

半年度报告 — 2020年3月31日（未经审核）

摩根亚洲股息基金

内地与香港互认基金系列



中国内地代理人:

上投摩根
基金 管 理

基金管理人:

摩根
资 产 管 理

此（等）报告并不构成购买组成本文件内容的任何基金单位之邀请。只有基于现时基金说明书（或同等文件）及最近之财务报告（如有）所作之认购方为有效。

本报告可能包含本基金若干并未获认可在中国内地发售或分销之股份类别。投资者应注意，本未经审核半年度报告内若干数据以综合方法表述，因此当中包括并未在中国内地注册的股份类别之资产。

内容	页
投资组合	1
投资组合持有变动表	2
财务状况表	3
综合收益表	3
可赎回份额持有人应占净资产变动表	4
现金流量表	4
财务报表之附注	5 - 12

投资组合

截至二零二零年三月三十一日(未经审计)

(续)

	单位数目	占资产		单位数目	占资产	
		公允价值 美元	净值 百分比		公允价值 美元	净值 百分比
上市投资 (95.3%)						
(I)股票 (97.5%)						
澳大利亚 (12.7%)						
Australia & NZ Bkg Group-AU List	1,062,014	11,024,096	1.1			
Brambles Ltd	4,905,426	31,704,985	3.2			
Dexus Stapled Sec	1,621,021	9,018,606	0.9			
Goodman Group Stapled Sec	300,462	2,225,163	0.2			
Insurance Australia Group	2,487,821	9,440,559	1.0			
Mirvac Group Stapled Sec	10,468,9					
	66	13,391,739	1.3			
Rio Tinto-AU List	236,867	12,260,489	1.2			
Tabcorp Hldgs	2,429,069	3,761,381	0.4			
Transurban Group Stapled Sec	2,694,863	19,858,666	2.0			
Viva Energy Group	9,378,678	7,290,079	0.7			
Westpac Banking	657,518	6,640,159	0.7			
中国 (24.0%)						
宝山钢铁股份有限公司 A 股(C1)	8,251,178	5,669,033	0.6			
中国人寿保险股份有限公司 H 股	8,697,000	17,032,920	1.7			
中国招商银行股份有限公司 H 股	5,255,500	23,731,760	2.4			
中国移动有限公司	2,578,000	19,174,767	1.9			
中国海外发展有限公司	3,798,000	11,784,683	1.2			
华润置地有限公司	3,396,000	14,020,565	1.4			
中国电信股份有限公司 H 股	34,622,000	10,497,065	1.1			
万科企业股份有限公司 A 股 - C2	1,531,800	5,543,110	0.6			
中国海洋石油有限公司	18,780,000	19,698,538	2.0			
杭州老板电器股份有限公司 A 股 - C2	1,346,568	5,402,838	0.5			
江苏宁沪高速公路股份有限公司 H 股	17,368,000	19,382,678	1.9			
九阳股份有限公司 A 股-C2	3,809,383	15,128,542	1.5			
美的集团股份有限公司 A 股 - C2	1,146,953	7,834,918	0.8			
中国平安保险(集团)股份有限公司 H 股	2,997,000	29,444,523	3.0			
中国邮政储蓄银行股份有限公司 H 股	32,168,000	19,589,075	2.0			
上海汽车集团股份有限公司 A 股 (C1)	1,105,953	3,198,560	0.3			
中石化炼化工程(集团)股份有限公司 H 股	15,468,000	6,505,784	0.6			
越秀交通基建有限公司	8,088,000	4,935,716	0.5			
香港 (12.6%)						
中电控股有限公司	4,051,500	37,374,015	3.8			
香港电讯信托与香港电讯有限公司	7,658,000	10,433,431	1.0			
香港交易及结算所有限公司	1,118,183	33,729,139	3.4			
领展房地产投资信托基金	2,145,100	18,182,801	1.8			
香港铁路有限公司	1,172,000	6,055,890	0.6			
金沙中国有限公司	4,006,400	14,679,813	1.5			
太古股份有限公司 A 股	702,500	4,527,200	0.5			
印度 (7.6%)						
ITC Ltd	7,217,482	16,380,981	1.6			
Power Grid Corp of India	13,668,857	28,746,586	2.9			
Tata Consultancy Services	1,279,836	30,893,191	3.1			
印度尼西亚 (4.5%)						
Bank Rakyat Indonesia Persero	75,857,100	14,045,889	1.4			
Telekomunikasi Indonesia	156,008,000	30,225,953	3.1			
韩国 (9.2%)						
KB Financial Group	272,190	7,725,111	0.8			
Samsung Electronics	1,675,262	65,711,390	6.6			
Samsung Electronics Pref	315,202	10,382,881	1.0			
Shinhan Financial Group	318,467	7,481,954	0.8			
新加坡 (12.3%)						
AIMS APAC REIT	8,419,519	6,149,735	0.6			
Ascendas India Trust	26,322,300	22,184,050	2.2			
DBS Group Hldgs	1,342,703	17,511,672	1.8			
Mapletree Commercial Trust	4,055,500	5,212,322	0.5			
Mapletree Logistics Trust	27,897,088	30,956,491	3.1			
Singapore Exchange	1,450,100	9,359,426	1.0			
Singapore Telecom	7,435,700	13,264,514	1.3			
United Overseas Bank	1,330,300	18,172,093	1.8			
台湾 (10.5%)						
日月光投资控股股份有限公司	5,459,000	10,578,093	1.1			
可成科技股份有限公司	1,099,000	7,104,624	0.7			
台达电子工业股份有限公司	845,000	3,366,979	0.3			
统一超商股份有限公司	427,000	3,995,867	0.4			
台湾积体电路制造股份有限公司	7,948,000	72,012,036	7.2			
世界先进积体电路股份有限公司	3,815,000	7,480,763	0.8			
泰国 (4.1%)						
Intouch Hldgs (F)	14,100,800	21,483,660	2.1			
Land & Houses (F)	18,326,200	3,741,465	0.4			
Siam Commercial Bank (F)	3,144,600	6,635,592	0.7			
Thai Oil (F)	9,980,100	9,351,354	0.9			
				970,327,958	97.5	
(II) 衍生性产品 (-2.2%)						
远期外汇合约 (-2.2%)				(22,373,219)	(2.2)	
总上市投资				947,954,739	95.3	
其他净资产				46,642,359	4.7	
截至二零二零年三月三十一日可赎回份额持有人应占净资产				994,597,098	100.0	
总投资, 按成本				1,149,764,659		

