

半年度报告 — 2020年3月31日（未经审核）

# 摩根国际债券基金

内地与香港互认基金系列



中国内地代理人:

**上投摩根**  
基金 管 理

基金管理人:

**摩根**  
资 产 管 理

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

本报告可能包含本基金若干并未获认可在中国内地发售或分销之股份类别。投资者应注意，本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 - 6
投资组合持有变动表	6 - 7
财务状况表	8
综合收益表	8
可赎回份额持有人应占净资产变动表	9
现金流量表	9
财务报表之附注	10 - 16

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	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
<b>上市投资 (98.8%)</b>			<b>百慕大 (0.2%)</b>		
			China Res Gas 4.5%		
			05/04/22-RegS	美元 1,500,000	1,606,763 0.2
<b>(I) 债务证券 (75.0%)</b>			<b>巴西 (0.1%)</b>		
<b>澳大利亚 (3.6%)</b>			Banco do Brasil 4.625%		
APT Pipelines 4.2%			15/1/25-RegS	美元 1,000,000	987,822 0.1
23/03/25-RegS	美元 500,000	527,465 0.0			
Ausgrid Finance			<b>加拿大 (4.5%)</b>		
4.35% 01/08/28-			British Columbia 2.2%		
RegS	美元 500,000	571,775 0.1	18/06/30	加元 1,000,000	723,885 0.1
Ausnet Serv VRN			British Columbia 4.3%		
5.75% 03/76-RegS	美元 500,000	503,698 0.0	18/06/42	加元 1,000,000	920,811 0.1
Australian Govt No124			Canada Govt Of 10.5%		
5.75% 15/5/21	澳元 2,400,000	1,591,354 0.2	15/03/21	加元 2,360,000	1,823,414 0.2
Australian Govt No138			Canada Govt Of 2.5%		
3.25% 21/4/29	澳元 14,070,000	10,660,006 1.1	01/06/24	加元 2,200,000	1,682,414 0.2
Australian Govt			Canada Govt Of 2.75%		
No140 4.5%/4/33-			01/12/48	加元 1,400,000	1,333,034 0.1
RegS	澳元 6,600,000	5,901,515 0.6	Canada Govt Of 5%		
Australian Govt No150			01/06/37	加元 6,655,000	7,553,866 0.8
3% 03/47-RegS	澳元 5,000,000	3,967,971 0.4	Canada Govt Of 2.25%		
Commonwealth Bk AU			01/06/29	加元 18,920,000	15,190,101 1.6
0.5% 07/26-RegS	欧元 1,000,000	1,120,075 0.1	Hydro-Quebec 4%		
Mirvac Group 3.625%			15/02/55	加元 300,000	282,969 0.0
18/03/27-RegS	美元 600,000	634,086 0.1	Hydro-Quebec No19 6.5%		
Queensland No23			15/02/35	加元 1,700,000	1,802,010 0.2
4.25%/7/23-			Ontario Prov Of 2.6%		
RegS/144A	澳元 900,000	619,276 0.1	02/06/25	加元 600,000	447,558 0.0
Queensland No24			Ontario Prov Of 2.7%		
5.75% 22/7/24-			02/06/29	加元 1,000,000	758,300 0.1
RegS	澳元 2,000,000	1,493,350 0.1	Ontario Prov Of 3.5%		
Queensland Try 3.5%			02/06/24	加元 3,750,000	2,889,085 0.3
08/30-RegS/144A			Ontario Prov Of 4%		
SGSP (Aust) Stp Cpn			02/06/21	加元 1,500,000	1,107,466 0.1
3.3% 09/04/23	美元 1,950,000	2,092,152 0.2	Province of Alberta 2.2%		
Sydney Airport Fin			26/07/22	美元 1,000,000	1,037,683 0.1
3.625% 4/26-RegS	美元 500,000	514,828 0.0	Quebec Prov Of 2.5%		
Transurban Queen			20/04/26	美元 500,000	547,925 0.0
4.5% 19/04/28-			Quebec Prov Of 2.6%		
RegS	美元 500,000	578,913 0.1	06/07/25	加元 2,700,000	2,016,894 0.2
Treasury Corp			Quebec Prov Of 3.75%		
Victoria 5.5%			01/09/24	加元 1,250,000	969,172 0.1
12/24	澳元 2,000,000	1,507,172 0.2	Quebec Prov Of 4.2%		
Westpac Banking			10/03/25-RegS	澳元 1,200,000	840,612 0.1
0.375%/02/04/26-			Quebec Prov Of 5%		
RegS	欧元 850,000	949,925 0.1	01/12/41	加元 1,650,000	1,651,445 0.2
<b>奥地利 (0.2%)</b>			<b>开曼群岛 (0.5%)</b>		
Austria Rep 1.5%			CDBL Funding I 3.5%		
20/02/47-			24/10/27-RegS	美元 250,000	277,765 0.0
RegS/144A	欧元 830,000	1,147,263 0.1	Hutchison Wham Int12		
Suzano Austria 7%			3.25% 22-RegS	美元 1,000,000	1,034,800 0.1
16/03/47-RegS	美元 400,000	383,424 0.1	Kuwait Projects 5%		
<b>比利时 (0.2%)</b>			15/03/23	美元 1,000,000	1,009,311 0.1
Belgium Kingdom			QNB Finance 2.125%		
No71 3.75%/45-			07/09/21-RegS	美元 450,000	439,684 0.1
RegS	欧元 845,000	1,612,006 0.2			
Belgium KingNo78					
1.6%/47-					
RegS/144A	欧元 390,000	523,803 0.0			

