

年度报告 - 2018年9月30日(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的股份类别之资产。

内容	页
投资组合 - 未经审计	1 - 4
投资组合持有变动表 - 未经审计	5
财务状况表	6
综合收益表	6
可赎回份额持有人应占净资产变动表	7
现金流量表	7
财务报表之附注	8 - 44
独立核数师报告	45 - 46
管理人及受托人的责任声明	47
受托人对份额持有人的报告	47
业绩纪录 - 未经审计	47 - 48
经营与管理	49

投资组合

截至二零一八年九月三十日 (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
上市投资 (94.3%)							
(I) 可换股 (4.8%)							
中国 (2.3%)							
China Railway Con CB 1.5%12/21-RegS	人民币 205,000,000	29,217,897	1.3	Fantasia Hldgs 8.375% 08/03/21-RegS	美元 25,300,000	21,324,123	0.9
CRRRC Group CB 0% 05/02/21-RegS	美元 23,000,000	23,017,250	1.0	FWD Ltd 5% 24/09/24-RegS	美元 16,400,000	16,568,464	0.7
香港 (0.2%)				FWD Ltd VRN 0% Perp-RegS	美元 20,000,000	13,924,000	0.6
Bagan Capital CB0% 23/09/21	美元 5,800,000	5,535,114	0.2	Greenland HK Hldgs 3.875%07/19-RegS	美元 29,150,000	28,436,735	1.3
日本 (0.8%)				KWG Group 6% 15/09/22-RegS	美元 4,400,000	3,988,233	0.2
Tohoku Elec Power CB 0% 03/12/20	日元 2,000,000,000	17,549,148	0.8	Logan Property Hldgs5.25%02/23- RegS	美元 15,100,000	13,446,802	0.6
新加坡 (0.8%)				Overseas Chinese VRN4.3% Perp - RegS	美元 10,800,000	10,669,590	0.5
CapitaLand Ltd CB 1.85%19/6/20- RegS	新加坡元 17,750,000	12,799,476	0.6	OVP Ltd 5.875% Perp-RegS	美元 2,700,000	2,637,214	0.1
CapitaLand Ltd CB 2.8% 8/06/25- RegS	新加坡元 7,250,000	5,290,995	0.2	Sands China 5.125% 08/08/25-RegS	美元 8,500,000	8,567,429	0.4
台湾 (0.7%)				Semiconductor Mfg 4.125%10/19-RegS	美元 11,600,000	11,816,195	0.5
Zhen Ding Technology CB 0% 26/06/19	美元 14,900,000	14,765,900	0.7	Shimao Property 8.375% 10/2/22- RegS	美元 6,906,000	7,348,085	0.3
		108,175,780	4.8	Sun Hung Kai Prop 4.45% Perp-RegS	美元 10,200,000	8,844,137	0.4
		-----	-----	Times China 6.25% 17/01/21-RegS	美元 12,800,000	12,412,124	0.5
(II) 债务证券 (88.9%)				WTT Investment 5.5% 21/11/22-RegS	美元 12,400,000	12,630,778	0.6
百慕大 (1.2%)				Yankuang Grp Cayman4.75% 11/20-RegS	美元 11,900,000	11,792,487	0.5
GCL New Energy 7.1% 30/01/21- RegS	美元 15,900,000	14,700,036	0.7	中国 (9.2%)			
Gome Retail Hldgs 5%10/03/20-RegS	美元 12,000,000	11,240,000	0.5	Bank of China Macau 4.65% 3/21-RegS	人民币 20,000,000	2,933,102	0.1
开曼群岛 (13.6%)				CCB Life Ins VRN 4.5% 21/4/77-RegS	美元 15,600,000	14,917,500	0.7
Agile Group Hldgs VRN 10.215% Perp Azure Orbit IV 3.75% 25/01/23-RegS	美元 10,000,000	10,332,138	0.5	China Const Bk 3.875% 13/5/25- RegS	美元 28,200,000	28,342,527	1.3
CAR Inc 6.125% 04/02/20-RegS	美元 10,500,000	10,431,203	0.5	China Dev Bank No1709 4.14% 9/20-IB	人民币 362,000,000	53,306,137	2.4
CDBL Funding Two 3% 01/08/22- RegS	美元 18,600,000	17,824,380	0.8	China Dev Bank No1802 4.53%02/20-IB	人民币 100,000,000	15,175,157	0.7
China Aoyuan Property7.5% 5/21-RegS	美元 8,000,000	8,099,000	0.4	China Dev Bank No1804 4.69% 3/23-IB	人民币 99,000,000	15,162,595	0.7
China Overseas Gr 4.875% 06/21- RegS	美元 10,000,000	10,124,000	0.4	China Life Ins VRN 4% 03/07/75-RegS	美元 17,000,000	16,844,922	0.7
China SCE Group 7.45% 04/21-RegS	美元 12,200,000	12,453,624	0.6	China Minmetals VRN 3.75% Perp-RegS	美元 10,800,000	10,185,750	0.4
CIFI Hldgs Group 5.5% 23/01/22- RegS	美元 9,000,000	8,329,400	0.4	Franshion Dev 6.75% 15/04/21-RegS	美元 3,000,000	3,242,475	0.1
ENN Energy Hldgs 3.25% 07/22-RegS	美元 18,400,000	17,836,014	0.8	Haitian (BVI) Intl 3.875%12/20-RegS	美元 13,300,000	12,943,329	0.6



投资组合 (续)

截至二零一八年九月三十日 (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
<b>中国 (续)</b>				<b>印度卢比</b>			
ICBC Macau VRN 3.875% 10/09/24- RegS	美元 8,100,000	8,090,364	0.3	Export-Imp Bk IN 9.45% 22/01/19	950,000,000	13,991,418	0.6
Postal Saving Bk VRN 4.5% Perp-RegS	美元 26,500,000	26,261,500	1.2	Export-Imp Bk IN NoQ17 9.28% 10/18	650,000,000	9,768,967	0.4
<b>香港 (11.0%)</b>				<b>印度卢比</b>			
Anhui Transport 4.875% 13/9/21- RegS	美元 3,900,000	3,883,220	0.2	Export-Imp Bk IN NoQ20	250,000,000	3,744,719	0.2
Bank of East Asi VRN5.625%Perp- RegS	美元 6,000,000	5,996,888	0.3	Export-Imp Bk IN 9.7%21/11/18	250,000,000	3,736,356	0.2
Bank of East Asia VRN 4% 11/26-RegS	美元 22,800,000	22,593,533	1.0	India Govt Bond 8.12% 10/12/20	500,000,000	7,093,707	0.3
Bank of East Asia VRN 4.25% 24-RegS	美元 12,200,000	12,355,126	0.6	India Govt Bond 8.19% 16/01/20	220,000,000	3,098,842	0.1
Bank of East Asia VRN 5.5%Perp-RegS	美元 5,000,000	5,064,653	0.2	India Govt Bond 8.27% 09/06/20	752,000,000	10,700,983	0.5
China Oil & Gas 4.625% 04/22- RegS	美元 14,600,000	14,226,737	0.6	JSW Steel 5.25% 13/04/22-RegS	美元 5,600,000	5,660,200	0.2
Chong Hing Bk VRN 3.876% 07/27- RegS	美元 9,400,000	9,019,754	0.4	NTPC Ltd 4.25% 26/02/26-RegS	美元 5,000,000	4,802,910	0.2
Chong Hing Bk VRN 6.5% Perp-RegS	美元 7,400,000	7,519,017	0.3	Power Fin Corp 3.75% 06/12/27-RegS	美元 27,100,000	24,103,530	1.1
CITIC Ltd VRN 8.625% Perp-RegS	美元 10,600,000	10,993,856	0.5	Power Finance 9.32% 17/09/19	250,000,000	3,481,514	0.2
CNAC (HK) Finbridge 3.5% 07/22-RegS	美元 17,000,000	16,574,150	0.7	UPL Corp 3.25% 13/10/21-RegS	美元 9,100,000	8,939,537	0.4
HK Intl (Qingdao) 4.25% 12/22-RegS	美元 9,300,000	8,799,311	0.4	<b>印度尼西亚 (4.3%)</b>			
HK Mortgage 4.05% 06/11/20-RegS	人民币 10,000,000	1,492,299	0.1	APL Realty Hldgs 5.95%02/06/24- RegS	美元 16,800,000	12,993,423	0.6
Huasing Intl Hldgs 4.5% 03/21-RegS	美元 10,900,000	10,478,988	0.5	Indonesia Govt NoFR53 8.25% 15/7/21	291,800,000,000	20,102,534	0.9
ICBC Asia VRN 4.25% Perp-RegS	美元 22,000,000	21,211,606	0.9	Indonesia Govt NoFR64	190,000,000,000	11,387,826	0.5
ICBCIL Finance 3.25% 17/03/20-RegS	美元 16,000,000	15,864,222	0.7	Indonesia Retail 9% 15/10/18	100,000,000,000	6,742,577	0.3
ICBCIL Finance 3.625% 19/05/26- RegS	美元 13,000,000	12,304,392	0.6	Lembaga Pembiayaan 7.95% 25/08/19	90,000,000,000	6,087,072	0.3
Lenovo Group 4.75% 29/03/23-RegS	美元 17,000,000	16,509,786	0.7	Pelabuhan Indonesia 5.375%5/45-RegS	美元 15,000,000	14,295,729	0.6
MCC Hldg (HK) 2.95% 31/05/20-RegS	美元 13,700,000	13,553,867	0.6	Perusahaan Penerbit 4.4% 03/28-RegS	美元 15,000,000	14,797,000	0.7
Vanke Real Estate 3.975% 11/19-RegS	美元 3,600,000	12,510,357	0.6	Saka Energi Indon 4.45% 05/24-RegS	美元 10,800,000	10,301,010	0.4
Weichai Intl HK VRN 3.75% Perp-RegS	美元 13,300,000	12,292,802	0.5	<b>英属泽西岛 (0.6%)</b>			
Wing Lung Bank VRN 3.75% 11/27-RegS	美元 14,700,000	14,139,011	0.6	West China Cement 6.5% 11/9/19-RegS	美元 12,700,000	12,872,861	0.6
<b>印度 (5.6%)</b>				<b>韩国 (4.9%)</b>			
Adani Transmission 4% 03/08/26-RegS	美元 9,800,000	8,809,656	0.4	Busan Bank 3.625% 25/07/26-RegS	美元 25,700,000	23,762,113	1.1
Bharat Petroleum 4% 08/05/25-RegS	美元 19,440,000	18,792,432	0.8	Export-Import Bk Kor4.68% 3/21- RegS	人民币 11,000,000	1,624,730	0.1
				Heungkuk Life VRN 4.475% 11/47-RegS	美元 16,700,000	15,282,193	0.7

投资组合 (续)