投资组合持有变动表

截至二零二零年三月三十一日止期间(未经审计)

持有占资产净值百分比

二零二零年 二零一九年
三月三十一日 九月三十日

上市投资

股票

中国	24.0	27.9
澳大利亚	12.7	15.3
香港	12.6	13.5
新加坡	12.3	6.9
台湾	10.5	10.3
韩国	9.2	9.2
印度	7.6	4.7
印度尼西亚	4.5	5.4
泰国	4.1	5.7

衍生性产品

远期外汇合约	(2.2)	(0.3)
--------	-------	-------

总上市投资	95.3	98.6
--------------	-------------	-------------

其他净资产	4.7	1.4
--------------	------------	------------

可赎回份额持有人应占净资产	100.0	100.0
----------------------	--------------	--------------

财务状况表

截至二零二零年三月三十一日(未经审计)

	二零二零年 三月三十一日 美元	二零一九年 九月三十日 美元
资产		
银行现金	51,857,920	15,713,579
应收经纪款项	-	12,259,999
分配应收款项	2,018,211	4,217,833
衍生性产品	3,611,923	368,688
投资	970,327,958	1,368,108,378
股息及其他应收款项	3,740,168	4,569,738
总资产	<u>1,031,556,180</u>	<u>1,405,238,215</u>
负债		
应付经纪款项	1,672,688	5,983,423
赎回应付款项	3,056,788	3,540,541
应付收益分配(附注 5)	4,820,699	5,106,024
衍生性产品	25,985,142	4,111,828
应付税项	-	149,308
其他应付款项	1,423,765	1,910,275
总负债(不含可赎回份额持有人 应占净资产)	<u>36,959,082</u>	<u>20,801,399</u>
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	<u>994,597,098</u>	<u>1,384,436,816</u>