投资组合 (续)

(续)

截至二零二零年三月三十一日 (未经审计)

	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
<b>开曼群岛 (续)</b>				Dexia Credit 1.625% 08/12/23-RegS	英镑 600,000	770,683	0.1
Saudi Elec Global 5.06% 8/4/43-RegS	美元 300,000	305,822	0.0	Dexia Credit Local 1.25% 11/24-RegS	欧元 1,200,000	1,407,272	0.1
Tencent Hldgs 3.975% 11/04/29-RegS	美元 1,000,000	1,127,015	0.1	France OAT 3.25% 25/05/45-RegS	欧元 400,000	713,531	0.1
Three Gorges Fin 1.3% 21/06/24-RegS	欧元 405,000	454,728	0.1	France OAT 3.5% 25/04/26	欧元 2,000,000	2,773,200	0.3
Three Gorges Fin 1.7% 10/06/22-RegS	欧元 200,000	227,416	0.0	France OAT 5.5% 25/04/29	欧元 10,500,000	17,970,574	1.8
<b>智利 (0.1%)</b>				France OAT 5.75% 25/10/32	欧元 5,444,000	10,298,069	1.1
Codelco 4.5% 13/08/23-RegS	美元 1,000,000	1,039,875	0.1	<b>德国 (0.9%)</b>			
<b>中国 (7.0%)</b>				Bundesrep Deut 0% 15/08/50-RegS	欧元 5,500,000	5,995,045	0.6
China Dev Bank No1910 3.65% 21/5/29	人民币 30,000,000	4,543,422	0.5	Kredit fuer Wied 2% 02/05/25	美元 1,400,000	1,507,007	0.2
China Dev Bank No1915 3.45% 20/9/29	人民币 100,000,000	14,818,047	1.6	Landwirtsch Renten 0.5% 02/29-RegS	欧元 700,000	802,717	0.1
China Dev Bank No2003 3.23% 10/1/25	人民币 60,000,000	8,762,925	0.9	<b>希腊 (1.0%)</b>			
China Dev Bank 1.25% 21/01/23-RegS	英镑 824,000	1,010,768	0.1	Alpha Bank 2.5% 05/02/23-RegS	欧元 2,000,000	2,299,036	0.2
China Govt 0.125% 12/11/26-RegS	欧元 1,177,000	1,272,584	0.1	Hellenic Repub 1.875%2/35- RegS/144A	欧元 4,000,000	4,514,649	0.5
China Govt 0.5% 12/11/31-RegS	欧元 839,000	879,328	0.1	Hellenic Repub 3.875%3/29- RegS/144A	欧元 1,920,000	2,500,094	0.3
China Govt Bond No1913 2.94% 10/24	人民币 100,000,000	14,696,011	1.5	<b>冰岛 (0.2%)</b>			
China Govt Bond No1915 3.13% 21/11/2	人民币 140,000,000	20,872,584	2.2	Iceland Rep Of 0.5% 20/12/22-RegS	欧元 1,500,000	1,678,360	0.2
Export-Imp Bk CN 0.75%28/05/23- RegS	欧元 200,000	224,274	0.0	<b>印度 (0.0%)</b>			
Ind & Comm Bk CN 4.875%21/9/25- RegS	美元 300,000	324,327	0.0	NTPC Ltd 4.25% 26/02/26-RegS	美元 200,000	191,490	0.0
<b>哥伦比亚 (0.1%)</b>				<b>印度尼西亚 (0.6%)</b>			
Ecopetrol SA 5.375% 26/06/26	美元 600,000	592,460	0.1	Pertamina Persero 6.5% 27/5/41-RegS	美元 300,000	340,596	0.0
<b>塞浦路斯 (0.6%)</b>				Perusahaan Listrik 2.875%10/25-RegS	欧元 400,000	458,953	0.1
Cyprus Rep Of 0.625% 03/12/24-RegS	欧元 620,000	681,689	0.1	Perusahaan Listrik 1.875% 11/31- RegS	欧元 1,500,000	1,517,879	0.2
Cyprus Rep Of 2.375% 25/09/28-RegS	欧元 4,312,000	5,292,547	0.5	Rep of Indonesia 1.4% 30/10/31	欧元 1,259,000	1,206,604	0.1
<b>法国 (3.7%)</b>				Rep of Indonesia 1.45% 18/09/26	欧元 397,000	405,120	0.0
BPCE SA 5.7% 22/10/23-RegS	美元 1,000,000	1,079,083	0.1	Rep of Indonesia 3.375% 07/25-RegS	欧元 400,000	458,644	0.1
Dexia Credit 1% 18/10/27-RegS	欧元 1,000,000	1,179,857	0.1	Rep of Indonesia 3.75% 25/4/22- RegS	美元 1,000,000	1,028,304	0.1

投资组合 (续)

(续)

截至二零二零年三月三十一日 (未经审计)

