Treasure VRN			
				3.5% Perp-RegS	美元 18,900,000	19,006,838	0.6
巴基斯坦 (0.3%)				China Cinda Fin			
Islamic Rep Pakistan				4.375% 08/02/25-Reg	美元 4,800,000	4,805,340	0.1
7.25%4/19-RegS	美元 5,000,000	5,275,410	0.2	China Railway XunJie			
Islamic Rep				3.25%7/26-RegS	美元 10,000,000	9,465,278	0.3
Pakistan6.75%12/19-RegS	美元 3,000,000	3,130,688	0.1	China Rein Fin 3.375%			
				09/03/22-RegS	美元 18,500,000	17,978,416	0.6
新加坡 (5.4%)				Chinalco Cap Hold			
Abja Investment 5.45%				4.25% 04/22-RegS	美元 9,100,000	9,056,838	0.3
24/01/28-RegS	美元 29,300,000	27,660,502	0.9	Chinalco Capital 4%			
Alam Synergy 6.625%				25/8/21-RegS	美元 12,500,000	12,254,514	0.4
24/04/22-RegS	美元 9,600,000	9,591,133	0.3	Chouzhou Intl Inv 4%			
BOC Aviation 4.2%				05/12/20-RegS	美元 13,800,000	13,774,332	0.4
05/11/18-RegS	人民币 44,000,000	7,084,476	0.2	Dianjian Haixing VRN			
				4.05%Perp-RegS	美元 17,100,000	17,368,171	0.5

投资组合 (续)
截至二零一八年三月三十一日(未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
维京群岛 (续)				Zhongrong Intl Res			
Dianjian Haiyu VRN 3.5% Perp-RegS	美元 12,000,000	11,592,000	0.4	7.25% 10/20-RegS	美元 15,700,000	15,123,287	0.5
Fortune Star 5.25% 23/03/22-RegS	美元 17,300,000	16,543,341	0.5			2,866,015,263	88.0
Fortune Star 5.95% 29/01/23-RegS	美元 30,800,000	30,002,665	0.9			-----	-----
Franshion Brilliant 4% Perp-RegS	美元 11,000,000	10,551,628	0.3	(III) 衍生性产品 (0.3%)			
Gemstones Intl 8.5% 15/08/20-RegS	美元 13,900,000	14,210,626	0.4	远期外汇合约 (0.4%)			
Greenland Glb Inv 3.5% 6/09/19-RegS	美元 18,100,000	17,739,589	0.5	期货 (-0.1%)			
Greenland Global 5.9% 12/02/23- RegS	美元 28,000,000	27,441,244	0.8	US 10Yr Note (CBT) Fut 06/18	(2,483)	(2,424,805)	(0.1)
HKT Capital No4 3 14/07/26-RegS	美元 34,800,000	32,671,980	1.0			10,000,238	0.3
Huaneng HK Cap 3.6% Perp-RegS	美元 13,700,000	13,128,710	0.4			-----	-----
Huarong Fin II VRN 2.875% Perp-RegS	美元 10,600,000	9,981,888	0.3	总上市投资			
Huarong Fin VRN 4% Perp-RegS	美元 25,100,000	24,540,549	0.8			3,063,070,202	94.0
Huarong Finance II 2.056% 2019-RegS	美元 12,800,000	12,795,396	0.4	其他净资产			
King Power Cap 5.625% 03/11/24- RegS	美元 19,400,000	21,506,476	0.7			194,008,193	6.0
Minmetals Bounteous 4.2% 07/26-RegS	美元 10,000,000	9,843,333	0.3	截至二零一八年三月三十一日可赎回份 额持有人应占净资产			
Nan Fung Tsy 3.875% 03/10/27-RegS	美元 19,500,000	18,688,164	0.6			3,257,078,395	100.0
NWD Fin (BVI) 5.75% Perp-RegS	美元 13,300,000	12,961,127	0.4	总投资, 按成本			
Proven Honour Cap 4.125% 05/26-RegS	美元 28,000,000	27,699,817	0.8			3,078,806,274	
Radiant Access 4.6% Perp-RegS	美元 10,300,000	9,386,104	0.3			-----	-----
RKI Overseas Fin 5% 09/08/19-RegS	美元 28,900,000	29,218,221	0.9				
SDSC Intl Finance 3.625% 11/19-RegS	美元 12,600,000	12,778,255	0.4				
Sino-Ocean Land 4.45% 04/02/20- RegS	美元 20,000,000	20,310,389	0.6				
Sino-Ocean Land 6% 30/07/24-RegS	美元 3,800,000	4,119,517	0.1				
Sino-Ocean VRN 4.9% Perp-RegS	美元 12,100,000	11,445,356	0.4				
Skyland Mining 3.25% 06/07/20-RegS	美元 16,100,000	15,938,419	0.5				
Studio City Fin 8.5% 01/12/20-RegS	美元 10,000,000	10,558,333	0.3				
Value Success Intl 4.75% 11/18-RegS	人民币 1,000,000	162,316	0.0				
Wisdom Glory VRN 5.25% Perp-RegS	美元 17,700,000	17,710,546	0.5				