截至二零一八年九月三十日 (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
<b>韩国 (续)</b>				Alam Synergy 6.625% 24/C4/22-RegS 美元 9,600,000 8,509,367 0.4			
Hyundai Cap 3% 06/03/22-RegS	美元 3,700,000	3,580,613	0.2	DBS Group Hldgs VRN 4.52%12/28-RegS	美元 4,400,000	4,511,809	0.2
Industrial Bk KR VRN 3.9% Perp-RegS	美元 6,800,000	6,551,800	0.3	Medco Platinum 6.75% 30/01/25- RegS	美元 18,400,000	17,575,450	0.8
Korea Dev Bank 4.6% 03/07/21-RegS	人民币 46,200,000	6,815,582	0.3	Parkway Pantai VRN 4.25% Perp-RegS	美元 16,100,000	15,477,019	0.7
Korea Land No42 3.5% 27/08/20	韩元 5,000,000,000	5,245,085	0.2	Public Utilities Board 3.52% 10/20	新加坡元 10,000,000	7,609,085	0.3
Korea Monetary No1904 1.6% 02/04/19	韩元 15,500,000,000	14,011,176	0.6	Singapore Govt 1.625% 01/10/19	新加坡元 29,500,000	21,732,757	1.0
Korea Treasury No1909 2.75% 10/9/19	韩元 14,500,000,000	13,196,941	0.6	Singapore Govt 2.75% 01/07/23	新加坡元 20,000,000	15,068,101	0.7
Korea Try No2106 ILB 1.5% 10/06/21	韩元 6,850,000,000	7,035,347	0.3	Theta Cap 7% 11/04/22-RegS	美元 23,510,000	20,790,024	0.9
Korea Try No2306 ILB 1.125% 10/6/23	韩元 7,000,000,000	6,863,765	0.3	United Overseas VRN 3.875%PERP-RegS	美元 18,000,000	17,238,375	0.7
Woori Bank VRN 5.25% Perp-RegS	美元 5,400,000	5,404,793	0.2	<b>国际 (0.3%)</b>			
<b>马来西亚 (2.9%)</b>				Inter-American Devel 9.5% 15/04/19 印尼盾 100,000,000,000 7,001,217 0.3			
Cagamas Bhd 4.1% 18/11/20	林吉特 15,000,000	3,686,904	0.2	<b>泰国 (6.2%)</b>			
Cagamas Bhd NoP8 6.35% 08/08/23	林吉特 55,000,000	13,801,876	0.6	Krung Thai Bk VRN 5.2% 12/24-RegS	美元 26,000,000	26,618,078	1.2
GOHL Capital 4.25% 24/01/27-RegS	美元 18,200,000	17,412,117	0.8	PTTEP Treasury VRN 4.6% Perp-RegS	美元 18,200,000	17,689,591	0.8
Malaysian Govt No0111 4.16% 15/7/21	林吉特 75,000,000	18,538,010	0.8	Thailand Gov 2.55% 26/06/20	泰铢 1,420,000,000	44,718,135	2.0
Malaysian Govt No0517 3.441% 02/21	林吉特 28,000,000	6,774,767	0.3	Thailand Govt 3.65% 17/12/21	泰铢 450,000,000	14,726,906	0.7
Putrajaya Hldgs 4.55% 19/09/23	林吉特 20,000,000	4,870,114	0.2	Thailand Govt 3.875% 13/06/19	泰铢 745,000,000	23,657,740	1.0
<b>毛里求斯 (0.5%)</b>				Thailand Govt IL 1.2% 14/07/21-RegS 泰铢 346,000,000 11,608,868 0.5			
Azure Power Energy 5.5% 11/22-RegS	美元 10,800,000	10,546,320	0.5	<b>维京群岛 (19.0%)</b>			
<b>荷兰 (2.7%)</b>				Baoxin Auto Fin VRN 5.625%Perp-RegS 美元 4,300,000 3,955,328 0.2			
BMW Finance 4.4% 20/09/21-RegS	人民币 31,000,000	4,529,461	0.2	Beijing Cap Polar 4.25% 03/21-RegS	美元 8,300,000	8,201,564	0.4
Daimler Intl Finance 4.8% 4/21-RegS	人民币 22,000,000	3,310,795	0.2	Bluestar Fin Hldgs 3.125% 9/19-RegS	美元 11,700,000	11,781,453	0.5
Greenko Dutch 4.875% 24/07/22- RegS	美元 13,400,000	12,985,577	0.6	CCCI Treasure VRN 3.5% Perp-RegS	美元 18,900,000	19,017,285	0.8
Minejesa Capital 4.625% 08/30- RegS	美元 24,000,000	22,194,050	1.0	China Railway XunJie 3.25%7/26-RegS	美元 10,000,000	9,323,875	0.4
Royal Capital VRN 4.875% Perp-RegS	美元 17,200,000	16,458,866	0.7	China Rein Fin 3.375% 09/03/22-RegS	美元 18,500,000	17,609,456	0.8
<b>新加坡 (6.9%)</b>				Chinalco Capital 4% 25/8/21-RegS 美元 8,500,000 8,310,875 0.4			
Abja Investment 5.45% 24/01/28- RegS	美元 29,300,000	26,832,737	1.2	Chouzhou Intl Inv 4% 05/12/20-RegS	美元 10,700,000	10,476,786	0.5
				Dianjian Haixing VRN 4.05%Perp-RegS	美元 17,100,000	17,429,175	0.8
				DianJian Haiyu VRN 3.5% Perp-RegS	美元 5,000,000	4,730,014	0.2

投资组合 (续)  
截至二零一八年九月三十日 (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)							
Fortune Star 5.25% 23/03/22-RegS	美元 13,300,000	12,534,142	0.5	(III) 货币市场 (0.7%)			
Fortune Star 5.95% 29/01/23-RegS	美元 23,800,000	22,645,634	1.0	新加坡 (0.7%)			
Franshion Brilliant 4% Perp-RegS	美元 11,000,000	10,007,556	0.4	MAS Bills No84 0% 19/10/18	新加坡元 22,000,000	16,088,089	0.7
Gemstones Intl 8.5% 15/08/20-RegS	美元 13,900,000	13,442,844	0.6				
Greenland Gib Inv 3.5% 6/09/19-RegS	美元 12,100,000	11,645,410	0.5	(IV) 衍生性产品 (-0.1%)			
Greenland Global 5.9% 12/02/23- RegS	美元 28,000,000	25,319,856	1.1	远期外汇合约 (-0.1%)		(2,651,280)	(0.1)
HKT Capital No4 3 14/07/26-RegS	美元 34,800,000	32,025,279	1.4	期货 (0.0%)			
Huarong Fin VRN 4% Perp-RegS	美元 25,100,000	24,004,385	1.1	US 10Yr Note (CBT) Fut 12/18	(300)	433,594	0.0
Huarong Finance II 2.056% 2019-RegS	美元 12,800,000	12,811,058	0.6	US 2Yr Note (CBT) Fut 12/18	(1,050)	567,188	0.0
King Power Cap 5.625% 03/11/24- RegS	美元 9,900,000	10,605,128	0.5			(1,650,498)	(0.1)
Minmetals Bounteous 4.2% 07/26-RegS	美元 10,000,000	9,715,167	0.4	总上市投资		2,116,393,517	94.3
Nan Fung Tsy 3.875% 03/10/27-RegS	美元 17,000,000	15,648,665	0.7	其他净资产		127,478,018	5.7
Nan Fung Tsy 5% 05/09/28-RegS	美元 2,500,000	2,416,153	0.1	截至二零一八年九月三十日可赎回份额持 有人应占净资产		2,243,871,535	100.0
NWD Fin (BVI) 5.75% Perp-RegS	美元 11,500,000	10,572,653	0.5				
RKI Overseas Fin 5% 09/08/19-RegS	美元 18,900,000	18,989,250	0.8	总投资, 按成本		2,212,141,432	
SDSC Intl Finance 3.625% 11/19-RegS	美元 12,600,000	12,700,126	0.6				
Sino-Ocean Land 4.45% 04/02/20- RegS	美元 14,000,000	14,065,042	0.6				
Sino-Ocean Land 6% 30/07/24-RegS	美元 3,800,000	3,867,513	0.2				
Sino-Ocean VRN 4.9% Perp-RegS	美元 12,100,000	10,119,969	0.4				
Skyland Mining 3.25% 06/07/20-RegS	美元 8,900,000	8,664,805	0.4				
Studio City Fin 8.5% 01/12/20-RegS	美元 10,000,000	10,333,333	0.5				
Wisdom Glory VRN 5.25% Perp-RegS	美元 13,100,000	12,893,675	0.6				
Yuexiu REIT MTN 4.75% 27/04/21- RegS	美元 10,600,000	10,815,386	0.5				
		1,993,780,146	88.9				

投资组合持有变动表

截至二零一八年九月三十日止年度 (未经审计)

持有占资产净值百分比

	2018	2017
<b>上市投资</b>		
<b>可换股</b>		
中国	2.3	2.4
日本	0.8	1.3
新加坡	0.8	0.9
台湾	0.7	1.1
香港	0.2	1.8
维京群岛	-	1.1
马来西亚	-	1.0
百慕大	-	0.5
菲律宾	-	0.2
<b>债务证券</b>		
维京群岛	19.0	14.9
开曼群岛	13.6	10.0
香港	11.0	6.4
中国	9.2	8.5
新加坡	6.9	6.2
泰国	6.2	2.3
印度	5.6	8.1
韩国	4.9	5.0
印度尼西亚	4.3	11.3
马来西亚	2.9	3.9
荷兰	2.7	2.4
百慕大	1.2	-
英属泽西岛	0.6	0.3
毛里求斯	0.5	0.5
国际	0.3	-
澳大利亚	-	1.6
菲律宾	-	1.0
斯里兰卡	-	0.8
新西兰	-	0.7
俄罗斯	-	0.5
巴基斯坦	-	0.4
美国	-	0.1
<b>货币市场</b>		
新加坡	0.7	-
<b>衍生性产品</b>		
期货	0.0	0.1
远期外汇合约	(0.1)	(0.6)
<b>总上市投资</b>	<u>94.3</u>	<u>94.7</u>
<b>其他净资产</b>	<u>5.7</u>	<u>5.3</u>
<b>截至九月三十日可赎回份额持有人应占净资产</b>	<u><u>100.0</u></u>	<u><u>100.0</u></u>



