

年度报告—2019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，也不应视作任何宣传。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，本年度报告中的财务报告内若干数据以综合方法表述，因此当中包括并未在中国内地注册的股份类别之资产。

内容	页
投资组合 - 未经审计	1 - 6
投资组合持有变动表 - 未经审计	6
财务状况表	7
综合收益表	7
可赎回份额持有人应占净资产变动表	8
现金流量表	8
财务报表之附注	9 - 46
独立核数师报告	47 - 48
管理人及受托人的责任声明	49
受托人对份额持有人的报告	49
业绩纪录 - 未经审计	49 - 50
经营与管理	51

投资组合

截至二零一九年九月三十日 (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 (97.2%)				ENN Energy Hldgs 3.25% 07/22-RegS	美元 18,400,000	18,503,934	0.6
(I) 债务证券 (97.4%)				FWD Ltd 5% 24/09/24-RegS	美元 16,400,000	17,594,284	0.5
澳大利亚 (0.5%)				FWD Ltd VRN 0% Perp-RegS	美元 20,000,000	16,225,000	0.5
Australia Gov No148 2.75%11/27-RegS	澳元 23,000,000	17,840,116	0.5	Greenland HK Hldgs 6% 17/07/21-RegS	美元 14,000,000	14,274,167	0.4
巴哈马群岛 (0.5%)				Longfor Grp Hldg 4.5% 16/01/28- RegS	美元 11,600,000	12,113,010	0.4
Competition Team 3.75% 12/3/24-RegS	美元 16,300,000	16,885,645	0.5	Melco Resorts Fin 5.625% 07/27-RegS	美元 5,200,000	5,435,625	0.2
百慕大 (2.0%)				Powerlong Real Est 6.95% 04/21-RegS	美元 8,500,000	8,763,594	0.3
China Oil & Gas 5.5% 25/01/23-RegS	美元 10,500,000	10,829,000	0.3	Redsun Properties 10.5%3/10/22-RegS	美元 14,400,000	13,365,600	0.4
GCL New Energy 7.1% 30/01/21-RegS	美元 23,800,000	22,817,787	0.7	Redsun Properties 13.5% 12/20-RegS	美元 2,000,000	2,132,700	0.1
Gome Retail Hldgs 5%10/03/20-RegS	美元 12,000,000	11,810,000	0.3	Sands China 5.125% 08/08/25	美元 8,500,000	9,403,934	0.3
Hopson Develop Hldgs7.5% 06/22- RegS	美元 21,600,000	22,032,720	0.7	Sands China 5.4% 08/08/28	美元 600,000	681,960	0.0
开曼群岛 (11.2%)				Semiconductor Mfg 4.125%10/19-RegS	美元 1,600,000	1,633,100	0.0
Agile Group 9% 21/05/20-RegS	美元 6,720,000	7,093,968	0.2	Shui On Dev 6.25% 28/11/21-RegS	美元 19,800,000	20,284,688	0.6
Agile Group 9.5% 23/11/20-RegS	美元 16,000,000	17,332,444	0.5	Sun Hung Kai Prop 3.75% 02/29-RegS	美元 5,500,000	5,905,350	0.2
Azure Orbit IV 3.75% 25/01/23-RegS	美元 18,100,000	18,682,368	0.6	Tencent Hldgs 3.975% 11/04/29-RegS	美元 10,400,000	11,320,617	0.3
Central China 7.325% 27/01/20-RegS	美元 15,400,000	15,619,685	0.5	Times China 6.25% 17/01/21-RegS	美元 12,800,000	13,047,644	0.4
China Aoyuan Group 7.5% 05/21-RegS	美元 8,000,000	8,432,600	0.2	Times China Hldgs 10.95% 11/20-RegS	美元 3,000,000	3,300,350	0.1
China Aoyuan Group 8.5% 01/22-RegS	美元 3,800,000	4,044,551	0.1	Times China Hldgs 6.75% 07/23-RegS	美元 7,600,000	7,591,355	0.2
China Overseas Gr 4.875% 06/21-RegS	美元 5,000,000	5,212,250	0.1	Times Property 6.25% 23/01/20-RegS	美元 6,000,000	6,092,433	0.2
China SCE Group 7.375% 4/24-RegS	美元 12,000,000	11,885,833	0.4	Yankuang Grp Cayman4.75% 11/20-RegS	美元 16,300,000	16,620,707	0.5
China SCE Group 7.45% 04/21-RegS	美元 9,200,000	9,661,738	0.3	Yuzhou Properties 6% 25/10/23-RegS	美元 4,700,000	4,429,750	0.1
China SCE Group 8.75% 15/01/21-RegS	美元 2,000,000	2,100,144	0.1	Yuzhou Properties 7.9% 11/5/21-RegS	美元 10,000,000	10,500,722	0.3
China State Const 3.375% 11/22-RegS	美元 2,000,000	2,040,875	0.1	Yuzhou Properties 8.625% 01/22-RegS	美元 6,500,000	6,808,371	0.2
CIFI Hldgs Group 6.7% 23/04/22-RegS	离岸人民币 74,800,000	10,537,793	0.3	智利 (0.5%)			
CIFI Hldgs Group VRN5.375%Perp-RegS	美元 7,500,000	7,218,940	0.2	Rep of Chile 4.5% 01/03/26-RegS	智利比索 10,405,000,000	16,036,450	0.5
CK Hutchison Intl 3.625% 04/29-RegS	美元 14,100,000	15,216,975	0.5	中国 (7.8%)			
Country Garden 5.625% 15/12/26-RegS	美元 9,000,000	9,306,563	0.3	Bank of China HK 3.625% 04/29- RegS	美元 6,800,000	7,308,394	0.2
				CCB Life Ins VRN 4.5% 21/4/77-RegS	美元 20,600,000	20,754,500	0.6

投资组合 (续)

截至二零一九年九月三十日 (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
中国 (续)				China Clean Energy 4.282%12/25-RegS 美元 10,000,000 10,764,722 0.3			
China CITIC Bk VRN 4.625% 2/29-RegS	美元 13,650,000	14,328,263	0.4	China Oil & Gas 4.625% 04/22- RegS	美元 11,900,000	12,172,320	0.4
China Const Bk VRN 3.875% 5/25-RegS	美元 26,200,000	26,721,489	0.8	Chong Hing Bk VRN 3.876% 07/27- RegS	美元 10,400,000	10,483,703	0.3
China Const Bk VRN 4.25% 02/29-RegS	美元 8,800,000	9,250,242	0.3	Chong Hing Bk VRN 5.7% Perp-RegS	美元 5,300,000	5,507,142	0.2
China Dev Bank No1910 3.65% 21/5/29	人民币 300,000,000	42,747,086	1.3	CNAC (HK) Finbridge 5.125%3/28-RegS	美元 11,000,000	12,405,472	0.4
China Life Ins VRN 4% 03/07/75-RegS	美元 14,600,000	14,785,826	0.4	CNAC HK Finbridge 3.875% 06/29- RegS	美元 29,100,000	30,312,864	0.9
China Minmetals VRN 3.75% Perp-RegS	美元 8,500,000	8,636,213	0.3	CNAC HK Finbridge 4.75% 06/49-RegS	美元 2,800,000	3,313,123	0.1
Haitian (BVI) Intl 3.875%12/20-RegS	美元 13,300,000	13,454,049	0.4	Gemdale Ever 4.95% 26/7/22-RegS	美元 6,100,000	6,040,144	0.2
Kunming Traffic Inv 6.2% 6/22-RegS	美元 12,800,000	13,135,218	0.4	Gemdale Ever 5.6% 14/06/22-RegS	美元 1,400,000	1,430,302	0.1
People's Bk of CN 离岸人民币 2.9%15/11/19-RegS	150,000,000	21,087,523	0.6	Gemdale Ever 6% 06/09/21-RegS	美元 9,000,000	9,194,100	0.3
Postal Saving Bk VRN 4.5% Perp-RegS	美元 29,200,000	29,211,680	0.9	GET Intl Invest 3.75% 18/07/22-RegS	美元 10,400,000	10,526,299	0.3
RKPF Overseas 7.875% 01/02/23- RegS	美元 5,800,000	6,206,435	0.2	HK Intl (Qingdao) 3.75% 12/20-RegS	美元 3,000,000	3,034,013	0.1
Shougang Group 4% 23/05/24-RegS	美元 11,000,000	11,524,944	0.4	HK Intl (Qingdao) 4.25% 12/22-RegS	美元 13,400,000	13,522,108	0.4
SiChuan Railway Inv 3.8% 06/22-RegS	美元 1,900,000	1,936,427	0.1	Huasing Intl Hldgs 4.5% 03/21-RegS	美元 10,900,000	10,958,043	0.3
Zhengzhou Real 3.95% 09/10/22- RegS	美元 16,400,000	16,410,004	0.5	ICBC Asia VRN 4.25% Perp-RegS	美元 23,000,000	23,261,369	0.7
哥伦比亚 (0.6%)				ICBCIL Finance 3.625% 19/05/26- RegS 美元 13,000,000 13,606,992 0.4			
Rep of Colombia 4.375% 21/03/23	哥伦比亚比索 500,000,000	143,218	0.0	ICBCIL Finance 3.75% 05/03/24-RegS	美元 18,200,000	18,929,062	0.6
Rep of Colombia 7.75% 14/04/21	哥伦比亚比索 2,185,000,000	676,536	0.0	Shanghai Comm Bk VRN 5% 01/29- RegS	美元 10,200,000	10,917,853	0.3
Rep of Colombia 7.75%9/30- RegS/144A	哥伦比亚比索 51,500,000,000	18,119,919	0.6	Weichai Intl HK VRN 3.75% Perp-RegS	美元 19,300,000	19,342,862	0.6
香港 (10.8%)				Wing Lung Bank VRN 3.75% 11/27-RegS 美元 17,100,000 17,346,881 0.5			
Anhui Transport 4.875% 13/9/21- RegS	美元 3,900,000	3,996,671	0.1	Yango Justice Intl 10.25% 3/22-RegS	美元 9,200,000	8,802,803	0.3
Bank of East Asi VRN5.625%Perp- RegS	美元 10,400,000	10,715,445	0.3	Yango Justice Intl 9.5% 3/4/21-RegS	美元 7,000,000	6,996,306	0.2
Bank of East Asia VRN 4% 11/26-RegS	美元 29,800,000	30,620,824	0.9	Yango Justice Intl 9.5%3/4/21-RegS	美元 2,800,000	2,798,522	0.1
Bank of East Asia VRN 4.25% 24-RegS	美元 4,300,000	4,372,521	0.1	Yanlord Land (HK) 6.8% 27/2/24-RegS	美元 11,800,000	12,235,682	0.4
Bank of East Asia VRN 5.5%Perp-RegS	美元 5,000,000	5,116,653	0.2	印度 (7.2%)			
Bocom Leasing Man 4.375% 01/24- RegS	美元 10,300,000	10,986,345	0.3	Adani Ports & Sp 3.375%24/7/24- RegS	美元 9,900,000	10,019,604	0.3
CDBL Funding I 4.25% 02/12/24-RegS	美元 16,000,000	17,172,778	0.5	Adani Ports & Sp 4.375% 07/29 - RegS	美元 6,300,000	6,634,810	0.2

投资组合 (续)

截至二零一九年九月三十日 (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
印度 (续)							
Adani Transmission 4% 03/08/26-RegS	美元 9,800,000	10,093,456	0.3	Indonesia Govt NoFR61 7% 15/05/22	印尼盾 450,000,000,000	32,938,930	1.0
Bharat Petroleum 4% 08/05/25-RegS	美元 16,440,000	17,476,359	0.5	Indonesia Govt NoFR68 8.375%15/3/34	印尼盾 80,000,000,000	5,980,029	0.2
Bharat Petroleum 4.375% 01/22-RegS	美元 3,000,000	3,132,427	0.1	Indonesia Govt NoFR82 7% 15/09/30	印尼盾 450,000,000,000	31,098,248	0.9
Canara Bank London 3.875% 3/24-RegS	美元 6,800,000	7,025,916	0.2	Pelabuhan Indonesia 5.375%5/45-RegS	美元 15,000,000	17,453,229	0.5
India Govt Bond 7.26% 14/01/29	印度卢比 3,308,990,000	49,191,107	1.5	Pertamina Persero 6.45%30/5/44- RegS	美元 3,000,000	3,934,588	0.1
India Govt Bond 7.37% 16/04/23	印度卢比 1,000,000,000	15,082,507	0.5	Perusahaan Listrik 3.875% 7/29-RegS	美元 8,600,000	8,991,001	0.3
India Govt Bond 7.72% 25/05/25	印度卢比 2,200,000,000	33,481,140	1.0	Perusahaan Listrik 5.375%01/29-RegS	美元 7,000,000	8,128,079	0.2
Indian Oil Corp 4.75% 16/01/24-RegS	美元 10,000,000	10,787,958	0.3	Perusahaan Penerbit 4.4% 03/28-RegS	美元 25,400,000	27,850,253	0.8
Indian Railway Fin3.73%29/3/24- RegS	美元 7,600,000	7,889,995	0.2	Perusahaan Penerbit 4.45% 2/29-RegS	美元 11,200,000	12,408,122	0.4
JSW Steel 5.25% 13/04/22-RegS	美元 3,600,000	3,737,520	0.1	Rep of Indonesia 4.75% 11/02/29	美元 10,800,000	12,389,730	0.4
Jubilant Pharma 6% 05/03/24-RegS	美元 10,200,000	10,639,450	0.3	Rep of Indonesia 5.35% 11/02/49	美元 4,000,000	5,149,522	0.2
NTPC Ltd 3.75% 03/04/24-RegS	美元 4,700,000	4,934,961	0.2	Saka Energi Indon 4.45% 05/24-RegS	美元 6,800,000	6,973,721	0.2
NTPC Ltd 4.25% 26/02/26-RegS	美元 5,000,000	5,322,160	0.2				
Oil India 5.125% 04/02/29-RegS	美元 9,100,000	10,436,923	0.3	韩国 (5.1%)			
Power Fin Corp 3.75% 06/12/27-RegS	美元 17,300,000	17,486,480	0.5	Busan Bank 3.625% 25/07/26-RegS	美元 25,700,000	26,257,583	0.8
Renew Power Syn 6.67% 12/03/24-RegS	美元 6,300,000	6,415,733	0.2	Hanwha Life Insur VRN 4.7%Perp- RegS	美元 2,200,000	2,261,881	0.1
UPL Corp 3.25% 13/10/21-RegS	美元 9,100,000	9,289,432	0.3	Hanwha Total Petro 3.875% 1/24-RegS	美元 3,500,000	3,680,528	0.1
				Heungkuk Life VRN 4.475% 11/47- RegS	美元 22,500,000	22,306,531	0.7
印度尼西亚 (9.0%)				Hyundai Cap 3% 06/03/22-RegS	美元 2,200,000	2,220,533	0.1
Bk Mandiri Persero3.75%11/4/24- RegS	美元 3,600,000	3,786,510	0.1	Industrial Bk KR VRN 3.9% Perp-RegS	美元 3,200,000	3,244,800	0.1
Bk Rakyat Indonesia 3.95% 3/24-RegS	美元 3,050,000	3,185,966	0.1	Kookmin Bank 4.5% 01/02/29-RegS	美元 9,900,000	10,995,930	0.3
Indonesia Asahan 6.53%15/11/28-RegS	美元 12,625,000	15,820,626	0.5	Korea Land No42 3.5% 27/08/20	韩元 5,000,000,000	4,847,289	0.1
Indonesia Asahan 6.75% 11/48-RegS	美元 14,200,000	18,817,506	0.6	Korea Treasury No2109 1.375% 09/21	韩元 20,000,000,000	16,746,428	0.5
Indonesia Asahan5.71% 15/11/23-RegS	美元 5,200,000	5,846,210	0.2	Korea Treasury No2906 1.875%10/6/29	韩元 18,959,850,000	16,550,048	0.5
Indonesia Govt 7.5% 15/06/35	50,000,000,000	3,554,530	0.1	Shinhan Bank 3.75% 20/09/27-RegS	美元 8,000,000	8,348,767	0.3
Indonesia Govt 8.25% 15/05/29	823,013,000,000	63,710,988	1.9	Shinhan Fin Grp VRN 3.34% 2/30-RegS	美元 17,200,000	17,541,344	0.5
Indonesia Govt NoFR53 8.25% 15/7/21	117,300,000,000	8,676,535	0.3	Shinhan Fin VRN 5.875% Perp-RegS	美元 3,000,000	3,251,350	0.1

