

半年度报告 - 2018年3月31日 (未经审核)

摩根亚洲股息基金

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	1 - 2
投资组合持有变动表	2
财务状况表	3
综合收益表	3
可赎回份额持有人应占净资产变动表	4
现金流量表	4
财务报表之附注	5 - 11

投资组合

截至二零一八年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比				
上市投资 (97.8%)											
(I) 股票及认股证(97.7%)				印度尼西亚(1.0%)							
				Telekomunikasi Indonesia	78,639,000	20,562,948	1.0				
澳大利亚 (12.3%)				韩国 (11.5%)							
Amcor Ltd	5,008,093	54,433,456	2.7	Doosan Corp	171,448	17,130,324	0.8				
AMP Ltd-AU List	1,896,517	7,259,070	0.4	ING Life Insurance Korea	240,670	10,081,542	0.5				
Australia & NZ Bkg Group-AU List	4,037,718	83,188,955	4.1	Korea Electric Power	2,929,208	90,275,338	4.5				
Macquarie Group	389,160	30,716,183	1.5	Samsung Electronics	21,057	48,617,391	2.4				
Qantas Airways	3,124,937	13,974,410	0.7	Samsung Fire & Marine Insurance	75,150	19,071,278	0.9				
QBE Insurance Group	4,485,467	33,132,761	1.6	Shinhan Financial Group	1,141,260	48,931,028	2.4				
Westpac Banking	1,235,069	27,113,434	1.3	马来西亚 (0.5%)							
中国 (31.5%)				CIMB Group Hldgs				5,276,234	9,807,684	0.5	
中国银行股份有限公司 H 股	130,678,000	70,265,046	3.5	新西兰 (0.4%)							
中国建设银行股份有限公司 H 股	67,105,000	68,915,090	3.4	Z Energy	1,410,487	7,122,677	0.4				
中国人寿保险股份有限公司 H 股	21,858,000	60,157,333	3.0	新加坡 (9.0%)							
中国移动有限公司	5,124,500	46,979,317	2.3	AIMS AMP Capital Ind REIT	6,818,766	7,072,006	0.3				
中国海外发展有限公司	9,990,000	34,686,174	1.7	Ascendas India Trust	26,322,300	20,274,173	1.0				
华润置地有限公司	1,510,000	5,492,973	0.3	DBS Group Hldgs	3,679,103	77,156,511	3.8				
中国海洋石油有限公司	20,045,000	29,524,891	1.5	Frasers Logistics & Industry Trust	10,672,100	8,871,036	0.4				
大唐国际发电股份有限公司 H 股	63,478,000	19,007,084	0.9	Mapletree Commercial Trust	5,957,468	7,132,788	0.4				
粤海投资有限公司	14,026,000	22,053,291	1.1	Mapletree Logistics Trust	16,443,818	15,424,309	0.8				
华电国际电力股份有限公司 H 股	47,636,000	18,330,176	0.9	Singapore Exchange	2,411,300	13,552,414	0.7				
华能国际电力股份有限公司 H 股	61,460,000	41,269,345	2.0	United Overseas Bank	1,536,800	32,229,086	1.6				
九阳股份有限公司 A 股-C2	3,877,386	11,118,705	0.5	台湾 (10.2%)							
联想集团有限公司	50,812,000	25,961,816	1.3	硕邦科技股份有限公司	6,565,000	15,108,259	0.8				
中国石油天然气股份有限公司 H 股	65,644,000	45,082,522	2.2	南茂科技股份有限公司	4,988,000	4,114,326	0.2				
中国人民财产保险股份有限公司 H 股	18,072,000	31,638,607	1.6	仁宝电脑工业股份有限公司	13,983,000	9,567,543	0.5				
青岛海尔股份有限公司 A 股-C1	3,226,603	9,047,150	0.4	兆丰金融控股股份公司	11,699,000	10,111,287	0.5				
上海汽车集团股份有限公司 A 股-C1	2,666,151	14,429,515	0.7	力成科技股份有限公司	3,876,000	12,190,184	0.6				
中石化炼化工程 (集团) 股份有限公司 H 股	21,106,500	21,003,499	1.0	瑞昱半导体股份有限公司	750,000	3,343,965	0.2				
越秀交通基建有限公司	44,068,000	33,914,443	1.7	台湾水泥股份有限公司	16,810,000	21,072,315	1.0				
浙江沪杭甬高速公路股份有限公司 H 股	30,202,000	30,824,257	1.5	台湾积体电路制造股份有限公司	6,472,000	54,937,751	2.7				
香港 (13.6%)				启碁科技股份有限公司				2,472,787	6,589,689	0.3	
中银香港 (控股) 有限公司	7,989,000	38,884,829	1.9	元大金控股股份有限公司	88,388,639	40,470,156	2.0				
长江和记实业有限公司	4,400,000	52,643,248	2.6	臻鼎科技控股股份有限公司	12,215,000	28,697,311	1.4				
香港宽频有限公司	15,206,500	17,941,744	0.9	泰国 (7.7%)							
汇丰控股有限公司	6,198,616	58,445,470	2.9	Bangkok Bank NVDR	14,010,100	88,263,181	4.3				
利福国际集团有限公司	5,664,000	9,280,868	0.4	Land & Houses (F)	46,878,300	15,741,035	0.8				
新世界发展有限公司	13,922,000	19,654,672	1.0	Siam Commercial Bank (F)	4,491,900	20,541,788	1.0				
新鸿基地产发展有限公司	2,398,000	37,887,441	1.8	Siam Commercial Bank NVDR	714,700	3,268,375	0.2				
万洲国际有限公司	39,505,000	42,080,680	2.1	Supalai Public Co (F)	17,316,700	11,906,270	0.6				
				Supalai Public Co (F) Wts				20/10/18	7,077,300	3,960,753	0.2
				TMB Bank (F)				147,922,000	12,110,020	0.6	
									1,981,645,196	97.7	
				(II) 衍生性产品 (0.1%)							
				远期外汇合约 (0.1%)					2,824,908	0.1	