投资组合持有变动表

截至二零一八年三月三十一日止期间(未经审计)

	持有占资产净值 百分比	
	二零一八年 三月三十一日	二零一七年 九月三十日
上市投资		
可换股		
中国	2.3	2.4
新加坡	1.1	0.9
香港	0.6	1.8
日本	0.6	1.3
维京群岛	0.5	1.1
台湾	0.4	1.1
马来西亚	0.2	1.0
百慕大	-	0.5
菲律宾	-	0.2
债务证券		
维京群岛	18.5	14.9
开曼群岛	13.4	10.0
香港	9.6	6.4
中国	9.1	8.5
印度	8.0	8.1
印度尼西亚	6.3	11.3
新加坡	5.4	6.2
马来西亚	4.2	3.9
韩国	3.7	5.0
泰国	3.4	2.3
荷兰	2.5	2.4
澳大利亚	1.2	1.6
百慕大	0.7	-
新西兰	0.7	0.7
英属泽西岛	0.4	0.3
毛里求斯	0.3	0.5
蒙古	0.3	-
巴基斯坦	0.3	0.4
菲律宾	-	1.0
斯里兰卡	-	0.8
俄罗斯	-	0.5
美国	-	0.1
衍生性产品		
远期外汇合约	0.4	(0.6)
期货	(0.1)	0.1
总上市投资	<u>94.0</u>	<u>94.7</u>
其他净资产	<u>6.0</u>	<u>5.3</u>
可赎回份额持有人应占净资产	<u><u>100.0</u></u>	<u><u>100.0</u></u>

财务状况表

截至二零一八年三月三十一日(未经审计)

	二零一八年 三月三十一日 美元	二零一七年 九月三十日 美元
资产		
银行现金	40,928,831	187,823,385
短期存款	174,937,809	-
应收经纪款项	23,912,409	31,674,306
分配应收款项	18,707,851	105,375,076
保证金	4,545,043	1,853,818
衍生性产品	26,271,011	26,044,811
投资	3,053,069,964	3,625,861,167
利息和其他应收款项	45,413	161,558
总资产	3,342,418,331	3,978,794,121
负债		
应付经纪款项	10,574,971	80,419,769
赎回应付款项	45,915,982	28,383,039
应付收益分配(附注 5)	8,344,098	9,950,415
衍生性产品	16,270,773	45,064,468
其他应付款项	4,234,112	5,138,399
总负债(不含可赎回份额持有人 应占净资产)	85,339,936	168,956,090
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	3,257,078,395	3,809,838,031

综合收益表

截至二零一八年三月三十一日止期间(未经审计)