投资组合 (续)

截至二零一九年九月三十日 (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
韩国 (续)				Royal Capital VRN			
Woori Banks VRN				4.875% Perp-RegS	美元 17,200,000	17,630,530	0.5
4.25% Perp	美元 11,900,000	11,900,000	0.4				
Woori Bank VRN 5%				秘鲁 (0.9%)			
10/06/45-RegS	美元 10,000,000	10,253,667	0.3	Rep of Peru 5.4%	秘鲁索尔		
Woori Bank VRN				12/08/34-RegS	97,000,000	30,906,983	0.9
5.25% Perp-RegS	美元 6,900,000	7,259,749	0.2				
卢森堡 (0.3%)				菲律宾 (2.0%)			
SPIC Lux Energy				Philippine Govt	菲律宾比索		
4.65% 30/10/23-RegS	美元 8,800,000	9,517,237	0.3	3.875% 22/11/19	750,000,000	14,674,155	0.5
				Philippine Govt			
马来西亚 (2.6%)				No1054 6.375%	菲律宾比索	5,738,718	0.2
Cagamas Bhd NoP8	林吉特			01/22			
6.35% 08/08/23	55,000,000	13,505,749	0.4	Philippine Govt			
GOHL Capital 4.25%				No1056 4.875%	菲律宾比索	4,524,402	0.1
24/01/27-RegS	美元 6,400,000	6,742,462	0.2	08/22			
Malaysia Govt No0418	林吉特			Philippine Govt			
4.893% 06/38	58,000,000	16,420,970	0.5	No1057 4.75%	菲律宾比索	894,589	0.0
Malaysian Govt				09/22			
No0112 3.418%	林吉特			Philippine Govt			
08/22	50,000,000	12,095,359	0.4	No1064 6.875%	菲律宾比索	9,102,981	0.3
Malaysian Govt No419	林吉特			01/29			
3.828% 5/07/34	65,000,000	16,077,742	0.5	Philippine Govt			
RHB Bank 3.766%				No2023 6.75%	菲律宾比索	7,060,942	0.2
19/02/24-RegS	美元 6,900,000	7,295,326	0.2	01/39			
SD Intl Sukuk 6.3%				Philippine Govt			
09/05/22-RegS	美元 7,000,000	7,322,700	0.2	NoR512 6.25%	菲律宾比索	24,601,705	0.7
TNB Global Vent				03/24			
4.851% 1/11/28-RegS	美元 7,100,000	8,227,214	0.2	Rizal Comm Banking	美元 450,000	465,961	0.0
				4.125% 3/23-RegS			
毛里求斯 (1.4%)				新加坡 (6.0%)			
Azure Power Energy				Abja Investment			
5.5% 11/22-RegS	美元 5,400,000	5,595,000	0.2	5.45% 24/01/28-RegS	美元 26,000,000	25,646,219	0.8
Azure Power Solar				Alam Synergy 6.625%			
5.65% 12/24-RegS	美元 2,750,000	2,763,609	0.1	24/04/22-RegS	美元 2,600,000	2,543,820	0.1
Greenko Mauritius				GLP Pte 3.875%			
6.25% 21/2/23-RegS	美元 4,700,000	4,820,764	0.1	04/06/25-RegS	美元 22,600,000	23,178,419	0.7
Greenko Solar 5.55%				Indika Energy 5.875%			
29/01/25-RegS	美元 8,900,000	8,973,944	0.3	09/11/24-RegS	美元 12,600,000	12,608,488	0.4
Neerg Energy 6%				LLPL Capital Pte			
13/02/22-RegS	美元 24,300,000	24,210,090	0.7	6.875% 4/2/39-RegS	美元 11,600,000	13,451,231	0.4
				LMIRT Capital 7.25%			
蒙古 (0.6%)				19/06/24-RegS	美元 17,508,000	18,730,788	0.6
Trad&Dev Bank				Medco Platinum			
9.375% 19/05/20-RegS	美元 20,000,000	21,246,500	0.6	6.75% 30/01/25-RegS	美元 24,200,000	24,630,458	0.7
				Parkway Pantai VRN			
荷兰 (1.6%)				4.25% Perp-RegS	美元 16,100,000	16,231,304	0.5
Greenko Dutch				Singapore Govt	新加坡元		
4.875% 24/07/22-RegS	美元 10,400,000	10,521,398	0.3	2.875% 01/07/29	31,000,000	24,838,725	0.7
Indo Energy Fin II				SSMS Plant Hldgs			
6.375% 1/23-RegS	美元 8,000,000	4,636,238	0.2	7.75% 1/23-RegS	美元 12,500,000	10,006,111	0.3
Minejesa Capital				United Overseas VRN			
4.625% 08/30-RegS	美元 18,000,000	18,664,238	0.6	3.75% 4/29-RegS	美元 8,600,000	9,065,188	0.3
				United Overseas VRN			
				3.875% PERP-RegS	美元 18,000,000	18,448,875	0.5

投资组合 (续)

截至二零一九年九月三十日 (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
斯里兰卡 (1.0%)				China Cinda Fin			
Rep of Sri Lanka				4.375% 08/02/25-Reg	美元		
6.35% 06/24-RegS	美元 3,500,000	3,567,215	0.1	China Railway XunJie	美元	3,634,399	0.1
Rep of Sri Lanka				3.25%/7/26-RegS	10,000,000	10,282,375	0.3
7.55% 03/30-RegS	美元 8,500,000	8,573,560	0.3	Chouzhou Intl Inv 4%	美元		
Rep of Sri Lanka				05/12/20-RegS	8,700,000	8,844,323	0.3
6.25% 27/7/21-RegS	美元 7,500,000	7,716,083	0.2	Chouzhou Intl Inv	美元		
Rep of Sri Lanka				4.5% 30/5/22-RegS	1,200,000	1,236,150	0.0
6.75% 18/4/28-RegS	美元 3,500,000	3,457,869	0.1	Dianjian Haixing VRN	美元		
Rep of Sri Lanka				4.05%Perp-RegS	14,115,000	14,388,125	0.4
7.85% 14/3/29-RegS	美元 8,500,000	8,613,109	0.3	DianJian Haiyu VRN	美元		
国际 (0.9%)				3.5% Perp-RegS	12,000,000	12,139,833	0.4
Corp Andina Fomento	哥伦比亚比索			Dianjian Haiyu VRN	美元		
6.77%5/28-RegS	46,000,000,000	14,467,109	0.4	4.3% Perp-RegS	3,100,000	3,203,118	0.1
Intl Finance 8.25%	巴西雷亚尔			Easy Tactic 8.125%	美元		
30/01/23	55,605,000	15,368,343	0.5	11/07/24-RegS	6,800,000	6,564,758	0.2
泰国 (4.1%)				Easy Tactic 8.125%	美元		
Kasikornbank VRN				27/02/23-RegS	14,600,000	14,235,345	0.4
3.343% 10/31-RegS	美元 8,400,000	8,338,680	0.3	Easy Tactic 8.625%	美元		
Krung Thai Bk VRN				27/02/24-RegS	1,100,000	1,071,670	0.0
5.2% 12/24-RegS	美元 32,500,000	33,071,097	1.0	ENN Clean Energy	美元		
PTTEP Treasury VRN				7.5% 27/02/21-RegS	3,700,000	3,851,083	0.1
4.6% Perp-RegS	美元 16,200,000	16,703,100	0.5	Expand Lead 6.4%	美元		
Siam Comm Bk 3.9%				18/09/21-RegS	13,800,000	14,234,163	0.4
11/02/24-RegS	美元 4,000,000	4,242,067	0.1	Fortune Star 5.25%	美元		
Siam Comm Bk 4.4%				23/03/22-RegS	5,300,000	5,271,468	0.2
11/02/29-RegS	美元 4,600,000	5,169,071	0.2	Fortune Star 5.95%	美元		
Thailand Govt 1.875%				29/01/23-RegS	13,400,000	13,530,613	0.4
17/06/22	泰铢 600,000,000	20,001,854	0.6	Fortune Star 6.75%	美元		
Thailand Govt 3.65%				02/07/23-RegS	13,900,000	14,424,551	0.4
17/12/21	泰铢 1,380,000,000	47,860,955	1.4	Franshion Brilliant	美元		
英国 (0.4%)				VRN 4%Perp-RegS	16,700,000	16,602,769	0.5
Vedanta Res Fin II 8%				Gemstones Intl 8.5%	美元		
23/04/23-RegS	美元 14,300,000	14,932,219	0.4	15/08/20-RegS	15,900,000	15,575,817	0.5
美国 (3.8%)				Greenland Global	美元		
US Treasury IL Nts				5.9% 12/02/23-RegS	18,400,000	18,374,802	0.6
0.5% 15/04/24	美元 123,500,000	127,450,291	3.8	HKT Capital No4 3	美元		
维京群岛 (16.6%)				14/07/26-RegS	20,800,000	20,992,747	0.6
Baoxin Auto Fin VRN				Huarong Fin 2017 VRN	美元		
5.625%Perp-RegS	美元 24,300,000	20,347,453	0.6	4% Perp-RegS	25,100,000	25,501,600	0.8
Baoxin Auto Finance				Huarong Fin 2019	美元		
7.9% 02/20-RegS	美元 2,400,000	2,399,333	0.1	4.5% 29/05/29-RegS	9,700,000	10,341,655	0.3
Beijing Cap Polar				Huarong Fin II VRN	美元		
4.25% 03/21-RegS	美元 8,300,000	8,412,799	0.3	2.875% Perp-RegS	7,000,000	6,884,553	0.2
Bluestar Fin Hldgs				Hysan (MTN) 2.82%	美元		
3.375% 7/24-RegS	美元 26,000,000	26,424,613	0.8	04/09/29-RegS	17,000,000	16,458,805	0.5
CCCI Treasure VRN				King Power Cap	美元		
3.5% Perp-RegS	美元 18,900,000	19,215,735	0.6	5.625% 03/11/24-RegS	9,900,000	11,385,743	0.4
Champion Sin VRN				Minmetals Bounteous	美元		
8.125% Perp-RegS	美元 20,000,000	21,202,236	0.7	4.2% 07/26-RegS	10,000,000	10,633,667	0.3
				New Metro Global	美元		
				6.5% 23/4/21-RegS	9,800,000	9,511,662	0.3
				New Metro Global	美元		
				6.75% 26/1/20-RegS	6,900,000	6,951,491	0.2

投资组合 (续)

截至二零一九年九月三十日 (未经审计)

投资组合持有变动表

截至二零一九年九月三十日止年度 (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	
			2019	2018
维京群岛 (续)				
NWD MTN Ltd 4.125% 18/07/29-RegS	美元 16,400,000	16,393,679	0.5	
Poly Real Estate 4.75% 17/9/23- RegS	美元 2,000,000	2,112,594	0.1	
RKPF Overseas 6.7% 30/09/24-RegS	美元 6,600,000	6,637,858	0.2	
RKPF Overseas 7.75% 18/04/21-RegS	美元 3,100,000	3,335,415	0.1	
RongXingDa Development 8% 4/22-RegS	美元 21,300,000	20,392,383	0.6	
SDSC Intl Finance 3.625% 11/19-RegS	美元 8,600,000	8,726,390	0.3	
Sino-Ocean Land 5.25% 30/04/22- RegS	美元 3,800,000	4,043,754	0.1	
Sino-Ocean Land 6% 30/07/24-RegS	美元 3,800,000	4,099,883	0.1	
Sino-Ocean Land VRN 4.9% Perp-RegS	美元 9,100,000	7,803,351	0.2	
Sinopec Grp 2018 3.68% 8/8/49- RegS	美元 19,600,000	21,344,748	0.7	
Skyland Mining 3.25% 06/07/20-RegS	美元 10,600,000	10,661,730	0.3	
Spic 2018 Usd Bd VRN 5.8% Perp- RegS	美元 10,000,000	10,815,444	0.3	
Tianqi Finco 3.75% 28/11/22-RegS	美元 1,500,000	1,173,319	0.0	
UHI Capital Ltd 3% 12/06/24-RegS	美元 12,500,000	12,782,292	0.4	
Xingsheng BVI 3.375% 25/07/22- RegS	美元 10,800,000	10,934,865	0.3	
Xingsheng BVI 4.5% 20/09/21-RegS	美元 3,167,000	3,252,747	0.1	
Yuxiu REIT MTN 4.75% 27/04/21- RegS	美元 10,600,000	11,072,436	0.3	
		<u>3,228,290,015</u>	<u>97.4</u>	
(II) 衍生性产品 (-0.2%)				
远期外汇合约 (-0.2%)		(6,997,715)	(0.2)	
		<u>3,221,292,300</u>	<u>97.2</u>	
其他净资产		<u>93,192,181</u>	<u>2.8</u>	
截至二零一九年九月三十日可赎回 份额持有人应占净资产				
		<u>3,314,484,481</u>	<u>100.0</u>	
总投资, 按成本				
		<u>3,165,998,673</u>		
上市投资				
可换股				
中国				
			-	2.3
日本				
			-	0.8
新加坡				
			-	0.8
台湾				
			-	0.7
香港				
			-	0.2
债务证券				
维京群岛			16.6	19.0
开曼群岛			11.2	13.6
香港			10.8	11.0
印度尼西亚			9.0	4.3
中国			7.8	9.2
印度			7.2	5.6
新加坡			6.0	6.9
韩国			5.1	4.9
泰国			4.1	6.2
美国			3.8	-
马来西亚			2.6	2.9
百慕大			2.0	1.2
菲律宾			2.0	-
荷兰			1.6	2.7
毛里求斯			1.4	0.5
斯里兰卡			1.0	-
秘鲁			0.9	-
国际			0.9	0.3
蒙古			0.6	-
哥伦比亚			0.6	-
澳大利亚			0.5	-
巴哈马群岛			0.5	-
智利			0.5	-
英国			0.4	-
卢森堡			0.3	-
英属泽西岛			-	0.6
货币市场				
新加坡			-	0.7
衍生性产品				
远期外汇合约			(0.2)	(0.1)
期货			-	0.0
总上市投资				
			<u>97.2</u>	<u>94.3</u>
其他净资产				
			<u>2.8</u>	<u>5.7</u>
截至九月三十日可赎回份额持有人应 占净资产				
			<u>100.0</u>	<u>100.0</u>