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
<b>跨国性 (0.6%)</b>			Central Nippon Exp		
African Exp&Imp			2.362% 5/21-RegS	美元 700,000	720,927 0.1
5.25% 11/10/23-RegS	美元 1,000,000	982,438 0.1	Chiba Bank 2.65%		
Asian Dev Ba NoGMTN			30/10/24-RegS	美元 1,000,000	1,062,099 0.1
0.625% 07/04/22	美元 1,853,000	1,851,314 0.2	Dev Bank of Japan		
Euro Stability 0.5%			0.875% 10/25-RegS	欧元 400,000	460,805 0.0
02/03/26-RegS	欧元 1,300,000	1,487,492 0.1	Dev Bank of Japan 2%		
European Fin Stab			19/10/21-RegS	美元 1,000,000	1,029,206 0.1
1.8% 10/77/48-RegS	欧元 400,000	592,178 0.1	Japan Fin Org 0.875%		
Inter-American Dev			22/09/21-RegS	欧元 800,000	896,489 0.1
3.2% 07/08/42	美元 500,000	645,669 0.1	Japan Fin Org 3.375%		
			27/09/23-RegS	美元 1,000,000	1,084,419 0.1
			JGB No1 (30Yr) 2.8%		
			20/09/29	日元 416,050,000	4,877,216 0.5
			JGB No1 (40Yr) 2.4%		
			20/03/48	日元 450,000,000	6,356,353 0.7
			JGB No10 (40Yr) 0.9%		
			20/03/57	日元 317,450,000	3,409,293 0.4
			JGB No151 (20Yr) 1.2%		
			20/12/34	日元 519,800,000	5,484,665 0.6
			JGB No160 (20Yr)		
			0.7% 20/03/37	日元 599,650,000	5,921,958 0.6
			JGB No20 (30Yr) 2.5%		
			20/09/35	日元 2,790,400,000	34,556,499 3.6
			JGB No37 (30Yr) 1.9%		
			20/09/42	日元 528,200,000	6,536,874 0.7
			JGB No4 (40Yr) 2.2%		
			20/03/51	日元 828,350,000	11,644,882 1.2
			JPN Bank for Intl 1.5%		
			21/07/21	美元 500,000	506,554 0.0
			JPN Bank for Intl 2.5%		
			01/06/22	美元 1,000,000	1,045,283 0.1
			JPN Bank for Intl		
			3.25% 20/07/28	美元 1,000,000	1,165,200 0.1
			Kansai Elec Power		
			2.55% 09/24-RegS	美元 800,000	789,762 0.1
			Mitsui Fudosan 2.95%		
			23/01/23-RegS	美元 200,000	205,469 0.0
			Sumitomo Mitsui Bk		
			0.409%11/29-RegS	欧元 2,000,000	2,205,103 0.2
			<b>韩国 (0.4%)</b>		
			Korea Dev Bank 0%		
			10/07/24-RegS	欧元 429,000	465,189 0.0
			Korea Dev Bank		
			0.625% 17/07/23-RegS	欧元 450,000	503,131 0.1
			Korea Housing 0.1%		
			18/06/24-RegS	欧元 1,199,000	1,315,454 0.1
			Korea Housing 0.75		
			30/10/23-RegS	欧元 799,000	901,650 0.1
			NongHyup Bank		
			1.875% 12/09/21-RegS	美元 1,000,000	1,005,892 0.1
			<b>卢森堡 (0.4%)</b>		
			European Fin Stab		
			0.75% 05/27-RegS	欧元 1,550,000	1,815,017 0.2
			European Fin Stab		
			2.35% 07/44-RegS	欧元 470,000	761,086 0.1
			<b>日本 (9.4%)</b>		
			Central Nippon Exp		
			2.091% 9/21-RegS	美元 500,000	509,725 0.1

投资组合 (续)

(续)