综合收益表

截至二零二零年三月三十一日止期间(未经审计)

	二零一九年 十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元	二零一八年 十月一日至 二零一九年 三月三十一日 美元
收入		
投资及衍生性产品净(亏损)/ 收益 [附注 4]	(279,585,968)	39,884,728
股息收入	17,653,087	16,473,351
存款利息	144,012	183,935
汇兑净亏损	(1,179,700)	(713,426)
	<u>(262,968,569)</u>	<u>55,828,588</u>
支出		
管理费用	9,794,527	10,706,438
交易成本	2,354,322	1,774,631
托管费用及银行费用	215,728	191,013
受托人费用	178,526	187,642
基金注册登记机构费用	59,700	55,383
法律及专业费用	39,808	62,613
核数师酬金	18,527	8,881
估值费用	8,680	8,540
印刷及出版支出	601	3,107
其他经营费用	17,054	12,151
	<u>12,687,473</u>	<u>13,010,399</u>
净经营(亏损)/利润	<u>(275,656,042)</u>	<u>42,818,189</u>
财务成本		
收益分配(附注 5)	(30,219,749)	(32,521,597)
利息支出	(3,767)	(9,866)
	<u>(30,223,516)</u>	<u>(32,531,463)</u>
除税前(亏损)/利润	<u>(305,879,558)</u>	<u>10,286,726</u>
税项	(1,599,599)	(1,741,470)
可赎回份额持有人应占净资产 及总综合收益之(减少)/增 加	<u>(307,479,157)</u>	<u>8,545,256</u>

可赎回份额持有人应占净资产变动表
截至二零二零年三月三十一日止期间(未经审计)

	二零一九年 十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元	二零一八年 十月一日至 二零一九年 三月三十一日 美元
期初可赎回份额持有人应占净资产	1,384,436,816	1,558,455,678
分配可赎回份额	277,251,164	455,448,264
赎回可赎回份额	(359,611,725)	(463,702,751)
净赎回	(82,360,561)	(8,254,487)
	1,302,076,255	1,550,201,191
可赎回份额持有人应占净资产及 总综合收益之(减少)/增加	(307,479,157)	8,545,256
期末可赎回份额持有人应占净资产	994,597,098	1,558,746,447

现金流量表
截至二零二零年三月三十一日止期间(未经审计)

	二零一九年 十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元	二零一八年 十月一日至 二零一九年 三月三十一日 美元
经营业务		
购入投资及衍生性产品	(637,270,024)	(470,153,258)
出售投资及衍生性产品所得款项	782,070,411	511,930,523
已收股息	18,479,945	17,393,231
已收利息	145,492	185,294
已付基金注册登记机构费用	(120,325)	(118,100)
已付受托人费用	(184,256)	(187,342)
已付税项	(1,748,907)	(1,186,941)
已付交易费用	(2,384,157)	(1,760,898)
已付管理费用	(10,159,512)	(10,689,000)
其他	(1,303,240)	(1,286,906)
经营业务所产生之现金净额	147,525,427	44,126,603
融资活动		
已付利息	(3,767)	(9,866)
分配可赎回份额所得款项	279,450,786	446,641,796
赎回可赎回份额付款	(360,095,478)	(469,847,846)
已付收益分配	(30,505,074)	(33,457,686)
融资活动所运用之现金净额	(111,153,533)	(56,673,602)
现金及现金等价物之增加/(减少)	36,371,894	(12,546,999)
期初现金及现金等价物	15,713,579	47,182,555
现金及现金等价物之汇兑(亏损)/收益	(227,553)	211,620
期末现金及现金等价物	51,857,920	34,847,176
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	51,857,920	18,829,664
短期存款	-	16,017,512
	51,857,920	34,847,176

财务报表之附注

1 本基金

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

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。

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

根据信托契约，管理人可决定发行不同产品类别（分别称为“类别”），虽然各类别之资产将作共同投资，但各类别可应用特定的收费结构、货币或收益分配政策。由于各类别有不同的收费结构，因此每类别应占之资产净值可能不同。