财务状况表

截至二零一八年九月三十日

	2018 美元	2017 美元
<b>资产</b>		
银行现金	86,723,773	187,823,385
应收经纪款项	1,759,000	31,674,306
分配应收款项	64,118,605	105,375,076
保证金	88,341	1,853,818
衍生性产品 [附注 4(l)(a)]	9,032,571	26,044,811
投资 [附注 4(l)(a)]	2,118,044,015	3,625,861,167
利息和其他应收款项	31,599	161,558
<b>总资产</b>	<b>2,279,797,904</b>	<b>3,978,794,121</b>
<b>负债</b>		
透支经纪款项	1,989,520	-
应付经纪款项	-	80,419,769
赎回应付款项	14,621,917	28,383,039
应付收益分配 [附注 6]	5,897,872	9,950,415
衍生性产品 [附注 4(l)(a)]	10,683,069	45,064,468
其他应付款项	2,733,991	5,138,399
<b>总负债 (不含可赎回份额持有人 应占净资产)</b>	<b>35,926,369</b>	<b>168,956,090</b>
<b>可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]</b>	<b>2,243,871,535</b>	<b>3,809,838,031</b>

由受托人及管理人于二零一九年一月二十二日批准

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

截至二零一八年九月三十日止年度

	2018 美元	2017 美元
<b>收入</b>		
投资及衍生性产品净(亏损) /收益 [附注 5]	(4,765,168)	135,920,264
存款利息	2,480,312	1,036,566
汇兑净亏损	(3,757,236)	(210,508)
其他收入 [附注 13]	195,321	229,325
	<b>(5,846,771)</b>	<b>136,975,647</b>
<b>支出</b>		
管理费用 [附注 8(e)]	31,541,278	33,736,314
受托人费用 [附注 9]	807,884	860,470
托管费用及银行费用	737,208	885,988
基金注册登记机构费用 [附注 8(h)]	444,204	513,302
交易成本	295,504	143,398
法律及专业费用	46,855	223,186
核数师酬金	35,100	24,000
印刷及出版支出	25,214	25,587
估值费用 [附注 8(e)]	17,150	17,220
其他经营费用	20,341	13,942
	<b>33,970,738</b>	<b>36,443,407</b>
<b>净经营(亏损)/利润</b>	<b>(39,817,509)</b>	<b>100,532,240</b>
<b>财务成本</b>		
收益分配 [附注 6]	(97,008,580)	(123,474,429)
利息支出	(42)	-
	<b>(97,008,622)</b>	<b>(123,474,429)</b>
<b>除税前亏损</b>	<b>(136,826,131)</b>	<b>(22,942,189)</b>
税项 [附注 7]	(2,329,484)	(4,751,498)
<b>可赎回份额持有人应占净资产 及总综合收益之减少</b>	<b>(139,155,615)</b>	<b>(27,693,687)</b>

可赎回份额持有人应占净资产变动表  
截至二零一八年九月三十日止年度

	2018 美元	2017 美元
年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 [附注 3]	1,183,054,328	2,620,029,238
赎回可赎回份额 [附注 3]	(2,609,865,209)	(2,707,169,707)
<b>净赎回</b>	<b>(1,426,810,881)</b>	<b>(87,140,469)</b>
	2,383,027,150	3,837,531,718
可赎回份额持有人应占净资产及 总综合收益之减少	(139,155,615)	(27,693,687)
年末可赎回份额持有人应占净资产	2,243,871,535	3,809,838,031

现金流量表  
截至二零一八年九月三十日止年度

	2018 美元	2017 美元
<b>经营业务</b>		
购入投资及衍生性产品	(1,859,809,672)	(1,549,385,875)
出售投资及衍生性产品所得款项	3,294,988,034	1,852,700,293
已收利息	2,479,998	1,009,311
透支经纪款项之增加	1,989,520	-
保证金之减少	1,765,477	4,495,939
已付交易费用	(295,134)	(144,591)
已付基金注册登记机构费用	(502,781)	(545,701)
已付受托人费用	(839,036)	(866,366)
已付税项	(3,366,769)	(5,329,822)
已付管理费用	(32,792,777)	(33,967,741)
其他	(3,863,865)	(1,984,450)
<b>经营业务所产生之现金净额</b>	<b>1,399,752,995</b>	<b>265,980,997</b>
<b>融资活动</b>		
已付利息	(42)	-
分配可赎回份额所得款项	1,224,310,799	2,565,461,159
赎回可赎回份额付款	(2,623,626,331)	(2,705,321,316)
已付收益分配	(101,061,123)	(125,123,600)
<b>融资活动所运用之现金净额</b>	<b>(1,500,376,697)</b>	<b>(264,983,757)</b>
<b>现金及现金等价物之(减少)/增加</b>	<b>(100,623,702)</b>	<b>997,240</b>
年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(亏损)/收益	(475,910)	707,421
<b>年末现金及现金等价物</b>	<b>86,723,773</b>	<b>187,823,385</b>
<b>现金及现金等价物余额分析:</b>		
银行现金	86,723,773	187,823,385

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。

*本基金采纳之准则，以及对准则之修订及解释*

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。此准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、按公允价值透过其他综合收益列账，和按公允价值透过损益列账。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，而在初始时作出不可撤销选项在其他综合收益列账的公允价值变动不得循环入账。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列账的负债，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。本基金已追溯应用香港财务报告准则第 9 号，并无导致当期或往期金融工具分类或计量的变化。

没有其他准则或对现有未生效准则的解释或修订预期会对本基金产生重大影响。

**(b) 投资及衍生性产品**

*分类*

对于投资及衍生性产品，本基金基于其管理该等金融资产的经营模式及该等金融资产的合同现金流量特点进行分类。本基金按公允价值对金融资产组合进行管理并评估业绩。本基金主要关注公允价值信息，并运用该等信息对资产业绩进行评估，从而作出相应决策。

公允价值为负数的衍生性产品合约列示为按公允价值透过损益列账的负债。

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。

*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，其后以公允价值重新计量。投资及衍生性产品所产生之已实现及未实现收益及亏损确认于综合收益表内。当收取投资及衍生性产品现金流量的权利已终止或本基金已转移差不多所有风险和回报时，即终止确认投资及衍生性产品。

*公允价值估计*

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被暂停买卖时，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。

*公允价值级次分层间的转拨*

在公允价值级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表内列账。

**(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。

该等金额按公允价值进行初始确认，并以摊余成本进行后续计量。于每一报告日期，若信贷风险自初始确认后显著增加，本基金应按与存续期预期信用损失相当的金额，对应收经纪款项计量损失准备金。计量损失准备金需考虑的因素包括经纪出现重大财务困难、破产、进行财务重组或拖欠付款的可能性。

**(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表上分类为金融负债，代表可赎回份额持有人应占净资产（或“资产净值”或“净资产”或“NAV”）。如果可赎回份额持有人行使他的赎回权，则将可赎回金额以应付账款的形式在财务状况表入账。

**(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）

2018

	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	24,155,484.127	15,026,586.666	435,422.728	462,584,033.437	8,686,844.376
总分配	14,682,022.333	7,531,341.097	14,123.213	190,444,560.465	6,219,438.755
总赎回	(21,256,858.964)	(9,862,213.080)	(148,901.223)	(395,936,044.088)	(8,340,767.719)
年末	17,580,647.496	12,695,714.683	300,644.718	257,092,549.814	6,565,515.412
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净资产	151,437,984	109,956,213	2,722,720	2,370,395,595	56,146,414
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	8.61	8.66	9.06	9.22	8.55
	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	1,589,789.521	490,430,593.426	1,159,768.963	72,495,884.779	330,804,088.910
总分配	566,510.249	178,631,654.002	2,571,529.305	19,299,408.414	55,805,420.400
总赎回	(608,124.895)	(301,670,439.005)	(3,566,396.124)	(56,442,604.373)	(237,223,196.120)
年末	1,548,174.875	367,391,808.423	164,902.144	35,352,688.820	149,386,313.190
	人民币	人民币	美元	美元	人民币
可赎回份额持有人应占净资产	18,776,312	3,249,538,350	1,974,794	371,634,095	1,721,353,017
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	12.13	8.84	11.98	10.51	11.52

2018

	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	94,155,390.680	59,066,119.270	2,915,664.600
总分配 总赎回	23,444,420.230 (53,596,002.020)	11,051,185.390 (23,892,382.100)	612,415.770 (1,166,097.650)
年末	64,003,808.890	46,224,922.560	2,361,982.720
	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应占 净资产	611,206,738	494,672,657	22,623,212
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	9.55	10.70	9.58

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 总赎回	21,675,357.155 (32,148,454.537)	11,473,295.495 (15,675,549.589)	207,471.310 (445,271.986)	412,244,272.273 (430,741,871.552)	10,532,337.932 (11,920,248.119)
年末	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

2017

	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 总赎回	828,282.694 (1,081,005.879)	258,552,159.072 (307,844,076.951)	4,873,434.041 (5,947,906.098)	53,778,808.383 (62,713,688.179)	240,311,250.340 (255,493,795.540)
年末	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:					
年初	77,499,861.830	40,714,981.090	1,788,057.380		
总分配 总赎回	52,551,036.590 (35,895,507.740)	27,533,054.400 (9,181,916.220)	1,670,314.000 (542,706.780)		
年末	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 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。

(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	合计 美元
<b>2018</b>				
银行现金	86,723,773	-	-	86,723,773
保证金	88,341	-	-	88,341
衍生性产品	1,000,782	-	-	1,000,782
投资 (注*)	232,810,453	1,008,131,710	877,101,852	2,118,044,015
总利率敏感性缺口	320,623,349	1,008,131,710	877,101,852	2,205,856,911
<b>2017</b>				
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	341,770,207	1,620,894,848	1,856,639,503	3,819,304,558

注:

\* 投资的票面息率范围介乎年率 0.00% - 10.22% (二零一七年: 年率 0.00% - 10.00%)。

截至九月三十日，本基金投资及衍生性产品之公平值如下：

	2018		2017	
	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	108,175,780	4.8	390,047,322	10.3
债务证券				
- 维京群岛	426,678,840	19.0	566,697,831	14.9
- 开曼群岛	304,219,280	13.6	382,579,840	10.0
- 香港	247,383,575	11.0	243,199,284	6.4
- 中国	207,405,358	9.2	324,080,000	8.5
- 新加坡	155,344,724	6.9	237,488,411	6.2
- 泰国	139,019,318	6.2	89,203,892	2.3
- 印度	126,724,771	5.6	309,403,930	8.1
- 韩国	109,374,138	4.9	189,301,052	5.0
- 印度尼西亚	96,707,171	4.3	430,615,962	11.3
- 其他	180,922,971	8.2	463,243,643	12.2
	1,993,780,146	88.9	3,235,813,845	84.9
货币市场	16,088,089	0.7	-	-
衍生性产品				
- 远期外汇合约	8,031,789	0.4	22,278,623	0.6
- 期货	1,000,782	0.0	3,766,188	0.1
	9,032,571	0.4	26,044,811	0.7
	2,127,076,586	94.8	3,651,905,978	95.9
负债				
衍生性产品				
- 远期外汇合约	(10,683,069)	(0.5)	(45,064,468)	(1.2)
	(10,683,069)	(0.5)	(45,064,468)	(1.2)
总上市投资	2,116,393,517	94.3	3,606,841,510	94.7

