

半年度报告—2021年3月31日（未经审核）

# 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。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 - 7
投资组合持有变动表	7
金融衍生工具详情	8 - 16
抵押品持有情况	17
财务状况表	18
综合收益表	18
可赎回份额持有人应占净资产变动表	19
现金流量表	19
财务报表之附注	20 - 27

投资组合

(续)

截至二零二一年三月三十一日 (未经审计)

	单位数目	占资产			单位数目	占资产	
		公平值 美元	净值 百分比			公平值 美元	净值 百分比
上市投资 (97.0%)				Country Garden 5.625% 15/12/26-RegS	美元 6,500,000	7,364,620	0.2
(i) 债务证券 (96.4%)				Country Garden 6.15% 17/09/25-RegS	美元 7,800,000	8,671,866	0.3
百慕大 (1.0%)				Country Garden 7.25% 08/04/26-RegS	美元 1,200,000	1,381,745	0.0
China Oil & Gas 5.5% 25/01/23-RegS	美元 10,500,000	10,958,843	0.3	Foxconn Far East Ltd 2.5% 28/10/30-RegS	美元 12,200,000	11,912,104	0.4
Hopson Develop Hldgs 7.5% 06/22-RegS	美元 20,100,000	20,919,624	0.7	FWD Ltd VRN 0% Perp- RegS	美元 20,300,000	18,595,267	0.6
开曼群岛 (14.4%)				Goodman HK Fin 4.375% 19/06/24-RegS	美元 8,300,000	9,144,847	0.3
Agile Group Hldgs VRN 6.875% 29/12/49-RegS	美元 2,000,000	2,036,701	0.1	Goodman HK Finance 3% 22/07/30-RegS	美元 2,300,000	2,306,332	0.1
Agile Group Hldgs VRN 7.875%-RegS	美元 20,800,000	21,777,969	0.7	Greenland HK Hldgs 6% 17/07/21-RegS	美元 11,000,000	11,013,941	0.3
Azure Orbit IV 4% 25/01/28-RegS	美元 700,000	755,211	0.0	HPHT Finance 21 2% 19/03/26-RegS	美元 6,300,000	6,339,071	0.2
CDBL Funding 2% 04/03/26-RegS	美元 5,800,000	5,767,259	0.2	KWG Group Holdings 6% 15/09/22-RegS	美元 2,000,000	2,045,209	0.1
Champion Mtn Ltd 2.95% 15/06/30-RegS	美元 11,600,000	11,472,970	0.3	KWG Property 7.875% 09/08/21-RegS	美元 4,900,000	5,038,410	0.2
China Aoyuan Group 7.5% 05/21-RegS	美元 7,000,000	7,214,858	0.2	Longfor Grp 3.85% 13/01/32-RegS	美元 2,000,000	2,091,155	0.1
China Aoyuan Group Ltd 6.2% 24/03/26-RegS	美元 2,000,000	1,918,679	0.1	Longfor Grp Hldg 4.5% 16/01/28-RegS	美元 11,600,000	12,703,914	0.4
China Aoyuan Group Ltd 7.95% 19/02/23-RegS	美元 3,500,000	3,681,125	0.1	Melco Resorts Fin 5.625% 07/27-RegS	美元 5,200,000	5,496,725	0.2