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

2 主要会计政策

(a) 中期财务报表之财务政策

编制本未经审计简明中期财务报表所使用的会计政策和计算方法与截至二零一九年九月三十日止年度财务报表所采纳的会计政策和计算方法一致。

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公平值为负数的衍生性产品合约列示为按公平值透过损益列账的负债。

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

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公平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平值确认，其后以公平值重新计量。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。在非活跃市场中进行金融工具交易时，以市场报价、交易商/经纪报价或其他获可观察输入值支持的报价来源作为估值。

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。

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

(c) 外币交易

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按期/年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

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

(d) 销售份额所得款项及赎回份额支付款项

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

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

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产(每份额)

二零二零年三月三十一日

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目	20,192,909.919	8,483,880.779	1,371,981.435	3,988,024.989	1,313,194.697
	澳元	加元	欧元	英镑	港元
可赎回份额持有人应占净资产	135,193,603	58,498,296	9,903,243	28,225,916	13,067,986
可赎回份额持有人应占净资产(每份额)	6.70	6.90	7.22	7.08	9.95
	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	新加坡元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目	173,096,691.946	4,972,604.198	1,045,100.499	154,498,414.766	933,262.242
	港元	纽元	人民币	人民币	新加坡元
可赎回份额持有人应占净资产	1,245,652,836	33,864,409	12,045,758	1,152,516,462	6,528,543
可赎回份额持有人应占净资产(每份额)	7.20	6.81	11.53	7.46	7.00
	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额
已发行份额数目	219,298.464	38,815,971.166	9,666,973.340	3,834,601.730	3,901,792.430
	美元	美元	美元	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占净资产	2,195,138	279,856,081	72,100,151	30,971,103	29,906,335
可赎回份额持有人应占净资产(每份额)	10.01	7.21	7.46	8.08	7.66

二零二零年三月三十一日

	PRC 人民币对冲份 额(累计) 份额	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	22,176,239.960	29,336,533.310	4,107,123.230	3,522,442.460
	人民币	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应占净 资产	169,874,632	211,865,993	31,386,808	25,550,958
可赎回份额持有人应占净 资产(每份额)	7.66	7.22	7.64	7.25

二零一九年九月三十日

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别(累计) 份额
已发行份额数目	21,946,697.689	8,993,396.991	1,308,102.363	4,081,327.210	1,303,569.977
	澳元	加元	欧元	英镑	港元
可赎回份额持有人应占净 资产	193,608,672	80,850,394	12,102,153	37,565,455	16,439,998
可赎回份额持有人应占净 资产(每份额)	8.82	8.99	9.25	9.20	12.61
	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	新加坡元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目	188,901,398.104	5,243,144.814	1,245,112.340	167,755,889.102	858,356.178
	港元	纽元	人民币	人民币	新加坡元
可赎回份额持有人应占净 资产	1,766,391,160	46,786,352	17,917,356	1,610,018,603	7,743,081
可赎回份额持有人应占净 资产(每份额)	9.35	8.92	14.39	9.60	9.02

二零一九年九月三十日

	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额
已发行份额数目	282,082,535	42,455,259,956	8,990,171,597	4,896,425,720	3,716,417,790
	美元	美元	美元	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占净资产	3,538,027	393,250,535	85,817,827	49,939,511	36,880,292
可赎回份额持有人应占净资产(每份额)	12.54	9.26	9.55	10.20	9.92
	PRC 人民币对冲份额(累计) 份额	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	29,018,058,960	31,592,315,030	4,102,671,470	3,116,898,470	
	人民币	人民币	美元	美元	
可赎回份额持有人应占净资产	277,120,157	293,273,002	39,293,862	29,055,297	
可赎回份额持有人应占净资产(每份额)	9.55	9.28	9.58	9.32	