截至二零二零年三月三十一日 (未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
<b>卢森堡 (续)</b>				<b>卡塔尔 (0.0%)</b>			
European Inv Bank 4.875% 15/02/36	美元 800,000	1,198,892	0.1	State of Qatar 2.375% 02/06/21-RegS	美元 200,000	201,093	0.0
<b>墨西哥 (0.7%)</b>				<b>沙特阿拉伯 (0.1%)</b>			
Mexican Bds Desarr 10% 05/12/24	墨西哥比索 386,900	1,916,521	0.2	Saudi Intl Bond 0.75% 09/07/27-RegS	欧元 1,070,000	1,124,068	0.1
Mexican Bds Desarr NoM20 8.5% 05/29	墨西哥比索 300,000	1,405,409	0.2	<b>新加坡 (0.2%)</b>			
Petroleos Mexic 8.25% 02/06/22-RegS	英镑 300,000	367,716	0.0	CMT MTN Pte 3.609% 04/04/29-RegS	美元 500,000	558,897	0.0
Petroleos Mexicanos 2.5% 11/22-RegS	欧元 700,000	662,320	0.1	Temasek Fin I 0.5% 01/03/22-RegS	欧元 700,000	773,893	0.1
United Mexican States 4.6% 10/02/48	美元 2,150,000	2,169,123	0.2	Temasek Fin I 0.5% 20/11/31	欧元 618,000	661,499	0.1
<b>摩洛哥 (0.0%)</b>				Temasek Fin I 1.5% 01/03/28-RegS	欧元 400,000	476,085	0.0
OCP SA 6.875% 25/04/44-RegS	美元 300,000	338,665	0.0	<b>西班牙 (3.0%)</b>			
<b>荷兰 (0.8%)</b>				Liberbank SA 0.25% 25/09/29-RegS	欧元 1,000,000	1,078,313	0.1
ABN Amro Bank 1.125% 23/04/39-RegS	欧元 900,000	1,106,990	0.1	Spain Kingdom Of 0.5%4/30-RegS/144A	欧元 13,300,000	14,385,760	1.5
BNG Bank 0.875% 24/10/36-RegS	欧元 600,000	719,231	0.1	Spain Kingdom Of 4.65% 30/07/25	欧元 1,460,000	2,027,959	0.2
BNG Bank 5.2% 07/12/28-RegS	英镑 400,000	681,978	0.1	Spain Kingdom Of 5.4%1/23-RegS&144A	欧元 5,500,000	7,012,070	0.7
Neder Waterscha 1.25% 27/05/36-RegS	欧元 600,000	760,419	0.1	Spain Kingdom Of2.7%10/48- RegS/144A	欧元 3,000,000	4,237,262	0.5
Neder Waterscha 3.4% 22/07/25-RegS	澳元 1,800,000	1,229,771	0.1	<b>国际 (0.3%)</b>			
Netherlands Govt 2.75% 15/01/47	欧元 260,000	483,116	0.0	African Dev Bk 0.5% 21/03/29	欧元 500,000	572,710	0.0
NIB Capital Bank 0.5% 19/03/27-RegS	欧元 1,700,000	1,909,306	0.2	Asian Dev Bank 1.375% 07/03/25	英镑 500,000	640,305	0.1
NN Bank Netherlands 0.125%9/29-RegS	欧元 600,000	647,783	0.0	European Inv Bank 4% 15/10/37	欧元 350,000	635,425	0.1
NXP BV/NXP Fdg 3.875% 01/09/22- RegS	美元 670,000	674,519	0.1	European Union 3.75% 04/04/42	欧元 710,000	1,364,613	0.1
<b>新西兰 (0.4%)</b>				<b>瑞典 (0.1%)</b>			
ASB Fin London 0.625% 18/10/24- RegS	欧元 973,000	1,099,049	0.1	Swedish Export 0.75% 06/04/23	美元 1,404,000	1,399,690	0.1
Auckland Council 0.125% 09/29-RegS	欧元 1,500,000	1,619,939	0.2	<b>泰国 (0.3%)</b>			
BNZ Intl Funding 2.65% 3/11/22-RegS	美元 1,000,000	1,010,218	0.1	Thailand Govt 2.4% 17/12/23	泰铢 45,000,000	1,452,178	0.1
<b>葡萄牙 (0.4%)</b>				Thailand Govt 3.775% 25/06/32	泰铢 23,000,000	867,874	0.1
Obrigacoes Tes2.875%10/25- RegS/144A	欧元 2,700,000	3,405,999	0.3	Thailand Govt of 3.3% 17/06/38	泰铢 24,000,000	888,984	0.1
Portugal Rep Of 5.125%15/10/24- 144A	美元 500,000	576,837	0.1	<b>土耳其 (0.5%)</b>			
				Rep of Turkey 5.75% 11/05/47	美元 2,800,000	2,137,018	0.2
				Rep of Turkey 7.625% 26/04/29	美元 2,350,000	2,326,833	0.3

投资组合 (续)

(续)