China Aoyuan Group Ltd 8.5% 23/01/22-RegS	美元 2,000,000	2,066,871	0.1	Melco Resorts Finance 5.375% 04/12/29-RegS	美元 2,000,000	2,164,518	0.1
China Evergrande 6.25% 28/6/21-RegS	美元 3,000,000	3,010,776	0.1	Powerlong Real 5.95% 30/04/25-RegS	美元 8,400,000	9,035,779	0.3
China Evergrande 8.9% 24/05/21-RegS	美元 1,000,000	1,025,355	0.0	Powerlong Real Est 4.875% 9/21-RegS	美元 2,000,000	2,015,557	0.1
China Overseas 2.375% 2/3/25-RegS	美元 10,100,000	10,219,333	0.3	Powerlong Real Est 7.125%11/22-RegS	美元 8,300,000	8,928,792	0.3
China Resources VRN 3.75% Perp-RegS	美元 12,400,000	13,045,007	0.4	Redsun Properties 10.5% 3/10/22-RegS	美元 10,000,000	11,005,967	0.3
China SCE Group Hldgs Ltd 5.875% 10/03/22- RegS	美元 2,000,000	2,031,052	0.1	Redsun Properties 9.7% 16/4/23-RegS	美元 6,200,000	6,596,517	0.2
CIFI Hldgs Group 6.7% 23/04/22-RegS	离岸人民币 20,000,000	3,207,861	0.1	Ronshine China 10.5% 01/03/22-RegS	美元 6,800,000	7,020,701	0.2
CIFI Hldgs Group 7.625% 28/02/23-RegS	美元 2,700,000	2,828,381	0.1	Ronshine China 7.35% 15/12/23-RegS	美元 12,200,000	11,883,357	0.4
CIFI Hldgs Group VRN 5.375% 29/12/49-RegS	美元 4,500,000	4,614,778	0.1	Ronshine China 8.1% 09/06/23-RegS	美元 4,700,000	4,688,711	0.1
CK Hutchison 17 VRN 4% 31/12/49	美元 2,100,000	2,175,219	0.1	Ronshine China 8.75% 25/10/22-RegS	美元 3,300,000	3,441,420	0.1
CK Hutchison Intl 2.5% 8/5/30-RegS	美元 3,500,000	3,518,501	0.1	Sands China 5.125% 08/08/25	美元 7,100,000	8,008,162	0.2
CK Hutchison Intl 2.75% 6/9/29-RegS	美元 300,000	306,371	0.0	Sands China 5.4% 08/08/28	美元 6,800,000	7,839,652	0.2
CK Hutchison Intl 3.625% 04/29-RegS	美元 4,200,000	4,626,735	0.1	Shimao Group Holdings 3.45% 11/01/31-RegS	美元 9,800,000	9,479,370	0.3
Country Garden 2.7% 12/07/26-RegS	美元 11,300,000	11,284,282	0.3	Shui On Develop 5.5% 03/03/25-RegS	美元 18,300,000	18,667,771	0.6
Country Garden 5.125% 17/01/25-RegS	美元 400,000	420,283	0.0	Shui On Develop Hldg VRN 6.4% 20/12/65	美元 4,300,000	4,425,580	0.1
Country Garden 5.625% 14/01/30-RegS	美元 4,000,000	4,386,061	0.1	Shui On Development Hldg 5.75% 12/11/23- RegS	美元 13,400,000	14,147,390	0.4

