

半年度报告 - 2019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，本未经审核半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 - 13

投资组合

截至二零一九年三月三十一日 (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 (97.5%)				香港 (11.8%)			
(I) 股票 (97.6%)				中银香港 (控股) 有限公司	8,176,500	33,851,967	2.2
澳大利亚 (16.2%)				长江和记实业有限公司	709,500	7,452,057	0.5
Amcor Ltd	1,074,026	11,741,560	0.8	长江基建集团有限公司	1,932,500	15,866,295	1.0
Australia & NZ Bkg Group-AU List	2,351,399	43,478,333	2.8	香港交易及结算所有限公司	695,100	24,226,824	1.6
Brambles Ltd	2,725,213	22,765,655	1.5	汇丰控股有限公司	2,563,016	20,863,410	1.3
Dexus Stapled Sec	2,185,212	19,775,860	1.3	展展房地產投資信託基金	941,500	11,010,223	0.7
Insurance Australia Group	4,359,738	23,784,498	1.5	金沙中国有限公司	4,999,200	25,123,528	1.6
Macquarie Group	42,645	3,920,504	0.2	新鸿基地产发展有限公司	2,120,000	36,377,811	2.3
Qantas Airways	3,297,676	13,258,573	0.8	九龙仓置业地产投资有限公司	1,217,000	9,061,669	0.6
QBE Insurance Group	1,875,583	16,400,864	1.1	印度 (3.4%)			
Scentre Group Stapled Secs	4,062,570	11,860,830	0.8	Coal India	2,242,194	7,677,350	0.5
Suncorp Group	1,313,579	12,858,130	0.8	Power Grid Corp of India	16,157,372	46,157,256	2.9
Tabcorp Hldgs	5,923,364	19,439,397	1.2	印度尼西亚 (5.2%)			
Transurban Group Stapled Sec	2,722,826	25,530,905	1.6	Astra Intl	16,734,900	8,608,366	0.6
Westpac Banking	1,490,665	27,446,529	1.8	Bank Mandiri (Persero)	52,527,900	27,481,238	1.8
中国 (24.6%)				Bank Rakyat Indonesia Persero	50,101,800	14,495,745	0.9
宝山钢铁股份有限公司 A 股 (C1)	24,210,844	26,045,755	1.7	Telekomunikasi Indonesia	108,708,500	30,154,392	1.9
中国建设银行股份有限公司 H 股	31,500,000	27,005,905	1.7	韩国 (9.9%)			
中国人寿保险股份有限公司 H 股	17,622,000	47,366,442	3.0	Hana Financial Group	145,000	4,649,811	0.3
中国移动有限公司	769,000	7,836,993	0.5	Korea Electric Power	1,065,290	28,061,114	1.8
中国海外发展有限公司	6,912,000	26,239,352	1.7	Lotte Chemical	17,132	4,384,500	0.3
华润置地有限公司	5,602,000	25,119,956	1.6	Orange Life Insurance	343,784	10,903,201	0.7
中国神华能源股份有限公司 H 股	1,414,000	3,224,301	0.2	Samsung Electronics	1,407,094	55,349,087	3.6
中国永达汽车服务控股有限公司	12,178,500	9,649,777	0.6	Samsung Electronics Pref	235,000	7,504,845	0.5
中国海洋石油有限公司	10,740,000	20,111,975	1.3	Samsung Fire & Marine Insurance	13,215	3,504,286	0.2
大唐国际发电股份有限公司 H 股	49,920,000	13,354,480	0.9	Shinhan Financial Group	906,076	33,525,850	2.1
华能国际电力股份有限公司 H 股	30,014,000	17,434,995	1.1	S-Oil Corp	81,770	6,454,578	0.4
华域汽车系统股份有限公司 A 股(C1)	2,722,500	8,255,831	0.5	新加坡 (8.8%)			
内蒙古伊利实业集团股份有限公司 A 股(C1)	3,045,243	13,190,246	0.8	AIMS AMP Capital Ind REIT-AC	114,106	119,624	0.0
江苏宁沪高速公路股份有限公司 H 股	12,054,000	17,044,618	1.1	AIMS APAC REIT Management	6,818,766	7,148,503	0.4
美的集团股份有限公司 A 股 - C2	2,271,628	16,471,090	1.1	Ascendas India Trust	26,322,300	23,125,535	1.5
中国石油天然气股份有限公司 H 股	42,328,000	27,445,974	1.8	CapitalLand Commercial Trust	10,444,100	14,958,696	0.9
中国平安保险 (集团) 股份有限公司 H 股	3,207,500	35,916,057	2.3	DBS Group Hldgs	1,752,603	32,645,385	2.1
中石化炼化工程 (集团) 股份有限公司 H 股	15,468,000	15,093,711	1.0	Mapletree Logistics Trust	27,103,550	29,214,605	1.9
越秀交通基建有限公司	21,546,000	17,538,830	1.1	United Overseas Bank	1,648,500	30,657,597	2.0
浙江沪杭甬高速公路股份有限公司 H 股	8,142,000	9,334,837	0.6	台湾 (11.5%)			
				硕邦科技股份有限公司	7,433,000	17,123,116	1.1
				台达电子工业股份有限公司	4,760,000	24,556,383	1.6
				力成科技股份有限公司	4,826,000	11,399,322	0.7
				慧荣科技股份有限公司 ADR	421,100	16,692,404	1.1
				台湾积体电路制造股份有限公司	10,697,000	85,206,714	5.5
				台湾积体电路制造股份有限公司 ADR	108,179	4,431,012	0.3
				世界先进积体电路股份有限公司	3,778,000	8,151,620	0.5
				启基科技股份有限公司	2,811,247	7,388,297	0.5
				元大金控股股份有限公司	6,707,639	3,819,505	0.2