4 投资及衍生性产品净(亏损)/收益

	二零一九年 十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元	二零一八年 十月一日至 二零一九年 三月三十一日 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益/亏损之变动	(146,901,168)	76,499,029
投资及衍生性产品销售之实现亏损	(132,684,800)	(36,614,301)
	<u>(279,585,968)</u>	<u>39,884,728</u>

5 收益分配

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

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

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零一九年	二零一八年
					十月一日至 二零二零年 三月三十一日	十月一日至 二零一九年 三月三十一日
					美元	美元
澳元对冲类别(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	澳元 0.0259	21,497,886.443	(383,604)	
加元对冲类别(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	加元 0.0325	8,688,516.168	(214,841)	
欧元对冲类别(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	欧元 0.0153	1,268,840.344	(21,659)	
英镑对冲类别(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	英镑 0.0255	3,900,821.874	(128,715)	
港元类别(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	港元 0.0374	183,588,964.677	(876,051)	
纽元对冲类别(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	纽元 0.0287	5,307,394.133	(97,684)	
人民币对冲类别(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	人民币 0.0454	165,042,911.445	(1,063,637)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	新加坡元 0.0325	862,081.544	(20,587)	
美元类别(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0370	41,920,140.497	(1,551,045)	
美元 C 类别(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0382	8,976,545.159	(342,904)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	人民币 0.0438	32,331,147.540	(201,019)	
PRC 人民币份额(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	人民币 0.0393	3,794,647.750	(21,169)	
PRC 美元份额(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0372	3,250,644.460	(120,924)	
澳元对冲类别(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	澳元 0.0279	21,856,926.904	(412,474)	
加元对冲类别(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	加元 0.0351	8,530,411.815	(225,423)	
欧元对冲类别(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	欧元 0.0185	1,218,225.316	(24,849)	
英镑对冲类别(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	英镑 0.0281	3,854,922.261	(140,116)	
港元类别(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	港元 0.0373	188,305,315.416	(897,293)	
纽元对冲类别(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	纽元 0.0304	4,997,371.978	(97,518)	
人民币对冲类别(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	人民币 0.0463	162,349,758.888	(1,069,253)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	新加坡元 0.0332	850,814.858	(20,657)	
美元类别(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0370	42,150,679.905	(1,559,575)	
美元 C 类别(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0382	8,963,402.453	(342,402)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	人民币 0.0448	32,373,273.020	(206,306)	
PRC 人民币份额(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	人民币 0.0390	3,974,554.370	(22,050)	
PRC 美元份额(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0372	3,331,667.400	(123,938)	
澳元对冲类别(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	澳元 0.0280	21,514,995.203	(423,471)	
加元对冲类别(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	加元 0.0334	8,718,385.056	(224,557)	
欧元对冲类别(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	欧元 0.0141	1,198,332.439	(18,966)	
英镑对冲类别(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	英镑 0.0246	3,903,609.275	(127,214)	
港元类别(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	港元 0.0371	181,516,019.990	(864,273)	
纽元对冲类别(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	纽元 0.0309	4,833,491.655	(100,762)	
人民币对冲类别(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	人民币 0.0478	160,763,330.419	(1,103,277)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	新加坡元 0.0336	895,266.724	(22,371)	
美元类别(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0370	41,734,980.126	(1,544,194)	
美元 C 类别(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0382	9,059,697.954	(346,081)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	人民币 0.0462	31,266,284.420	(207,390)	
PRC 人民币份额(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	人民币 0.0389	3,707,393.410	(20,706)	
PRC 美元份额(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0372	3,270,476.900	(121,662)	
澳元对冲类别(每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	澳元 0.0282	20,409,757.916	(385,305)	
加元对冲类别(每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	加元 0.0342	8,523,041.496	(220,398)	
欧元对冲类别(每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	欧元 0.0162	1,252,139.247	(22,479)	
英镑对冲类别(每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	英镑 0.0267	3,795,507.118	(133,586)	
港元类别(每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	港元 0.0370	177,716,716.622	(846,826)	
纽元对冲类别(每月派息)	2020年1月31日	2020年2月11日	纽元 0.0311	4,903,264.004	(98,685)	
人民币对冲类别(每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	人民币 0.0475	156,960,000.635	(1,064,660)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	新加坡元 0.0339	896,036.521	(22,255)	
美元类别(每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	美元 0.0370	42,677,698.349	(1,579,075)	
美元 C 类别(每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	美元 0.0382	9,351,897.029	(357,242)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	人民币 0.0459	29,474,721.900	(192,820)	
PRC 人民币份额(每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	人民币 0.0381	3,600,051.810	(19,549)	
PRC 美元份额(每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	美元 0.0372	3,365,838.750	(125,209)	