投资组合 (续)

(续)

截至二零二一年三月三十一日 (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>				ICBCIL Finance 1.75% 25/08/25-RegS	美元 14,800,000	14,743,242	0.5
Sun Hung Kai Prop 3.75% 02/29-RegS	美元 6,000,000	6,524,064	0.2	Kunming Rail 3.5% 12/12/22-RegS	美元 9,600,000	9,677,215	0.3
Sunac China Hldgs 6.5% 9/07/23-RegS	美元 7,600,000	7,955,038	0.2	Kunming Traffic Inv 6.2% 6/22-RegS	美元 11,000,000	10,931,271	0.3
Sunac China Hldgs 7.95% 08/22-RegS	美元 11,000,000	11,508,257	0.3	RKPF Overseas 7.875% 01/02/23-RegS	美元 1,300,000	1,378,013	0.1
Sunac China Hldgs 8.35% 19/4/23-RegS	美元 5,300,000	5,721,541	0.2	Shougang Group 4% 23/05/24-RegS	美元 16,000,000	17,268,452	0.5
Sunac China Holdings Ltd 5.95% 26/04/24-RegS	美元 8,500,000	8,717,371	0.3	SiChuan Railway Inv 3.8% 06/22-RegS	美元 1,100,000	1,135,468	0.0
Sunac China Holdings Ltd 6.5% 26/01/26-RegS	美元 8,000,000	8,039,073	0.2	Zhengzhou Real 3.95% 09/10/22-RegS	美元 7,400,000	7,714,635	0.3
Sunac China Holdings Ltd 6.65% 03/08/24-RegS	美元 2,100,000	2,177,118	0.1	<b>哥伦比亚 (0.0%)</b>			
Sunac China Holdings Ltd 7.95% 11/10/23-RegS	美元 1,000,000	1,096,501	0.0	Rep of Colombia 4.375% 21/03/23	哥伦比亚比索 500,000,000	139,206	0.0
Times China Hldg Ltd 5.75% 14/01/27-RegS	美元 17,600,000	17,253,379	0.5	Rep of Colombia 7.75% 14/04/21	哥伦比亚比索 2,185,000,000	639,619	0.0
Times China Hldg Ltd 6.75% 08/07/25-RegS	美元 2,000,000	2,126,051	0.1	<b>香港 (9.7%)</b>			
Times China Hldgs 6.75% 07/23-RegS	美元 4,500,000	4,773,512	0.1	AIA Group 3.2% 16/09/40-RegS	美元 6,000,000	5,942,762	0.2
Yuzhou Group 6.35% 13/01/27-RegS	美元 5,900,000	4,997,048	0.1	AIA Group VRN 29/12/49- RegS	美元 8,600,000	8,600,000	0.3
Yuzhou Group Hldgs 6% 25/10/23-RegS	美元 13,000,000	11,893,323	0.4	Airport Authority HK VRN 31/12/49-RegS	美元 9,400,000	9,440,008	0.3
Yuzhou Group Hldgs 7.375% 1/26-RegS	美元 2,000,000	1,741,970	0.1	Bank of East Asia VRN 5.625% Perp-RegS	美元 9,400,000	9,853,609	0.3
Yuzhou Group VRN 5.375% Perp-RegS	美元 15,900,000	14,079,778	0.4	Bank of East Asia VRN 4% 11/26-RegS	美元 15,100,000	15,524,468	0.5
Zhongsheng Group 3% 13/01/26-RegS	美元 6,900,000	6,988,575	0.2	Bank of East Asia VRN 5.825% 31/12/49-RegS	美元 6,200,000	6,848,761	0.2
<b>中国 (7.6%)</b>				Bank of East Asia VRN 5.875% Perp-RegS	美元 3,000,000	3,210,220	0.1
Bank of China HK 3.625% 04/29-RegS	美元 6,800,000	7,315,800	0.2	Bocom Leasing Man 4.375% 01/24-RegS	美元 6,300,000	6,851,045	0.2
Bank of China VRN 3.6% Perp-RegS	美元 17,800,000	18,537,810	0.6	CDBL Funding I 4.25% 02/12/24-RegS	美元 7,000,000	7,772,104	0.2
Bank of Communication VRN 3.8% 31/12/49- RegS	美元 16,300,000	17,028,054	0.5	China Clean Energy 4.282% 12/25-RegS	美元 4,500,000	4,891,744	0.2
CCB Life Ins VRN 4.5% 21/4/77-RegS	美元 20,600,000	21,277,658	0.7	China Oil & Gas 4.625% 04/22-RegS	美元 7,900,000	8,162,122	0.3
CDB Fin Leasing VRN 2.875% 9/30-RegS	美元 12,600,000	12,824,275	0.4	Chong Hing Bk VRN 3.876% 07/27-RegS	美元 17,800,000	18,062,770	0.6
China CITIC Bk VRN 4.625% 2/29-RegS	美元 10,050,000	10,753,657	0.3	Chong Hing Bk VRN 5.7% Perp-RegS	美元 6,300,000	6,666,965	0.2
China Constr VRN 2.45% 24/6/30-RegS	美元 10,100,000	10,329,112	0.3	CITIC Ltd 3.875% 28/02/27-RegS	美元 14,700,000	15,955,484	0.5
China Development 2.98% 08/01/24-RegS	人民币 260,000,000	39,750,942	1.2	CMB International Leasin 2% 04/02/26-RegS	美元 2,400,000	2,385,844	0.1
China Govt 3.81% 14/09/50	人民币 130,000,000	20,229,539	0.6	CMB Wing Lung Bk VRN 3.75% 11/27-RegS	美元 12,800,000	13,333,011	0.4
China Minmetals VRN 3.75% Perp-RegS	美元 5,000,000	5,183,820	0.2	CNAC HK Finbrid VRN 3.35% Perp-RegS	美元 28,700,000	28,717,061	0.9
ENN Energy 2.625% 17/09/30-RegS	美元 6,800,000	6,556,372	0.2	CNAC HK Finbridge 3.875% 06/29-RegS	美元 17,000,000	16,911,220	0.5
ICBC Ltd VRN 3.58% Perp- RegS	美元 13,500,000	14,160,970	0.4				