财务状况表

截至二零一九年三月三十一日 (未经审计)

	二零一九年 三月三十一日 美元	二零一八年 九月三十日 美元
资产		
银行现金	18,829,664	29,897,332
短期存款	16,017,512	17,285,223
应收经纪款项	6,213,184	4,148,389
分配应收款项	13,315,256	4,508,788
衍生性产品	821,110	2,208,647
投资	1,521,502,288	1,528,940,360
股息及其他应收款项	4,362,431	5,283,413
总资产	<u>1,581,061,445</u>	<u>1,592,272,152</u>
负债		
应付经纪款项	4,243,003	2,336,442
赎回应付款项	8,071,993	14,217,088
应付收益分配 [附注 5]	5,358,723	6,294,812
衍生性产品	2,208,195	8,963,626
应付税项	557,335	32,481
其他应付款项	1,875,749	1,972,025
总负债 (不含可赎回份额持有人 应占净资产)	<u>22,314,998</u>	<u>33,816,474</u>
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	<u>1,558,746,447</u>	<u>1,558,455,678</u>

综合收益表

截至二零一九年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零一八年 十月一日至 二零一九年 三月三十一日 美元	二零一七年 十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元
收入		
投资及衍生性产品净收益 [附注 4]	39,884,728	88,475,205
股息收入	16,473,351	17,140,088
存款利息	183,935	153,651
汇兑净 (亏损) / 收益	(713,426)	78,916
其他收入	-	134
支出		
管理费用	10,706,438	13,668,895
交易成本	1,774,631	2,201,565
托管费用及银行费用	191,013	232,493
受托人费用	187,642	236,572
法律及专业费用	62,613	4,629
基金注册登记机构费用	55,383	85,165
核数师酬金	8,881	8,433
估值费用	8,540	8,540
印刷及出版支出	3,107	633
其他经营费用	12,151	4,172
	<u>13,010,399</u>	<u>16,451,097</u>
净经营利润	<u>42,818,189</u>	<u>89,396,897</u>
财务成本		
收益分配 [附注 5]	(32,521,597)	(41,013,910)
利息支出	(9,866)	(3,675)
	<u>(32,531,463)</u>	<u>(41,017,585)</u>
除税前利润	<u>10,286,726</u>	<u>48,379,312</u>
税项	(1,741,470)	(1,399,563)
可赎回份额持有人应占净资产 及总综合收益之增加	<u>8,545,256</u>	<u>46,979,749</u>