投资组合 (续)

截至二零一八年三月三十一日 (未经审计)

投资组合持有变动表

截至二零一八年三月三十一日止期间 (未经审计)

单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比	持有占资产净值百分比	
			二零一八年 三月三十一日	二零一七年 九月三十日
总上市投资	1,984,470,104	97.8		
其他净资产	43,676,288	2.2		
截至二零一八年三月三十一日可赎回份额 持有人应占净资产	<u>2,028,146,392</u>	<u>100.0</u>		
总投资, 按成本	<u>1,969,131,471</u>			
			上市投资	
			股票及认股证	
			31.5	29.4
			13.6	13.6
			12.3	16.0
			11.5	10.4
			10.2	10.8
			9.0	8.1
			7.7	8.1
			1.0	-
			0.5	0.7
			0.4	0.7
			衍生性产品	
			0.1	(1.2)
			<u>97.8</u>	<u>96.6</u>
			<u>2.2</u>	<u>3.4</u>
			<u>100.0</u>	<u>100.0</u>

财务状况表

截至二零一八年三月三十一日 (未经审计)

	二零一八年 三月三十一日 美元	二零一七年 九月三十日 美元
资产		
银行现金	27,118,331	61,711,785
短期存款	37,112,518	-
应收经纪款项	2,380,213	11,839,227
分配应收款项	28,248,502	9,824,695
衍生性产品	6,768,073	2,885,567
投资	1,981,645,196	1,698,276,624
股息及其他应收款项	5,973,949	2,534,676
总资产	<u>2,089,246,782</u>	<u>1,787,072,574</u>
负债		
应付经纪款项	35,388,362	10,308,325
赎回应付款项	11,417,400	8,558,692
应付收益分配 [附注 5]	7,848,317	6,340,229
衍生性产品	3,943,165	23,475,527
其他应付款项	2,503,146	2,318,619
总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)	<u>61,100,390</u>	<u>51,001,392</u>
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	<u>2,028,146,392</u>	<u>1,736,071,182</u>