财务状况表

截至二零一九年九月三十日

综合收益表

截至二零一九年九月三十日止年度

	2019 美元	2018 美元		2019 美元	2018 美元
资产			收入		
银行现金	146,274,407	86,723,773	投资及衍生性产品净收益/ (亏损) [附注 5]	155,941,064	(4,765,168)
短期存款	5,740,235	-	存款利息	2,757,073	2,480,312
应收经纪款项	-	1,759,000	汇兑净亏损	(8,219,273)	(3,757,236)
分配应收款项	30,596,837	64,118,605	其他收入 [附注 13]	53,950	195,321
保证金	4,313,846	88,341			
衍生性产品 [附注 4(i)(a)]	12,695,707	9,032,571			
投资 [附注 4(i)(a)]	3,228,290,015	2,118,044,015		150,532,814	(5,846,771)
利息和其他应收款项	11,958	31,599			
总资产	<u>3,427,923,005</u>	<u>2,279,797,904</u>	支出		
			管理费用 [附注 8(e)]	25,825,064	31,541,278
负债			交易成本	1,420,368	295,504
透支经纪款项	475,689	1,989,520	受托人费用 [附注 9]	666,179	807,884
应付经纪款项	54,534,239	-	托管费用及银行费用	655,182	737,208
赎回应付款项	26,226,963	14,621,917	基金注册登记机构费用 [附注 8(h)]	403,948	444,204
应付收益分配 [附注 6]	8,627,256	5,897,872	核数师酬金	28,104	35,100
衍生性产品 [附注 4(i)(a)]	19,693,422	10,683,069	法律及专业费用	27,702	46,855
其他应付款项	3,880,955	2,733,991	估值费用 [附注 8(e)]	17,220	17,150
			印刷及出版支出	12,134	25,214
总负债 (不含可赎回份额 持有人应占净资产)	<u>113,438,524</u>	<u>35,926,369</u>	其他经营费用	19,776	20,341
				29,075,677	33,970,738
可赎回份额持有人应占净 资产 [附注 3]	<u>3,314,484,481</u>	<u>2,243,871,535</u>	净经营利润 / (亏损)	<u>121,457,137</u>	<u>(39,817,509)</u>
由受托人及管理人于二零二零年一月二十二日批准			财务成本		
签署人:			收益分配 [附注 6]	(82,555,833)	(97,008,580)
汇丰机构信托服务 (亚洲) 有限公司, 受托人			利息支出	(545)	(42)
				(82,556,378)	(97,008,622)
摩根基金 (亚洲) 有限公司, 管理人			除税前利润 / (亏损)	<u>38,900,759</u>	<u>(136,826,131)</u>
			所得税 [附注 7]	(2,164,013)	(2,329,484)
			可赎回份额持有人应占净资产 及总综合收益之增加 / (减少)	<u>36,736,746</u>	<u>(139,155,615)</u>

可赎回份额持有人应占净资产变动表
截至二零一九年九月三十日止年度

现金流量表
截至二零一九年九月三十日止年度

	2019 美元	2018 美元		2019 美元	2018 美元
年初可赎回份额持有人应占净资产	2,243,871,535	3,809,838,031	经营业务		
分配可赎回份额(附注 3)	2,720,323,366	1,183,054,328	购入投资及衍生性产品	(4,680,295,086)	(1,859,809,672)
赎回可赎回份额(附注 3)	(1,686,447,166)	(2,609,865,209)	出售投资及衍生性产品		
净分配 / (赎回)	1,033,876,200	(1,426,810,881)	所得款项	3,787,630,606	3,294,988,034
	3,277,747,735	2,383,027,150	已收利息	2,780,389	2,479,998
可赎回份额持有人应占净资产及 总综合收益之增加 / (减少)	36,736,746	(139,155,615)	已付基金注册登记机构 费用	(362,304)	(502,781)
			已付受托人费用	(638,275)	(839,036)
年末可赎回份额持有人应占 净资产	3,314,484,481	2,243,871,535	已付交易费用	(1,419,672)	(295,134)
			透支经纪款项之 (减少) / 增加	(1,513,831)	1,989,520
			已付税项	(2,196,005)	(3,366,769)
			保证金之(增加) / 减少	(4,225,505)	1,765,477
			已付管理费用	(24,722,346)	(32,792,777)
			其他	(7,367,439)	(3,863,865)
			经营业务所(运用) / 产生之现金净额	(932,329,468)	1,399,752,995
			融资活动		
			已付利息	(545)	(42)
			分配可赎回份额所得款 项	2,753,845,134	1,224,310,799
			赎回可赎回份额付款	(1,674,842,120)	(2,623,626,331)
			已付收益分配	(79,826,449)	(101,061,123)
			融资活动所产生 / (运 用) 之现金净额	999,176,020	(1,500,376,697)
			现金及现金等价物之增 加 / (减少)	66,846,552	(100,623,702)
			年初现金及现金等价物	86,723,773	187,823,385
			现金及现金等价物之汇 兑亏损	(1,555,683)	(475,910)
			年末现金及现金等价物	152,014,642	86,723,773
			现金及现金等价物余额分析:		
			银行现金	146,274,407	86,723,773
			短期存款	5,740,235	-
				152,014,642	86,723,773

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。

投资管理人已通过特别决议将其名称由 JF 资产管理有限公司更改为「摩根资产管理（亚太）有限公司」，更名自二零一九年七月三十日生效。

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。

于二零一八年十月一日生效的新准则及对现有准则的修订

没有于二零一八年十月一日开始的财政年度首次生效的新准则或对现有准则的修订对本基金产生重大影响。

于二零一八年十月一日后生效且本基金并未提早采纳之新准则、对准则之修订和解释

若干新准则、准则修订及解释在二零一八年十月一日开始的年度期间生效，但在编制此等财务报表时并未提前采纳。此等新准则、准则修订及解释预期不会对本基金的财务报表产生重大影响。

(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计量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。

公平值估计

公平值指在计量日期，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平值，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平值计算。

债务证券的公平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平值而计算，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。

公平值级次分层间的转拨

在公平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帐。

(d) 收入及支出

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

投资利息收入乃作为投资及衍生性产品净收益/亏损的一部分，在综合收益表确认。

银行现金及短期存款利息收入乃按实际利息法在综合收益表确认。

支出乃按应计基准在综合收益表确认。

(e) 外币交易

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

与现金及现金等价物有关的汇兑盈亏在综合收益表内的“汇兑净收益/亏损”中呈列。与按公平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。

(k) 作为抵押品的投资

如果获得抵押品的一方依照合同或惯例有权将抵押品出售或再抵押，则本基金在财务状况表中将该资产与其他资产分开列账，并将该资产确认为抵押品。如果获得抵押品的一方无权将抵押品出售或再抵押，则在财务报表附注中披露该抵押品。

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）

2019

	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	17,580,647.496	12,695,714.683	300,644.718	257,092,549.814	6,565,515.412
总分配	24,150,973.006	10,631,997.339	336,987.575	372,732,455.961	9,235,073.470
总赎回	(18,611,333.771)	(8,088,131.005)	(239,712.888)	(216,720,795.405)	(5,792,282.768)
年末	<u>23,120,286.731</u>	<u>15,239,581.017</u>	<u>397,919.405</u>	<u>413,104,210.370</u>	<u>10,008,306.114</u>
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净资产	<u>205,855,872</u>	<u>136,297,063</u>	<u>3,723,282</u>	<u>3,941,035,656</u>	<u>88,379,459</u>
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	<u>8.90</u>	<u>8.94</u>	<u>9.36</u>	<u>9.54</u>	<u>8.83</u>

	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲份额 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	1,548,174.875	367,391,808.423	164,902.144	35,352,688.820	149,386,313.190
总分配	6,412,654.200	221,508,028.376	158,292.747	61,844,281.163	444,483,363.510
总赎回	(462,442.935)	(171,581,959.422)	(114,284.626)	(45,890,045.396)	(137,926,159.850)
年末	<u>7,498,386.140</u>	<u>417,317,877.377</u>	<u>208,910.265</u>	<u>51,306,924.587</u>	<u>455,943,516.850</u>
	人民币	人民币	美元	美元	人民币
可赎回份额持有人应占净资产	<u>98,885,725</u>	<u>3,811,348,133</u>	<u>2,707,081</u>	<u>557,035,318</u>	<u>5,711,865,861</u>
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	<u>13.19</u>	<u>9.13</u>	<u>12.96</u>	<u>10.86</u>	<u>12.53</u>

2019

	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	64,003,808.890	46,224,922.560	2,361,982.720
总分配	55,599,036.900	10,951,952.000	2,411,716.130
总赎回	(30,054,639.040)	(19,098,764.670)	(903,820.750)
年末	<u>89,548,206.750</u>	<u>38,078,109.890</u>	<u>3,869,878.100</u>
	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应占净 资产	<u>883,011,937</u>	<u>440,896,043</u>	<u>38,278,097</u>
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	<u>9.86</u>	<u>11.58</u>	<u>9.89</u>

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	<u>17,580,647.496</u>	<u>12,695,714.683</u>	<u>300,644.718</u>	<u>257,092,549.814</u>	<u>6,565,515.412</u>
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净 资产	<u>151,437,984</u>	<u>109,956,213</u>	<u>2,722,720</u>	<u>2,370,395,595</u>	<u>56,146,414</u>
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	<u>8.61</u>	<u>8.66</u>	<u>9.06</u>	<u>9.22</u>	<u>8.55</u>

2018

	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	<u>1,548,174.875</u>	<u>367,391,808.423</u>	<u>164,902.144</u>	<u>35,352,688.820</u>	<u>149,386,313.190</u>
	人民币	人民币	美元	美元	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	<u>18,776,312</u>	<u>3,249,538,350</u>	<u>1,974,794</u>	<u>371,634,095</u>	<u>1,721,353,017</u>
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	<u>12.13</u>	<u>8.84</u>	<u>11.98</u>	<u>10.51</u>	<u>11.52</u>
	PRC 人民币对冲份额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额		
已发行份额数目:					
年初	94,155,390.680	59,066,119.270	2,915,664.600		
总分配	23,444,420.230	11,051,185.390	612,415.770		
总赎回	(53,596,002.020)	(23,892,382.100)	(1,166,097.650)		
年末	<u>64,003,808.890</u>	<u>46,224,922.560</u>	<u>2,361,982.720</u>		
	人民币	美元	美元		
可赎回份额持有人应占净 资产	<u>611,206,738</u>	<u>494,672,657</u>	<u>22,623,212</u>		
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	<u>9.55</u>	<u>10.70</u>	<u>9.58</u>		

4 财务风险管理

(i) 财务风险因素

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

(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
<u>2019</u>				
银行现金	146,274,407	-	-	146,274,407
短期存款	5,740,235	-	-	5,740,235
保证金	4,313,846	-	-	4,313,846
投资（注*）	148,419,414	1,315,186,699	1,764,683,902	3,228,290,015
总利率敏感性缺口	<u>304,747,902</u>	<u>1,315,186,699</u>	<u>1,764,683,902</u>	<u>3,384,618,503</u>
<u>2018</u>				
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	<u>320,623,349</u>	<u>1,008,131,710</u>	<u>877,101,852</u>	<u>2,205,856,911</u>

注：

* 投资的票面息率范围介乎年率 0.00% - 13.50%（二零一八年：年率 0.00% - 10.22%）。

截至九月三十日，本基金投资及衍生性产品的公允价值如下：

	2019		2018	
	投资之公允价值 美元	占资产净值 百分比	投资之公允价值 美元	占资产净值 百分比
上市投资				
<u>资产</u>				
可换股	-	-	108,175,780	4.8
债务证券				
- 维京群岛	549,712,342	16.6	426,678,840	19.0
- 开曼群岛	370,415,622	11.2	304,219,280	13.6
- 香港	356,883,924	10.8	247,383,575	11.0
- 印度尼西亚	296,694,323	9.0	96,707,171	4.3
- 中国	257,498,293	7.8	207,405,358	9.2
- 印度	239,077,938	7.2	126,724,771	5.6
- 新加坡	199,379,626	6.0	155,344,724	6.9
- 韩国	167,666,428	5.1	109,374,138	4.9
- 泰国	135,386,824	4.1	139,019,318	6.2
- 其他	655,574,695	19.6	180,922,971	8.2
	3,228,290,015	97.4	1,993,780,146	88.9
货币市场	-	-	16,088,089	0.7
衍生性产品				
- 远期外汇合约	12,695,707	0.4	8,031,789	0.4
- 期货	-	-	1,000,782	0.0
	12,695,707	0.4	9,032,571	0.4
	3,240,985,722	97.8	2,127,076,586	94.8
<u>负债</u>				
衍生性产品				
- 远期外汇合约	(19,693,422)	(0.6)	(10,683,069)	(0.5)
	(19,693,422)	(0.6)	(10,683,069)	(0.5)
总上市投资	3,221,292,300	97.2	2,116,393,517	94.3

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。修正久期计量与利率变动相关的债券和可换股价格的敏感度。于二零一九年九月三十日，投资管理人估计本基金的修正久期为 4.19（二零一八年： 2.83）。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 34,719,225 美元（二零一八年： 15,875,391 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，投资管理人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 ¹ ）	美元 等值	与美元比较之合 理变动百分比 （注 ² ）	估计对资产 净值的影响 美元
2019			
澳元	155,980,919	-6.8	(10,606,702)
巴西雷亚尔	15,368,343	-4.1	(630,102)
加元	103,227,923	-2.4	(2,477,470)
智利比索	16,036,450	-9.4	(1,507,426)
人民币（离岸）	1,464,720,488	-3.7	(54,194,658)
人民币（在岸）	42,748,943	-3.6	(1,538,962)
哥伦比亚比索	3,304,996	-14.6	(482,529)
港元	5,006,690	-0.2	(10,013)
印度卢比	(6,495,629)	+2.3	(149,399)
印尼盾	33,697,564	+5.0	1,684,878
韩元	38,123,815	-7.3	(2,783,038)
马来西亚林吉特	34,653,659	-1.2	(415,844)
墨西哥新比索	(3,304)	-5.3	175
纽元	55,549,721	-5.4	(2,999,685)
秘鲁新索尔	30,906,983	-2.5	(772,675)
菲律宾比索	17,114,942	+4.2	718,828
新加坡元	24,839,499	-1.2	(298,074)
英镑	4,686,162	-5.5	(257,739)
泰铢	56,796,336	+5.7	3,237,391
	<u>2,096,264,500</u>		<u>(73,483,044)</u>
2018			
澳元	109,806,052	-7.8	(8,564,872)
加元	85,280,810	-3.2	(2,728,986)
人民币（离岸）	723,239,194	-3.3	(23,866,893)
人民币（在岸）	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
马来西亚林吉特	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>

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

注：

* 资产及负债汇兑风险承担净值包括货币及非货币资产及负债。

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

(b) 信贷风险

信贷风险指交易对手无法于到期日支付全数金额的风险。

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，未对十二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：

	2019 美元	2018 美元
银行现金	146,274,407	86,723,773
短期存款	5,740,235	-
应收经纪款项	-	1,759,000
分配应收款项	30,596,837	64,118,605
保证金	4,313,846	88,341
经纪发行的衍生性产品	12,695,707	8,031,789
投资 - 债务证券	3,228,290,015	1,993,780,146
投资 - 货币市场	-	16,088,089
利息及其他应收款项	11,958	31,599
	<u>3,427,923,005</u>	<u>2,170,621,342</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及货币市场，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用评级的债务证券及货币市场。