截至二零二零年三月三十一日 (未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
<b>阿拉伯联合酋长国 (0.1%)</b>				US Treasury 2.25%			
ABU Dhabi Natl 4.875% 23/04/30- RegS	美元 300,000	318,369	0.0	15/08/46	美元 10,300,000	12,487,057	1.3
DP World 2.375% 25/09/26-RegS	欧元 400,000	415,996	0.1	US Treasury 2.5%	美元 4,000,000	5,061,387	0.5
				15/02/46			
<b>英国 (2.8%)</b>				US Treasury 3%	美元 6,770,000	9,495,733	1.0
Lloyds Bank 0.25% 25/03/24-RegS	欧元 1,089,000	1,164,259	0.1	15/02/49			
Nationwide Bldg 0.75% 26/10/22- RegS	欧元 1,000,000	1,123,516	0.1	US Treasury 3.125%	美元 4,280,000	6,139,007	0.6
UK Treasury 3.5% 22/07/68-RegS	英镑 1,250,000	3,364,745	0.3	15/05/48			
UK Treasury 3.75% 22/07/52-RegS	英镑 2,730,000	6,301,538	0.6	US Treasury 5.5%	美元 15,000,000	21,099,570	2.2
UK Treasury 4.75% 07/12/38	英镑 5,240,000	11,186,822	1.2	15/08/28	美元 33,960,000	53,310,027	5.5
UK Treasury 5% 07/03/25-RegS	英镑 1,010,000	1,551,657	0.2	US Treasury 6.25%	美元 6,047,500	7,301,931	0.8
UK Treasury 8% 07/06/21	英镑 1,170,000	1,622,299	0.2	15/05/30			
				US Treasury 6.25%	美元 6,047,500	7,301,931	0.8
<b>美国 (23.9%)</b>				15/08/23			
Amazon.com 4.8% 05/12/34	美元 600,000	790,962	0.1	US Treasury 7.625%	美元 30,040,000	40,803,567	4.2
Bank of New York Mellon 3% 24/02/25	美元 1,000,000	1,047,367	0.1	15/02/25			
Brambles USA 4.125% 23/10/25-RegS	美元 500,000	539,079	0.1	US Treasury IL Nts 1% 15/02/48	美元 15,000,000	19,271,947	2.0
Bristol-Myers 3.9% 20/02/28-RegS	美元 600,000	672,529	0.1	Verizon Commun 3.125% 16/03/22	美元 1,000,000	1,035,229	0.1
Comcast Corp 3.3% 01/02/27	美元 1,000,000	1,053,020	0.1	Walt Disney 3.7%	美元 600,000	669,171	0.1
CVS Health 4.3% 25/03/28	美元 1,000,000	1,051,806	0.1	23/03/27			
General Motors Fin 3.7% 09/05/23	美元 300,000	282,281	0.0	Wells Fargo & Co 4.1% 03/06/26	美元 500,000	528,211	0.0
HCA Inc 4.5% 15/02/27	美元 1,000,000	1,044,815	0.1	Wells Fargo VRN 2.164% 11/02/26	美元 800,000	788,773	0.1
Massmutual Glb Fund 2.5% 10/22-RegS	美元 200,000	201,958	0.0	<b>维京群岛 (0.5%)</b>			
Metropolitan Life 3% 19/09/27-RegS	美元 1,000,000	1,007,603	0.1	Cheung Kong Infra Fin 1% 12/24-RegS	欧元 450,000	491,359	0.0
Nike Inc 2.75% 27/03/27	美元 600,000	626,059	0.1	Franshion Brilliant 3.6% 03/22-RegS	美元 1,000,000	1,026,850	0.1
Oracle Corp 3.25% 15/11/27	美元 700,000	731,627	0.1	JIC Zhixin 0.5% 24/11/20-RegS	欧元 500,000	548,906	0.1
Pfizer Inc 3.45% 15/03/29	美元 1,000,000	1,091,879	0.1	JIC Zhixin 3% 24/11/22-RegS	美元 500,000	523,958	0.1
Southern Copper 7.5% 27/07/35	美元 1,000,000	1,199,038	0.1	State Grid Overseas 1.25% 5/22-RegS	欧元 300,000	336,223	0.0
US Treasury 1.125% 28/02/22	美元 34,000,000	34,605,682	3.6	Xingsheng BVI 3.375% 25/07/22- RegS	美元 1,000,000	1,045,631	0.1
US Treasury 1.5% 15/02/30	美元 6,000,000	6,486,217	0.7	Xingsheng BVI 4.5% 20/09/21-RegS	美元 600,000	623,880	0.1
						723,467,865	75.0
						-----	-----
				<b>(II) 集体投资计划 (24.1%)</b>			
				<b>卢森堡 (24.1%)</b>			
				JPMF-JPM Global Corp Bd'X'-dist- USD**	2,244,312	232,847,410	24.1
						-----	-----
				<b>(III) 衍生性产品 (-0.3%)</b>			
				<b>远期外汇合约 (-0.4%)</b>		(3,962,109)	(0.4)



投资组合 (续)

截至二零二零年三月三十一日 (未经审计)

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)

单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
<b>期货 (0.1%)</b>		
Euro BUXL 30Yr Bd (EUX) Fut 06/20 (30)	65,045	0.0
Euro-BOBL (EUX) Fut 06/20 (280)	(393,254)	(0.1)
Euro-BTP (EUX) Fut 06/20 38	(44,768)	(0.0)
Euro-Bund (EUX) Fut 06/20 110	221,206	0.0
Euro-OAT (EUX) Fut 06/20 (62)	(202,552)	(0.0)
JGB 10Yr Bond (OSE) Fut 06/20 31	(135,612)	(0.0)
Long Gilt (LIF) Fut 06/20 (79)	96,976	0.0
US 10Yr Note (CBT) Fut 06/20 187	367,719	0.1
US Ultra Bond (CBT) Fut 06/20 55	725,938	0.1
	<u>(3,261,411)</u>	<u>(0.3)</u>
<b>总上市投资</b>	<b>953,053,864</b>	<b>98.8</b>
<b>其他净资产</b>	<b>11,288,366</b>	<b>1.2</b>
<b>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</b>	<b>964,342,230</b>	<b>100.0</b>
<b>总投资, 按成本</b>	<b>952,233,072</b>	