综合收益表

截至二零一八年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零一七年 十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元	二零一六年 十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元
收入		
投资及衍生性产品净收益 [附注 4]	88,475,205	77,567,631
股息收入	17,140,088	27,073,569
存款利息	153,651	43,201
汇兑净收益 / (亏损)	78,916	(468,120)
其他收入	134	158
	<u>105,847,994</u>	<u>104,216,439</u>
支出		
管理费用	13,668,895	13,057,105
交易成本	2,201,565	1,679,652
受托人费用	236,572	227,398
托管费用及银行费用	232,493	225,549
基金注册登记机构费用	85,165	163,137
估值费用	8,540	8,610
核数师酬金	8,433	8,528
法律及专业费用	4,629	24,717
印刷及出版支出	633	13,315
其他经营费用	4,172	6,316
	<u>16,451,097</u>	<u>15,414,327</u>
净经营利润	<u>89,396,897</u>	<u>88,802,112</u>
财务成本		
收益分配 [附注 5]	(41,013,910)	(49,740,711)
已付利息	(3,675)	(171)
	<u>(41,017,585)</u>	<u>(49,740,882)</u>
除税前利润	<u>48,379,312</u>	<u>39,061,230</u>
税项	(1,399,563)	(2,421,739)
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加	<u>46,979,749</u>	<u>36,639,491</u>

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

	二零一七年 十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元	二零一六年 十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元
期初可赎回份额持有人应占净资产	1,736,071,182	1,774,824,574
分配可赎回份额	1,392,186,900	895,756,297
赎回可赎回份额	(1,147,091,439)	(877,715,242)
净分配	<u>245,095,461</u>	<u>18,041,055</u>
	1,981,166,643	1,792,865,629
可赎回份额持有人应占净资产及 总综合收益之增加	<u>46,979,749</u>	<u>36,639,491</u>
期末可赎回份额持有人应占净资产	<u><u>2,028,146,392</u></u>	<u><u>1,829,505,120</u></u>

现金流量表
截至二零一八年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零一七年 十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元	二零一六年 十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元
经营业务		
购入投资及衍生性产品	(721,658,455)	(469,086,815)
出售投资及衍生性产品所得款 项	537,851,268	483,966,209
已收股息	13,749,798	16,158,533
已收利息	150,198	43,655
已付基金注册登记机构费用	(185,098)	(198,226)
已付受托人费用	(231,072)	(225,343)
已付税项	(1,399,563)	(2,421,739)
已付交易费用	(2,166,405)	(1,696,556)
已付管理费用	(13,341,302)	(12,942,015)
其他	(1,978,310)	(686,768)
经营业务所(运用)/产生之 现金净额	<u>(189,208,941)</u>	<u>12,910,935</u>
融资活动		
已付利息	(3,675)	(171)
分配可赎回份额所得款项	1,373,763,093	881,963,549
赎回可赎回份额付款	(1,144,232,731)	(862,986,218)
已付收益分配	(39,505,822)	(50,517,146)
融资活动所产生/(运用)之 现金净额	<u>190,020,865</u>	<u>(31,539,986)</u>
现金及现金等价物之增加/ (减少)	811,924	(18,629,051)
期初现金及现金等价物	61,711,785	52,486,767
现金及现金等价物之汇兑收益 /(亏损)	1,707,140	(134,313)
期末现金及现金等价物	<u>64,230,849</u>	<u>33,723,403</u>
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	27,118,331	33,723,403
短期存款	37,112,518	-
	<u>64,230,849</u>	<u>33,723,403</u>

财务报表之附注

1 本基金

摩根亚洲股息基金（“本基金”）根据二零一一年五月六日的信托契约（经修订）（“信托契约”）成立，受香港法律监管。本基金已获香港证券及期货事务监察委员会认可。

本基金的投资目标为通过主要投资于亚太区（日本除外）内的、投资管理入预期会派发股息的公司的股票，以提供收益及长期资本增长。本基金所持有的此等股票将根据公司的过往派息纪录及公告，以及其长期资本增长潜力而挑选。

根据信托契约，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

(a) 中期财务报表之财务政策

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

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

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

当预期某一借入证券将会下跌时，本基金出售该证券进行卖空，或通过卖空进行套汇交易。卖空被分类为按公允价值透过损益列账的金融负债。

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。

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

(c) 外币交易

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按期/年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