	2019 占资产净值百分比	2018 占资产净值百分比
标准普尔(AAA)/穆迪(Aaa)/惠誉(AAA)	5.5	2.0
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	0.9	1.4
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	17.1	14.8
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	31.6	29.7
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	17.0	17.2
标准普尔(B)/穆迪(B)/惠誉(B)	8.9	6.1
未评级	16.4	18.4
	<u>97.4</u>	<u>89.6</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。

	2019 占资产净值百分比	2018 占资产净值百分比
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	0.6	1.1
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	2.8	4.3
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	7.7	5.1
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	0.5	0.5
未评级	4.8	7.4
	<u>16.4</u>	<u>18.4</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。

	2019 交易对手风险承担 美元	2018 交易对手风险承担 美元
银行结余及短期存款		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	18,125,320	14,439,103
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	133,889,322	72,284,670
存放经纪处的保证金及经纪持有/发行的衍生性产品		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	6,953,589	6,649,185
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	10,055,964	2,470,000
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>3,228,290,015</u>	<u>2,118,044,015</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。

	2019		2018	
	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	475,689	-	1,989,520	-
应付经纪款项	54,534,239	-	-	-
赎回应付款项	26,226,963	-	14,621,917	-
应付收益分配	8,627,256	-	5,897,872	-
衍生性产品	8,379,924	11,313,498	6,929,140	3,753,929
其他应付款项	3,880,955	-	2,733,991	-
可赎回份额持有人应占净资产	3,314,484,481	-	2,243,871,535	-
总金融负债	3,416,609,507	11,313,498	2,276,043,975	3,753,929

投资管理通过投资于预期一般在一个月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

截至二零一九年及二零一八年九月三十日，本基金受制于与若干衍生品交易对手的总净额结算协议。

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

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

	财务状况表中列示的经确认金融资产总额 美元	受总抵销安排及类似协议规限的相 关金额		净额 美元
		金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	
<u>2019</u>				
<u>资产</u>				
保证金	4,313,846	-	(1,445,536)	2,868,310
衍生性产品	11,685,436	(8,251,789)	(475,689)	2,957,958
按公允价值透过损益列账的金融资产	<u>15,999,282</u>	<u>(8,251,789)</u>	<u>(1,921,225)</u>	<u>5,826,268</u>

	财务状况表中列示的经确认金融 负债总额 美元	受总抵销安排及类似协议规限的相 关金额		净额 美元
		金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	
<u>2019</u>				
<u>负债</u>				
透支经纪款项	475,689	-	(475,689)	-
衍生性产品	15,287,964	(8,251,789)	(1,445,536)	5,590,639
按公允价值透过损益列账的金融负债	<u>15,763,653</u>	<u>(8,251,789)</u>	<u>(1,921,225)</u>	<u>5,590,639</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		
	资产总额	金融工具	抵押品及保证金	
	美元	美元	美元	美元
<u>2018</u>				
<u>资产</u>				
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	<u>1,592,673</u>	<u>(406,722)</u>	<u>-</u>	<u>1,185,951</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
<u>2018</u>				
<u>负债</u>				
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	<u>2,801,694</u>	<u>(406,722)</u>	<u>-</u>	<u>2,394,972</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

截至二零一九年及二零一八年九月三十日，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）按公允价值次计量之公平值：

上市投资	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总额 美元
2019				
资产				
债务证券	-	3,228,290,015	-	3,228,290,015
衍生性产品	-	12,695,707	-	12,695,707
按公允价值透过损益列账的总金融资产	-	3,240,985,722	-	3,240,985,722
负债				
衍生性产品	-	19,693,422	-	19,693,422
按公允价值透过损益列账的总金融负债	-	19,693,422	-	19,693,422
2018				
资产				
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
按公允价值透过损益列账的总金融资产	17,088,871	2,109,987,715	-	2,127,076,586
负债				
衍生性产品	-	10,683,069	-	10,683,069
按公允价值透过损益列账的总金融负债	-	10,683,069	-	10,683,069

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。

截至二零一九年及二零一八年九月三十日止年度，公允价值层次之间并无转移。

截至二零一九年及二零一八年九月三十日，以摊余成本计量的资产和负债，其账面价值为其公允值的合理约数。

5 投资及衍生性产品净收益/（亏损）

	2019 美元	2018 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益/亏损之变动	151,041,542	(129,326,332)
投资及衍生性产品销售之实现收益	4,899,522	124,561,164
	<u>155,941,064</u>	<u>(4,765,168)</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。

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2019 美元	2018 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 0.0288	16,889,031.696	(344,739)	
加元对冲类别 (每月派息)	2018 年 10 月 31 日	2018 年 11 月 8 日	加元 0.0252	12,483,470.662	(239,546)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2018 年 10 月 31 日	2018 年 11 月 8 日	英镑 0.0197	292,080.964	(7,352)	
港元类别 (每月派息)	2018 年 10 月 31 日	2018 年 11 月 8 日	港元 0.0329	249,725,510.368	(1,048,035)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2018 年 10 月 31 日	2018 年 11 月 8 日	纽元 0.0286	6,653,163.099	(124,253)	
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 0.0477	353,104,838.596	(2,414,885)	
美元类别 (每月派息)	2018 年 10 月 31 日	2018 年 11 月 8 日	美元 0.0375	35,569,006.304	(1,333,838)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2018 年 10 月 31 日	2018 年 11 月 8 日	人民币 0.0515	60,478,149.270	(446,560)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2018 年 10 月 31 日	2018 年 11 月 8 日	美元 0.0342	2,321,306.500	(79,389)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2018 年 11 月 30 日	2018 年 12 月 10 日	澳元 0.0276	16,130,569.003	(325,110)	
加元对冲类别 (每月派息)	2018 年 11 月 30 日	2018 年 12 月 10 日	加元 0.0263	12,404,668.779	(245,461)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2018 年 11 月 30 日	2018 年 12 月 10 日	英镑 0.0206	333,505.573	(8,766)	
港元类别 (每月派息)	2018 年 11 月 30 日	2018 年 12 月 10 日	港元 0.0329	241,329,106.744	(1,014,564)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2018 年 11 月 30 日	2018 年 12 月 10 日	纽元 0.0276	6,518,104.854	(123,573)	
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 0.0402	346,752,378.390	(2,003,989)	
美元类别 (每月派息)	2018 年 11 月 30 日	2018 年 12 月 10 日	美元 0.0375	34,767,451.891	(1,303,779)	
PRC 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 0.0434	60,256,379.640	(375,961)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2018 年 11 月 30 日	2018 年 12 月 10 日	美元 0.0342	2,255,471.140	(77,137)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2018 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 9 日	澳元 0.0264	16,343,174.862	(303,748)	
加元对冲类别 (每月派息)	2018 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 9 日	加元 0.0240	12,124,130.331	(213,047)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2018 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 9 日	英镑 0.0160	333,601.914	(6,798)	
港元类别 (每月派息)	2018 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 9 日	港元 0.0329	236,696,065.084	(994,629)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2018 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 9 日	纽元 0.0267	6,248,544.125	(111,872)	
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 0.0368	343,758,311.657	(1,841,290)	
美元类别 (每月派息)	2018 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 9 日	美元 0.0375	34,614,870.306	(1,298,058)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2018 年 12 月 28 日	2019 年 1 月 9 日	人民币 0.0397	60,367,293.190	(348,118)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2018 年 12 月 28 日	2019 年 1 月 9 日	美元 0.0342	2,256,633.970	(77,177)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019 年 1 月 31 日	2019 年 2 月 13 日	澳元 0.0294	18,084,609.193	(387,680)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019 年 1 月 31 日	2019 年 2 月 13 日	加元 0.0266	13,656,780.922	(276,609)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019 年 1 月 31 日	2019 年 2 月 13 日	英镑 0.0207	336,405.861	(9,160)	
港元类别 (每月派息)	2019 年 1 月 31 日	2019 年 2 月 13 日	港元 0.0360	252,730,751.965	(1,159,507)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019 年 1 月 31 日	2019 年 2 月 13 日	纽元 0.0283	7,873,544.756	(154,549)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019 年 1 月 31 日	2019 年 2 月 13 日	人民币 0.0364	352,009,002.308	(1,910,184)	
美元类别 (每月派息)	2019 年 1 月 31 日	2019 年 2 月 13 日	美元 0.0410	32,707,081.125	(1,340,990)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019 年 1 月 31 日	2019 年 2 月 13 日	人民币 0.0393	57,921,452.990	(339,353)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019 年 1 月 31 日	2019 年 2 月 13 日	美元 0.0374	2,175,734.200	(81,372)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019 年 2 月 28 日	2019 年 3 月 8 日	澳元 0.0296	18,435,959.736	(388,241)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019 年 2 月 28 日	2019 年 3 月 8 日	加元 0.0279	13,399,614.654	(283,864)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019 年 2 月 28 日	2019 年 3 月 8 日	英镑 0.0221	399,423.502	(11,741)	
港元类别 (每月派息)	2019 年 2 月 28 日	2019 年 3 月 8 日	港元 0.0361	265,048,758.313	(1,218,919)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019 年 2 月 28 日	2019 年 3 月 8 日	纽元 0.0282	8,312,173.170	(159,746)	
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 0.0307	358,643,391.281	(1,644,514)	
美元类别 (每月派息)	2019 年 2 月 28 日	2019 年 3 月 8 日	美元 0.0410	36,296,804.387	(1,488,169)	
PRC 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 0.0332	57,914,818.080	(287,187)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019 年 2 月 28 日	2019 年 3 月 8 日	美元 0.0373	2,122,205.210	(79,158)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019 年 3 月 29 日	2019 年 4 月 9 日	澳元 0.0294	18,590,791.725	(388,255)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019 年 3 月 29 日	2019 年 4 月 9 日	加元 0.0272	14,709,595.221	(299,488)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019 年 3 月 29 日	2019 年 4 月 9 日	英镑 0.0209	386,848.898	(10,535)	
港元类别 (每月派息)	2019 年 3 月 29 日	2019 年 4 月 9 日	港元 0.0361	295,925,507.373	(1,360,889)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019 年 3 月 29 日	2019 年 4 月 9 日	纽元 0.0284	8,160,355.325	(158,056)	
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 0.0337	378,955,848.238	(1,900,236)	
美元类别 (每月派息)	2019 年 3 月 29 日	2019 年 4 月 9 日	美元 0.0410	40,462,587.596	(1,658,966)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019 年 3 月 29 日	2019 年 4 月 9 日	人民币 0.0364	74,988,043.400	(406,146)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019 年 3 月 29 日	2019 年 4 月 9 日	美元 0.0374	3,063,229.310	(114,565)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2019 美元	2018 美元
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	美元 0.0304	21,632,986.140	(462,882)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	美元 0.0295	14,755,279.359	(323,581)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	美元 0.0232	397,769.156	(12,030)	
港元类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	美元 0.0387	333,417,206.540	(1,644,689)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	美元 0.0310	8,215,097.799	(169,838)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	美元 0.0370	397,291,952.276	(2,180,575)	
美元类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	美元 0.0440	43,967,550.930	(1,934,572)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	美元 0.0399	87,530,324.630	(518,073)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	美元 0.0401	3,977,704.090	(159,506)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	美元 0.0297	22,083,342.702	(454,423)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	美元 0.0295	14,908,632.710	(325,323)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	美元 0.0230	344,119.981	(9,976)	
港元类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	美元 0.0387	356,394,932.373	(1,759,122)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	美元 0.0301	8,956,757.114	(175,738)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	美元 0.0384	412,569,399.958	(2,285,060)	
美元类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	美元 0.0440	46,858,134.984	(2,061,758)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	美元 0.0415	86,562,875.240	(518,142)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	美元 0.0401	3,869,387.310	(155,162)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	美元 0.0285	22,616,626.825	(452,330)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	美元 0.0296	15,065,832.364	(341,265)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	美元 0.0237	355,679.295	(10,728)	
港元类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	美元 0.0386	383,919,558.812	(1,896,870)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	美元 0.0304	9,236,214.876	(188,587)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	美元 0.0398	422,589,511.182	(2,447,121)	
美元类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	美元 0.0440	48,007,926.745	(2,112,349)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	美元 0.0429	86,605,119.740	(540,573)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	美元 0.0401	3,876,990.750	(155,467)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	美元 0.0265	23,425,438.979	(427,869)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	美元 0.0298	15,220,537.807	(345,408)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	美元 0.0232	394,614.655	(11,210)	
港元类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	美元 0.0385	396,296,669.801	(1,949,108)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	美元 0.0298	10,320,494.658	(202,983)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	美元 0.0366	420,135,949.653	(2,231,328)	
美元类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	美元 0.0440	50,858,857.243	(2,237,790)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	美元 0.0396	86,534,569.010	(497,253)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	美元 0.0401	3,869,288.150	(155,158)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	美元 0.0266	22,833,387.401	(409,214)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	美元 0.0310	15,277,414.370	(356,412)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	美元 0.0244	389,022.597	(11,560)	
港元类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	美元 0.0387	413,767,090.767	(2,043,659)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	美元 0.0287	9,582,626.904	(173,456)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	美元 0.0419	422,433,254.009	(2,473,097)	
美元类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	美元 0.0440	49,314,230.558	(2,169,827)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	美元 0.0452	87,599,260.880	(553,233)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	美元 0.0401	3,853,332.630	(154,519)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元 0.0273	23,113,196.253	(425,571)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元 0.0318	15,272,642.206	(366,820)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元 0.0254	397,919.405	(12,455)	
港元类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元 0.0386	412,695,392.568	(2,032,049)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元 0.0282	9,998,300.635	(176,798)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元 0.0447	417,381,906.329	(2,612,582)	
美元类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元 0.0440	50,893,109.617	(2,239,297)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元 0.0484	89,496,073.470	(606,566)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元 0.0401	3,868,269.210	(155,118)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	澳元 0.0322	24,755,622.642		(611,200)
加元对冲类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	加元 0.0266	14,782,001.708		(305,020)
英镑对冲类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	英镑 0.0205	432,405.388		(11,771)
港元类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	港元 0.0306	476,050,289.033		(1,867,151)
纽元对冲类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	纽元 0.0341	9,078,665.348		(212,080)
人民币对冲类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	人民币 0.0465	509,925,409.445		(3,575,510)
美元类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	美元 0.0350	73,596,230.640		(2,575,868)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	人民币 0.0503	97,164,332.930		(736,976)
PRC 美元份额 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	美元 0.0319	2,886,332.790		(92,074)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2019 美元	2018 美元
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		(1,792,442)
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)
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)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2019 美元	2018 美元
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		(1,320,201)
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)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	澳元 0.0302	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)
可赎回份额持有人之总收益分配					(82,555,833)	(97,008,580)

7 税项

截至二零一九年及二零一八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。

中国税项

本基金持有若干中国证券之投资。根据中华人民共和国税法，海外投资者从中国获得的股息和利息应缴付百分之十的企业所得税，但政府债券利息根据规定获豁免缴纳所得税，而海外机构投资者于二零一八年十一月七日至二零二一年十一月六日期间从中国本地债券市场中买卖债券所得的债券利息亦暂时获豁免缴纳所得税。在中国支付相关款项的单位有责任在支付该等款项时预扣此税项。若源自中国的股息和利息未获得特别税项豁免且支付单位未预扣税项，则全额计提百分之十的中国税项拨备。之前针对于免税期间获得之债券利息收入所计提的 162,397 美元中国税项拨备已于本年度转回。