\* 由管理人的关联人士发行和管理

# 未有在香港获得认可, 且不可向香港居民提供

	持有占资产净值百分比	
	二零二零年 三月三十一日	二零一九年 九月三十日
<b>上市投资</b>		
<b>债务证券</b>		
美国	23.9	17.6
日本	9.4	19.3
中国	7.0	2.1
意大利	6.3	2.9
加拿大	4.5	3.6
法国	3.7	2.8
澳大利亚	3.6	3.0
西班牙	3.0	3.7
英国	2.8	4.1
希腊	1.0	0.1
德国	0.9	1.1
荷兰	0.8	1.3
墨西哥	0.7	0.4
塞浦路斯	0.6	0.5
跨国性	0.6	0.3
印度尼西亚	0.6	0.7
开曼群岛	0.5	0.5
维京群岛	0.5	0.3
土耳其	0.5	-
韩国	0.4	0.5
葡萄牙	0.4	1.2
卢森堡	0.4	0.4
新西兰	0.4	0.4
国际	0.3	0.6
泰国	0.3	0.3
新加坡	0.2	0.2
比利时	0.2	0.7
冰岛	0.2	0.2
百慕大	0.2	-
爱尔兰	0.2	0.2
奥地利	0.2	0.5
瑞典	0.1	-
沙特阿拉伯	0.1	0.2
智利	0.1	0.0
巴西	0.1	-
阿拉伯联合酋长国	0.1	0.2
以色列	0.1	0.2
哥伦比亚	0.1	0.1
摩洛哥	0.0	0.0
卡塔尔	0.0	0.1
印度	0.0	0.0
波兰	-	0.2
斯洛文尼亚	-	0.2
芬兰	-	0.2
匈牙利	-	0.1
哈萨克斯坦	-	0.1
斯洛伐克	-	0.1
香港	-	0.1
科威特	-	0.1
丹麦	-	0.0

投资组合持有变动表(续)

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

集体投资计划

卢森堡	24.1	23.2
欧洲	-	1.8
跨国性	-	1.5

衍生性产品

期货	0.1	0.0
远期外汇合约	(0.4)	0.4

总上市投资	98.8	98.3
-------	------	------

其他净资产	1.2	1.7
-------	-----	-----

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
<b>资产</b>		
银行现金	24,268,245	22,744,035
应收经纪款项	12,711,379	3,964,578
分配应收款项	7,139,859	22,449,089
保证金	1,728,257	322,843
衍生性产品	17,242,102	8,026,730
投资	956,315,275	1,009,125,661
利息及其他应收款项	1,710	13,138
<b>总资产</b>	<u>1,019,406,827</u>	<u>1,066,646,074</u>
<b>负债</b>		
应付经纪款项	24,786,945	22,995,931
赎回应付款项	5,976,299	5,548,291
应付收益分配[附注 5]	2,996,328	2,860,807
衍生性产品	20,503,513	3,622,129
其他应付款项	801,512	820,523
<b>总负债(不含可赎回份额持有人 应占净资产)</b>	<u>55,064,597</u>	<u>35,847,681</u>
<b>可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]</b>	<u>964,342,230</u>	<u>1,030,798,393</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
<b>收入</b>		
投资及衍生性产品净(亏损)/ 收益 [附注 4]	(2,917,480)	25,508,095
股息收入	97,909	72,405
存款利息	30,320	32,591
汇兑净(亏损)/收益	(1,702,888)	389,419
其他收入	17	119
	<u>(4,492,122)</u>	<u>26,002,629</u>
<b>支出</b>		
管理费用	4,166,650	1,884,169
托管费用及银行费用	195,741	81,142
受托人费用	93,958	42,338
基金注册登记机构费用	49,538	26,018
法律及专业费用	36,421	101,113
核数师酬金	20,154	10,826
交易成本	12,385	8,730
印刷及出版支出	568	646
其他经营费用	1,687	854
	<u>4,577,102</u>	<u>2,155,836</u>
<b>净经营(亏损)/利润</b>	<u>(9,069,224)</u>	<u>23,846,793</u>
<b>财务成本</b>		
收益分配[附注 5]	(15,961,516)	(8,124,384)
利息支出	(203)	(1,662)
	<u>(15,961,719)</u>	<u>(8,126,046)</u>
<b>除税前(亏损)/利润</b>	<u>(25,030,943)</u>	<u>15,720,747</u>
税项	(475,443)	(6,212)
<b>可赎回份额持有人应占净资产 及总综合收益之(减少)/增 加</b>	<u>(25,506,386)</u>	<u>15,714,535</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	1,030,798,393	355,844,823
分配可赎回份额	551,413,915	452,149,918
赎回可赎回份额	(592,363,692)	(314,392,449)
<b>净(赎回)/分配</b>	<b>(40,949,777)</b>	<b>137,757,469</b>
	989,848,616	493,602,292
可赎回份额持有人应占净资产及 总综合收益之(减少)/增加	(25,506,386)	15,714,535
期末可赎回份额持有人应占净资产	964,342,230	509,316,827

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
<b>经营业务</b>		
购入投资及衍生性产品	(956,898,592)	(347,850,393)
出售投资及衍生性产品所得款项	1,007,501,723	222,556,206
已收股息	97,909	72,405
已收利息	36,901	32,028
已付交易费用	(15,790)	(10,743)
已付受托人费用	(92,264)	(39,776)
已付基金注册登记机构费用	(103,222)	(43,866)
已付税项	(459,440)	(4,012)
保证金之增加	(1,405,414)	(229,329)
已付管理费用	(4,098,167)	(1,770,155)
其他	(2,027,985)	217,946
<b>经营业务所产生/(运用)之现金净额</b>	<b>42,535,659</b>	<b>(127,069,689)</b>
<b>融资活动</b>		
已付利息	(203)	(1,662)
分配可赎回份额所得款项	566,723,145	451,242,894
赎回可赎回份额付款	(591,935,684)	(310,966,327)
已付收益分配	(15,825,995)	(7,853,355)
<b>融资活动所(运用)/产生之现金净额</b>	<b>(41,038,737)</b>	<b>132,421,550</b>
<b>现金及现金等价物之增加</b>	<b>1,496,922</b>	<b>5,351,861</b>
期初现金及现金等价物	22,744,035	6,526,585
现金及现金等价物之汇兑收益/(亏损)	27,288	(46,803)
<b>期末现金及现金等价物</b>	<b>24,268,245</b>	<b>11,831,643</b>
<b>现金及现金等价物余额分析:</b>		
银行现金	24,268,245	11,831,643