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

(d) 销售份额所得款项及赎回份额支付款项

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

可赎回份额持有人有权选择赎回份额，此等份额在财务状况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。

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

二零一八年三月三十一日

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目	31,017,770.590	12,469,281.593	1,938,926.109	5,538,725.292	1,512,163.362
	澳元	加元	欧元	英镑	港元
可赎回份额持有人应占净资产	303,516,214	124,101,730	19,784,966	56,350,845	19,557,736
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	9.79	9.95	10.2	10.17	12.93

	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	新加坡元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目	334,502,527.289	7,411,154.640	1,840,155.175	188,127,156.215	1,607,811.921
	港元	纽元	人民币	人民币	新加坡元
可赎回份额持有人应占净 资产	3,439,993,553	73,313,701	27,004,505	1,996,985,344	16,057,763
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	10.28	9.89	14.68	10.62	9.99
	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额			
已发行份额数目	341,270.670	75,005,175.631			
	美元	美元			
可赎回份额持有人应占净 资产	4,385,069	763,288,367			
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	12.85	10.18			
<u>二零一七年九月三十日</u>					
	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目	27,108,234.972	10,051,457.473	1,825,364.582	6,387,566.040	877,376.220
	澳元	加元	欧元	英镑	港元
可赎回份额持有人应占净 资产	259,499,760	97,613,361	18,159,564	63,339,050	10,787,381
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	9.57	9.71	9.95	9.92	12.30

	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	新加坡元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目	280,011,130.965	8,621,369.463	2,752,627.244	193,808,307.217	1,279,397.621
	港元	纽元	人民币	人民币	新加坡元
可赎回份额持有人应占净 资产	2,795,839,385	83,401,013	38,144,622	2,005,664,263	12,477,623
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	9.98	9.67	13.86	10.35	9.75
	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额			
已发行份额数目	3,655,626.170	57,111,634.129			
	美元	美元			
可赎回份额持有人应占净 资产	44,675,415	566,995,843			
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	12.22	9.93			

4 投资及衍生性产品净收益

	二零一七年 十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元	二零一六年 十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益/亏损之变动	15,424,961	35,861,924
投资及衍生性产品销售之实现收益	73,050,244	41,705,707
	88,475,205	77,567,631

5 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。

	二零一七年 十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元	二零一六年 十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元
净经营利润	89,396,897	88,802,112
调整：		
投资和衍生性产品净收益	(88,475,205)	(77,567,631)
汇兑净(收益)/亏损	(78,916)	468,120
交易成本	2,201,565	1,679,652
已付利息	(3,675)	(171)
税项	(1,399,563)	(2,421,739)
收益可分配金额	1,641,103	10,960,343