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期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。于二零一八年九月三十日，投资人估计本基金的修正久期为 2.83（二零一七年：3.45）。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 15,875,391 美元（二零一七年：32,859,853 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及保证金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
<b>2018</b>			
澳元	109,806,052	-7.8	(8,564,872)
加元	85,280,810	-3.2	(2,728,986)
人民币（境外）	723,239,194	-3.3	(23,866,893)
人民币（境内）	114,781,712	-3.5	(4,017,360)
港元	(1,409,706)	-0.2	2,819
印度卢比	13,257,770	-9.9	(1,312,519)
印尼盾	12,802,035	-9.6	(1,228,995)
日元	3,805,534	-0.9	(34,250)
韩元	2,651,062	+3.3	87,485
林吉特	2,918,678	+2.0	58,374
纽元	37,405,103	-8.3	(3,104,624)
新加坡元	75,951,173	-0.6	(455,707)
英镑	3,732,213	-2.8	(104,502)
泰铢	67,411,286	+3.1	2,089,750
	<u>1,251,632,916</u>		<u>(43,180,280)</u>
<b>2017</b>			
澳元	178,549,885	+2.5	4,463,747
加元	110,128,764	+5.1	5,616,567
人民币（境外）	1,387,354,690	+0.4	5,549,419
人民币（境内）	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>

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方向变动。

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。

管理人会参考交易对手的违约历史及其信贷评级等因素进行信贷风险监控。由于过去 5 年内, 本基金在分配应收款项或应收经纪款项等应收款项未发生历史违约, 故管理人认为该等应收款项不存在重大信贷风险。

总体而言, 由于该等工具违约风险较低, 且本基金交易对手均有足够能力在短期内履行其合同义务, 故管理人认为违约概率近乎零。因此, 未对 12 个月内的预期信贷损失确认损失准备金。

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:

	2018 美元	2017 美元
银行现金	86,723,773	187,823,385
应收经纪款项	1,759,000	31,674,306
分配应收款项	64,118,605	105,375,076
保证金	88,341	1,853,818
经纪发行的衍生性产品	8,031,789	22,278,623
投资 - 债务证券	1,993,780,146	3,235,813,845
投资 - 货币市场	16,088,089	-
利息和其他应收款项	31,599	161,558
	<u>2,170,621,342</u>	<u>3,584,980,611</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和货币市场, 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及货币市场之信贷风险。

下表概述截至九月三十日按照信贷评级的债务证券和货币市场。

	2018 占资产净值百分比	2017 占资产净值百分比
标准普尔(AAA)/穆迪(Aaa)/惠誉(AAA)	2.0	0.5
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	1.4	1.2
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	14.8	17.8
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	29.7	37.7
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	17.2	11.8
标准普尔(B)/穆迪(B)/惠誉(B)	6.1	2.7
未评级	18.4	13.3
	<u>89.6</u>	<u>85.0</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和货币市场。

	2018 占资产净值百分比	2017 占资产净值百分比
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	1.1	0.3
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	4.3	1.4
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	5.1	3.9
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	0.5	-
未评级	7.4	7.7
	<u>18.4</u>	<u>13.3</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。

	2018 交易对手风险承担 美元	2017 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)	14,439,103	91,287,775
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	72,284,670	96,535,610
存放经纪之保证金及经纪发行/持有的衍生性产品		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	6,649,185	2,669,432
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	2,470,000	21,463,009
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	1,727	-
托管机构的投资余额		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	<u>2,118,044,015</u>	<u>3,625,861,167</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。

	2018		2017	
	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
透支经纪款项	1,989,520	-	-	-
应付经纪款项	-	-	80,419,769	-
赎回应付款项	14,621,917	-	28,383,039	-
应付收益分配	5,897,872	-	9,950,415	-
衍生性产品	6,929,140	3,753,929	31,832,974	13,231,494
其他应付款项	2,733,991	-	5,138,399	-
可赎回份额持有人应占净资产	2,243,871,535	-	3,809,838,031	-
<b>总金融负债</b>	<b>2,276,043,975</b>	<b>3,753,929</b>	<b>3,965,562,627</b>	<b>13,231,494</b>

投资管理通过投资于预期一般在一个月以内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**

截至二零一八年及二零一七年九月三十日，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盘提供抵押而持有。

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	
<b>2018</b>				
<b>资产</b>				
保证金	88,341	-	-	88,341
衍生性产品	1,504,332	(406,722)	-	1,097,610
按公允价值透过损益列账的金融资产	1,592,673	(406,722)	-	1,185,951

	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	
<b>2018</b>				
<b>负债</b>				
衍生性产品	2,801,694	(406,722)	-	2,394,972
按公允价值透过损益列账的金融负债	2,801,694	(406,722)	-	2,394,972

	财务状况表中列	受总抵销安排及类似协议规限的相		净额
	示的经确认金融	关金额		
	资产总额	金融工具	抵押品及保证金	
	美元	美元	美元	美元
<b>2017</b>				
<b>资产</b>				
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	受总抵销安排及类似协议规限的相		净额
	示的经确认金融	关金额		
	负债总额	金融工具	抵押品及保证金	
	美元	美元	美元	美元
<b>2017</b>				
<b>负债</b>				
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>

## (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呈示，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

截至二零一八年及二零一七年九月三十日，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）按公平值级次计量之公平值：

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
<b>2018</b>				
<u>资产</u>				
可换股	-	108,175,780	-	108,175,780
债务证券	-	1,993,780,146	-	1,993,780,146
货币市场	16,088,089	-	-	16,088,089
衍生性产品	1,000,782	8,031,789	-	9,032,571
按公平值透过损益列账的总金融资产	<u>17,088,871</u>	<u>2,109,987,715</u>	-	<u>2,127,076,586</u>
<u>负债</u>				
衍生性产品	-	10,683,069	-	10,683,069
按公平值透过损益列账的总金融负债	<u>-</u>	<u>10,683,069</u>	-	<u>10,683,069</u>
<b>2017</b>				
<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>-</u>	<u>45,064,468</u>	-	<u>45,064,468</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。

在截至二零一八年及二零一七年九月三十日止年度，公平值层次之间并无转移。

截至二零一八年与二零一七年九月三十日，以摊余成本计量的资产和负债，其账面价值为其公允价值的合理约数。

## 5 投资及衍生性产品净（亏损）/收益

	2018 美元	2017 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益/亏损之变动	(129,326,332)	(65,181,232)
投资及衍生性产品销售之实现收益	124,561,164	201,101,496
	<u>(4,765,168)</u>	<u>135,920,264</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。

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。

	2018 美元	2017 美元
净经营（亏损）／利润	(39,817,509)	100,532,240
调整：		
投资及衍生性产品净亏损／（收益）	4,765,168	(135,920,264)
利息收入包括于投资及衍生性产品净收益（票面利率）	131,698,060	136,937,668
汇兑净亏损	3,757,236	210,508
交易成本	295,504	143,398
利息支出	(42)	-
税项	(2,329,484)	(4,751,498)
资本利得税	(247,125)	762,515
收益可分配金额	98,121,808	97,914,567

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2018 美元	2017 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	475,050,289.033	(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	(1,612,308)	
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	9,016,520.774	(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	2018 美元	2017 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	(497,801)	
加元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	加元 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	(452,910)	
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)	2018年4月30日	2018年5月9日	澳元 0.0303	21,456,792.011	(490,759)	
加元对冲类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	加元 0.0254	14,403,648.055	(285,388)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	英镑 0.0197	334,905.127	(9,087)	
港元类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	港元 0.0330	376,743,752.321	(1,584,117)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	纽元 0.0317	7,709,132.298	(172,190)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	人民币 0.0423	434,028,314.647	(2,905,405)	
美元类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	美元 0.0375	49,067,424.445	(1,840,028)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2018年4月27日	2018年5月9日	人民币 0.0457	82,702,387.110	(597,375)	
PRC美元份额 (每月派息)	2018年4月27日	2018年5月9日	美元 0.0342	2,753,474.830	(94,169)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	澳元 0.0303	21,675,854.749	(496,951)	
加元对冲类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	加元 0.0258	14,348,867.766	(285,385)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	英镑 0.0200	330,181.407	(8,787)	
港元类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	港元 0.0330	340,881,926.100	(1,434,076)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	纽元 0.0318	7,595,858.380	(169,482)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	人民币 0.0449	427,965,458.387	(2,999,891)	
美元类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	美元 0.0375	43,415,039.106	(1,628,064)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	人民币 0.0486	76,369,421.920	(579,437)	
PRC美元份额 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	美元 0.0342	2,603,157.890	(89,028)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	澳元 0.0298	20,843,837.649	(458,934)	
加元对冲类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	加元 0.0247	13,893,108.204	(260,869)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	英镑 0.0187	320,650.110	(7,916)	
港元类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	港元 0.0330	313,832,460.579	(1,320,061)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	纽元 0.0305	7,665,593.969	(158,295)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	人民币 0.0446	407,259,773.560	(2,740,545)	
美元类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	美元 0.0375	40,157,398.887	(1,505,902)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	人民币 0.0482	71,983,199.210	(523,490)	
PRC美元份额 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	美元 0.0342	2,508,826.220	(85,802)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	澳元 0.0306	19,693,654.887	(447,992)	
加元对冲类别 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	加元 0.0260	13,484,298.144	(269,272)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	英镑 0.0197	320,861.736	(8,292)	
港元类别 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	港元 0.0330	292,485,677.201	(1,230,004)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	纽元 0.0309	7,122,166.947	(149,827)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	人民币 0.0383	394,344,815.042	(2,216,135)	
美元类别 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	美元 0.0375	37,585,305.856	(1,409,449)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	人民币 0.0413	68,112,285.740	(412,759)	
PRC美元份额 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	美元 0.0341	2,446,225.160	(83,416)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	澳元 0.0298	18,492,177.973	(398,532)	
加元对冲类别 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	加元 0.0265	13,126,097.501	(266,760)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	英镑 0.0209	302,121.765	(8,207)	
港元类别 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	港元 0.0330	268,349,826.628	(1,128,253)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	纽元 0.0313	6,910,260.861	(143,509)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	人民币 0.0346	374,397,685.789	(1,896,073)	
美元类别 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	美元 0.0375	36,524,294.009	(1,369,661)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	人民币 0.0373	65,090,839.080	(355,365)	
PRC美元份额 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	美元 0.0342	2,382,212.190	(81,472)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2018 美元	2017 美元
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	澳元 0.0303	17,607,923.132	(386,028)	
加元对冲类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	加元 0.0256	12,715,819.342	(251,837)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	英镑 0.0210	300,644.718	(8,233)	
港元类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	港元 0.0330	257,404,986.539	(1,085,556)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	纽元 0.0305	6,565,515.433	(132,755)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	人民币 0.0413	367,315,634.623	(2,206,437)	
美元类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	美元 0.0375	35,489,736.820	(1,330,865)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	人民币 0.0446	64,070,212.420	(415,617)	
PRC美元份额 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	美元 0.0341	2,361,982.720	(80,544)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	澳元 0.0361	34,679,333.896		(952,651)
加元对冲类别 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	加元 0.0272	19,848,410.109		(402,818)
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	英镑 0.0244	741,757.607		(22,097)
港元类别 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	港元 0.0304	507,073,157.794		(1,987,791)
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	纽元 0.0408	10,631,741.006		(310,323)
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	人民币 0.0550	513,027,950.938		(4,160,535)
美元类别 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	美元 0.0350	82,438,595.966		(2,885,351)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	人民币 0.0592	74,055,723.070		(646,436)
PRC美元份额 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	美元 0.0319	1,787,474.040		(57,020)
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	澳元 0.0364	34,175,387.881		(919,118)
加元对冲类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	加元 0.0271	20,666,602.688		(416,529)
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	英镑 0.0254	773,257.002		(24,539)
港元类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	港元 0.0304	506,988,401.014		(1,986,998)
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	纽元 0.0394	10,703,770.321		(298,921)
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	人民币 0.0534	472,564,966.158		(3,652,504)
美元类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	美元 0.0350	78,682,899.551		(2,753,901)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	人民币 0.0575	69,354,053.340		(577,202)
PRC美元份额 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	美元 0.0319	1,746,695.720		(55,720)
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	澳元 0.0361	32,154,066.482		(840,508)
加元对冲类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	加元 0.0251	18,554,287.255		(347,275)
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	英镑 0.0206	526,477.901		(13,401)
港元类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	港元 0.0304	472,723,007.671		(1,853,541)
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	纽元 0.0382	9,745,136.069		(259,580)
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	人民币 0.0735	446,297,794.670		(4,708,594)
美元类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	美元 0.0350	71,503,414.442		(2,502,619)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	人民币 0.0792	64,703,249.100		(735,581)
PRC美元份额 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	美元 0.0319	1,668,033.960		(53,210)
澳元对冲类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	澳元 0.0382	29,537,381.826		(852,339)
加元对冲类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	加元 0.0272	17,018,014.446		(352,678)
英镑对冲类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	英镑 0.0240	534,681.718		(16,103)
港元类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	港元 0.0326	437,140,971.642		(1,836,786)
纽元对冲类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	纽元 0.0404	9,182,007.752		(269,813)
人民币对冲类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	人民币 0.1081	401,155,516.254		(6,318,652)
美元类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	美元 0.0375	66,880,409.659		(2,508,015)
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2017年1月26日	2017年2月8日	人民币 0.1166	62,237,653.500		(1,059,790)
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)