根据中华人民共和国税法，海外投资者出售中国证券所实现的收益通常需缴纳百分之十的企业所得税。但目前，出售中国 A 股（包括在沪港通/深港通机制下买卖的股份）所得收益获暂时豁免缴纳企业所得税，此豁免自二零一四年十一月十七日起生效。若出售部分中国证券所得收益目前未经明确规定获豁免缴纳企业所得税，则全额计提百分之十的中国税项拨备。

香港税项

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。

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
<u>2019</u>					
于本年度内，管理人及其关联人士之间无投资交易。					
<u>2018</u>					
J.P. Morgan Securities plc London	114,718,750*	2.36	2,100	2.75	0.00

* 上述金额包含于二零一八年总计 114,718,750 美元的期货交易。

(b) 与管理人及其关联人士之年末结余：

	2019 美元	2018 美元
银行现金	8,537,062	10,875,147
保证金	-	260
应收款项	7,890	31,590
应付款项	(2,934,456)	(1,795,867)
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 177,986 美元（二零一八年：241,049 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 4,887 美元（二零一八年：4,681 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零一至百分之零点五不等。基金注册登记机构费用于每季季末支付。

9 受托人费用

受托人费用按本基金资产净值的首 4,000 万美元，以本基金资产净值的年率百分之零二零六计算；资产净值介乎 4,000 万美元至 7,000 万美元，按年率百分之零二零四计算；超过 7,000 万美元时，按年率百分之零二零二五计算。受托人费用于每个交易日累计，并于每月月底支付。

10 借款

截至二零一九年九月三十日止年度，本基金从不同的金融机构借入无抵押短期借款，香港上海汇丰银行有限公司（受托人的关联人）为其中之一。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。

11 非金钱收益／佣金共享安排

投资管理人与经纪签署了非金钱收益／佣金共享安排，从而收取若干产品和服务以协助作出投资决策。由基金支付的部分交易佣金会由经纪保留，作为产品和服务的补偿。

该等产品和服务必须对本基金具有明显的利益，并仅限于研究和咨询服务。

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
<u>2019</u>			
未平仓合约：			
澳元 427,566	美元 290,535	2019 年 10 月 2 日	2,142
纽元 328,253	美元 207,594	2019 年 10 月 2 日	1,746
美元 1,101	加元 1,460	2019 年 10 月 2 日	2
澳元 769,671	美元 520,127	2019 年 10 月 3 日	984
澳元 31,910	美元 21,616	2019 年 10 月 4 日	93
加元 249,680	美元 188,678	2019 年 10 月 4 日	98
纽元 132,898	美元 83,843	2019 年 10 月 4 日	502
澳元 64,838	美元 43,741	2019 年 10 月 8 日	1
离岸人民币 23,250,635	美元 3,267,818	2019 年 10 月 8 日	11,974
离岸人民币 6,724,191	美元 945,068	2019 年 10 月 8 日	3,463
离岸人民币 4,350,741	美元 610,300	2019 年 10 月 8 日	1,055
离岸人民币 705,500	美元 99,156	2019 年 10 月 8 日	363
美元 223,805	加元 296,321	2019 年 10 月 8 日	19
离岸人民币 11,251,010	美元 1,578,146	2019 年 10 月 9 日	2,639
离岸人民币 8,217,932	美元 1,152,705	2019 年 10 月 9 日	1,927
离岸人民币 10,704	美元 1,504	2019 年 10 月 9 日	5
离岸人民币 7,035,279	美元 986,366	2019 年 10 月 10 日	1,227
离岸人民币 1,100,300	美元 154,319	2019 年 10 月 10 日	246
离岸人民币 11,228,901	美元 1,578,001	2019 年 10 月 11 日	5,679
离岸人民币 3,731,500	美元 524,389	2019 年 10 月 11 日	1,887
澳元 1,156,568	美元 795,811	2019 年 10 月 21 日	15,243
澳元 886,114	美元 608,410	2019 年 10 月 21 日	10,371
澳元 618,359	美元 425,514	2019 年 10 月 21 日	8,184
澳元 572,268	美元 394,407	2019 年 10 月 21 日	8,184
澳元 621,195	美元 423,838	2019 年 10 月 21 日	4,593
澳元 305,709	美元 209,866	2019 年 10 月 21 日	3,543
澳元 262,178	美元 180,450	2019 年 10 月 21 日	3,506

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
澳元 238,750	美元 163,963	2019年10月21日	2,831
澳元 422,363	美元 287,163	2019年10月21日	2,110
澳元 141,686	美元 97,256	2019年10月21日	1,632
澳元 124,542	美元 85,549	2019年10月21日	1,496
澳元 304,600	美元 206,519	2019年10月21日	944
澳元 577,838	美元 390,901	2019年10月21日	918
澳元 120,168	美元 81,960	2019年10月21日	859
澳元 56,868	美元 38,948	2019年10月21日	568
澳元 39,104	美元 26,617	2019年10月21日	226
澳元 144,920	美元 97,947	2019年10月21日	140
澳元 6,183	美元 4,204	2019年10月21日	32
澳元 7,772	美元 5,268	2019年10月21日	23
澳元 1,614	美元 1,108	2019年10月21日	19
澳元 1,598	美元 1,097	2019年10月21日	19
澳元 1,603	美元 1,101	2019年10月21日	18
澳元 1,608	美元 1,094	2019年10月21日	9
澳元 1,624	美元 1,104	2019年10月21日	8
澳元 2,082	美元 1,412	2019年10月21日	7
澳元 1,629	美元 1,101	2019年10月21日	2
加元 1,062,730	美元 807,406	2019年10月21日	4,558
加元 296,884	美元 225,780	2019年10月21日	1,496
加元 392,136	美元 297,288	2019年10月21日	1,046
加元 362,422	美元 274,724	2019年10月21日	930
加元 39,622	美元 30,144	2019年10月21日	211
加元 484,018	美元 365,725	2019年10月21日	70
加元 210,881	美元 159,357	2019年10月21日	45
加元 1,447	美元 1,099	2019年10月21日	6
加元 11,684	美元 8,831	2019年10月21日	5
离岸人民币 48,478,381	美元 6,860,565	2019年10月21日	74,300
离岸人民币 49,028,120	美元 6,919,310	2019年10月21日	56,087
离岸人民币 39,215,711	美元 5,529,831	2019年10月21日	40,203
离岸人民币 39,616,331	美元 5,579,048	2019年10月21日	33,339
离岸人民币 30,239,187	美元 4,264,344	2019年10月21日	31,298
离岸人民币 16,676,978	美元 2,354,511	2019年10月21日	19,977
离岸人民币 40,272,439	美元 5,653,840	2019年10月21日	16,285
离岸人民币 26,081,729	美元 3,664,368	2019年10月21日	13,306
离岸人民币 27,093,713	美元 3,804,183	2019年10月21日	11,458
离岸人民币 9,506,960	美元 1,342,294	2019年10月21日	11,458
离岸人民币 22,512,987	美元 3,162,328	2019年10月21日	10,837
离岸人民币 9,448,552	美元 1,332,627	2019年10月21日	9,967
离岸人民币 18,498,317	美元 2,599,284	2019年10月21日	9,789
离岸人民币 4,666,426	美元 662,968	2019年10月21日	9,736
离岸人民币 17,964,403	美元 2,524,222	2019年10月21日	9,467
离岸人民币 7,500,363	美元 1,057,631	2019年10月21日	7,689
离岸人民币 6,043,421	美元 853,417	2019年10月21日	7,426
离岸人民币 6,274,637	美元 884,852	2019年10月21日	6,494
离岸人民币 5,643,617	美元 796,480	2019年10月21日	6,456
离岸人民币 11,007,382	美元 1,545,537	2019年10月21日	4,664
离岸人民币 4,629,308	美元 651,931	2019年10月21日	3,896
离岸人民币 2,281,951	美元 322,937	2019年10月21日	3,497
离岸人民币 6,739,561	美元 946,933	2019年10月21日	3,493
离岸人民币 2,434,882	美元 343,633	2019年10月21日	2,785

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 5,458,251	美元 766,860	2019年10月21日	2,785
离岸人民币 2,137,552	美元 301,787	2019年10月21日	2,561
离岸人民币 4,828,220	美元 678,435	2019年10月21日	2,555
离岸人民币 13,489,892	美元 1,890,908	2019年10月21日	2,520
离岸人民币 10,330,398	美元 1,448,573	2019年10月21日	2,468
离岸人民币 1,467,395	美元 207,663	2019年10月21日	2,249
离岸人民币 4,843,769	美元 680,012	2019年10月21日	1,955
离岸人民币 3,879,951	美元 545,004	2019年10月21日	1,868
离岸人民币 1,441,573	美元 203,320	2019年10月21日	1,521
离岸人民币 2,809,386	美元 394,625	2019年10月21日	1,352
离岸人民币 5,232,459	美元 733,718	2019年10月21日	1,250
离岸人民币 3,084,518	美元 433,035	2019年10月21日	1,247
离岸人民币 5,381,263	美元 754,302	2019年10月21日	1,004
离岸人民币 716,153	美元 100,992	2019年10月21日	741
离岸人民币 1,204,217	美元 169,208	2019年10月21日	635
离岸人民币 520,989	美元 73,559	2019年10月21日	628
离岸人民币 1,456,748	美元 204,513	2019年10月21日	589
离岸人民币 793,453	美元 111,490	2019年10月21日	418
离岸人民币 769,137	美元 108,060	2019年10月21日	392
离岸人民币 324,991	美元 45,827	2019年10月21日	333
离岸人民币 130,736	美元 18,573	2019年10月21日	272
离岸人民币 490,589	美元 68,935	2019年10月21日	260
离岸人民币 600,000	美元 84,242	2019年10月21日	251
离岸人民币 169,396	美元 23,921	2019年10月21日	208
离岸人民币 217,874	美元 30,683	2019年10月21日	183
离岸人民币 121,671	美元 17,171	2019年10月21日	139
离岸人民币 78,334	美元 11,032	2019年10月21日	66
离岸人民币 127,308	美元 17,886	2019年10月21日	65
离岸人民币 30,024	美元 4,265	2019年10月21日	62
离岸人民币 257,605	美元 36,122	2019年10月21日	61
离岸人民币 107,894	美元 15,159	2019年10月21日	56
离岸人民币 69,476	美元 9,754	2019年10月21日	28
离岸人民币 35,947	美元 5,051	2019年10月21日	19
离岸人民币 7,784	美元 1,106	2019年10月21日	16
离岸人民币 7,784	美元 1,106	2019年10月21日	16
离岸人民币 7,736	美元 1,095	2019年10月21日	12
离岸人民币 7,805	美元 1,101	2019年10月21日	8
离岸人民币 7,789	美元 1,097	2019年10月21日	7
离岸人民币 7,789	美元 1,097	2019年10月21日	7
离岸人民币 12,554	美元 1,764	2019年10月21日	7
离岸人民币 7,789	美元 1,097	2019年10月21日	7
离岸人民币 7,826	美元 1,100	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,858	美元 1,104	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,828	美元 1,100	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,794	美元 1,095	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,826	美元 1,100	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,828	美元 1,099	2019年10月21日	3
离岸人民币 14,743	美元 2,067	2019年10月21日	3
离岸人民币 7,828	美元 1,099	2019年10月21日	3
离岸人民币 7,826	美元 1,097	2019年10月21日	2
离岸人民币 7,826	美元 1,097	2019年10月21日	2
纽元 1,216,366	美元 775,641	2019年10月21日	12,615
纽元 630,066	美元 404,986	2019年10月21日	9,746

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
纽元 579,278	美元 372,142	2019年10月21日	8,761
纽元 255,986	美元 164,567	2019年10月21日	3,986
纽元 312,233	美元 199,585	2019年10月21日	3,722
纽元 667,772	美元 422,494	2019年10月21日	3,601
纽元 280,943	美元 179,247	2019年10月21日	3,012
纽元 74,808	美元 48,034	2019年10月21日	1,107
纽元 85,209	美元 54,178	2019年10月21日	726
纽元 76,556	美元 48,441	2019年10月21日	418
纽元 28,359	美元 18,037	2019年10月21日	247
纽元 169,414	美元 106,467	2019年10月21日	193
纽元 36,575	美元 23,129	2019年10月21日	185
纽元 10,492	美元 6,760	2019年10月21日	179
纽元 21,205	美元 13,436	2019年10月21日	134
纽元 20,632	美元 13,021	2019年10月21日	79
纽元 26,670	美元 16,781	2019年10月21日	50
纽元 1,909	美元 1,229	2019年10月21日	31
纽元 1,712	美元 1,095	2019年10月21日	20
纽元 1,731	美元 1,104	2019年10月21日	18
纽元 1,722	美元 1,095	2019年10月21日	15
纽元 1,744	美元 1,107	2019年10月21日	14
纽元 1,750	美元 1,107	2019年10月21日	9
纽元 1,741	美元 1,100	2019年10月21日	8
纽元 1,738	美元 1,097	2019年10月21日	7
纽元 1,751	美元 1,105	2019年10月21日	6
英镑 63,522	美元 78,422	2019年10月21日	86
英镑 6,867	美元 8,543	2019年10月21日	75
英镑 6,701	美元 8,299	2019年10月21日	35
英镑 886	美元 1,107	2019年10月21日	15
英镑 5,741	美元 7,085	2019年10月21日	5
美元 3,943,005	离岸人民币 28,335,566	2019年10月21日	23,570
美元 2,341,553	离岸人民币 16,842,316	2019年10月21日	16,131
美元 1,755,109	离岸人民币 12,624,141	2019年10月21日	12,091
美元 2,972,122	离岸人民币 21,303,615	2019年10月21日	10,077
美元 4,514,046	英镑 3,665,031	2019年10月21日	5,666
美元 488,227	离岸人民币 3,508,427	2019年10月21日	2,902
美元 1,731,337	离岸人民币 12,387,619	2019年10月21日	2,750
美元 729,990	离岸人民币 5,224,499	2019年10月21日	1,364
美元 1,620,749	离岸人民币 11,587,676	2019年10月21日	1,358
美元 1,655,486	纽元 2,641,085	2019年10月21日	1,266
美元 746,017	加元 988,991	2019年10月21日	1,124
美元 726,076	加元 962,391	2019年10月21日	971
美元 260,328	离岸人民币 1,865,877	2019年10月21日	868
美元 160,743	加元 213,887	2019年10月21日	839
美元 119,014	加元 158,646	2019年10月21日	836
美元 126,623	离岸人民币 910,000	2019年10月21日	764
美元 645,569	离岸人民币 4,615,495	2019年10月21日	533
美元 264,416	加元 350,702	2019年10月21日	525
美元 70,904	离岸人民币 510,000	2019年10月21日	488
美元 148,056	加元 196,495	2019年10月21日	388
美元 230,035	加元 304,945	2019年10月21日	339
美元 97,674	离岸人民币 700,110	2019年10月21日	331
美元 111,956	加元 148,581	2019年10月21日	291
美元 162,127	离岸人民币 1,160,011	2019年10月21日	258
美元 120,639	加元 159,960	2019年10月21日	203
美元 62,063	加元 82,400	2019年10月21日	186