投资组合 (续)

(续)

截至二零二一年三月三十一日 (未经审计)

	单位数目	占资产		单位数目	占资产	
		公平值 美元	净值 百分比		公平值 美元	净值 百分比
<b>香港 (续)</b>						
Gemdale Ever 5.6% 14/06/22-RegS	美元 1,400,000	1,461,753	0.0	13/04/22-RegS	美元 3,600,000	3,782,538 0.1
GET Intl Invest 3.75% 18/07/22-RegS	美元 10,000,000	10,299,272	0.3	JSW Steel 5.95% 18/04/24-RegS	美元 4,000,000	4,381,401 0.1
GLP China Holdings Ltd 2.95% 29/03/26-RegS	美元 9,400,000	9,368,998	0.3	Jubilant Pharma 6% 05/03/24-RegS	美元 10,200,000	10,813,411 0.3
HBIS Group HK 3.75% 18/12/22-RegS	美元 7,000,000	6,585,321	0.2	NTPC Ltd 3.75% 03/04/24-RegS	美元 3,700,000	3,992,998 0.1
HK Intl (Qingdao) 3.9% 11/22-RegS	美元 7,600,000	7,782,025	0.2	NTPC Ltd 4.5% 19/03/28- RegS	美元 5,000,000	5,431,783 0.2
HK Intl (Qingdao) 4.25% 12/22-RegS	美元 10,900,000	11,212,759	0.3	Oil India 5.125% 04/02/29-RegS	美元 3,250,000	3,641,708 0.1
HK Red Star Macal 3.375% 21/09/22-RegS	美元 9,500,000	8,274,153	0.3	Power Fin Corp 3.75% 06/12/27-RegS	美元 4,300,000	4,532,188 0.1
ICBCIL Finance 3.625% 19/05/26-RegS	美元 13,000,000	14,111,743	0.4	Renew Power Syn 6.67% 12/03/24-RegS	美元 9,600,000	10,129,486 0.3
Lenovo Group Ltd 3.421% 02/11/30-RegS	美元 7,700,000	7,860,330	0.2	<b>印度尼西亚 (10.0%)</b>		
MTR Corp 1.625% 19/08/30-RegS	美元 14,600,000	13,776,631	0.4	Adaro Indonesia 4.25% 31/10/24-RegS	美元 10,000,000	10,328,264 0.3
Weichai Intl HK VRN 3.75% Perp-RegS	美元 16,300,000	16,653,463	0.5	Bank Mandiri 4.75% 13/5/25-RegS	美元 3,500,000	3,927,579 0.1
Yango Justice Intl 10% 12/02/23	美元 1,000,000	1,067,347	0.0	Bank Tabungan Negara 4.2% 1/25-RegS	美元 6,300,000	6,477,114 0.2
Yango Justice Intl 10.25% 3/22-RegS	美元 10,500,000	10,774,716	0.3	Bk Mandiri Persero 3.75% 11/4/24-RegS	美元 2,200,000	2,368,750 0.1
Yango Justice Intl 9.25% 15/04/23-RegS	美元 1,000,000	1,033,274	0.0	Bk Rakyat Indonesia 3.95% 3/24-RegS	美元 1,550,000	1,659,782 0.0
Yango Justice Intl 9.5% 3/4/21-RegS	美元 10,300,000	10,783,814	0.3	Hutama Karya 3.75% 11/05/30-RegS	美元 12,500,000	13,317,867 0.4
<b>印度 (6.6%)</b>						
Adani Green Energy 6.25% 12/24-RegS	美元 4,800,000	5,394,220	0.2	Indonesia Asahan 6.53% 15/11/28-RegS	美元 8,625,000	10,618,616 0.3
Adani Ports & Sp 3.375% 24/7/24-RegS	美元 9,900,000	10,457,981	0.3	Indonesia Asahan 6.757% 11/48-RegS	美元 24,200,000	30,859,269 0.9
Adani Ports & Sp 4.2% 04/08/27-RegS	美元 10,200,000	10,916,453	0.3	Indonesia Asahan Alumin 5.45% 15/05/30-RegS	美元 8,000,000	9,265,071 0.3
Adani Renewable 4.625% 15/10/39-RegS	美元 2,900,000	2,932,841	0.1	Indonesia Asahan Alumin 5.8% 15/05/50-RegS	美元 2,000,000	2,338,822 0.1
Adani Transmiss 4.25% 21/05/36-RegS	美元 2,600,000	2,633,791	0.1	Indonesia Govt NoFR 68 8.375% 15/3/34	印尼盾 170,000,000,000	12,901,123 0.4
Adani Transmission 4% 03/08/26-RegS	美元 9,800,000	10,537,234	0.3	Indonesia Govt NoFR87 6.5% 15/02/31	印尼盾 340,000,000,000	23,177,864 0.7
Bharat Petroleum 4% 08/05/25-RegS	美元 10,940,000	11,591,640	0.4	Indonesia Rep 5.625% 15/05/23	印尼盾 350,000,000,000	24,932,800 0.8
India Govt 5.15% 09/11/25	印度卢比 2,500,000,000	34,125,837	1.0	Indonesia Rep 7.5% 15/06/35	印尼盾 320,000,000,000	23,059,592 0.7
India Govt Bond 5.22% 15/06/25	4,850,000,000	66,514,228	2.0	Indonesia Rep 8.375% 15/03/24-RegS	印尼盾 330,000,000,000	24,577,198 0.7
India Govt Bond 7.27% 08/04/26	印度卢比 1,000,000	14,918	0.0	Pelabuhan Indonesia 5.375% 5/45-RegS	美元 15,000,000	17,876,979 0.5
Indian Oil Corp 4.75% 16/01/24-RegS	美元 2,000,000	2,193,592	0.1	Pertamina Persero 5.625% 20/05/43	美元 5,000,000	5,770,629 0.2
Indian Railway Fin 3.249% 2/30-RegS	美元 5,000,000	5,002,385	0.2	Perusahaan Listrik 3.875% 7/29-RegS	美元 8,600,000	9,108,219 0.3
Indian Railway Fin 3.73% 29/3/24-RegS	美元 4,600,000	4,910,207	0.2	Perusahaan Listrik 4% 30/06/50-RegS	美元 20,000,000	19,334,922 0.6
Indian Railway Finance 3.835% 13/12/27-RegS	美元 1,300,000	1,415,855	0.1	Perusahaan Listrik 5.375%01/29-RegS	美元 7,000,000	8,152,894 0.2

投资组合 (续)

(续)

截至二零二一年三月三十一日 (未经审计)