二零一九年
十月一日至
二零二零年
三月三十一日
二零一八年
十月一日至
二零一九年
三月三十一日

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	美元	美元
澳元对冲类别(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	澳元 0.0299	20,075,354.162	(387,013)	
加元对冲类别(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	加元 0.0364	8,678,595.819	(235,334)	
欧元对冲类别(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	欧元 0.0198	1,384,719.168	(30,117)	
英镑对冲类别(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	英镑 0.0290	3,881,162.432	(143,765)	
港元类别(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	港元 0.0370	175,619,975.338	(833,812)	
纽元对冲类别(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	纽元 0.0320	4,979,132.868	(98,826)	
人民币对冲类别(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	人民币 0.0473	154,964,767.378	(1,048,587)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	新加坡元 0.0347	932,631.172	(23,187)	
美元类别(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0370	41,110,711.028	(1,521,096)	
美元 C 类别(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0383	9,449,461.782	(361,915)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	人民币 0.0457	28,427,169.360	(185,849)	
PRC 人民币份额(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	人民币 0.0389	3,903,590.650	(21,723)	
PRC 美元份额(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0372	3,470,967.750	(129,120)	
澳元对冲类别(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	澳元 0.0322	20,195,447.589	(398,012)	
加元对冲类别(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	加元 0.0348	8,483,880.779	(207,426)	
欧元对冲类别(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	欧元 0.0246	1,371,981.435	(37,033)	
英镑对冲类别(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	英镑 0.0302	3,985,244.616	(149,233)	
港元类别(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	港元 0.0369	173,212,545.913	(824,620)	
纽元对冲类别(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	纽元 0.0355	4,975,834.382	(104,722)	
人民币对冲类别(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	人民币 0.0432	154,369,753.878	(940,828)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	新加坡元 0.0342	933,262.242	(22,416)	
美元类别(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0370	38,968,349.450	(1,441,829)	
美元 C 类别(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0383	9,666,973.340	(370,245)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	人民币 0.0418	29,080,757.410	(171,493)	
PRC 人民币份额(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	人民币 0.0396	3,901,792.430	(21,798)	
PRC 美元份额(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0372	3,522,680.950	(131,044)	
澳元对冲类别(每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	澳元 0.0334	24,551,192.585	(581,182)	
加元对冲类别(每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	加元 0.0300	9,730,020.425	(222,275)	
欧元对冲类别(每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	欧元 0.0140	1,478,876.925	(23,459)	
英镑对冲类别(每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	英镑 0.0239	4,629,744.401	(141,384)	
港元类别(每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	港元 0.0373	225,391,244.892	(1,072,415)	
纽元对冲类别(每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	纽元 0.0338	6,686,206.644	(147,574)	
人民币对冲类别(每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	人民币 0.0564	186,614,300.992	(1,509,032)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2018年10月31日	2018年11月9日	新加坡元 0.0305	1,463,803.011	(32,240)	
美元类别(每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	美元 0.0370	56,330,916.220	(2,084,245)	
澳元对冲类别(每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	澳元 0.0322	24,217,069.015	(569,441)	
加元对冲类别(每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	加元 0.0313	9,571,749.729	(225,413)	
欧元对冲类别(每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	欧元 0.0153	1,468,673.886	(25,442)	
英镑对冲类别(每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	英镑 0.0249	4,556,991.697	(144,775)	
港元类别(每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	港元 0.0373	221,992,751.135	(1,058,088)	
纽元对冲类别(每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	纽元 0.0327	6,468,702.591	(145,298)	