	二零一七年 十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元	二零一六年 十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元
收入		
投资和衍生性产品净收益/ (亏损) [附注 4]	118,020,590	(22,596,845)
存款利息	1,206,894	536,063
汇兑净亏损	(410,411)	(1,487,625)
其他收入	182,723	60,246
	118,999,796	(23,488,161)
支出		
管理费用	18,362,528	17,121,448
受托人费用	465,836	438,221
托管费用及银行费用	369,789	281,001
交易费用	258,881	106,649
基金注册登记机构费用	144,594	250,373
法律及专业费用	42,730	135,140
核数师酬金	21,590	14,725
估值费用	8,540	8,610
印刷及出版支出	2,850	17,758
其他经营费用	11,180	9,464
	19,688,518	18,383,389
净经营利润/(亏损)	99,311,278	(41,871,550)
财务成本		
收益分配[附注 5]	(56,504,299)	(66,241,954)
除税前利润/(亏损)	42,806,979	(108,113,504)
税项	(1,670,640)	(2,698,533)
可赎回份额持有人应占净资产 及总综合收益之增加/(减少)	41,136,339	(110,812,037)

可赎回份额持有人应占净资产变动表
截至二零一八年三月三十一日止期间(未经审计)

	二零一七年 十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元	二零一六年 十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元
期初可赎回份额持有人应占净资产	3,809,838,031	3,924,672,187
分配可赎回份额	830,916,811	865,788,086
赎回可赎回份额	(1,424,812,786)	(1,611,057,843)
净赎回	<u>(593,895,975)</u>	<u>(745,269,757)</u>
	3,215,942,056	3,179,402,430
可赎回份额持有人应占净资产及 总综合收益之增加/(减少)	<u>41,136,339</u>	<u>(110,812,037)</u>
期末可赎回份额持有人应占净资产	<u>3,257,078,395</u>	<u>3,068,590,393</u>

现金流量表
截至二零一八年三月三十一日止期间(未经审计)

	二零一七年 十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元	二零一六年 十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元
经营业务		
购入投资及衍生性产品	(1,312,752,813)	(276,974,726)
出售投资及衍生性产品所得 款项	1,912,461,810	1,079,434,268
已收利息	1,192,910	531,125
已付基金注册登记机构费用	(286,066)	(305,993)
已付交易费用	(259,971)	(108,932)
已付受托人费用	(473,557)	(452,158)
已付税项	(2,052,492)	(3,253,097)
保证金之(增加)/减少	(2,691,225)	2,191,415
已付管理费用	(18,665,171)	(17,683,869)
其他	(1,973,059)	(1,505,137)
经营业务所产生之现金净额	<u>574,500,366</u>	<u>781,872,896</u>
融资活动		
分配可赎回份额所得款项	917,584,036	893,540,629
赎回可赎回份额付款	(1,407,279,843)	(1,615,168,811)
已付收益分配	(58,110,616)	(68,503,863)
融资活动所运用之现金净额	<u>(547,806,423)</u>	<u>(790,132,045)</u>
现金及现金等价物之增加/ (减少)	<u>26,693,943</u>	<u>(8,259,149)</u>
期初现金及现金等价物	187,823,385	186,118,724
现金及现金等价物之汇兑收 益/(亏损)	1,349,312	(476,621)
期末现金及现金等价物	<u>215,866,640</u>	<u>177,382,954</u>
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	40,928,831	28,340,133
短期存款	174,937,809	149,042,821
	<u>215,866,640</u>	<u>177,382,954</u>

财务报表之附注

1 本基金

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

本基金之投资目标为通过主要投资于亚洲债券和其他债务证券之主动管理组合，致力提供具竞争力的总回报（包括资本增长及定息收益）。

根据二零一二年二月二十七日的增补信托契约，管理人可决定发行不同类别（分别称为“类别”），虽然各类别之资产将作共同投资，但各类别可应用特定的收费结构、货币或收益分配政策。由于各类别有不同的收费结构，因此每类别应占之资产净值可能不同。