	单位数目	占资产		单位数目	占资产	
		公平值 美元	净值 百分比		公平值 美元	净值 百分比
<b>印度尼西亚 (续)</b>						
Perusahaan Listrik Neg 4.375% 05/02/50- RegS	美元 9,000,000	9,173,750	0.3	Greenko Solar 5.55% 29/01/25-RegS	美元 3,300,000	3,430,384 0.1
Perusahaan Listrik Neg 6.25% 25/01/49-RegS	美元 2,000,000	2,510,417	0.1	India Green Energy Hld 5.375% 29/04/24-RegS	美元 5,000,000	5,313,440 0.1
Perusahaan Listrik Negar 5.25% 24/10/42-RegS	美元 2,000,000	2,263,292	0.1	India Green Power Hol 4% 22/02/27	美元 10,150,000	10,256,913 0.3
Perusahaan Listrik Negar 6.15% 21/05/48-RegS	美元 28,000,000	34,763,492	1.1	Neerg Energy 6% 13/02/22-RegS	美元 15,100,000	15,425,035 0.5
Perusahaan Penerbit 3.8% 06/50-RegS	美元 4,600,000	4,722,610	0.1	<b>墨西哥 (1.7%)</b>		
Rep of Indonesia 3.7% 30/10/49	美元 6,000,000	6,199,569	0.2	Mexican Bds Desarr NoM20 8.5% 05/29	墨西哥比索 6,055,400	34,033,476 1.0
Saka Energi Indon 4.45% 05/24-RegS	美元 9,500,000	8,595,906	0.3	Mexico Utd States 7.75% 29/05/31	墨西哥比索 4,400,000	23,455,849 0.7
<b>韩国 (3.8%)</b>				<b>荷兰 (1.6%)</b>		
Busan Bank 3.625% 25/07/26-RegS	美元 22,700,000	24,246,865	0.7	Greenko Dutch Bv 3.85% 29/03/26	美元 15,000,000	15,104,458 0.5
Hanwha Life Insur VRN 4.7% Perp-RegS	美元 2,200,000	2,341,165	0.1	Minejesa Capital 4.625% 08/30-RegS	美元 16,000,000	16,821,793 0.5
Heungkuk Life VRN 4.475% 11/47-RegS	美元 22,500,000	23,206,914	0.7	Royal Capital VRN 4.875% Perp-RegS	美元 18,200,000	19,271,085 0.6
Hyundai Capital Services 1.25% 08/02/26-RegS	美元 5,500,000	5,380,135	0.2	<b>巴基斯坦 (0.4%)</b>		
Industrial Bk KR VRN 3.9% Perp-RegS	美元 3,200,000	3,312,891	0.1	Islamic Rep Pakistan 6.875% 12/27 RegS	美元 12,000,000	12,820,833 0.4
Kookmin Bank 4.5% 01/02/29-RegS	美元 9,900,000	11,173,496	0.3	<b>菲律宾 (2.3%)</b>		
Shinhan Bank 3.75% 20/09/27-RegS	美元 8,000,000	8,735,031	0.3	Megaworld Corp 4.125% 30/07/27-RegS	美元 14,400,000	15,475,141 0.5
Shinhan Fin Grp VRN 3.34% 2/30-RegS	美元 17,200,000	18,063,639	0.5	Metropolitan Bank 2.125% 01/26-RegS	美元 17,000,000	17,423,268 0.5
Shinhan Fin VRN 5.875% Perp-RegS	美元 8,000,000	8,749,787	0.3	PLDT Inc 2.5% 23/01/31- RegS	美元 3,600,000	3,570,830 0.1
Woori Bank VRN 4.25% Perp-RegS	美元 12,900,000	13,773,921	0.4	Rizal Comm Bank VRN 6.5% Perp-RegS	美元 15,500,000	16,273,247 0.5
Woori Bank VRN 5.25% Perp-RegS	美元 5,900,000	6,210,290	0.2	SMC Global Power Hld VRN 6.5% 31/12/49- RegS	美元 8,400,000	8,957,634 0.3
<b>马来西亚 (1.8%)</b>				SMC Global Power Hld VRN 7% 31/12/49-RegS	美元 10,000,000	10,975,761 0.3
Axiata SPV5 Labuan Ltd 3.064% 19/08/50- RegS	美元 5,000,000	4,588,973	0.1	Union Bk Of Philippines 2.125% 22/10/25-RegS	美元 4,000,000	4,135,178 0.1
GOHL Capital 4.25% 24/01/27-RegS	美元 16,900,000	18,090,905	0.5	<b>新加坡 (5.4%)</b>		
Malaysia Investmnt Issu 3.422% 30/09/27	林吉特 115,000,000	28,370,581	0.9	Abja Investment 5.45% 24/01/28-RegS	美元 9,200,000	9,584,110 0.3
TNB Global Vent 4.851% 1/11/28-RegS	美元 7,100,000	8,248,514	0.3	BOC Aviation 3.25% 29/04/25-RegS	美元 4,800,000	5,105,963 0.1
<b>毛里求斯 (1.9%)</b>				Continuum Energy 4.5% 09/02/27	美元 1,400,000	1,442,525 0.0
Azure Power Energy 5.5% 11/22-RegS	美元 5,400,000	5,644,356	0.2	DBS Grp Hldgs VRN 3.3% Perp-RegS	美元 9,000,000	9,258,225 0.3
Azure Power Solar 5.65% 12/24-RegS	美元 8,750,000	9,424,832	0.3	GLP Pte 3.875% 04/06/25-RegS	美元 24,600,000	25,991,246 0.8
Greenko Mauritius 6.25% 21/2/23-RegS	美元 13,500,000	14,047,715	0.4	Indika Energy 5.875% 09/11/24-RegS	美元 15,600,000	16,043,408 0.5