财务报表之附注

1 本基金

摩根国际债券基金（“本基金”）根据一九七九年四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。

本基金的投资目标旨在通过主要投资于环球投资级别债务证券，取得比环球债券市场更高的回报。

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。

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) 证券借贷**

本基金可订立以卖空为目的之证券借贷安排。短仓指提供已售，但尚未购买的证券之责任，并以投资的公平值列账。于期/年内借来的证券为资产负债表外交易，因此不包括在基金的投资组合中。证券借贷有关的抵押品一般包括现金抵押，并分开纳入财务状况表内。

**(d) 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。

**(e) 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	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
已发行份额数目	8,019,549.391	5,865,943.819	114,008,590.141	3,197,069.417	482,650.250
	澳元	加元	港元	纽元	人民币
可赎回份额持有人应占净资产	79,524,281	58,284,943	1,135,004,429	31,729,782	6,206,591
可赎回份额持有人应占净资产(每份额)	9.92	9.94	9.96	9.92	12.86
	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元类别 (每半年派息) 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	66,740,121.134	32,406,577.558	1,110,634.691	24,681,804.770	14,862,046.000
	人民币	美元	美元	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占净资产	655,940,121	322,704,845	24,998,354	275,334,133	159,693,800
可赎回份额持有人应占净资产(每份额)	9.83	9.96	22.51	11.16	10.75
	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	23,578,202.830	24,791,589.130	7,226,060.620	5,827,578.510	
	人民币	人民币	美元	美元	
可赎回份额持有人应占净资产	251,724,345	252,857,954	76,388,524	59,407,228	
可赎回份额持有人应占净资产(每份额)	10.68	10.20	10.57	10.19	

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	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
已发行份额数目	7,444,011.787	4,244,250.403	120,496,839.798	4,545,798.754	476,522.596
	澳元	加元	港元	纽元	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	75,379,036	42,996,672	1,235,343,698	46,035,618	6,094,496
可赎回份额持有人应占净 资产(每份额)	10.13	10.13	10.25	10.13	12.79
	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元类别 (每半年派息) 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	71,664,480.866	34,591,420.909	585,059.950	47,956,241.690	12,459,676.480
	人民币	美元	美元	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	717,124,629	350,740,212	13,405,615	538,799,669	137,346,857
可赎回份额持有人应占净 资产(每份额)	10.01	10.14	22.91	11.24	11.02
	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	33,812,398.910	23,360,446.870	6,836,468.040	4,282,638.440	
	人民币	人民币	美元	美元	
可赎回份额持有人应占净 资产	358,901,326	242,583,238	72,249,710	44,456,561	
可赎回份额持有人应占净 资产(每份额)	10.61	10.38	10.57	10.38	



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	(25,985,874)	17,592,661
投资及衍生性产品销售之实现收益	23,068,394	7,915,434
	<u>(2,917,480)</u>	<u>25,508,095</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 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
澳元对冲类别(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	澳元 0.0206	7,153,969.309	(101,532)	
加元对冲类别(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	加元 0.0272	4,627,905.911	(95,773)	
港元类别(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	港元 0.0313	121,517,635.558	(485,283)	
纽元对冲类别(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	纽元 0.0233	4,558,286.239	(68,111)	
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 0.0376	77,176,638.149	(411,921)	
美元类别(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0310	36,662,785.099	(1,136,547)	
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 0.0334	13,611,028.980	(64,532)	
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 0.0390	24,594,510.770	(136,158)	
PRC 美元份额(每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0317	4,700,366.190	(149,002)	
澳元对冲类别(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	澳元 0.0228	7,185,455.570	(110,814)	
加元对冲类别(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	加元 0.0301	4,745,699.786	(107,544)	
港元类别(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	港元 0.0313	118,720,579.280	(474,715)	
纽元对冲类别(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	纽元 0.0252	4,515,811.532	(73,047)	
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 0.0387	76,906,211.381	(423,370)	
美元类别(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0310	35,665,719.957	(1,105,638)	
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 0.0332	15,162,912.980	(71,609)	
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 0.0402	24,943,263.780	(142,635)	
PRC 美元份额(每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0317	5,063,086.040	(160,500)	
澳元对冲类别(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	澳元 0.0232	7,255,372.126	(118,324)	
加元对冲类别(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	加元 0.0283	4,573,084.848	(99,802)	
港元类别(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	港元 0.0312	111,512,310.091	(446,519)	
纽元对冲类别(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	纽元 0.0260	4,231,913.170	(74,232)	
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 0.0399	74,288,379.840	(425,562)	
美元类别(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0310	32,688,515.208	(1,013,345)	
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 0.0330	11,970,052.880	(56,713)	
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 0.0414	24,064,372.580	(143,036)	
PRC 美元份额(每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0317	5,057,076.960	(160,309)	
澳元对冲类别(每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	澳元 0.0235	6,746,411.679	(106,135)	
加元对冲类别(每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	加元 0.0292	4,810,247.051	(106,203)	
港元类别(每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	港元 0.0311	101,266,892.770	(405,594)	
纽元对冲类别(每月派息)	2020年1月31日	2020年2月11日	纽元 0.0262	4,177,859.990	(70,837)	
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 0.0394	71,660,833.058	(403,187)	
美元类别(每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	美元 0.0310	32,845,276.613	(1,018,204)	
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 0.0324	12,665,592.640	(58,487)	
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 0.0409	24,797,800.430	(144,552)	
PRC 美元份额(每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	美元 0.0317	5,251,269.770	(166,465)	
澳元对冲类别(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	澳元 0.0249	7,338,354.473	(117,812)	
加元对冲类别(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	加元 0.0316	5,181,938.890	(121,987)	
港元类别(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	港元 0.0311	108,881,517.981	(434,517)	