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 156,595	加元 207,485	2019年10月21日	152
美元 52,777	离岸人民币 377,722	2019年10月21日	99
美元 32,442	加元 43,038	2019年10月21日	71
美元 34,251	澳元 50,842	2019年10月21日	62
美元 53,676	英镑 43,562	2019年10月21日	45
美元 4,807	离岸人民币 34,543	2019年10月21日	29
美元 32,177	离岸人民币 230,050	2019年10月21日	27
美元 146,400	澳元 216,942	2019年10月21日	13
美元 1,874	离岸人民币 13,469	2019年10月21日	11
美元 4,026	澳元 5,975	2019年10月21日	6
林吉特 82,996,000	美元 20,000,000	2019年11月15日	189,521
林吉特 111,089,450	美元 26,691,362	2019年11月15日	175,203
林吉特 66,969,600	美元 16,000,000	2019年11月15日	14,894
林吉特 54,405,000	美元 13,000,000	2019年11月15日	13,963
离岸人民币 17,729,408	美元 2,479,876	2019年11月21日	100
离岸人民币 6,267,170	美元 876,612	2019年11月21日	34
离岸人民币 670,782	美元 93,825	2019年11月21日	4
美元 57,122	纽元 91,006	2019年11月21日	11
美元 43,803	澳元 64,838	2019年11月21日	1
澳元 23,307,612	美元 16,000,000	2019年11月25日	253,377
澳元 8,812,572	美元 6,000,000	2019年11月25日	46,226
澳元 11,811,483	美元 8,000,000	2019年11月25日	20,162
离岸人民币 309,477,600	美元 45,000,000	2019年11月25日	1,718,237
离岸人民币 404,186,340	美元 58,000,000	2019年11月25日	1,472,815
离岸人民币 350,000,000	美元 50,370,279	2019年11月25日	1,421,285
离岸人民币 145,205,760	美元 21,000,000	2019年11月25日	692,354
离岸人民币 461,175,000	美元 65,000,000	2019年11月25日	502,707
离岸人民币 163,822,790	美元 23,000,000	2019年11月25日	88,683
离岸人民币 42,751,260	美元 6,000,000	2019年11月25日	21,054
印尼盾 601,449,000,000	美元 42,731,723	2019年11月25日	588,335
印尼盾 249,287,500,000	美元 17,500,000	2019年11月25日	32,484
印尼盾 442,277,000,000	美元 31,000,000	2019年11月25日	9,755
印度卢比 1,230,985,000	美元 17,500,000	2019年11月25日	203,427
韩元 38,565,800,000	美元 32,600,000	2019年11月25日	393,074
韩元 18,902,560,000	美元 16,000,000	2019年11月25日	214,165
韩元 15,373,930,000	美元 13,000,000	2019年11月25日	160,981
墨西哥比索 157,989,664	美元 8,000,000	2019年11月25日	66,920
墨西哥比索 258,854,630	美元 13,034,101	2019年11月25日	36,323
菲律宾比索 836,973,000	美元 16,200,000	2019年11月25日	77,515
美元 99,360,854	离岸人民币 712,443,750	2019年11月25日	277,802
美元 17,101,764	印度卢比 1,230,985,000	2019年11月25日	195,635
美元 7,855,238	墨西哥比索 160,000,000	2019年11月25日	180,337
美元 15,995,662	菲律宾比索 836,973,000	2019年11月25日	127,027
美元 12,028,123	新加坡元 16,644,456	2019年11月25日	15,612
美元 5,956,068	林吉特 25,000,000	2019年11月25日	10,384
哥伦比亚比索 54,016,000,000	美元 16,000,000	2019年12月10日	520,348
哥伦比亚比索 51,023,700,000	美元 14,700,000	2019年12月10日	77,866
墨西哥比索 315,877,760	美元 16,000,000	2019年12月19日	195,444
印度卢比 4,189,924,808	美元 58,493,994	2020年2月28日	292,753
离岸人民币 396,206,807	美元 56,781,969	2020年5月15日	1,584,588
美元 34,873,507	离岸人民币 251,206,807	2020年5月15日	123,897
未实现总收益			12,695,707

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／ (亏损) 美元
加元 43,038	美元 32,432	2019年10月2日	(74)
加元 962,391	美元 725,865	2019年10月2日	(1,017)
美元 1,101	澳元 1,629	2019年10月2日	(2)
美元 1,104	纽元 1,751	2019年10月2日	(6)
美元 97,878	澳元 144,920	2019年10月2日	(129)
美元 106,422	纽元 169,414	2019年10月2日	(182)
加元 988,991	美元 745,811	2019年10月3日	(1,161)
美元 8,829	加元 11,684	2019年10月3日	(4)
美元 5,265	澳元 7,772	2019年10月3日	(22)
英镑 43,562	美元 53,641	2019年10月4日	(45)
美元 1,257	澳元 1,864	2019年10月4日	(0)
美元 3,876	加元 5,132	2019年10月4日	(0)
美元 1,101	英镑 893	2019年10月4日	(0)
美元 1,093	纽元 1,744	2019年10月4日	(0)
纽元 91,006	美元 57,065	2019年10月8日	(4)
美元 754,457	离岸人民币 5,381,263	2019年10月8日	(905)
美元 733,983	离岸人民币 5,232,459	2019年10月8日	(1,268)
美元 1,449,095	离岸人民币 10,330,398	2019年10月8日	(2,504)
美元 36,129	离岸人民币 257,605	2019年10月9日	(56)
美元 1,891,280	离岸人民币 13,489,892	2019年10月9日	(2,257)
美元 15,163	离岸人民币 107,894	2019年10月10日	(55)
美元 947,172	离岸人民币 6,739,561	2019年10月10日	(3,441)
美元 93,929	离岸人民币 670,782	2019年10月11日	(3)
美元 2,482,629	离岸人民币 17,729,408	2019年10月11日	(75)
离岸人民币 1,156,000	美元 161,846	2019年10月15日	(4)
离岸人民币 12,803,798	美元 1,792,601	2019年10月15日	(45)
澳元 2,691,233	美元 1,815,974	2019年10月21日	(339)
澳元 1,888,764	美元 1,272,498	2019年10月21日	(2,229)
加元 1,452	美元 1,097	2019年10月21日	(0)
加元 1,459	美元 1,100	2019年10月21日	(2)
加元 1,459	美元 1,100	2019年10月21日	(2)
加元 1,460	美元 1,102	2019年10月21日	(2)
加元 1,463	美元 1,102	2019年10月21日	(3)
加元 1,620	美元 1,220	2019年10月21日	(3)
加元 145,308	美元 109,680	2019年10月21日	(94)
加元 102,001	美元 76,963	2019年10月21日	(95)
加元 203,382	美元 153,347	2019年10月21日	(299)
加元 566,963	美元 427,639	2019年10月21日	(677)
加元 821,075	美元 619,394	2019年10月21日	(894)
加元 406,658	美元 305,616	2019年10月21日	(1,597)
加元 1,151,965	美元 864,285	2019年10月21日	(5,977)
离岸人民币 7,865	美元 1,100	2019年10月21日	(1)
离岸人民币 7,865	美元 1,100	2019年10月21日	(1)
离岸人民币 7,865	美元 1,100	2019年10月21日	(1)
离岸人民币 43,576	美元 6,095	2019年10月21日	(5)
离岸人民币 110,890	美元 15,510	2019年10月21日	(13)
离岸人民币 43,769	美元 6,107	2019年10月21日	(20)
离岸人民币 203,630	美元 28,462	2019年10月21日	(43)
离岸人民币 240,760	美元 33,504	2019年10月21日	(199)
离岸人民币 301,127	美元 41,865	2019年10月21日	(288)
离岸人民币 732,353	美元 101,904	2019年10月21日	(615)
离岸人民币 10,185,091	美元 1,424,673	2019年10月21日	(1,092)
离岸人民币 2,696,884	美元 376,263	2019年10月21日	(1,262)
离岸人民币 5,329,718	美元 744,760	2019年10月21日	(1,323)
离岸人民币 14,586,188	美元 2,039,994	2019年10月21日	(1,860)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 22,432,341	美元 3,137,488	2019年10月21日	(2,713)
离岸人民币 7,010,803	美元 978,130	2019年10月21日	(3,280)
离岸人民币 4,020,197	美元 559,221	2019年10月21日	(3,548)
离岸人民币 8,114,043	美元 1,132,141	2019年10月21日	(3,707)
离岸人民币 6,050,638	美元 841,996	2019年10月21日	(5,007)
离岸人民币 27,420,487	美元 3,832,626	2019年10月21日	(5,843)
离岸人民币 21,890,915	美元 3,046,188	2019年10月21日	(18,221)
离岸人民币 19,379,816	美元 2,694,358	2019年10月21日	(18,534)
离岸人民币 33,687,111	美元 4,683,488	2019年10月21日	(32,217)
纽元 4,376	美元 2,743	2019年10月21日	(2)
英镑 1,820	美元 2,244	2019年10月21日	(0)
美元 3,839	加元 5,082	2019年10月21日	(0)
美元 1,103	离岸人民币 7,858	2019年10月21日	(3)
美元 1,096	离岸人民币 7,805	2019年10月21日	(4)
美元 1,504	离岸人民币 10,704	2019年10月21日	(6)
美元 2,294	离岸人民币 16,330	2019年10月21日	(8)
美元 2,502	离岸人民币 17,811	2019年10月21日	(9)
美元 1,140	离岸人民币 8,081	2019年10月21日	(9)
美元 1,319	英镑 1,061	2019年10月21日	(11)
美元 4,016	离岸人民币 28,444	2019年10月21日	(34)
美元 4,411	离岸人民币 31,253	2019年10月21日	(36)
美元 5,460	离岸人民币 38,721	2019年10月21日	(40)
美元 21,996	离岸人民币 156,776	2019年10月21日	(50)
美元 21,628	澳元 31,910	2019年10月21日	(92)
美元 9,151	英镑 7,340	2019年10月21日	(98)
美元 399,868	加元 529,170	2019年10月21日	(102)
美元 188,726	加元 249,680	2019年10月21日	(103)
美元 21,764	离岸人民币 154,710	2019年10月21日	(108)
美元 130,596	英镑 105,793	2019年10月21日	(132)
美元 35,507	加元 46,743	2019年10月21日	(195)
美元 28,563	加元 37,548	2019年10月21日	(197)
美元 73,289	离岸人民币 521,973	2019年10月21日	(221)
美元 62,993	离岸人民币 448,320	2019年10月21日	(235)
美元 154,287	离岸人民币 1,100,300	2019年10月21日	(261)
美元 89,703	纽元 142,579	2019年10月21日	(264)
美元 84,280	离岸人民币 600,000	2019年10月21日	(289)
美元 99,896	离岸人民币 711,010	2019年10月21日	(365)
美元 99,129	离岸人民币 705,500	2019年10月21日	(370)
美元 85,601	纽元 135,820	2019年10月21日	(401)
美元 36,071	纽元 56,800	2019年10月21日	(440)
美元 133,802	离岸人民币 952,278	2019年10月21日	(497)
美元 83,875	纽元 132,898	2019年10月21日	(508)
美元 78,998	离岸人民币 560,200	2019年10月21日	(578)
美元 65,213	澳元 95,622	2019年10月21日	(677)
美元 137,048	加元 180,425	2019年10月21日	(744)
美元 102,601	纽元 162,269	2019年10月21日	(809)
美元 520,431	澳元 769,671	2019年10月21日	(979)
美元 610,080	离岸人民币 4,350,741	2019年10月21日	(1,040)
美元 125,837	纽元 198,899	2019年10月21日	(1,067)
美元 233,615	澳元 344,558	2019年10月21日	(1,073)
美元 65,401	澳元 95,212	2019年10月21日	(1,142)
美元 51,050	纽元 79,470	2019年10月21日	(1,198)
美元 141,882	澳元 208,442	2019年10月21日	(1,204)
美元 986,162	离岸人民币 7,035,279	2019年10月21日	(1,326)
美元 376,032	离岸人民币 2,676,413	2019年10月21日	(1,374)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 213,415	澳元 313,977	2019年10月21日	(1,512)
美元 459,349	离岸人民币 3,270,151	2019年10月21日	(1,576)
美元 300,183	离岸人民币 2,133,012	2019年10月21日	(1,593)
美元 286,622	纽元 454,194	2019年10月21日	(1,705)
美元 291,518	离岸人民币 2,070,000	2019年10月21日	(1,749)
美元 207,682	纽元 328,253	2019年10月21日	(1,768)
美元 227,093	离岸人民币 1,609,200	2019年10月21日	(1,829)
美元 137,529	纽元 216,308	2019年10月21日	(1,838)
美元 232,441	离岸人民币 1,647,098	2019年10月21日	(1,873)
美元 273,326	纽元 432,713	2019年10月21日	(1,884)
美元 428,729	澳元 632,412	2019年10月21日	(1,913)
美元 524,270	离岸人民币 3,731,500	2019年10月21日	(1,915)
美元 1,152,340	离岸人民币 8,217,932	2019年10月21日	(1,950)
美元 285,745	澳元 420,318	2019年10月21日	(2,072)
美元 609,433	离岸人民币 4,338,616	2019年10月21日	(2,091)
美元 704,980	离岸人民币 5,020,927	2019年10月21日	(2,124)
美元 215,719	纽元 340,497	2019年10月21日	(2,125)
美元 290,726	澳元 427,566	2019年10月21日	(2,160)
美元 313,105	离岸人民币 2,220,345	2019年10月21日	(2,290)
美元 647,225	离岸人民币 4,606,174	2019年10月21日	(2,428)
美元 98,685	纽元 153,350	2019年10月21日	(2,488)
美元 139,348	纽元 218,000	2019年10月21日	(2,596)
美元 154,071	澳元 224,352	2019年10月21日	(2,654)
美元 1,577,646	离岸人民币 11,251,010	2019年10月21日	(2,670)
美元 138,835	澳元 201,451	2019年10月21日	(2,874)
美元 132,022	纽元 205,403	2019年10月21日	(3,172)
美元 874,578	离岸人民币 6,224,837	2019年10月21日	(3,193)
美元 565,471	离岸人民币 4,015,275	2019年10月21日	(3,392)
美元 944,811	离岸人民币 6,724,191	2019年10月21日	(3,524)
美元 551,794	加元 725,595	2019年10月21日	(3,637)
美元 1,247,351	离岸人民币 8,884,300	2019年10月21日	(3,679)
美元 619,587	离岸人民币 4,399,537	2019年10月21日	(3,717)
美元 545,297	离岸人民币 3,866,896	2019年10月21日	(3,989)
美元 823,376	离岸人民币 5,852,991	2019年10月21日	(4,044)
美元 508,429	离岸人民币 3,601,356	2019年10月21日	(4,293)
美元 171,579	纽元 266,310	2019年10月21日	(4,521)
美元 619,757	离岸人民币 4,394,923	2019年10月21日	(4,534)
美元 242,097	澳元 351,750	2019年10月21日	(4,697)
美元 2,204,765	澳元 3,259,334	2019年10月21日	(5,037)
美元 1,771,639	离岸人民币 12,618,564	2019年10月21日	(5,226)
美元 641,974	离岸人民币 4,547,096	2019年10月21日	(5,449)
美元 1,505,805	离岸人民币 10,717,488	2019年10月21日	(5,515)
美元 337,049	澳元 491,073	2019年10月21日	(5,620)
美元 1,577,645	离岸人民币 11,228,901	2019年10月21日	(5,764)
美元 849,727	离岸人民币 6,025,731	2019年10月21日	(6,215)
美元 328,913	澳元 478,074	2019年10月21日	(6,256)
美元 505,858	纽元 795,358	2019年10月21日	(6,927)
美元 2,341,778	离岸人民币 16,678,870	2019年10月21日	(6,982)
美元 898,072	离岸人民币 6,363,811	2019年10月21日	(7,233)
美元 1,993,246	离岸人民币 14,186,991	2019年10月21日	(7,277)
美元 533,376	纽元 836,466	2019年10月21日	(8,657)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 528,113	澳元 769,213	2019年10月21日	(8,966)
美元 1,968,806	离岸人民币 13,989,765	2019年10月21日	(10,446)
美元 1,015,470	离岸人民币 7,175,698	2019年10月21日	(10,981)
美元 699,012	澳元 1,018,314	2019年10月21日	(11,745)
美元 3,266,931	离岸人民币 23,250,635	2019年10月21日	(12,184)
美元 1,002,354	离岸人民币 7,055,707	2019年10月21日	(14,663)
美元 1,609,014	澳元 2,349,603	2019年10月21日	(23,252)
美元 3,296,228	离岸人民币 23,348,162	2019年10月21日	(27,835)
美元 2,635,635	离岸人民币 18,624,406	2019年10月21日	(28,499)
美元 14,320,557	离岸人民币 102,012,533	2019年10月21日	(40,301)
美元 29,505,967	离岸人民币 209,237,730	2019年10月21日	(215,803)
美元 104,437,513	加元 137,916,525	2019年10月21日	(247,290)
美元 122,533,880	离岸人民币 872,870,465	2019年10月21日	(344,838)
美元 54,827,097	纽元 85,375,461	2019年10月21日	(1,270,562)
美元 547,268,556	离岸人民币 3,898,469,200	2019年10月21日	(1,540,141)
美元 140,332,012	澳元 205,011,530	2019年10月21日	(1,968,416)
美元 808,820,638	离岸人民币 5,761,636,244	2019年10月21日	(2,276,209)
林吉特 63,019,500	美元 15,000,000	2019年11月15日	(42,248)
林吉特 63,307,500	美元 15,000,000	2019年11月15日	(110,992)
林吉特 84,266,000	美元 20,000,000	2019年11月15日	(113,617)
林吉特 69,832,950	美元 16,500,000	2019年11月15日	(168,564)
美元 13,160,413	林吉特 55,000,000	2019年11月15日	(32,375)
美元 20,354,406	林吉特 85,000,000	2019年11月15日	(65,628)
美元 14,409,222	林吉特 60,000,000	2019年11月15日	(87,756)
美元 45,449,109	林吉特 190,000,000	2019年11月15日	(97,693)
美元 49,277,423	林吉特 205,886,000	2019年11月15日	(134,168)
澳元 1,864	美元 1,259	2019年11月21日	(0)
加元 5,132	美元 3,879	2019年11月21日	(1)
加元 296,321	美元 223,945	2019年11月21日	(32)
纽元 1,744	美元 1,095	2019年11月21日	(0)
英镑 893	美元 1,103	2019年11月21日	(0)
美元 161,693	离岸人民币 1,156,000	2019年11月21日	(6)
美元 794,243	离岸人民币 5,678,220	2019年11月21日	(42)
美元 1,790,909	离岸人民币 12,803,798	2019年11月21日	(68)
离岸人民币 164,510,674	美元 23,000,000	2019年11月25日	(7,521)
离岸人民币 302,143,138	美元 42,200,000	2019年11月25日	(56,009)
印尼盾 235,158,146,661	美元 16,218,922	2019年11月25日	(258,554)
印尼盾 301,220,000,000	美元 20,000,000	2019年11月25日	(1,106,413)
印度卢比 714,282,000	美元 10,000,000	2019年11月25日	(36,378)
韩元 7,903,350,000	美元 6,500,000	2019年11月25日	(100,216)
韩元 12,160,000,000	美元 10,000,000	2019年11月25日	(155,013)
韩元 39,844,200,000	美元 33,000,000	2019年11月25日	(274,538)
林吉特 273,240,500	美元 65,000,000	2019年11月25日	(210,973)
菲律宾比索 859,567,500	美元 16,500,000	2019年11月25日	(57,719)
菲律宾比索 863,890,500	美元 16,500,000	2019年11月25日	(140,993)
菲律宾比索 845,360,000	美元 16,000,000	2019年11月25日	(284,042)
新加坡元 11,109,704	美元 8,000,000	2019年11月25日	(38,860)
新加坡元 16,644,456	美元 12,000,000	2019年11月25日	(43,745)
美元 15,513,867	林吉特 65,000,000	2019年11月25日	(1,112)
美元 8,072,411	新加坡元 11,109,704	2019年11月25日	(33,529)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 20,363,183	林吉特 85,000,000	2019年11月25日	(77,329)
美元 14,013,653	澳元 20,624,055	2019年11月25日	(79,906)
美元 33,534,541	韩元 40,000,000,000	2019年11月25日	(130,031)
美元 16,355,316	离岸人民币 116,000,000	2019年11月25日	(132,389)
美元 42,388,665	离岸人民币 302,143,138	2019年11月25日	(132,825)
美元 13,037,136	墨西哥比索 256,844,294	2019年11月25日	(141,520)
美元 15,966,204	澳元 23,307,612	2019年11月25日	(219,207)
美元 32,409,868	离岸人民币 230,000,000	2019年11月25日	(243,696)
美元 16,372,437	印尼盾 230,000,000,000	2019年11月25日	(257,773)
美元 14,526,934	离岸人民币 100,000,000	2019年11月25日	(542,197)
美元 14,989,580	离岸人民币 103,000,000	2019年11月25日	(585,335)
美元 70,848,625	离岸人民币 500,000,000	2019年11月25日	(922,663)
美元 78,528,355	韩元 92,749,840,000	2019年11月25日	(1,072,610)
墨西哥比索 309,662,348	美元 15,500,000	2019年12月10日	(14,301)
美元 15,683,017	墨西哥比索 309,662,348	2019年12月10日	(170,560)
美元 15,950,543	墨西哥比索 315,877,760	2019年12月19日	(147,780)
印度卢比 610,479,000	美元 8,443,284	2020年2月28日	(36,733)
美元 66,690,800	印度卢比 4,800,403,808	2020年2月28日	(9,693)
印度卢比 1,458,072,000	美元 19,800,000	2020年3月9日	(426,560)
印度卢比 2,397,525,000	美元 32,500,000	2020年3月19日	(714,216)
美元 21,026,703	离岸人民币 145,000,000	2020年5月15日	(830,348)
印度卢比 2,313,065,000	美元 31,000,000	2020年8月3日	(511,559)