投资组合 (续)

(续)

截至二零二一年三月三十一日 (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>新加坡 (续)</b>				Thai Oil Trsry Center 3.5% 17/10/49-RegS	美元 9,000,000	7,857,373	0.2
Indika Energy Capital Iv 8.25% 22/10/25-RegS	美元 5,200,000	5,684,575	0.2	Thailand Govt 1.585% 17/12/35-RegS	泰铢 560,000,000	16,314,280	0.5
Jollibee Worldwide P VRN 3.9% 31/12/49-RegS	美元 2,000,000	1,983,813	0.1	Thailand Govt Bond 2.125% 17/12/26	泰铢 230,000,000	7,768,554	0.2
LLPL Capital Pte 6.875% 4/2/39-RegS	美元 13,800,000	14,859,571	0.4	Thailand Govt Bond 2.875% 17/12/28	泰铢 230,000,000	8,085,829	0.3
Medco Bell 6.375% 30/01/27-RegS	美元 4,000,000	4,070,808	0.1	<b>美国 (0.2%)</b>			
Medco Oak Tree 7.375% 14/05/26-RegS	美元 3,000,000	3,290,898	0.1	Inter American Devel Bk 5% 12/02/24-RegS	印度卢比 500,000,000	6,884,713	0.2
Medco Platinum 6.75% 30/01/25-RegS	美元 22,600,000	24,044,988	0.7	<b>维京群岛 (22.6%)</b>			
OCBC VRN 1.832% 10/09/30-RegS	美元 15,300,000	15,195,634	0.5	Amipeace Ltd 2.25% 22/10/30-RegS	美元 6,800,000	6,521,999	0.2
Parkway Pantai VRN 4.25% Perp-RegS	美元 15,600,000	15,893,367	0.5	BAIC Finance Inv 2% 16/03/24-RegS	美元 2,700,000	2,719,819	0.1
PSA Intl Pte 2.25% 30/04/30-RegS	美元 7,100,000	7,172,164	0.2	Beijing Capital 2.8% 18/3/23-RegS	美元 13,400,000	13,549,827	0.4
United Overseas VRN 3.875% PERP-RegS	美元 18,000,000	18,997,875	0.6	Bluestar Fin Hldgs 3.375% 7/24-RegS	美元 24,700,000	25,900,746	0.8
<b>斯里兰卡 (0.7%)</b>				Bluestar Fin Hldgs VRN 3.875% 31/12/49-RegS	美元 10,800,000	11,042,838	0.3
Rep of Sri Lanka 6.25% 27/7/21-RegS	美元 5,000,000	4,895,106	0.2	CAS Capital No1 VRN 4% 31/12/49-RegS	美元 22,700,000	22,870,881	0.7
Rep of Sri Lanka 6.75% 18/4/28-RegS	美元 3,000,000	1,942,478	0.1	Castle Peak Pwr Fin 2.125% 03/03/31-RegS	美元 6,900,000	6,631,989	0.2
Rep of Sri Lanka 6.85% 3/11/25-RegS	美元 2,000,000	1,322,842	0.0	Castle Peak Pwr Fin 2.2% 06/30-RegS	美元 7,200,000	7,018,394	0.2
Republic of Sri Lanka 5.75% 18/01/22-RegS	美元 5,000,000	4,463,399	0.1	CCCI Treasure VRN 3.65% Perp-RegS	美元 10,200,000	10,278,887	0.3
Republic of Sri Lanka 5.75% 18/04/23-RegS	美元 11,000,000	7,854,052	0.2	Central Plaza Dev VRN 5.75% 31/12/49-RegS	美元 9,900,000	9,989,911	0.3
Republic of Sri Lanka 5.875% 25/07/22- RegS	美元 3,000,000	2,394,813	0.1	Chalco HK Inv VRN 4.25% Perp-RegS	美元 3,500,000	3,602,100	0.1
<b>国际 (2.4%)</b>				Champion Path Holdings 4.5% 27/01/26-RegS	美元 5,400,000	5,688,463	0.2
Corp Andina Fomento 6.77% 5/28-RegS	哥伦比亚比索 46,000,000,000	13,471,674	0.4	Champion Path Holdings 4.85% 27/01/28-RegS	美元 6,800,000	7,159,552	0.2
European Bk Recon & Dev 6.45% 13/12/22-RegS	印尼盾 120,000,000,000	8,610,354	0.3	Champion Sin VRN 8.125% Perp-RegS	美元 20,000,000	21,052,836	0.6
European Investment Bank 6.27% 28/08/24- RegS	印尼盾 200,000,000,000	14,557,407	0.4	China Railway XunJie 3.25% 7/26-RegS	美元 8,500,000	8,976,531	0.3
Intl Bk Recon & Develop 6.75% 04/02/24-RegS	巴西雷亚尔 99,755,000	17,904,037	0.5	Chinalco Capital 4% 25/8/21-RegS	美元 1,000,000	1,012,355	0.0
Intl Finance Corp 5.85% 25/11/22-RegS	印度卢比 1,280,000,000	18,048,370	0.6	Chouzhou Intl Inv 3.15% 11/8/23-RegS	美元 14,600,000	14,744,029	0.4
Intl Finance Corp 6.2% 27/07/22-RegS	巴西雷亚尔 34,890,000	6,293,383	0.2	Chouzhou Intl Inv 4.5% 30/5/22-RegS	美元 4,200,000	4,352,615	0.1
<b>泰国 (2.3%)</b>				CLP Power HK Fin 2.125% 06/30-RegS	美元 12,100,000	11,766,058	0.4
Bangkok Bank VRN 5% 31/12/49-RegS	美元 9,000,000	9,502,120	0.3	CN Huaneng VRN 2.85% 31/12/49-RegS	美元 5,900,000	6,055,563	0.2
Kasikornbank VRN 3.343% 10/31-RegS	美元 13,100,000	13,599,466	0.4	CN Huaneng VRN 3.08% 31/12/49-RegS	美元 5,900,000	6,072,470	0.2
Krung Thai Bank/Caym VRN 4.4% 31/12/49- RegS	美元 13,200,000	13,275,680	0.4	CNPC Global Cap 2% 23/06/30-RegS	美元 27,100,000	25,639,877	0.8
				CNPC Global Cap 1.35% 23/06/25-RegS	美元 17,000,000	16,795,592	0.5