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
纽元对冲类别(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	纽元 0.0270	4,202,456.163	(70,377)	
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 0.0399	69,076,332.699	(394,287)	
美元类别(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0310	35,384,344.684	(1,096,915)	
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 0.0331	13,776,444.580	(65,234)	
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 0.0413	25,862,121.550	(152,800)	
PRC 美元份额(每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0317	5,521,209.440	(175,022)	
澳元对冲类别(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	澳元 0.0280	8,010,632.850	(137,281)	
加元对冲类别(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	加元 0.0303	5,854,661.599	(124,633)	
港元类别(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	港元 0.0310	114,149,127.027	(456,543)	
纽元对冲类别(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	纽元 0.0320	3,199,124.278	(60,691)	
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 0.0375	66,807,543.367	(353,444)	
美元类别(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0310	32,612,036.518	(1,010,974)	
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 0.0336	14,679,647.460	(69,586)	
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 0.0390	24,792,279.520	(136,410)	
PRC 美元份额(每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0317	5,807,473.640	(184,097)	
美元类别(每半年派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.4158	1,112,721.022	(462,669)	
澳元对冲类别(每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	澳元 0.0248	5,208,945.740		(91,558)
加元对冲类别(每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	加元 0.0206	2,488,376.432		(39,033)
港元类别(每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	港元 0.0273	68,950,814.918		(240,115)
纽元对冲类别(每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	纽元 0.0248	1,842,668.161		(29,841)
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 0.0438	52,283,574.462		(328,332)
美元类别(每月派息)	2018年10月31日	2018年11月8日	美元 0.0270	16,521,787.463		(446,088)
澳元对冲类别(每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	澳元 0.0235	5,639,885.899		(96,785)
加元对冲类别(每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	加元 0.0218	3,214,328.850		(52,722)
港元类别(每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	港元 0.0273	86,067,503.051		(300,245)
纽元对冲类别(每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	纽元 0.0236	2,916,571.008		(47,280)
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 0.0359	56,955,717.745		(293,955)
美元类别(每月派息)	2018年11月30日	2018年12月10日	美元 0.0270	19,031,159.156		(513,841)
澳元对冲类别(每月派息)	2018年12月28日	2019年1月9日	澳元 0.0221	5,801,567.522		(90,218)
加元对冲类别(每月派息)	2018年12月28日	2019年1月9日	加元 0.0192	3,327,247.662		(46,852)
港元类别(每月派息)	2018年12月28日	2019年1月9日	港元 0.0272	86,548,770.886		(300,649)
纽元对冲类别(每月派息)	2018年12月28日	2019年1月9日	纽元 0.0227	2,980,206.115		(45,285)
人民币对冲类别(每月派息)	2018年12月28日	2019年1月9日	人民币 0.0323	57,434,400.921		(269,469)
美元类别(每月派息)	2018年12月28日	2019年1月9日	美元 0.0270	18,978,940.743		(512,431)
澳元对冲类别(每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	澳元 0.0222	7,226,645.355		(116,979)
加元对冲类别(每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	加元 0.0190	3,121,952.763		(45,166)
港元类别(每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	港元 0.0273	108,332,356.428		(376,907)
纽元对冲类别(每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	纽元 0.0213	2,404,956.709		(35,530)
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 0.0286	61,461,515.998		(262,053)
美元类别(每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	美元 0.0270	23,593,366.998		(637,021)
澳元对冲类别(每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8号	澳元 0.0226	7,717,364.772		(124,086)
加元对冲类别(每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8号	加元 0.0205	2,778,218.197		(43,245)
港元类别(每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8号	港元 0.0273	108,920,739.209		(378,804)
纽元对冲类别(每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8号	纽元 0.0213	2,360,575.362		(34,266)
人民币对冲类别(每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8号	人民币 0.0226	65,298,490.918		(220,419)
美元类别(每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8号	美元 0.0270	22,376,917.599		(604,178)
澳元对冲类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	澳元 0.0223	6,861,820.520		(108,697)
加元对冲类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	加元 0.0197	2,692,992.704		(39,711)
港元类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	港元 0.0273	99,104,588.340		(344,659)
纽元对冲类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	纽元 0.0214	2,401,232.659		(35,046)
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 0.0257	56,910,980.993		(217,630)
美元类别(每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	美元 0.0270	21,852,211.540		(590,009)
美元类别(每半年派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	美元 0.3770	438,406.016		(165,279)
可赎回份额持有人之总收益分配					(15,961,516)	(8,124,384)

## 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。