可赎回份额持有人应占净资产变动表
截至二零一九年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零一八年 十月一日至 二零一九年 三月三十一日 美元	二零一七年 十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元
期初可赎回份额持有人应占净资产	1,558,455,678	1,736,071,182
分配可赎回份额	455,448,264	1,392,186,900
赎回可赎回份额	(463,702,751)	(1,147,091,439)
净(赎回)/分配	(8,254,487)	245,095,461
	1,550,201,191	1,981,166,643
可赎回份额持有人应占净资产及 总综合收益之增加	8,545,256	46,979,749
期末可赎回份额持有人应占净资产	1,558,746,447	2,028,146,392

现金流量表
截至二零一九年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零一八年 十月一日至 二零一九年 三月三十一日 美元	二零一七年 十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元
经营业务		
购入投资及衍生性产品	(470,153,258)	(721,658,455)
出售投资及衍生性产品所得款 项	511,930,523	537,851,268
已收股息	17,393,231	13,749,798
已收利息	185,294	150,198
已付基金注册登记机构费用	(118,100)	(185,098)
已付受托人费用	(187,342)	(231,072)
已付税项	(1,186,941)	(1,399,563)
已付交易费用	(1,760,898)	(2,166,405)
已付管理费用	(10,689,000)	(13,341,302)
其他	(1,286,906)	(1,978,310)
经营业务所产生/(运用) 之现金净额	44,126,603	(189,208,941)
融资活动		
已付利息	(9,866)	(3,675)
分配可赎回份额所得款项	446,641,796	1,373,763,093
赎回可赎回份额付款	(469,847,846)	(1,144,232,731)
已付收益分配	(33,457,686)	(39,505,822)
融资活动所(运用)/产生 之现金净额	(56,673,602)	190,020,865
现金及现金等价物之(减 少)/增加	(12,546,999)	811,924
期初现金及现金等价物	47,182,555	61,711,785
现金及现金等价物之汇兑收益	211,620	1,707,140
期末现金及现金等价物	34,847,176	64,230,849
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	18,829,664	27,118,331
短期存款	16,017,512	37,112,518
	34,847,176	64,230,849

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

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二零一八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。

(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。

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。

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

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）

二零一九年三月三十一日

	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	25,383,211.692	9,615,807.054	1,891,941.861	4,344,365.840	1,270,043.598
	澳元	加元	欧元	英镑	港元
可赎回份额持有人应占净资产	240,547,930	92,789,592	18,732,816	42,864,209	16,769,055
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	9.48	9.65	9.90	9.87	13.20

二零一九年三月三十一日

	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额
已发行份额数目	217,194,328.827	5,654,810.139	1,136,533.370	941,305.420	1,449,148.732
	港元	纽元	人民币	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	2,176,052,753	54,196,243	11,408,465	9,407,048	21,829,269
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	10.02	9.58	10.04	9.99	15.06
	PRC 人民币对冲份 额 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲份 额 (每月派息) 份额	新加坡元对冲类别 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额
已发行份额数目	9,165,999.830	186,864,330.209	12,629,721.710	941,212.710	821,976.080
	人民币	人民币	人民币	新加坡元	美元
可赎回份额持有人应占净 资产	91,694,243	1,924,850,775	125,915,323	9,109,640	8,233,589
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	10.00	10.30	9.97	9.68	10.02
	美元类别 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额	美元类别 (每月派息) 份额		
已发行份额数目	394,381.834	637,721.510	57,869,395.875		
	美元	美元	美元		
可赎回份额持有人应占净 资产	5,172,406	6,363,876	573,596,676		
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	13.12	9.98	9.91		