投资组合 (续)

(续)

截至二零二一年三月三十一日 (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>维京群岛 (续)</b>				New Metro Global 6.5%			
Dianjian Haiyu VRN 3.45% Perp-RegS	美元 6,400,000	6,529,227	0.2	20/05/22-RegS	美元 1,850,000	1,951,459	0.1
Dianjian Haiyu VRN 4.3% Perp-RegS	美元 2,100,000	2,219,425	0.1	New Metro Global 7.5% 12/21-RegS	美元 8,000,000	8,378,488	0.3
Easy Tactic 8.125% 11/07/24-RegS	美元 6,800,000	6,294,274	0.2	NWD MTN Ltd 4.125% 18/07/29-RegS	美元 16,400,000	16,869,017	0.5
Easy Tactic 8.125% 27/02/23-RegS	美元 13,700,000	13,223,659	0.4	RKPF Overseas 2019 A 5.9% 05/03/25-RegS	美元 2,000,000	2,083,522	0.1
Expand Lead 6.4% 18/09/21-RegS	美元 9,400,000	9,576,824	0.3	RKPF Overseas 2020 A 5.2% 12/01/26-RegS	美元 18,400,000	18,917,999	0.6
Fortune Star 5.25% 23/03/22-RegS	美元 3,300,000	3,338,774	0.1	RKPF Overseas 6.7% 30/09/24-RegS	美元 17,100,000	18,205,192	0.6
Fortune Star 5.95% 29/01/23-RegS	美元 12,500,000	12,970,303	0.4	RongXingDa Dev 8% 24/04/22-RegS	美元 31,300,000	30,402,656	0.9
Fortune Star 6.75% 02/07/23-RegS	美元 15,400,000	16,462,654	0.5	Scenery Journey 11.5% 24/10/22-RegS	美元 2,500,000	2,348,247	0.1
Franshion Brilliant VRN 4% Perp-RegS	美元 16,700,000	17,071,889	0.5	Scenery Journey 13% 06/11/22-RegS	美元 3,500,000	3,456,247	0.1
Gemstones Intl 12% 10/03/23-RegS	美元 26,000,000	25,727,051	0.8	SD Iron & Steel Xinheng 6.85% 25/09/22-RegS	美元 9,300,000	9,438,660	0.3
Greenland Global 5.9% 12/02/23-RegS	美元 20,400,000	17,988,425	0.5	Sinopec Grp 2018 2.15% 13/5/25-RegS	美元 8,400,000	8,612,744	0.3
Greenland Global 6.25% 12/22-RegS	美元 6,100,000	6,021,470	0.2	Sinopec Grp 2018 2.7% 13/05/30-RegS	美元 14,900,000	14,971,520	0.5
Guangzhou Metro 1.507% 17/9/25-RegS	美元 5,000,000	4,867,185	0.1	Spic 2018 Usd Bd VRN 5.8% Perp-RegS	美元 4,500,000	4,809,534	0.1
Haitian Bvi Int Invest 2.8% 04/11/23-RegS	美元 12,400,000	12,534,941	0.4	Studio City Fin 5% 15/01/29-RegS	美元 3,800,000	3,859,449	0.1
Hejun Shunze Invest 11% 4/6/22-RegS	美元 10,400,000	9,576,029	0.3	Studio City Finance 6% 15/7/25-RegS	美元 11,500,000	12,317,267	0.4
Hejun Shunze Investment 10.4% 09/03/23-RegS	美元 11,900,000	10,144,721	0.3	UHI Capital Ltd 3% 12/06/24-RegS	美元 10,000,000	10,541,403	0.3
HKT Capital No4 3 14/07/26-RegS	美元 7,000,000	7,408,637	0.2	Wealth Driven 5.5% 17/08/23-RegS	美元 3,900,000	3,955,471	0.1
Hopson Capital International 5.8% 12/1/22-RegS	美元 17,400,000	17,706,078	0.5	Yunda Hldg Inv 2.25% 19/08/25-RegS	美元 3,500,000	3,472,144	0.1
Huarong Fin 2017 VRN 4% Perp-RegS	美元 22,100,000	22,757,807	0.7			3,169,056,575	96.4
Huarong Fin 2019 3.375% 02/30-RegS	美元 11,100,000	10,897,311	0.3			-----	-----
Huarong Fin 2019 4.5% 29/05/29-RegS	美元 7,500,000	8,025,150	0.2	<b>(II) 货币市场 (0.5%)</b>			
Huarong Finance 2019 3.875% 13/11/29-RegS	美元 6,169,000	6,349,864	0.2	<b>中国 (0.5%)</b>			
Hysan (MTN) 2.875% 02/06/27-RegS	美元 14,000,000	14,811,391	0.4	Agricultural Bk 2% 14/05/21	离岸人民币 47,000,000	7,281,471	0.2
JIC Zhixin 3.5% 24/11/27- RegS	美元 2,000,000	2,167,724	0.1	Bank of Communication Macau 2.85% 01/06/21-RegS	离岸人民币 70,000,000	10,692,764	0.3
King Power Cap 5.625% 03/11/24-RegS	美元 8,400,000	9,803,119	0.3			17,974,235	0.5
Minmetals Boun VRN 3.375% Perp-RegS	美元 5,200,000	5,347,836	0.2			-----	-----
Minmetals Bounteous 4.2% 07/26-RegS	美元 15,000,000	16,585,000	0.5				
New Metro Global 4.5% 02/05/26-RegS	美元 15,200,000	14,997,566	0.5				
New Metro Global 4.8% 15/12/24-RegS	美元 7,700,000	7,902,289	0.2				