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零一七年 十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元	二零一六年 十月一日至 二零一七年 三月三十一日 美元
澳元对冲类别(每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	澳元 0.0386	28,107,499.221	(831,885)	
加元对冲类别(每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	加元 0.0328	9,852,725.299	(250,694)	
欧元对冲类别(每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	欧元 0.0190	1,691,166.534	(37,432)	
英镑对冲类别(每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	英镑 0.0256	6,199,869.740	(210,768)	
港元类别(每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	港元 0.0362	262,001,521.523	(1,215,675)	
纽元对冲类别(每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	纽元 0.0413	8,654,681.813	(244,863)	
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 0.0569	189,256,757.525	(1,623,836)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	新加坡元 0.0320	1,215,271.347	(28,544)	
美元类别(每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	美元 0.0360	55,059,547.009	(1,982,144)	
澳元对冲类别(每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	澳元 0.0379	28,612,220.708	(823,225)	
加元对冲类别(每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	加元 0.0326	9,666,996.964	(244,620)	
欧元对冲类别(每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	欧元 0.0197	1,603,772.934	(37,671)	
英镑对冲类别(每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	英镑 0.0275	5,784,731.794	(215,339)	
港元类别(每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	港元 0.0362	253,496,806.045	(1,174,949)	
纽元对冲类别(每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	纽元 0.0413	8,816,259.059	(249,872)	
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 0.0572	185,721,225.146	(1,606,481)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	新加坡元 0.0329	1,270,147.357	(31,023)	
美元类别(每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	美元 0.0360	53,543,178.874	(1,927,554)	
澳元对冲类别(每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	澳元 0.0364	26,593,124.396	(757,113)	
加元对冲类别(每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	加元 0.0291	9,441,958.962	(219,291)	
欧元对冲类别(每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	欧元 0.0100	1,637,774.119	(19,666)	
英镑对冲类别(每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	英镑 0.0199	5,385,302.615	(144,971)	
港元类别(每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	港元 0.0362	246,462,990.223	(1,141,310)	
纽元对冲类别(每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	纽元 0.0400	8,242,324.824	(234,478)	
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 0.0576	182,805,258.002	(1,616,938)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	新加坡元 0.0320	1,315,947.788	(31,510)	
美元类别(每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	美元 0.0360	52,641,636.661	(1,895,099)	
澳元对冲类别(每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	澳元 0.0373	27,198,221.300	(821,486)	
加元对冲类别(每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	加元 0.0313	10,891,280.184	(277,864)	
欧元对冲类别(每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	欧元 0.0138	1,749,114.500	(30,070)	
英镑对冲类别(每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	英镑 0.0237	5,316,624.301	(179,184)	
港元类别(每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	港元 0.0382	297,051,646.623	(1,450,802)	
纽元对冲类别(每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	纽元 0.0414	8,000,938.535	(245,150)	
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 0.0590	186,061,793.008	(1,744,061)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零一七年	二零一六年
					十月一日至 二零一八年 三月三十一日	十月一日至 二零一七年 三月三十一日
					美元	美元
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	新加坡元 0.0317	1,334,929.921	(32,323)	
美元类别 (每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	美元 0.0380	59,627,598.092	(2,265,849)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	澳元 0.0378	27,681,692.458	(815,382)	
加元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	加元 0.0341	10,704,774.107	(284,881)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	欧元 0.0195	1,789,126.717	(42,551)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	英镑 0.0272	5,372,957.465	(201,365)	
港元类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	港元 0.0383	316,977,789.078	(1,551,410)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	纽元 0.0403	7,551,518.217	(219,800)	
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 0.0594	184,981,775.537	(1,736,012)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	新加坡元 0.0317	1,755,797.932	(42,075)	
美元类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	美元 0.0380	63,904,658.659	(2,428,377)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	澳元 0.0361	30,646,884.744	(848,628)	
加元对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	加元 0.0307	12,455,327.062	(296,590)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	欧元 0.0129	1,973,629.844	(31,312)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	英镑 0.0224	5,536,281.228	(173,965)	
港元类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	港元 0.0384	334,256,150.365	(1,635,442)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	纽元 0.0394	7,413,279.127	(210,709)	