收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2018 美元	2017 美元
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		(3,291,773)
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)
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)
可赎回份额持有人之总收益分配					(97,008,580)	(123,474,429)



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。

截至二零一八年及二零一七年九月三十日止年度，已就若干收取的利息收入和所得的资本收益预扣或缴付海外税项。

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。所有该等交易均于正常业务过程中按一般商业条款订立。

(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
<b>2018</b>					
J.P. Morgan Securities plc London	114,718,750*	2.36	2,100	2.75	0.00
<b>2017</b>					
JP Morgan Asset Management (Europe) S.à r.l.	60,335,600	1.86	-	-	-
J.P. Morgan Securities plc London	32,391,650	1.00	-	-	-

\* 上述金额包含总计 114,718,750 美元的期货交易（二零一七年：无）。

(b) 与管理人及其关联人士之年末结余：

	2018 美元	2017 美元
银行现金	10,875,147	22,985,034
保證金	260	-
应收款项	31,590	28,966
应付款项	(1,795,867)	(3,088,641)
透支经纪款项	(1,989,520)	-

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 241,049 美元（二零一七年：93,223 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 4,681 美元（二零一七年：109,977 美元）。

(e) 支付给摩根基金（亚洲）有限公司之管理费按本基金资产净值的年率百分之一计算。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比率为本基金资产净值的年率介乎百分之零点点一五至百分之零点点五不等。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，按年率百分之零点零四计算；超过 7,000 万美元时，按年率百分之零点零二五计算。受托人费用于每个交易日累计，并于每月月底支付。

## 10 借款

截至二零一八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。截至二零一七年九月三十日止年度，本基金无银行借款。

## 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）、市场分析及相关出版物的。

## 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
<b>2018</b>			
未平仓合约：			
美元 72,798	加元 94,119	2018年10月2日	16
美元 1,098	加元 1,424	2018年10月2日	4
美元 63,926	加元 82,896	2018年10月3日	205
美元 1,092	加元 1,427	2018年10月3日	12
美元 1,096	纽元 1,654	2018年10月3日	0
澳元 574,242	美元 416,821	2018年10月4日	1,299
美元 249,410	纽元 376,313	2018年10月4日	86
美元 33,386	澳元 46,244	2018年10月4日	76
美元 1,101	纽元 1,660	2018年10月4日	0
人民币 3,316,581,310	美元 483,220,122	2018年10月9日	836,361
人民币 66,859,111	美元 9,740,589	2018年10月9日	16,193
人民币 11,372,680	美元 1,666,474	2018年10月9日	12,361
人民币 13,032,056	美元 1,907,228	2018年10月9日	11,767
人民币 5,826,722	美元 857,578	2018年10月9日	10,104
人民币 4,082,542	美元 599,985	2018年10月9日	6,194
人民币 6,994,131	美元 1,023,161	2018年10月9日	5,892
人民币 18,906,534	美元 2,755,038	2018年10月9日	5,157
人民币 17,680,856	美元 2,575,608	2018年10月9日	3,997
人民币 16,417,389	美元 2,391,584	2018年10月9日	3,738
人民币 2,819,152	美元 413,310	2018年10月9日	3,276
人民币 5,105,046	美元 745,668	2018年10月9日	3,159
人民币 3,253,570	美元 475,610	2018年10月9日	2,391

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
人民币 6,239,025	美元 909,654	2018年10月9日	2,213
人民币 3,152,809	美元 460,649	2018年10月9日	2,086
人民币 903,504	美元 133,088	2018年10月9日	1,677
人民币 3,989,907	美元 581,974	2018年10月9日	1,657
人民币 3,303,526	美元 482,142	2018年10月9日	1,657
人民币 4,162,343	美元 607,041	2018年10月9日	1,644
人民币 6,802,394	美元 990,419	2018年10月9日	1,038
人民币 1,798,099	美元 262,475	2018年10月9日	948
人民币 1,290,200	美元 188,441	2018年10月9日	787
人民币 4,874,556	美元 709,486	2018年10月9日	501
人民币 540,550	美元 78,934	2018年10月9日	313
人民币 354,517	美元 51,779	2018年10月9日	216
人民币 75,272	美元 10,975	2018年10月9日	27
人民币 14,610	美元 2,141	2018年10月9日	16
人民币 7,576	美元 1,113	2018年10月9日	11
人民币 7,466	美元 1,095	2018年10月9日	9
人民币 44,507	美元 6,480	2018年10月9日	7
人民币 35,212	美元 5,126	2018年10月9日	5
人民币 7,521	美元 1,099	2018年10月9日	5
人民币 12,738	美元 1,858	2018年10月9日	5
人民币 7,537	美元 1,101	2018年10月9日	5
人民币 7,521	美元 1,098	2018年10月9日	5
人民币 8,402	美元 1,226	2018年10月9日	4
人民币 7,540	美元 1,099	2018年10月9日	3
美元 502,971,661	人民币 3,466,329,796	2018年10月9日	1,192,431
美元 2,687,181	人民币 18,519,246	2018年10月9日	6,371
美元 405,183	人民币 2,818,792	2018年10月9日	4,799
美元 801,096	人民币 5,520,673	2018年10月9日	1,864
美元 534,618	人民币 3,686,991	2018年10月9日	1,641
美元 460,935	人民币 3,175,975	2018年10月9日	998
美元 290,106	人民币 2,000,000	2018年10月9日	786
美元 323,441	人民币 2,225,848	2018年10月9日	300
美元 203,438	人民币 1,400,018	2018年10月9日	189
美元 8,387	人民币 58,348	2018年10月9日	99
美元 1,591	人民币 11,069	2018年10月9日	19
美元 4,304	人民币 29,664	2018年10月9日	10
澳元 151,821,360	美元 109,974,232	2018年10月10日	116,295
澳元 1,365,560	美元 1,004,143	2018年10月10日	16,023
澳元 255,161	美元 187,466	2018年10月10日	2,831
澳元 188,070	美元 138,180	2018年10月10日	2,092
澳元 286,823	美元 209,144	2018年10月10日	1,598
澳元 346,242	美元 251,999	2018年10月10日	1,458
澳元 23,869	美元 17,497	2018年10月10日	225
澳元 1,498	美元 1,092	2018年10月10日	8
澳元 1,578	美元 1,149	2018年10月10日	7
加元 98,652	美元 76,483	2018年10月10日	151
加元 1,427	美元 1,106	2018年10月10日	2
人民币 4,771,345	美元 702,823	2018年10月10日	8,900
人民币 2,493,565	美元 366,999	2018年10月10日	4,346
人民币 1,980,511	美元 291,047	2018年10月10日	3,010
人民币 3,304,002	美元 482,667	2018年10月10日	2,148
人民币 2,499,029	美元 365,563	2018年10月10日	2,116
人民币 1,390,405	美元 204,328	2018年10月10日	2,113
人民币 1,088,363	美元 160,317	2018年10月10日	2,030
人民币 2,453,499	美元 358,505	2018年10月10日	1,680
人民币 2,438,764	美元 356,352	2018年10月10日	1,669
人民币 2,929,799	美元 427,686	2018年10月10日	1,589
人民币 2,429,715	美元 354,947	2018年10月10日	1,580
人民币 3,539,813	美元 516,365	2018年10月10日	1,551
人民币 3,176,696	美元 463,396	2018年10月10日	1,392
人民币 3,116,808	美元 454,664	2018年10月10日	1,369
人民币 2,579,730	美元 376,489	2018年10月10日	1,304