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

2 主要会计政策

(a) 中期财务报表之财务政策

除采纳了一项新财务报告准则—香港财务报告准则第9号「金融工具」外，编制本未经审计简明中期财务报表所使用的会计政策和计算方法与截至二零一七年九月三十日止年度财务报表所采纳的会计政策和计算方法一致。该准则并无对本基金的简明中期财务报表产生任何重大影响。

(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、终止确认及计量

投资及衍生性产品之买卖于交易日确认。投资及衍生性产品先以公允价值确认，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。

(c) 外币交易

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按期/年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

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

(d) 销售份额所得款项及赎回份额支付款项

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

可赎回份额持有人有权选择赎回份额，此等份额在财务状况报表上分类为金融负债，代表可赎回份额持有人应占净资产（或“资产净值”或“净资产”或“NAV”）。如果可赎回份额持有人行使他的赎回权，则将可赎回金额以应付账款的形式在财务状况报表日入账。

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

二零一八年三月三十一日

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目	21,102,206,911	14,609,342,538	359,040,133	394,587,962,651	7,901,425,197
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净资产	188,213,850	130,975,268	3,366,263	3,775,680,907	69,990,279
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	8.92	8.97	9.38	9.57	8.86

	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲份额 (累计) 份额
已发行份额数目	1,822,975.855	456,620,430.997	1,544,895.755	50,261,256.305	291,413,347.420
	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	22,270,378	4,181,983,721	18,745,877	546,660,058	3,383,846,788
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	12.22	9.16	12.13	10.88	11.61
	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	88,231,407.280	49,374,970.700	2,801,887.460		
	人民币	美元	美元		
可赎回份额持有人应占净 资产	872,775,441	535,243,747	27,768,177		
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	9.89	10.84	9.91		
<u>二零一七年九月三十日</u>					
	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目	24,155,484.127	15,026,586.666	435,422.728	462,584,033.437	8,686,844.376
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净 资产	219,559,065	137,199,992	4,157,347	4,487,647,800	78,391,549
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	9.09	9.13	9.55	9.70	9.02

	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲份额 (累计) 份额
已发行份额数目	1,589,789.521	490,430,593.426	1,159,768.963	72,495,884.779	330,804,088.910
	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	19,181,758	4,570,432,055	14,067,443	803,248,157	3,796,281,190
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	12.07	9.32	12.13	11.08	11.48
	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	94,155,390.680	59,066,119.270	2,915,664.600		
	人民币	美元	美元		
可赎回份额持有人应占净资产	948,303,236	640,043,722	29,438,715		
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	10.07	10.84	10.10		

4 投资及衍生性产品净收益／(亏损)

	二零一七年 十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元	二零一六年 十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益／亏损之变动	(49,314,489)	(87,035,138)
投资及衍生性产品销售之实现收益	167,335,079	64,438,293
	118,020,590	(22,596,845)

5 收益分配

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

	二零一七年 十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元	二零一六年 十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元
净经营利润 / (亏损)	99,311,278	(41,871,550)
调整：		
投资及衍生性产品净 (收益) / 亏损	(118,020,590)	22,596,845
利息收入包括于投资及衍生性产品净收益 (票面利率)	74,538,147	69,576,613
汇兑净亏损	410,411	1,487,625
交易成本	258,881	106,649
税项	(1,670,640)	(2,698,533)
资本利得税	(179,286)	654,516
可分配金额	54,648,201	49,852,165