二零一八年九月三十日

	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	25,078,226.135	9,877,942.309	1,553,788.546	4,953,046.260	1,292,757.437
	澳元	加元	欧元	英镑	港元
可赎回份额持有人应占净资产	236,489,568	94,664,021	15,276,700	48,524,037	16,478,379
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.43	9.58	9.83	9.80	12.75
	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	242,164,862.290	6,870,594.703	1,573,624.119	190,590,640.316	1,767,059.188
	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	2,397,665,622	65,500,294	22,929,067	1,949,899,852	17,001,971
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.90	9.53	14.57	10.23	9.62
	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	357,512.440	58,738,129.006			
	美元	美元			
可赎回份额持有人应占净资产	4,541,186	577,217,695			
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	12.70	9.83			

4 投资及衍生性产品净收益

	二零一八年 十月一日至 二零一九年 三月三十一日 美元	二零一七年 十月一日至 二零一八年 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	76,499,029	15,424,961
投资及衍生性产品销售之实现（亏损）／收益	(36,614,301)	73,050,244
	<u>39,884,728</u>	<u>88,475,205</u>

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。

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。

	二零一八年 十月一日至 二零一九年 三月三十一日 美元	二零一七年 十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元
净经营利润	42,818,189	89,396,897
调整：		
投资及衍生性产品净收益	(39,884,728)	(88,475,205)
汇兑净亏损／（收益）	713,426	(78,916)
交易成本	1,774,631	2,201,565
利息支出	(9,866)	(3,675)
税项	(1,741,470)	(1,399,563)
收益可分配金额	<u>3,670,182</u>	<u>1,641,103</u>