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
人民币 3,495,622	美元 509,672	2018年10月10日	1,285
人民币 1,089,679	美元 159,753	2018年10月10日	1,275
人民币 2,199,353	美元 321,057	2018年10月10日	1,193
人民币 1,893,940	美元 276,404	2018年10月10日	958
人民币 1,110,527	美元 162,450	2018年10月10日	940
人民币 3,932,432	美元 572,805	2018年10月10日	890
人民币 1,769,540	美元 258,131	2018年10月10日	777
人民币 357,111	美元 52,601	2018年10月10日	664
人民币 1,178,174	美元 172,010	2018年10月10日	662
人民币 848,316	美元 123,898	2018年10月10日	522
人民币 1,186,229	美元 172,968	2018年10月10日	449
人民币 1,185,979	美元 172,927	2018年10月10日	444
人民币 201,725	美元 29,690	2018年10月10日	352
人民币 872,296	美元 127,193	2018年10月10日	330
人民币 3,688,776	美元 536,800	2018年10月10日	321
人民币 806,147	美元 117,558	2018年10月10日	315
人民币 590,117	美元 86,055	2018年10月10日	231
人民币 2,048,959	美元 298,170	2018年10月10日	178
人民币 135,282	美元 19,833	2018年10月10日	158
人民币 180,883	美元 26,418	2018年10月10日	111
人民币 1,757,693	美元 255,730	2018年10月10日	99
人民币 52,000	美元 7,659	2018年10月10日	97
人民币 1,520,456	美元 221,214	2018年10月10日	86
人民币 90,140	美元 13,130	2018年10月10日	20
人民币 7,478	美元 1,101	2018年10月10日	13
人民币 7,576	美元 1,113	2018年10月10日	12
人民币 7,466	美元 1,094	2018年10月10日	9
人民币 7,466	美元 1,094	2018年10月10日	9
人民币 7,521	美元 1,098	2018年10月10日	5
人民币 7,521	美元 1,098	2018年10月10日	5
人民币 7,526	美元 1,096	2018年10月10日	1
人民币 7,526	美元 1,096	2018年10月10日	1
人民币 7,552	美元 1,099	2018年10月10日	0
人民币 7,552	美元 1,099	2018年10月10日	0
英镑 2,732,740	美元 3,594,584	2018年10月10日	29,724
英镑 4,910	美元 6,436	2018年10月10日	31
英镑 836	美元 1,101	2018年10月10日	10
纽元 56,688,266	美元 37,666,547	2018年10月10日	82,226
纽元 42,950	美元 28,724	2018年10月10日	249
纽元 353,715	美元 234,613	2018年10月10日	100
纽元 8,877	美元 5,959	2018年10月10日	74
纽元 8,163	美元 5,476	2018年10月10日	64
纽元 12,254	美元 8,159	2018年10月10日	35
纽元 1,639	美元 1,098	2018年10月10日	12
纽元 1,787	美元 1,190	2018年10月10日	5
美元 89,737,385	加元 116,053,681	2018年10月10日	59,635
美元 3,737,636	英镑 2,892,057	2018年10月10日	35,041
美元 755,112	澳元 1,058,007	2018年10月10日	10,461
美元 2,022,807	人民币 13,950,943	2018年10月10日	6,156
美元 165,627	加元 217,920	2018年10月10日	2,990
美元 126,083	澳元 177,087	2018年10月10日	2,058
美元 170,549	澳元 237,517	2018年10月10日	1,318
美元 141,916	加元 185,091	2018年10月10日	1,299
美元 57,533	澳元 81,079	2018年10月10日	1,136
美元 167,486	加元 217,796	2018年10月10日	1,034
美元 92,673	加元 120,804	2018年10月10日	800
美元 137,675	加元 178,955	2018年10月10日	792
美元 163,277	澳元 226,673	2018年10月10日	744
美元 42,031	澳元 58,885	2018年10月10日	579



交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 81,232	澳元 112,969	2018年10月10日	513
美元 30,451	加元 40,000	2018年10月10日	499
美元 173,674	澳元 240,573	2018年10月10日	405
美元 230,210	澳元 318,665	2018年10月10日	375
美元 56,037	纽元 85,036	2018年10月10日	342
美元 16,180	加元 21,284	2018年10月10日	288
美元 34,628	澳元 48,221	2018年10月10日	265
美元 13,013	纽元 20,000	2018年10月10日	247
美元 55,837	澳元 77,477	2018年10月10日	225
美元 84,101	人民币 579,809	2018年10月10日	224
美元 453,074	人民币 3,116,808	2018年10月10日	220
美元 222,028	人民币 1,528,008	2018年10月10日	199
美元 170,601	人民币 1,174,158	2018年10月10日	163
美元 50,562	人民币 348,718	2018年10月10日	154
美元 15,350	加元 20,000	2018年10月10日	126
美元 139,055	人民币 956,986	2018年10月10日	125
美元 257,229	人民币 1,769,540	2018年10月10日	125
美元 4,724	纽元 7,226	2018年10月10日	67
美元 20,817	纽元 31,470	2018年10月10日	48
美元 6,000	英镑 4,634	2018年10月10日	46
美元 15,828	澳元 21,925	2018年10月10日	37
美元 110,127	人民币 757,451	2018年10月10日	34
美元 53,088	人民币 365,224	2018年10月10日	29
美元 128,893	加元 166,605	2018年10月10日	18
美元 2,901	人民币 20,000	2018年10月10日	8
美元 14,637	人民币 100,700	2018年10月10日	8
美元 15,848	人民币 109,000	2018年10月10日	5
美元 1,086	纽元 1,643	2018年10月10日	3
美元 1,398	人民币 9,623	2018年10月10日	1
人民币 7,526,346	美元 1,098,372	2018年11月5日	5,650
人民币 7,851,490	美元 1,145,141	2018年11月5日	5,212
人民币 6,294,724	美元 918,087	2018年11月5日	4,179
人民币 5,024,939	美元 732,687	2018年11月5日	3,135
人民币 3,999,297	美元 582,472	2018年11月5日	1,828
人民币 2,459,133	美元 358,608	2018年11月5日	1,575
人民币 3,692,584	美元 537,666	2018年11月5日	1,553
人民币 7,422,512	美元 1,078,816	2018年11月5日	1,169
人民币 4,734,383	美元 688,242	2018年11月5日	874
人民币 3,442,393	美元 500,423	2018年11月5日	634
人民币 4,749,871	美元 689,841	2018年11月5日	224
人民币 1,321,101	美元 191,956	2018年11月5日	150
人民币 1,226,998	美元 178,288	2018年11月5日	145
人民币 60,357	美元 8,803	2018年11月5日	40
人民币 7,538	美元 1,099	2018年11月5日	5
人民币 8,519	美元 1,238	2018年11月5日	2
人民币 7,552	美元 1,098	2018年11月5日	1
美元 1,239,283	人民币 8,539,607	2018年11月5日	552
美元 83,316	人民币 575,322	2018年11月5日	213
美元 38,130	人民币 262,686	2018年11月5日	8
澳元 270,196	美元 196,952	2018年11月13日	1,384
澳元 300,590	美元 218,670	2018年11月13日	1,103
澳元 102,116	美元 74,145	2018年11月13日	233
澳元 52,952	美元 38,482	2018年11月13日	155
澳元 14,618	美元 10,635	2018年11月13日	54
澳元 1,512	美元 1,102	2018年11月13日	8
澳元 1,509	美元 1,097	2018年11月13日	5
澳元 281,345	美元 203,642	2018年11月13日	4
澳元 1,524	美元 1,103	2018年11月13日	0
加元 272,924	美元 211,656	2018年11月13日	316
加元 174,006	美元 134,815	2018年11月13日	73
加元 2,060	美元 1,598	2018年11月13日	2
加元 1,437	美元 1,114	2018年11月13日	1

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
人民币 2,258,431	美元 329,235	2018年11月13日	1,479
人民币 3,341,809	美元 486,410	2018年11月13日	1,429
人民币 2,308,867	美元 336,062	2018年11月13日	987
人民币 668,410	美元 97,429	2018年11月13日	426
人民币 602,316	美元 87,806	2018年11月13日	395
人民币 2,221,670	美元 322,692	2018年11月13日	272
人民币 1,871,746	美元 271,866	2018年11月13日	229
人民币 2,073,626	美元 300,957	2018年11月13日	21
人民币 27,039	美元 3,941	2018年11月13日	17
人民币 632,225	美元 91,758	2018年11月13日	6
人民币 7,538	美元 1,099	2018年11月13日	5
人民币 19,353	美元 2,812	2018年11月13日	4
人民币 7,527	美元 1,094	2018年11月13日	1
人民币 7,570	美元 1,099	2018年11月13日	0
人民币 7,568	美元 1,098	2018年11月13日	0
人民币 7,570	美元 1,099	2018年11月13日	0
英镑 13,817	美元 18,196	2018年11月13日	142
纽元 565,090	美元 375,875	2018年11月13日	1,164
纽元 220,148	美元 146,843	2018年11月13日	863
纽元 106,623	美元 71,003	2018年11月13日	301
纽元 6,351	美元 4,230	2018年11月13日	18
纽元 1,663	美元 1,109	2018年11月13日	7
纽元 1,660	美元 1,101	2018年11月13日	1
美元 85,223,050	加元 110,337,601	2018年11月13日	217,046
美元 250,450,588	人民币 1,725,844,986	2018年11月13日	13,114
美元 89,930,097	人民币 619,704,698	2018年11月13日	4,709
美元 103,413	加元 135,009	2018年11月13日	1,130
美元 145,125	加元 187,478	2018年11月13日	49
美元 106,197	人民币 732,018	2018年11月13日	38
美元 45,472	人民币 313,452	2018年11月13日	18
美元 43,521	人民币 300,000	2018年11月13日	17
美元 15,958	人民币 110,000	2018年11月13日	6
美元 34,424	澳元 47,565	2018年11月13日	4
美元 50,124	人民币 345,396	2018年11月13日	2
印尼盾 317,460,000,000	美元 22,000,000	2018年11月19日	864,309
印尼盾 218,625,000,000	美元 15,000,000	2018年11月19日	444,495
人民币 568,755,321	美元 83,340,218	2018年12月6日	877,254
人民币 113,000,729	美元 16,500,000	2018年12月6日	116,197
印尼盾 542,441,800,000	美元 36,626,725	2018年12月6日	619,205
印尼盾 160,177,341,002	美元 10,657,175	2018年12月6日	24,534
印度卢比 1,531,665,000	美元 21,644,386	2018年12月6日	747,636
印度卢比 1,757,262,500	美元 24,500,000	2018年12月6日	525,386
印度卢比 618,986,420	美元 8,609,589	2018年12月6日	164,658
日元 1,552,730,200	美元 14,087,797	2018年12月6日	344,182
林吉特 160,496,700	美元 39,000,000	2018年12月6日	258,883
美元 8,255,481	印尼盾 126,473,973,355	2018年12月6日	141,448
美元 7,351,138	新加坡元 10,100,000	2018年12月6日	51,310
		未实现总收益	8,031,789