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零一七年	二零一六年
					十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元	十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元
澳元对冲类别 (每月派息)	2017 年 10 月 31 日	2017 年 11 月 8 日	澳元 0.0322	24,755,622.642	(611,200)	
加元对冲类别 (每月派息)	2017 年 10 月 31 日	2017 年 11 月 8 日	加元 0.0266	14,782,001.708	(305,020)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2017 年 10 月 31 日	2017 年 11 月 8 日	英镑 0.0205	432,405.388	(11,771)	
港元类别 (每月派息)	2017 年 10 月 31 日	2017 年 11 月 8 日	港元 0.0306	476,050,289.033	(1,867,151)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2017 年 10 月 31 日	2017 年 11 月 8 日	纽元 0.0341	9,078,665.348	(212,080)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2017 年 10 月 31 日	2017 年 11 月 8 日	人民币 0.0465	509,925,409.445	(3,575,510)	
美元类别 (每月派息)	2017 年 10 月 31 日	2017 年 11 月 8 日	美元 0.0350	73,596,230.640	(2,575,868)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2017 年 10 月 31 日	2017 年 11 月 8 日	人民币 0.0503	97,164,332.930	(736,976)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2017 年 10 月 31 日	2017 年 11 月 8 日	美元 0.0319	2,886,332.790	(92,074)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2017 年 11 月 30 日	2017 年 12 月 8 日	澳元 0.0316	25,747,312.614	(617,656)	
加元对冲类别 (每月派息)	2017 年 11 月 30 日	2017 年 12 月 8 日	加元 0.0265	15,914,833.132	(327,364)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2017 年 11 月 30 日	2017 年 12 月 8 日	英镑 0.0224	414,751.004	(12,576)	
港元类别 (每月派息)	2017 年 11 月 30 日	2017 年 12 月 8 日	港元 0.0307	467,822,635.716	(1,838,897)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2017 年 11 月 30 日	2017 年 12 月 8 日	纽元 0.0340	10,611,810.247	(247,600)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2017 年 11 月 30 日	2017 年 12 月 8 日	人民币 0.0465	518,706,404.706	(3,647,476)	
美元类别 (每月派息)	2017 年 11 月 30 日	2017 年 12 月 8 日	美元 0.0350	72,097,843.833	(2,523,425)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2017 年 11 月 30 日	2017 年 12 月 8 日	人民币 0.0503	99,207,826.370	(754,626)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2017 年 11 月 30 日	2017 年 12 月 8 日	美元 0.0319	2,848,832.360	(90,878)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2017 年 12 月 29 日	2018 年 1 月 9 日	澳元 0.0302	24,638,896.229	(581,994)	
加元对冲类别 (每月派息)	2017 年 12 月 29 日	2018 年 1 月 9 日	加元 0.0232	15,568,260.388	(288,267)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2017 年 12 月 29 日	2018 年 1 月 9 日	英镑 0.0153	397,007.664	(8,217)	
港元类别 (每月派息)	2017 年 12 月 29 日	2018 年 1 月 9 日	港元 0.0307	456,419,340.849	(1,792,444)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2017 年 12 月 29 日	2018 年 1 月 9 日	纽元 0.0329	10,592,821.497	(247,856)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2017 年 12 月 29 日	2018 年 1 月 9 日	人民币 0.0470	514,611,576.534	(3,714,152)	
美元类别 (每月派息)	2017 年 12 月 29 日	2018 年 1 月 9 日	美元 0.0350	69,716,705.902	(2,440,085)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2017 年 12 月 29 日	2018 年 1 月 9 日	人民币 0.0508	94,802,884.840	(739,550)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2017 年 12 月 29 日	2018 年 1 月 9 日	美元 0.0319	2,817,069.890	(89,865)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2018 年 1 月 31 日	2018 年 2 月 8 日	澳元 0.0293	21,989,828.884	(521,724)	
加元对冲类别 (每月派息)	2018 年 1 月 31 日	2018 年 2 月 8 日	加元 0.0237	14,444,705.692	(279,039)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2018 年 1 月 31 日	2018 年 2 月 8 日	英镑 0.0176	375,474.814	(9,397)	
港元类别 (每月派息)	2018 年 1 月 31 日	2018 年 2 月 8 日	港元 0.0307	410,768,405.833	(1,612,309)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2018 年 1 月 31 日	2018 年 2 月 8 日	纽元 0.0322	9,018,520.774	(214,875)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2018 年 1 月 31 日	2018 年 2 月 8 日	人民币 0.0455	504,110,903.773	(3,644,098)	
美元类别 (每月派息)	2018 年 1 月 31 日	2018 年 2 月 8 日	美元 0.0350	65,386,593.409	(2,288,531)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2018 年 1 月 31 日	2018 年 2 月 8 日	人民币 0.0492	93,436,711.710	(730,357)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2018 年 1 月 31 日	2018 年 2 月 8 日	美元 0.0319	3,009,322.920	(95,997)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零一七年	二零一六年
					十月一日至 二零一八年 三月三十一日	十月一日至 二零一七年 三月三十一日
					美元	美元
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	澳元 0.0298	21,436,946.254	(497,800)	