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 0.0588	188,117,016.137	(1,760,215)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	新加坡元 0.0324	1,607,811.921	(39,726)	
美元类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	美元 0.0380	75,045,535.344	(2,851,730)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	澳元 0.0441	38,390,038.471	(1,288,290)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	加元 0.0354	11,209,358.628	(296,073)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	欧元 0.0242	2,099,249.358	(55,689)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	英镑 0.0314	7,258,150.143	(278,250)	
港元类别 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	港元 0.0370	271,439,849.002	(1,295,096)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	纽元 0.0492	10,426,594.680	(366,992)	
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 0.0655	268,994,540.676	(2,597,946)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	新加坡元 0.0348	1,535,135.648	(38,381)	
美元类别 (每月派息)	2016年10月31日	2016年11月8日	美元 0.0370	51,671,392.098	(1,911,842)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	澳元 0.0443	40,070,265.672	(1,311,542)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	加元 0.0353	10,853,185.893	(284,930)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	欧元 0.0267	2,099,702.155	(59,471)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	英镑 0.0324	7,353,541.786	(297,676)	
港元类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	港元 0.0370	294,768,696.069	(1,406,076)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	纽元 0.0476	10,800,899.410	(364,410)	
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 0.0634	252,449,219.840	(2,316,601)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	新加坡元 0.0356	1,546,087.889	(38,426)	
美元类别 (每月派息)	2016年11月30日	2016年12月8日	美元 0.0370	52,389,616.809	(1,938,416)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	澳元 0.0441	38,128,378.221	(1,217,546)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	加元 0.0333	10,483,856.811	(260,328)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	欧元 0.0209	2,030,523.185	(44,761)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	英镑 0.0278	7,253,040.097	(249,150)	
港元类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	港元 0.0370	302,403,439.156	(1,443,146)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	纽元 0.0465	11,074,832.824	(359,095)	
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 0.0843	243,680,432.094	(2,948,678)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	新加坡元 0.0369	1,512,134.202	(38,622)	
美元类别 (每月派息)	2016年12月30日	2017年1月10日	美元 0.0370	52,515,280.692	(1,943,065)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	澳元 0.0412	38,001,561.404	(1,182,703)	
加元对冲类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	加元 0.0306	10,510,815.272	(245,052)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	欧元 0.0201	1,952,847.738	(42,022)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	英镑 0.0269	7,284,011.455	(245,885)	
港元类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	港元 0.0350	327,703,953.260	(1,478,322)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2017年1月27日	2017年2月8日	纽元 0.0440	10,601,538.201	(339,285)	
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 0.1157	233,383,308.562	(3,934,497)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零一七年	二零一六年
					十月一日至 二零一八年 三月三十一日	十月一日至 二零一七年 三月三十一日
					美元	美元
新加坡元对冲类别（每月派息）	2017年1月27日	2017年2月8日	新加坡元 0.0347	2,121,215.287		(51,577)
美元类别（每月派息）	2017年1月27日	2017年2月8日	美元 0.0350	57,177,345.289		(2,001,207)
澳元对冲类别（每月派息）	2017年2月28日	2017年3月8日	澳元 0.0401	35,999,162.550		(1,109,886)
加元对冲类别（每月派息）	2017年2月28日	2017年3月8日	加元 0.0320	10,159,703.470		(245,468)
欧元对冲类别（每月派息）	2017年2月28日	2017年3月8日	欧元 0.0247	1,987,554.832		(52,166)
英镑对冲类别（每月派息）	2017年2月28日	2017年3月8日	英镑 0.0300	7,324,292.346		(273,431)
港元类别（每月派息）	2017年2月28日	2017年3月8日	港元 0.0350	321,924,769.781		(1,451,522)
纽元对冲类别（每月派息）	2017年2月28日	2017年3月8日	纽元 0.0424	9,721,603.539		(298,121)
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 0.0754	225,827,405.473		(2,487,002)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2017年2月28日	2017年3月8日	新加坡元 0.0325	1,613,638.830		(37,498)
美元类别（每月派息）	2017年2月28日	2017年3月8日	美元 0.0350	59,233,996.621		(2,073,190)
澳元对冲类别（每月派息）	2017年3月31日	2017年4月11日	澳元 0.0400	34,584,127.926		(1,055,300)
加元对冲类别（每月派息）	2017年3月31日	2017年4月11日	加元 0.0309	10,843,871.181		(251,247)
欧元对冲类别（每月派息）	2017年3月31日	2017年4月11日	欧元 0.0205	1,983,913.804		(43,499)
英镑对冲类别（每月派息）	2017年3月31日	2017年4月11日	英镑 0.0269	6,734,987.108		(226,545)
港元类别（每月派息）	2017年3月31日	2017年4月11日	港元 0.0350	308,717,889.581		(1,390,353)
纽元对冲类别（每月派息）	2017年3月31日	2017年4月11日	纽元 0.0430	10,578,857.183		(317,991)
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 0.0666	218,452,402.634		(2,117,163)
新加坡元对冲类别（每月派息）	2017年3月31日	2017年4月11日	新加坡元 0.0323	1,608,325.563		(37,178)
美元类别（每月派息）	2017年3月31日	2017年4月11日	美元 0.0350	60,060,089.978		(2,102,103)
可赎回份额持有人的总收益分配					(41,013,910)	(49,740,711)

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

6 非金钱收益／佣金共享安排

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

提供的产品和服务对本基金的益处必须明显，可包括研究和咨询服务、经济政治分析、投资组合分析（包括估值和业绩考评）、市场分析、数据与行情服务。