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 18,162	英镑 13,817	2018年10月2日	(144)
美元 38,474	澳元 52,952	2018年10月2日	(158)
美元 70,993	纽元 106,623	2018年10月2日	(302)
美元 74,127	澳元 102,116	2018年10月3日	(236)
美元 375,816	纽元 565,090	2018年10月3日	(1,162)
加元 135,009	美元 103,333	2018年10月4日	(1,123)
美元 1,103	澳元 1,524	2018年10月4日	(0)
美元 1,113	加元 1,437	2018年10月4日	(1)
美元 203,585	澳元 281,345	2018年10月5日	(4)
美元 134,707	加元 174,006	2018年10月5日	(80)
澳元 47,565	美元 34,416	2018年10月9日	(2)
人民币 7,540	美元 1,093	2018年10月9日	(3)
人民币 5,954,614	美元 863,803	2018年10月9日	(2,273)
人民币 6,088,138	美元 882,846	2018年10月9日	(2,650)
人民币 6,744,420	美元 969,044	2018年10月9日	(11,905)
人民币 52,045,092	美元 7,553,474	2018年10月9日	(16,281)
美元 2,818	人民币 19,353	2018年10月9日	(3)
美元 2,374	人民币 16,294	2018年10月9日	(4)
美元 1,209	人民币 8,272	2018年10月9日	(5)
美元 2,694	人民币 18,470	2018年10月9日	(7)
美元 4,407	人民币 30,217	2018年10月9日	(12)
美元 3,948	人民币 27,039	2018年10月9日	(16)
美元 4,549	人民币 31,123	2018年10月9日	(23)
美元 6,121	人民币 41,574	2018年10月9日	(74)
美元 48,729	人民币 334,463	2018年10月9日	(82)
美元 404,732	人民币 2,776,480	2018年10月9日	(904)
美元 362,708	人民币 2,486,848	2018年10月9日	(1,006)
美元 1,208,630	人民币 8,302,347	2018年10月9日	(1,086)
美元 809,906	人民币 5,560,089	2018年10月9日	(1,212)
美元 932,450	人民币 6,400,133	2018年10月9日	(1,576)
美元 551,752	人民币 3,780,594	2018年10月9日	(1,879)
美元 567,009	人民币 3,882,359	2018年10月9日	(2,335)
美元 191,720	人民币 1,301,569	2018年10月9日	(2,412)
美元 505,191	人民币 3,456,059	2018年10月9日	(2,520)
美元 446,561	人民币 3,052,866	2018年10月9日	(2,534)
美元 405,723	人民币 2,771,823	2018年10月9日	(2,572)
美元 627,913	人民币 4,297,973	2018年10月9日	(2,791)
美元 829,629	人民币 5,682,045	2018年10月9日	(3,198)
美元 1,502,093	人民币 10,300,048	2018年10月9日	(3,992)
美元 1,025,961	人民币 7,020,746	2018年10月9日	(4,822)
美元 585,370	人民币 3,983,160	2018年10月9日	(6,035)
美元 853,478	人民币 5,825,875	2018年10月9日	(6,127)
美元 555,756	人民币 3,776,299	2018年10月9日	(6,508)
美元 895,899	人民币 6,111,378	2018年10月9日	(7,023)
澳元 1,532	美元 1,104	2018年10月10日	(4)
澳元 1,524	美元 1,094	2018年10月10日	(8)
澳元 1,532	美元 1,100	2018年10月10日	(8)
澳元 149,770	美元 107,953	2018年10月10日	(421)
澳元 81,136	美元 58,267	2018年10月10日	(443)
澳元 123,731	美元 88,847	2018年10月10日	(685)
澳元 306,286	美元 220,783	2018年10月10日	(845)
澳元 165,067	美元 118,542	2018年10月10日	(901)
澳元 135,876	美元 96,986	2018年10月10日	(1,334)
澳元 302,375	美元 217,278	2018年10月10日	(1,521)
澳元 338,735	美元 243,472	2018年10月10日	(1,636)
澳元 1,172,938	美元 846,757	2018年10月10日	(1,981)
澳元 575,659	美元 413,954	2018年10月10日	(2,593)
澳元 374,815	美元 267,556	2018年10月10日	(3,660)
澳元 1,324,672	美元 954,771	2018年10月10日	(3,762)
澳元 770,114	美元 553,067	2018年10月10日	(4,187)
澳元 369,067	美元 262,782	2018年10月10日	(4,276)
澳元 4,754,181	美元 3,434,691	2018年10月10日	(5,435)
澳元 894,129	美元 634,574	2018年10月10日	(12,417)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
加元 1,446	美元 1,112	2018年10月10日	(7)
加元 1,435	美元 1,103	2018年10月10日	(8)
加元 1,434	美元 1,101	2018年10月10日	(8)
加元 1,434	美元 1,098	2018年10月10日	(12)
加元 560,065	美元 433,324	2018年10月10日	(29)
加元 9,499	美元 7,220	2018年10月10日	(130)
加元 12,474	美元 9,459	2018年10月10日	(193)
加元 79,730	美元 61,315	2018年10月10日	(376)
加元 44,725	美元 34,228	2018年10月10日	(378)
加元 28,187	美元 21,400	2018年10月10日	(410)
加元 81,470	美元 62,532	2018年10月10日	(506)
加元 53,043	美元 40,385	2018年10月10日	(657)
加元 135,864	美元 104,235	2018年10月10日	(890)
加元 163,351	美元 125,381	2018年10月10日	(1,013)
加元 195,092	美元 149,814	2018年10月10日	(1,140)
加元 224,333	美元 172,431	2018年10月10日	(1,147)
加元 1,781,903	美元 1,375,852	2018年10月10日	(2,903)
加元 213,980	美元 162,259	2018年10月10日	(3,308)
加元 671,741	美元 516,128	2018年10月10日	(3,635)
加元 780,512	美元 599,216	2018年10月10日	(4,709)
加元 427,992	美元 325,377	2018年10月10日	(5,783)
加元 401,219	美元 304,574	2018年10月10日	(5,871)
加元 913,529	美元 693,259	2018年10月10日	(13,588)
加元 110,337,601	美元 85,168,253	2018年10月10日	(205,935)
人民币 7,572	美元 1,101	2018年10月10日	(1)
人民币 7,572	美元 1,101	2018年10月10日	(1)
人民币 7,528	美元 1,092	2018年10月10日	(3)
人民币 110,000	美元 15,983	2018年10月10日	(15)
人民币 1,044,571	美元 151,864	2018年10月10日	(54)
人民币 721,380	美元 104,847	2018年10月10日	(67)
人民币 839,143	美元 121,963	2018年10月10日	(78)
人民币 732,018	美元 106,364	2018年10月10日	(97)
人民币 8,586,585	美元 1,248,353	2018年10月10日	(442)
人民币 1,513,410	美元 219,537	2018年10月10日	(566)
人民币 2,656,867	美元 385,244	2018年10月10日	(1,159)
人民币 3,423,927	美元 496,467	2018年10月10日	(1,493)
人民币 7,209,476	美元 1,045,817	2018年10月10日	(2,696)
人民币 619,704,698	美元 90,052,938	2018年10月10日	(74,128)
人民币 1,725,844,986	美元 250,792,696	2018年10月10日	(206,444)
英镑 5,192	美元 6,733	2018年10月10日	(41)
英镑 8,762	美元 11,257	2018年10月10日	(173)
英镑 149,893	美元 192,729	2018年10月10日	(2,807)
纽元 1,676	美元 1,104	2018年10月10日	(8)
纽元 1,691	美元 1,105	2018年10月10日	(16)
纽元 33,710	美元 22,248	2018年10月10日	(101)
纽元 12,869	美元 8,423	2018年10月10日	(109)
纽元 32,316	美元 21,288	2018年10月10日	(138)
纽元 28,998	美元 18,961	2018年10月10日	(265)
纽元 115,612	美元 76,354	2018年10月10日	(297)
纽元 94,208	美元 62,015	2018年10月10日	(446)
纽元 72,110	美元 47,317	2018年10月10日	(492)
纽元 113,354	美元 74,355	2018年10月10日	(799)
纽元 841,291	美元 556,080	2018年10月10日	(1,696)
纽元 295,938	美元 193,755	2018年10月10日	(2,452)
纽元 339,509	美元 220,861	2018年10月10日	(4,233)
纽元 636,543	美元 417,047	2018年10月10日	(4,981)