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零一八年 十月一日至 二零一九年 三月三十一日 美元	二零一七年 十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元
澳元对冲类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	澳元 0.0334	24,551,192.585	(581,182)	
加元对冲类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	加元 0.0300	9,730,020.425	(222,273)	
欧元对冲类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	欧元 0.0140	1,478,876.925	(23,459)	
英镑对冲类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	英镑 0.0239	4,629,744.401	(141,384)	
港元类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	港元 0.0373	225,391,244.892	(1,072,415)	
纽元对冲类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	纽元 0.0338	6,686,206.644	(147,574)	
人民币对冲类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	人民币 0.0564	186,614,300.992	(1,509,032)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月9日	新加坡元 0.0305	1,463,803.011	(32,240)	
美元类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	美元 0.0370	56,330,916.220	(2,084,245)	
澳元对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	澳元 0.0322	24,217,069.015	(569,441)	
加元对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	加元 0.0313	9,571,749.729	(225,413)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零一八年	二零一七年
					十月一日至 二零一九年 三月三十一日 美元	十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元
欧元对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	欧元 0.0153	1,468,673.886	(25,442)	
英镑对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	英镑 0.0249	4,556,991.697	(144,775)	
港元类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	港元 0.0373	221,992,751.135	(1,058,088)	
纽元对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	纽元 0.0327	6,468,702.591	(145,298)	
人民币对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	人民币 0.0480	182,690,352.230	(1,260,685)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	新加坡元 0.0303	1,360,393.754	(30,044)	
美元类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	美元 0.0370	55,366,396.874	(2,048,558)	
澳元对冲类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	澳元 0.0310	24,055,256.692	(524,982)	
加元对冲类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	加元 0.0288	9,644,159.542	(203,362)	
欧元对冲类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	欧元 0.0096	1,467,997.762	(16,110)	
英镑对冲类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	英镑 0.0203	4,540,989.065	(117,403)	
港元类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	港元 0.0372	215,973,759.409	(1,026,167)	
纽元对冲类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	纽元 0.0319	6,236,866.146	(133,410)	
人民币对冲类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	人民币 0.0442	181,256,663.433	(1,166,104)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	新加坡元 0.0305	1,360,884.875	(30,453)	
美元类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	美元 0.0370	54,444,331.780	(2,014,440)	
澳元对冲类别（每月派息）	2018年1月31日	2019年2月13日	澳元 0.0310	24,985,687.912	(564,768)	
加元对冲类别（每月派息）	2018年1月31日	2019年2月13日	加元 0.0285	9,843,324.929	(213,611)	
欧元对冲类别（每月派息）	2018年1月31日	2019年2月13日	欧元 0.0111	1,401,655.119	(17,852)	
英镑对冲类别（每月派息）	2018年1月31日	2019年2月13日	英镑 0.0216	4,543,925.858	(129,110)	
港元类别（每月派息）	2018年1月31日	2019年2月13日	港元 0.0374	218,685,568.516	(1,042,329)	
纽元对冲类别（每月派息）	2018年1月31日	2019年2月13日	纽元 0.0304	6,797,364.409	(143,325)	
人民币对冲类别（每月派息）	2018年1月31日	2019年2月13日	人民币 0.0406	185,275,660.724	(1,121,410)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2018年1月31日	2019年2月13日	新加坡元 0.0298	1,117,921.883	(24,775)	
美元类别（每月派息）	2018年1月31日	2019年2月13日	美元 0.0370	56,868,080.566	(2,104,119)	
澳元对冲类别（每月派息）	2019年2月28日	2019年3月8日	澳元 0.0312	26,093,571.829	(579,205)	
加元对冲类别（每月派息）	2019年2月28日	2019年3月8日	加元 0.0297	9,734,008.495	(219,514)	
欧元对冲类别（每月派息）	2019年2月28日	2019年3月8日	欧元 0.0138	1,364,075.476	(21,435)	
英镑对冲类别（每月派息）	2019年2月28日	2019年3月8日	英镑 0.0228	4,639,193.795	(140,689)	
港元类别（每月派息）	2019年2月28日	2019年3月8日	港元 0.0374	216,040,538.393	(1,029,315)	
纽元对冲类别（每月派息）	2019年2月28日	2019年3月8日	纽元 0.0303	6,207,285.394	(128,177)	
人民币对冲类别（每月派息）	2019年2月28日	2019年3月8日	人民币 0.0342	190,081,900.683	(970,964)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零一八年	二零一七年
					十月一日至 二零一九年 三月三十一日 美元	十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	新加坡元 0.0308	1,065,669.074	(24,291)	
美元类别(每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	美元 0.0370	57,675,825.633	(2,134,006)	
澳元对冲类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	澳元 0.0309	25,393,310.165	(557,378)	
加元对冲类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	加元 0.0288	9,619,742.735	(207,379)	
欧元对冲类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	欧元 0.0110	1,901,136.043	(23,482)	
英镑对冲类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	英镑 0.0213	4,344,365.840	(120,578)	
港元类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	港元 0.0374	217,176,054.543	(1,034,705)	
纽元对冲类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	纽元 0.0303	5,645,290.840	(116,658)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	人民币 0.0374	187,316,881.244	(1,042,407)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	新加坡元 0.0306	941,212.710	(21,263)	
美元类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	美元 0.0370	57,853,279.825	(2,140,572)	
PRC人民币对份额 额(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	人民币 0.0363	12,540,956.210	(67,737)	
PRC人民币份额 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	人民币 0.0372	912,007.830	(5,048)	
PRC美元份额(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	美元 0.0373	576,831.520	(21,516)	
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)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零一八年	二零一七年
					十月一日至 二零一九年 三月三十一日 美元	十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元
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)
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)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零一八年	二零一七年
					十月一日至 二零一九年 三月三十一日 美元	十月一日至 二零一八年 三月三十一日 美元
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)
可赎回份额持有人之总收益分配					(32,521,597)	(41,013,910)

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）、市场分析及投资相关的出版物。