人民币对冲类别(每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	人民币 0.0480	182,690,352.230	(1,260,685)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	新加坡元 0.0303	1,360,393.754	(30,044)	
美元类别(每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	美元 0.0370	55,366,396.874	(2,048,558)	
澳元对冲类别(每月派息)	2018年12月31日	2019年1月9日	澳元 0.0310	24,055,256.692	(524,982)	
加元对冲类别(每月派息)	2018年12月31日	2019年1月9日	加元 0.0288	9,644,159.542	(203,362)	
欧元对冲类别(每月派息)	2018年12月31日	2019年1月9日	欧元 0.0096	1,467,997.762	(16,110)	
英镑对冲类别(每月派息)	2018年12月31日	2019年1月9日	英镑 0.0203	4,540,989.065	(117,403)	
港元类别(每月派息)	2018年12月31日	2019年1月9日	港元 0.0372	215,973,759.409	(1,026,167)	
纽元对冲类别(每月派息)	2018年12月31日	2019年1月9日	纽元 0.0319	6,236,866.146	(133,410)	
人民币对冲类别(每月派息)	2018年12月31日	2019年1月9日	人民币 0.0442	181,256,663.433	(1,166,104)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2018年12月31日	2019年1月9日	新加坡元 0.0305	1,360,884.875	(30,453)	
美元类别(每月派息)	2018年12月31日	2019年1月9日	美元 0.0370	54,444,331.780	(2,014,440)	
澳元对冲类别(每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	澳元 0.0310	24,985,687.912	(564,768)	
加元对冲类别(每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	加元 0.0285	9,843,324.929	(213,611)	
欧元对冲类别(每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	欧元 0.0111	1,401,655.119	(17,852)	
英镑对冲类别(每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	英镑 0.0216	4,543,925.858	(129,110)	
港元类别(每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	港元 0.0374	218,685,568.516	(1,042,329)	
纽元对冲类别(每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	纽元 0.0304	6,797,364.409	(143,325)	
人民币对冲类别(每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	人民币 0.0406	185,275,660.724	(1,121,410)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	新加坡元 0.0298	1,117,921.883	(24,775)	
美元类别(每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	美元 0.0370	56,868,080.566	(2,104,119)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零一九年	二零一八年
					十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元	十月一日至 二零一九年 三月三十一日 美元
澳元对冲类别(每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	澳元 0.0312	26,093,571.829		(579,205)
加元对冲类别(每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	加元 0.0297	9,734,008.495		(219,514)
欧元对冲类别(每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	欧元 0.0138	1,364,075.476		(21,435)
英镑对冲类别(每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	英镑 0.0228	4,639,193.795		(140,689)
港元类别(每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	港元 0.0374	216,040,538.393		(1,029,315)
纽元对冲类别(每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	纽元 0.0303	6,207,285.394		(128,177)
人民币对冲类别(每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	人民币 0.0342	190,081,900.683		(970,964)
新加坡元对冲类别(每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	新加坡元 0.0308	1,065,669.074		(24,291)
美元类别(每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	美元 0.0370	57,675,825.633		(2,134,006)
澳元对冲类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	澳元 0.0309	25,393,310.165		(557,378)
加元对冲类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	加元 0.0288	9,619,742.735		(207,379)
欧元对冲类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	欧元 0.0110	1,901,136.043		(23,482)
英镑对冲类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	英镑 0.0213	4,344,365.840		(120,578)
港元类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	港元 0.0374	217,176,054.543		(1,034,705)
纽元对冲类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	纽元 0.0303	5,645,290.840		(116,658)
人民币对冲类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	人民币 0.0374	187,316,881.244		(1,042,407)
新加坡元对冲类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	新加坡元 0.0306	941,212.710		(21,263)
美元类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	美元 0.0370	57,853,279.825		(2,140,572)
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	人民币 0.0363	12,540,956.210		(67,737)
PRC 人民币份额(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	人民币 0.0372	912,007.830		(5,048)
PRC 美元份额(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	美元 0.0373	576,831.520		(21,516)
可赎回份额持有人之总收益分配						
					(30,219,749)	(32,521,597)

6 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。由本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。