交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 1,672	英镑 1,270	2018年10月10日	(15)
美元 1,763	人民币 12,000	2018年10月10日	(18)
美元 59,224	纽元 89,279	2018年10月10日	(32)
美元 46,443	人民币 319,085	2018年10月10日	(37)
美元 117,587	人民币 808,259	2018年10月10日	(37)
美元 5,749	英镑 4,372	2018年10月10日	(45)
美元 14,594	人民币 100,000	2018年10月10日	(50)
美元 72,775	人民币 500,000	2018年10月10日	(57)
美元 14,665	人民币 100,394	2018年10月10日	(64)
美元 47,345	人民币 325,042	2018年10月10日	(72)
美元 8,977	人民币 61,000	2018年10月10日	(106)
美元 43,742	人民币 300,000	2018年10月10日	(112)
美元 49,242	人民币 337,721	2018年10月10日	(126)
美元 87,395	人民币 600,000	2018年10月10日	(133)
美元 55,046	人民币 377,468	2018年10月10日	(148)
美元 47,489	人民币 325,400	2018年10月10日	(164)
美元 65,623	人民币 450,000	2018年10月10日	(177)
美元 14,724	纽元 21,935	2018年10月10日	(181)
美元 52,262	人民币 358,021	2018年10月10日	(193)
美元 53,858	人民币 368,782	2018年10月10日	(224)
美元 58,417	人民币 400,000	2018年10月10日	(243)
美元 59,221	纽元 88,947	2018年10月10日	(249)
美元 62,828	人民币 430,102	2018年10月10日	(276)
美元 48,287	人民币 330,117	2018年10月10日	(277)
美元 62,898	人民币 430,000	2018年10月10日	(361)
美元 46,158	人民币 314,874	2018年10月10日	(364)
美元 141,207	人民币 967,667	2018年10月10日	(474)
美元 32,193	澳元 43,816	2018年10月10日	(488)
美元 49,148	人民币 334,435	2018年10月10日	(509)
美元 66,882	纽元 100,000	2018年10月10日	(582)
美元 57,500	纽元 85,812	2018年10月10日	(607)
美元 109,312	澳元 150,073	2018年10月10日	(719)
美元 169,644	人民币 1,161,045	2018年10月10日	(787)
美元 186,943	澳元 257,225	2018年10月10日	(816)
美元 164,821	人民币 1,125,041	2018年10月10日	(1,200)
美元 81,161	澳元 110,466	2018年10月10日	(1,228)
美元 105,114	人民币 714,256	2018年10月10日	(1,236)
美元 128,300	澳元 175,034	2018年10月10日	(1,646)
美元 554,835	人民币 3,802,173	2018年10月10日	(1,864)
美元 624,701	澳元 859,980	2018年10月10日	(2,419)
美元 464,427	人民币 3,170,104	2018年10月10日	(3,381)
美元 486,166	纽元 725,776	2018年10月10日	(4,976)
美元 515,023	澳元 700,465	2018年10月10日	(8,167)
美元 39,224,089	纽元 58,480,354	2018年10月10日	(451,580)
美元 93,644,875	人民币 636,773,913	2018年10月10日	(1,035,414)
美元 118,462,797	澳元 161,177,162	2018年10月10日	(1,834,874)
美元 259,581,968	人民币 1,765,126,234	2018年10月10日	(2,870,149)
人民币 300,000	美元 43,584	2018年10月11日	(44)
人民币 313,452	美元 45,539	2018年10月11日	(46)
美元 91,952	人民币 632,225	2018年10月11日	(9)
美元 301,591	人民币 2,073,626	2018年10月11日	(29)
人民币 345,396	美元 50,225	2018年10月12日	(2)
人民币 117,144	美元 17,000	2018年11月5日	(8)
人民币 1,557,986	美元 226,153	2018年11月5日	(46)
人民币 3,596,144	美元 521,862	2018年11月5日	(250)
人民币 11,803,003	美元 1,713,343	2018年11月5日	(292)
人民币 11,586,280	美元 1,677,988	2018年11月5日	(4,182)
美元 1,268	人民币 8,708	2018年11月5日	(4)
美元 6,903	人民币 47,518	2018年11月5日	(5)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 5,119	人民币 35,212	2018年11月5日	(6)
美元 86,728	人民币 597,307	2018年11月5日	(7)
美元 224,471	人民币 1,545,713	2018年11月5日	(55)
美元 32,033	人民币 220,000	2018年11月5日	(92)
美元 336,459	人民币 2,315,963	2018年11月5日	(213)
美元 196,254	人民币 1,349,596	2018年11月5日	(312)
美元 82,452	人民币 565,000	2018年11月5日	(422)
美元 106,425	人民币 729,710	2018年11月5日	(482)
美元 1,097,378	人民币 7,554,518	2018年11月5日	(566)
美元 262,090	人民币 1,798,099	2018年11月5日	(1,033)
美元 323,017	人民币 2,214,954	2018年11月5日	(1,439)
美元 1,120,545	人民币 7,694,697	2018年11月5日	(3,386)
美元 2,752,115	人民币 18,906,534	2018年11月5日	(7,157)
美元 482,713,742	人民币 3,316,581,310	2018年11月5日	(1,193,550)
澳元 46,244	美元 33,394	2018年11月13日	(77)
加元 1,424	美元 1,099	2018年11月13日	(4)
加元 1,427	美元 1,093	2018年11月13日	(12)
加元 94,119	美元 72,857	2018年11月13日	(25)
加元 82,896	美元 63,976	2018年11月13日	(214)
人民币 7,568	美元 1,098	2018年11月13日	(0)
人民币 9,623	美元 1,396	2018年11月13日	(0)
人民币 956,986	美元 138,832	2018年11月13日	(50)
人民币 1,400,018	美元 203,128	2018年11月13日	(50)
人民币 1,174,158	美元 170,340	2018年11月13日	(60)
人民币 1,528,008	美元 221,672	2018年11月13日	(80)
人民币 2,225,848	美元 322,947	2018年11月13日	(80)
纽元 1,654	美元 1,097	2018年11月13日	(0)
纽元 376,313	美元 249,461	2018年11月13日	(72)
美元 5,769	英镑 4,379	2018年11月13日	(47)
美元 48,013	人民币 330,501	2018年11月13日	(49)
美元 51,673	人民币 354,997	2018年11月13日	(154)
美元 51,682	人民币 354,517	2018年11月13日	(233)
美元 154,824	人民币 1,064,876	2018年11月13日	(284)
美元 64,895	纽元 97,380	2018年11月13日	(322)
美元 78,780	人民币 540,550	2018年11月13日	(333)
美元 198,080	澳元 272,706	2018年11月13日	(695)
美元 453,755	人民币 3,120,914	2018年11月13日	(834)
美元 188,088	人民币 1,290,200	2018年11月13日	(849)
美元 257,724	人民币 1,769,540	2018年11月13日	(921)
美元 416,918	澳元 574,242	2018年11月13日	(1,281)
美元 453,947	人民币 3,116,808	2018年11月13日	(1,623)
美元 479,137	纽元 716,749	2018年11月13日	(3,860)
美元 3,599,966	英镑 2,732,740	2018年11月13日	(29,311)
美元 37,671,156	纽元 56,688,266	2018年11月13日	(81,148)
美元 109,997,005	澳元 151,821,360	2018年11月13日	(108,667)
美元 20,085,884	印尼盾 290,000,000,000	2018年11月19日	(784,606)
美元 17,344,587	印尼盾 246,085,000,000	2018年11月19日	(968,511)
人民币 134,589,176	美元 19,500,000	2018年12月6日	(13,879)
韩元 48,083,750,000	美元 43,295,291	2018年12月6日	(148,356)
林吉特 24,906,000	美元 6,000,000	2018年12月6日	(11,876)
新加坡元 13,684,030	美元 10,000,000	2018年12月6日	(29,339)
泰铢 881,010,000	美元 27,000,000	2018年12月6日	(300,363)
美元 10,596,540	印度卢比 772,911,612	2018年12月6日	(52,157)
		未实现总亏损	(10,683,069)
		未实现净亏损	(2,651,280)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
<b>2017</b>			
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	美元 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
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

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
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
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



交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
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
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

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
印尼盾 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
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

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
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)
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)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
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)
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)



交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
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)
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)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
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)
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)
已平仓但尚未结算之合约:			
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)
		未实现净亏损	(22,785,845)

(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>2018</u>				
US 10 Years Note (CBT) Futures	(300)	(36,067,969)	2018年12月	433,594
US 2 Years Note (CBT) Futures	(1,050)	(221,838,281)	2018年12月	567,188
				1,000,782
<u>2017</u>				
US 10 Years Note (CBT) Futures	(2,344)	(296,717,438)	2017年12月	2,984,938
US 5 Years Note (CBT) Futures	(1,000)	(118,281,250)	2017年12月	781,250
				3,766,188

### 13 其他收入

本年度本基金收到管理人因估值和/或其他操作错误而支付的赔偿 1,673 美元（二零一七年：169,079 美元）。

## 独立核数师报告

致摩根亚洲总收益债券基金（“贵基金”）份额持有人

### 就财务报表审计作出的报告

#### 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六页至第四十四页的财务报表，包括：

- 于二零一八年九月三十日的财务状况表；
- 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二零一八年九月三十日的财务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”）份额持有人

**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  
 二零一九年一月二十二日



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
- 按持续运营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二零一八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

二零一九年一月二十二日

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
<b>30/9/18</b> - 澳元对冲类别（每月派息） - 加元对冲类别（每月派息） - 英镑对冲类别（每月派息） - 港元类别（每月派息） - 纽元对冲类别（每月派息） - 人民币对冲类别（累计） - 人民币对冲类别（每月派息） - 美元类别（累计） - 美元类别（每月派息） - PRC 人民币对冲份额（累计） - PRC 人民币对冲份额（每月派息） - PRC 美元份额（累计） - PRC 美元份额（每月派息）	澳元 151,437,984 加元 109,956,213 英镑 2,722,720 港元 2,370,395,595 纽元 56,146,414 人民币 18,776,312 人民币 3,249,538,350 美元 1,974,794 美元 371,634,095 人民币 1,721,353,017 人民币 611,206,738 美元 494,672,657 美元 22,623,212	澳元 8.61 加元 8.66 英镑 9.06 港元 9.22 纽元 8.55 人民币 12.13 人民币 8.84 美元 11.98 美元 10.51 人民币 11.52 人民币 9.55 美元 10.70 美元 9.58
<b>30/9/17</b> - 澳元对冲类别（每月派息） - 加元对冲类别（每月派息） - 英镑对冲类别（每月派息） - 港元类别（每月派息） - 纽元对冲类别（每月派息） - 人民币对冲类别（累计） - 人民币对冲类别（每月派息） - 美元类别（累计） - 美元类别（每月派息） - PRC 人民币对冲份额（累计） - PRC 人民币对冲份额（每月派息） - PRC 美元份额（累计） - PRC 美元份额（每月派息）	澳元 219,559,065 加元 137,199,992 英镑 4,157,347 港元 4,487,647,800 纽元 78,391,549 人民币 19,181,758 人民币 4,570,432,055 美元 14,067,443 美元 803,248,157 人民币 3,796,281,190 人民币 948,303,236 美元 640,043,722 美元 29,438,715	澳元 9.09 加元 9.13 英镑 9.55 港元 9.70 纽元 9.02 人民币 12.07 人民币 9.32 美元 12.13 美元 11.08 人民币 11.48 人民币 10.07 美元 10.84 美元 10.10
<b>30/9/16</b> - 澳元对冲类别（每月派息） - 加元对冲类别（每月派息） - 英镑对冲类别（每月派息） - 港元类别（每月派息） - 纽元对冲类别（每月派息） - 人民币对冲类别（累计） - 人民币对冲类别（每月派息） - 美元类别（累计） - 美元类别（每月派息） - PRC 人民币对冲份额（累计） - PRC 人民币对冲份额（每月派息） - PRC 美元份额（累计） - PRC 美元份额（每月派息）	澳元 321,280,527 加元 179,196,989 英镑 6,555,386 港元 4,722,528,266 纽元 92,826,121 人民币 21,105,857 人民币 5,166,107,748 美元 26,539,869 美元 919,519,116 人民币 3,763,109,762 人民币 799,689,319 美元 432,075,847 美元 18,403,254	澳元 9.28 加元 9.32 英镑 9.74 港元 9.82 纽元 9.21 人民币 11.45 人民币 9.57 美元 11.88 美元 11.29 人民币 10.88 人民币 10.32 美元 10.61 美元 10.29



业绩记录 - 未经审计 (续)

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
<b>30/9/18</b>		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.14	澳元 8.54
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.18	加元 8.58
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.59	英镑 8.97
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.76	港元 9.17
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.07	纽元 8.47
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.32	人民币 11.88
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.38	人民币 8.78
- 美元类别 (累计)	美元 12.30	美元 11.75
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.13	美元 10.42
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.72	人民币 11.30
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.14	人民币 9.48
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.99	美元 10.49
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.15	美元 9.49
<b>30/9/17</b>		
- 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
<b>30/9/16</b>		
- 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
<b>30/9/15</b>		
- 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

(续)

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
<b>30/9/14</b>		
- 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
<b>30/9/13</b>		
- 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
<b>30/9/12</b>		
- 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
<b>30/9/11</b>		
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.96	美元 10.68
<b>30/9/10</b>		
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.78	美元 10.45
<b>30/9/09</b>		
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.82	美元 7.98

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**

于二零一九年一月二十二日  
Edwin Tsun Kay CHAN  
Kheng Leong CHEAH  
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