加元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	澳元 0.0260	14,072,340.744	(285,543)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	英镑 0.0204	365,801.704	(10,282)	
港元类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	港元 0.0307	423,327,046.538	(1,660,785)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	纽元 0.0315	8,120,087.474	(184,739)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	人民币 0.0462	473,556,581.901	(3,456,617)	
美元类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	美元 0.0350	53,971,709.267	(1,889,010)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	人民币 0.0499	93,174,348.720	(734,572)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	美元 0.0319	2,945,070.980	(93,948)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	澳元 0.0283	20,864,264.173	(452,912)	
加元对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	加元 0.0231	14,595,329.214	(261,510)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	英镑 0.0162	359,040.133	(8,159)	
港元类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	港元 0.0308	403,826,475.284	(1,584,783)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	纽元 0.0307	7,892,765.506	(174,801)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	人民币 0.0456	457,066,600.704	(3,316,689)	
美元类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	美元 0.0350	50,354,708.643	(1,762,415)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	人民币 0.0493	88,395,303.590	(693,484)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	美元 0.0319	2,800,797.880	(89,345)	
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	18,848,410.109	(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	773,257.020	(24,539)	
港元类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	港元 0.0304	506,988,401.014	(1,986,998)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	纽元 0.0394	10,703,770.321	(298,921)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	人民币 0.0534	472,564,966.158	(3,652,504)	
美元类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	美元 0.0350	78,682,899.551	(2,753,901)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	人民币 0.0575	69,354,053.340	(577,202)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	美元 0.0319	1,746,695.720	(55,720)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	澳元 0.0361	32,154,066.482	(840,508)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	加元 0.0251	18,554,287.255	(347,275)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	英镑 0.0206	526,477.901	(13,401)	
港元类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	港元 0.0304	472,723,007.671	(1,853,541)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	纽元 0.0382	9,745,136.069	(259,580)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	人民币 0.0735	446,297,794.670	(4,708,594)	
美元类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	美元 0.0350	71,503,414.442	(2,502,619)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	人民币 0.0792	64,703,249.100	(735,581)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	美元 0.0319	1,668,033.960	(53,210)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	澳元 0.0382	29,537,381.826	(852,339)	
加元对冲类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	加元 0.0272	17,018,014.446	(352,678)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	英镑 0.0240	534,681.718	(16,103)	
港元类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	港元 0.0326	437,140,971.642	(1,836,786)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	纽元 0.0404	9,182,007.752	(269,813)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	人民币 0.1081	401,155,516.254	(6,318,652)	
美元类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	美元 0.0375	66,880,409.659	(2,508,015)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2017年1月26日	2017年2月8日	人民币 0.1166	62,237,653.500	(1,059,790)	
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)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零一七年	二零一六年
					十月一日至 二零一八年 三月三十一日	十月一日至 二零一七年 三月三十一日
					美元	美元
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)
可赎回份额持有人的总收益分配					(56,504,299)	(66,241,954)

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

6 非金钱收益／佣金共享安排

投资管理人与经纪签署非金钱收益／佣金共享安排，从而收取若干产品和服务以支持投资决策。投资管理人并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。