未实现总亏损 (19,437,960)

已平仓但尚未结算之合约:

印度卢比 630,855,000	美元 8,806,519	2019年11月15日	
美元 8,995,508	印度卢比 630,855,000	2019年11月15日	(188,989)
泰铢 338,789,000	美元 11,000,000	2019年11月25日	
美元 11,066,473	泰铢 338,789,000	2019年11月25日	(66,473)

未实现总亏损 (255,462)

未实现净亏损 (6,997,715)

2018

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
离岸人民币 3,316,581,310	美元 483,220,122	2018年10月9日	836,361
离岸人民币 66,859,111	美元 9,740,589	2018年10月9日	16,193
离岸人民币 11,372,680	美元 1,666,474	2018年10月9日	12,361
离岸人民币 13,032,056	美元 1,907,228	2018年10月9日	11,767
离岸人民币 5,826,722	美元 857,578	2018年10月9日	10,104
离岸人民币 4,082,542	美元 599,985	2018年10月9日	6,194
离岸人民币 6,994,131	美元 1,023,161	2018年10月9日	5,892
离岸人民币 18,906,534	美元 2,755,038	2018年10月9日	5,157
离岸人民币 17,680,856	美元 2,575,608	2018年10月9日	3,997
离岸人民币 16,417,389	美元 2,391,584	2018年10月9日	3,738
离岸人民币 2,819,152	美元 413,310	2018年10月9日	3,276
离岸人民币 5,105,046	美元 745,668	2018年10月9日	3,159
离岸人民币 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
离岸人民币 6,239,025	美元 909,654	2018年10月9日	2,213
离岸人民币 3,152,809	美元 460,649	2018年10月9日	2,086
离岸人民币 903,504	美元 133,088	2018年10月9日	1,677
离岸人民币 3,989,907	美元 581,974	2018年10月9日	1,657
离岸人民币 3,303,526	美元 482,142	2018年10月9日	1,657
离岸人民币 4,162,343	美元 607,041	2018年10月9日	1,644
离岸人民币 6,802,394	美元 990,419	2018年10月9日	1,038
离岸人民币 1,798,099	美元 262,475	2018年10月9日	948
离岸人民币 1,290,200	美元 188,441	2018年10月9日	787
离岸人民币 4,874,556	美元 709,486	2018年10月9日	501
离岸人民币 540,550	美元 78,934	2018年10月9日	313
离岸人民币 354,517	美元 51,779	2018年10月9日	216
离岸人民币 75,272	美元 10,975	2018年10月9日	27
离岸人民币 14,610	美元 2,141	2018年10月9日	16
离岸人民币 7,576	美元 1,113	2018年10月9日	11
离岸人民币 7,466	美元 1,095	2018年10月9日	9
离岸人民币 44,507	美元 6,480	2018年10月9日	7
离岸人民币 35,212	美元 5,126	2018年10月9日	5
离岸人民币 7,521	美元 1,099	2018年10月9日	5
离岸人民币 12,738	美元 1,858	2018年10月9日	5
离岸人民币 7,537	美元 1,101	2018年10月9日	5
离岸人民币 7,521	美元 1,098	2018年10月9日	5
离岸人民币 8,402	美元 1,226	2018年10月9日	4
离岸人民币 7,540	美元 1,099	2018年10月9日	3
美元 502,971,661	离岸人民币 3,466,329,796	2018年10月9日	1,192,431
美元 2,687,181	离岸人民币 18,519,246	2018年10月9日	6,371
美元 405,183	离岸人民币 2,818,792	2018年10月9日	4,799
美元 801,096	离岸人民币 5,520,673	2018年10月9日	1,864
美元 534,618	离岸人民币 3,686,991	2018年10月9日	1,641
美元 460,935	离岸人民币 3,175,975	2018年10月9日	998
美元 290,106	离岸人民币 2,000,000	2018年10月9日	786
美元 323,441	离岸人民币 2,225,848	2018年10月9日	300
美元 203,438	离岸人民币 1,400,018	2018年10月9日	189
美元 8,387	离岸人民币 58,348	2018年10月9日	99
美元 1,591	离岸人民币 11,069	2018年10月9日	19
美元 4,304	离岸人民币 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
离岸人民币 4,771,345	美元 702,823	2018年10月10日	8,900
离岸人民币 2,493,565	美元 366,999	2018年10月10日	4,346
离岸人民币 1,980,511	美元 291,047	2018年10月10日	3,010
离岸人民币 3,304,002	美元 482,667	2018年10月10日	2,148
离岸人民币 2,499,029	美元 365,563	2018年10月10日	2,116
离岸人民币 1,390,405	美元 204,328	2018年10月10日	2,113
离岸人民币 1,088,363	美元 160,317	2018年10月10日	2,030
离岸人民币 2,453,499	美元 358,505	2018年10月10日	1,680
离岸人民币 2,438,764	美元 356,352	2018年10月10日	1,669
离岸人民币 2,929,799	美元 427,686	2018年10月10日	1,589
离岸人民币 2,429,715	美元 354,947	2018年10月10日	1,580
离岸人民币 3,539,813	美元 516,365	2018年10月10日	1,551
离岸人民币 3,176,696	美元 463,396	2018年10月10日	1,392
离岸人民币 3,116,808	美元 454,664	2018年10月10日	1,369
离岸人民币 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
离岸人民币 3,495,622	美元 509,672	2018年10月10日	1,285
离岸人民币 1,089,679	美元 159,753	2018年10月10日	1,275
离岸人民币 2,199,353	美元 321,057	2018年10月10日	1,193
离岸人民币 1,893,940	美元 276,404	2018年10月10日	958
离岸人民币 1,110,527	美元 162,450	2018年10月10日	940
离岸人民币 3,932,432	美元 572,805	2018年10月10日	890
离岸人民币 1,769,540	美元 258,131	2018年10月10日	777
离岸人民币 357,111	美元 52,601	2018年10月10日	664
离岸人民币 1,178,174	美元 172,010	2018年10月10日	662
离岸人民币 848,316	美元 123,898	2018年10月10日	522
离岸人民币 1,186,229	美元 172,968	2018年10月10日	449
离岸人民币 1,185,979	美元 172,927	2018年10月10日	444
离岸人民币 201,725	美元 29,690	2018年10月10日	352
离岸人民币 872,296	美元 127,193	2018年10月10日	330
离岸人民币 3,688,776	美元 536,800	2018年10月10日	321
离岸人民币 806,147	美元 117,558	2018年10月10日	315
离岸人民币 590,117	美元 86,055	2018年10月10日	231
离岸人民币 2,048,959	美元 298,170	2018年10月10日	178
离岸人民币 135,282	美元 19,833	2018年10月10日	158
离岸人民币 180,883	美元 26,418	2018年10月10日	111
离岸人民币 1,757,693	美元 255,730	2018年10月10日	99
离岸人民币 52,000	美元 7,659	2018年10月10日	97
离岸人民币 1,520,456	美元 221,214	2018年10月10日	86
离岸人民币 90,140	美元 13,130	2018年10月10日	20
离岸人民币 7,478	美元 1,101	2018年10月10日	13
离岸人民币 7,576	美元 1,113	2018年10月10日	12
离岸人民币 7,466	美元 1,094	2018年10月10日	9
离岸人民币 7,466	美元 1,094	2018年10月10日	9
离岸人民币 7,521	美元 1,098	2018年10月10日	5
离岸人民币 7,521	美元 1,098	2018年10月10日	5
离岸人民币 7,526	美元 1,096	2018年10月10日	1
离岸人民币 7,526	美元 1,096	2018年10月10日	1
离岸人民币 7,552	美元 1,099	2018年10月10日	0
离岸人民币 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	离岸人民币 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	离岸人民币 579,809	2018年10月10日	224
美元 453,074	离岸人民币 3,116,808	2018年10月10日	220
美元 222,028	离岸人民币 1,528,008	2018年10月10日	199
美元 170,601	离岸人民币 1,174,158	2018年10月10日	163
美元 50,562	离岸人民币 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	离岸人民币 956,986	2018年10月10日	125
美元 257,229	离岸人民币 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	离岸人民币 757,451	2018年10月10日	34
美元 53,088	离岸人民币 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	离岸人民币 20,000	2018年10月10日	8
美元 14,637	离岸人民币 100,700	2018年10月10日	8
美元 15,848	离岸人民币 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	离岸人民币 9,623	2018年10月10日	1
离岸人民币 7,526,346	美元 1,098,372	2018年11月5日	5,650
离岸人民币 7,851,490	美元 1,145,141	2018年11月5日	5,212
离岸人民币 6,294,724	美元 918,087	2018年11月5日	4,179
离岸人民币 5,024,939	美元 732,687	2018年11月5日	3,135
离岸人民币 3,999,297	美元 582,472	2018年11月5日	1,828
离岸人民币 2,459,133	美元 358,608	2018年11月5日	1,575
离岸人民币 3,692,584	美元 537,666	2018年11月5日	1,553
离岸人民币 7,422,512	美元 1,078,816	2018年11月5日	1,169
离岸人民币 4,734,383	美元 688,242	2018年11月5日	874
离岸人民币 3,442,393	美元 500,423	2018年11月5日	634
离岸人民币 4,749,871	美元 689,841	2018年11月5日	224
离岸人民币 1,321,101	美元 191,956	2018年11月5日	150
离岸人民币 1,226,998	美元 178,288	2018年11月5日	145
离岸人民币 60,357	美元 8,803	2018年11月5日	40
离岸人民币 7,538	美元 1,099	2018年11月5日	5
离岸人民币 8,519	美元 1,238	2018年11月5日	2
离岸人民币 7,552	美元 1,098	2018年11月5日	1
美元 1,239,283	离岸人民币 8,539,607	2018年11月5日	552
美元 83,316	离岸人民币 575,322	2018年11月5日	213
美元 38,130	离岸人民币 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
离岸人民币 2,258,431	美元 329,235	2018年11月13日	1,479
离岸人民币 3,341,809	美元 486,410	2018年11月13日	1,429
离岸人民币 2,308,867	美元 336,062	2018年11月13日	987
离岸人民币 668,410	美元 97,429	2018年11月13日	426
离岸人民币 602,316	美元 87,806	2018年11月13日	395
离岸人民币 2,221,670	美元 322,692	2018年11月13日	272
离岸人民币 1,871,746	美元 271,866	2018年11月13日	229
离岸人民币 2,073,626	美元 300,957	2018年11月13日	21
离岸人民币 27,039	美元 3,941	2018年11月13日	17
离岸人民币 632,225	美元 91,758	2018年11月13日	6
离岸人民币 7,538	美元 1,099	2018年11月13日	5
离岸人民币 19,353	美元 2,812	2018年11月13日	4
离岸人民币 7,527	美元 1,094	2018年11月13日	1
离岸人民币 7,570	美元 1,099	2018年11月13日	0
离岸人民币 7,568	美元 1,098	2018年11月13日	0
离岸人民币 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	离岸人民币 1,725,844,986	2018年11月13日	13,114
美元 89,930,097	离岸人民币 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	离岸人民币 732,018	2018年11月13日	38
美元 45,472	离岸人民币 313,452	2018年11月13日	18
美元 43,521	离岸人民币 300,000	2018年11月13日	17
美元 15,958	离岸人民币 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	离岸人民币 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
离岸人民币 568,755,321	美元 83,340,218	2018年12月6日	877,254
离岸人民币 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

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)
离岸人民币 7,540	美元 1,093	2018年10月9日	(3)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 5,954,614	美元 863,803	2018年10月9日	(2,273)
离岸人民币 6,088,138	美元 882,846	2018年10月9日	(2,650)
离岸人民币 6,744,420	美元 969,044	2018年10月9日	(11,905)
离岸人民币 52,045,092	美元 7,553,474	2018年10月9日	(16,281)
美元 2,818	离岸人民币 19,353	2018年10月9日	(3)
美元 2,374	离岸人民币 16,294	2018年10月9日	(4)
美元 1,209	离岸人民币 8,272	2018年10月9日	(5)
美元 2,694	离岸人民币 18,470	2018年10月9日	(7)
美元 4,407	离岸人民币 30,217	2018年10月9日	(12)
美元 3,948	离岸人民币 27,039	2018年10月9日	(16)
美元 4,549	离岸人民币 31,123	2018年10月9日	(23)
美元 6,121	离岸人民币 41,574	2018年10月9日	(74)
美元 48,729	离岸人民币 334,463	2018年10月9日	(82)
美元 404,732	离岸人民币 2,776,480	2018年10月9日	(904)
美元 362,708	离岸人民币 2,486,848	2018年10月9日	(1,006)
美元 1,208,630	离岸人民币 8,302,347	2018年10月9日	(1,086)
美元 809,906	离岸人民币 5,560,089	2018年10月9日	(1,212)
美元 932,450	离岸人民币 6,400,133	2018年10月9日	(1,576)
美元 551,752	离岸人民币 3,780,594	2018年10月9日	(1,879)
美元 567,009	离岸人民币 3,882,359	2018年10月9日	(2,335)
美元 191,720	离岸人民币 1,301,569	2018年10月9日	(2,412)
美元 505,191	离岸人民币 3,456,059	2018年10月9日	(2,520)
美元 446,561	离岸人民币 3,052,866	2018年10月9日	(2,534)
美元 405,723	离岸人民币 2,771,823	2018年10月9日	(2,572)
美元 627,913	离岸人民币 4,297,973	2018年10月9日	(2,791)
美元 829,629	离岸人民币 5,682,045	2018年10月9日	(3,198)
美元 1,502,093	离岸人民币 10,300,048	2018年10月9日	(3,992)
美元 1,025,961	离岸人民币 7,020,746	2018年10月9日	(4,822)
美元 585,370	离岸人民币 3,983,160	2018年10月9日	(6,035)
美元 853,478	离岸人民币 5,825,875	2018年10月9日	(6,127)
美元 555,756	离岸人民币 3,776,299	2018年10月9日	(6,508)
美元 895,899	离岸人民币 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)
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)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／ (亏损) 美元
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)
离岸人民币 7,572	美元 1,101	2018 年 10 月 10 日	(1)
离岸人民币 7,572	美元 1,101	2018 年 10 月 10 日	(1)
离岸人民币 7,528	美元 1,092	2018 年 10 月 10 日	(3)
离岸人民币 110,000	美元 15,983	2018 年 10 月 10 日	(15)
离岸人民币 1,044,571	美元 151,864	2018 年 10 月 10 日	(54)
离岸人民币 721,380	美元 104,847	2018 年 10 月 10 日	(67)
离岸人民币 839,143	美元 121,963	2018 年 10 月 10 日	(78)
离岸人民币 732,018	美元 106,364	2018 年 10 月 10 日	(97)
离岸人民币 8,586,585	美元 1,248,353	2018 年 10 月 10 日	(442)
离岸人民币 1,513,410	美元 219,537	2018 年 10 月 10 日	(566)
离岸人民币 2,656,867	美元 385,244	2018 年 10 月 10 日	(1,159)
离岸人民币 3,423,927	美元 496,467	2018 年 10 月 10 日	(1,493)
离岸人民币 7,209,476	美元 1,045,817	2018 年 10 月 10 日	(2,696)
离岸人民币 619,704,698	美元 90,052,938	2018 年 10 月 10 日	(74,128)
离岸人民币 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)
美元 1,672	英镑 1,270	2018 年 10 月 10 日	(15)
美元 1,763	离岸人民币 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	离岸人民币 319,085	2018 年 10 月 10 日	(37)
美元 117,587	离岸人民币 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	离岸人民币 100,000	2018 年 10 月 10 日	(50)
美元 72,775	离岸人民币 500,000	2018 年 10 月 10 日	(57)
美元 14,665	离岸人民币 100,394	2018 年 10 月 10 日	(64)
美元 47,345	离岸人民币 325,042	2018 年 10 月 10 日	(72)
美元 8,977	离岸人民币 61,000	2018 年 10 月 10 日	(106)
美元 43,742	离岸人民币 300,000	2018 年 10 月 10 日	(112)
美元 49,242	离岸人民币 337,721	2018 年 10 月 10 日	(126)
美元 87,395	离岸人民币 600,000	2018 年 10 月 10 日	(133)
美元 55,046	离岸人民币 377,468	2018 年 10 月 10 日	(148)
美元 47,489	离岸人民币 325,400	2018 年 10 月 10 日	(164)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／ (亏损) 美元
美元 65,623	离岸人民币 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	离岸人民币 358,021	2018年10月10日	(193)
美元 53,858	离岸人民币 368,782	2018年10月10日	(224)
美元 58,417	离岸人民币 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	离岸人民币 430,102	2018年10月10日	(276)
美元 48,287	离岸人民币 330,117	2018年10月10日	(277)
美元 62,898	离岸人民币 430,000	2018年10月10日	(361)
美元 46,158	离岸人民币 314,874	2018年10月10日	(364)
美元 141,207	离岸人民币 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	离岸人民币 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	离岸人民币 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	离岸人民币 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 105,314	离岸人民币 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	离岸人民币 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	离岸人民币 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	离岸人民币 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	离岸人民币 1,765,126,234	2018年10月10日	(2,870,149)
离岸人民币 300,000	美元 43,584	2018年10月11日	(44)
离岸人民币 313,452	美元 45,539	2018年10月11日	(46)
美元 91,952	离岸人民币 632,225	2018年10月11日	(9)
美元 301,591	离岸人民币 2,073,626	2018年10月11日	(29)
离岸人民币 345,396	美元 50,225	2018年10月12日	(2)
离岸人民币 117,144	美元 17,000	2018年11月5日	(8)
离岸人民币 1,557,986	美元 226,153	2018年11月5日	(46)
离岸人民币 3,596,144	美元 521,862	2018年11月5日	(250)
离岸人民币 11,803,003	美元 1,713,343	2018年11月5日	(292)
离岸人民币 11,586,280	美元 1,677,988	2018年11月5日	(4,182)
美元 1,268	离岸人民币 8,708	2018年11月5日	(4)
美元 6,903	离岸人民币 47,518	2018年11月5日	(5)
美元 5,119	离岸人民币 35,212	2018年11月5日	(6)
美元 86,728	离岸人民币 597,307	2018年11月5日	(7)
美元 224,471	离岸人民币 1,545,713	2018年11月5日	(55)
美元 32,033	离岸人民币 220,000	2018年11月5日	(92)
美元 336,459	离岸人民币 2,315,963	2018年11月5日	(213)
美元 196,254	离岸人民币 1,349,596	2018年11月5日	(312)
美元 82,452	离岸人民币 565,000	2018年11月5日	(422)
美元 106,425	离岸人民币 729,710	2018年11月5日	(482)
美元 1,097,378	离岸人民币 7,554,518	2018年11月5日	(566)
美元 262,090	离岸人民币 1,798,099	2018年11月5日	(1,033)
美元 323,017	离岸人民币 2,214,954	2018年11月5日	(1,439)
美元 1,120,545	离岸人民币 7,694,697	2018年11月5日	(3,386)
美元 2,752,115	离岸人民币 18,906,534	2018年11月5日	(7,157)
美元 482,713,742	离岸人民币 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)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 7,568	美元 1,098	2018 年 11 月 13 日	(0)
离岸人民币 9,623	美元 1,396	2018 年 11 月 13 日	(0)
离岸人民币 956,986	美元 138,832	2018 年 11 月 13 日	(50)
离岸人民币 1,400,018	美元 203,128	2018 年 11 月 13 日	(50)
离岸人民币 1,174,158	美元 170,340	2018 年 11 月 13 日	(60)
离岸人民币 1,528,008	美元 221,672	2018 年 11 月 13 日	(80)
离岸人民币 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	离岸人民币 330,501	2018 年 11 月 13 日	(49)
美元 51,673	离岸人民币 354,997	2018 年 11 月 13 日	(154)
美元 51,682	离岸人民币 354,517	2018 年 11 月 13 日	(233)
美元 154,824	离岸人民币 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	离岸人民币 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	离岸人民币 3,120,914	2018 年 11 月 13 日	(834)
美元 188,088	离岸人民币 1,290,200	2018 年 11 月 13 日	(849)
美元 257,724	离岸人民币 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	离岸人民币 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)
离岸人民币 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)

(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>2019</u>				
无				
<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
				<u>1,000,782</u>

13 其他收入

本年度本基金未收到管理人因估值和/或其他操作错误而支付的赔偿(二零一八年: 1,673 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七页至第四十六页的财务报表，包括：

- 于二零一九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二零一九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，我们所获得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所了解的情况存在重大抵触或者似乎存在重大错误陈述的情况。

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。

管理层就财务报表需承担的责任

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导致的重大错误陈述获取合理保证，并出具包含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责或承担任何责任。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被视作重大。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，以及获取充足及适当的审计凭证，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及相关披露的合理性。

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的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披露。

罗兵咸永道会计师事务所
 执业会计师
 香港
 二零二零年一月二十二日

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
- 按持续营运的基准编制财务报表，除非该假设不恰当。

管理人亦务必遵照信托契约，采取合理措施预防和监测欺诈及其他不法行为。

受托人的责任

基金受托人务必：

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

受托人对份额持有人的报告

本受托人谨确认管理人于截至二零一九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
二零二零年一月二十二日

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
30/9/19 - 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 205,855,872 加元 136,297,063 英镑 3,723,282 港元 3,941,035,656 纽元 88,379,459 人民币 98,885,725 人民币 3,811,348,133 美元 2,707,081 美元 557,035,318 人民币 5,711,865,861 人民币 883,011,937 美元 440,896,043 美元 38,278,097	澳元 8.90 加元 8.94 英镑 9.36 港元 9.54 纽元 8.83 人民币 13.19 人民币 9.13 美元 12.96 美元 10.86 人民币 12.53 人民币 9.86 美元 11.58 美元 9.89
30/9/18 - 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
30/9/17 - 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

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
30/9/19		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.98	澳元 8.48
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.02	加元 8.53
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.43	英镑 8.92
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.64	港元 9.07
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.91	纽元 8.42
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.21	人民币 12.01
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.22	人民币 8.71
- 美元类别 (累计)	美元 12.98	美元 11.84
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.96	美元 10.35
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 12.55	人民币 11.41
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.96	人民币 9.40
- PRC 美元份额 (累计)	美元 11.60	美元 10.58
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 9.99	美元 9.43
30/9/18		
- 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 13.32	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
30/9/17		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.56	澳元 8.99
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.60	加元 9.03
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.04	英镑 9.43
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.12	港元 9.51
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.50	纽元 8.93
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.11	人民币 11.20
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.86	人民币 9.20
- 美元类别 (累计)	美元 12.24	美元 11.60
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.63	美元 10.95
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.51	人民币 10.63
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.42	人民币 9.92
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.88	美元 10.36
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.38	美元 9.98
30/9/16		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.65	澳元 9.01
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.68	加元 9.03
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.11	英镑 9.41
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.20	港元 9.53
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.58	纽元 8.94
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 11.82	人民币 10.36
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.95	人民币 9.26
- 美元类别 (累计)	美元 12.29	美元 11.09
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.73	美元 10.93
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.00	人民币 10.02
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.53	人民币 10.00
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.77	美元 9.96
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.49	美元 9.96

(续)

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
30/9/15		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.97	澳元 9.05
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.95	加元 9.07
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.35	英镑 9.45
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.46	港元 9.53
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.90	纽元 8.98
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 10.92	人民币 10.12
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.32	人民币 9.32
- 美元类别 (累计)	美元 11.83	美元 11.06
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.04	美元 10.97
30/9/14		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.05	澳元 9.41
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.06	加元 9.42
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.54	港元 9.89
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.00	纽元 9.36
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 10.49	人民币 10.01
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.41	人民币 9.91
- 美元类别 (累计)	美元 11.61	美元 10.53
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.13	美元 11.36
30/9/13		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.46	澳元 9.29
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.46	加元 9.29
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.94	港元 9.73
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.42	纽元 9.24
- 美元类别 (累计)	美元 11.40	美元 10.28
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.58	美元 11.19
30/9/12		
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.68	港元 9.91
- 美元类别 (累计)	美元 10.87	美元 9.97
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.29	美元 10.48
30/9/11		
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.96	美元 10.68
30/9/10		
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.78	美元 10.45

经营与管理

管理人及服务提供者

摩根基金（亚洲）有限公司
遮打大厦 21 楼
中环干诺道中 8 号
香港

投资管理人

摩根资产管理（亚太）有限公司
（前称 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

于二零二零年一月二十二日
Daniel James WATKINS
Desiree Qionghui WANG
Edwin Tsun Kay CHAN
Ioan William ROBERTS
Kheng Leong CHEAH

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