投资组合 (续)

截至二零二一年三月三十一日 (未经审计)

投资组合持有变动表

截至二零二一年三月三十一日止期间 (未经审计)

单位数目	占资产		持有占资产净值百分比	
	公平值 美元	净值 百分比	二零二一年 三月三十一日	二零二零年 九月三十日
<b>(III) 衍生性产品 (0.1%)</b>				
远期外汇合约 (0.1%)	1,105,327	0.1		
<b>期货 (0.0%)</b>				
US 10yr Note (CBT) Fut 06/21	(817)	717,984	0.0	
US 5yr Note (CBT) Fut 06/21	(2,003)	1,030,179	0.0	
US Ultra Bond (CBT) Fut 06/21	294	(1,052,469)	(0.0)	
		1,801,021	0.1	
		-----	----	
<b>总上市投资</b>	<b>3,188,831,831</b>	<b>97.0</b>		
<b>其他净资产</b>	<b>100,091,931</b>	<b>3.0</b>		
		-----		
<b>截至二零二一年三月三十一日可赎回 份额持有人应占净资产</b>	<b>3,288,923,762</b>	<b>100.0</b>		
		=====		
<b>总投资, 按成本</b>	<b>3,124,406,793</b>			
		=====		
<b>上市投资</b>				
<b>债务证券</b>				
			22.6	20.8
			14.4	11.9
			10.0	11.3
			9.7	10.4
			7.6	12.2
			6.6	5.0
			5.4	5.9
			3.8	5.1
			2.4	0.4
			2.3	1.7
			2.3	0.5
			1.9	1.5
			1.8	2.9
			1.7	1.1
			1.6	1.3
			1.0	1.0
			0.7	0.3
			0.4	0.8
			0.2	0.4
			0.0	0.0
			-	0.5
			-	0.3
			-	0.3
			-	0.2
<b>货币市场</b>				
			0.5	-
<b>衍生性产品</b>				
			0.1	0.1
			0.0	(0.0)
			-----	-----
<b>总上市投资</b>			<b>97.0</b>	<b>95.9</b>
<b>其他净资产</b>			<b>3.0</b>	<b>4.1</b>
			-----	-----
<b>可赎回份额持有人应占净资产</b>			<b>100.0</b>	<b>100.0</b>
			=====	=====

金融衍生工具详情

截至二零二一年三月三十一日 (未经审计)

截至二零二一年三月三十一日，本基金持有之金融衍生工具汇总如下：

(a) 远期外汇合约

以下为截至二零二一年三月三十一日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／ (亏损) 美元
<u>截至二零二一年三月三十一日</u>				
未平仓合约：				
澳元 1,521	美元 1,160	2021年4月1日	美国道富银行	2
离岸人民币 5,699,480	美元 869,833	2021年4月1日	美林国际, 伦敦	1,168
离岸人民币 1,260,854	美元 192,427	2021年4月1日	美林国际, 伦敦	258
离岸人民币 988,104	美元 150,801	2021年4月1日	美林国际, 伦敦	203
离岸人民币 154,456	美元 23,572	2021年4月1日	美林国际, 伦敦	32
美元 781,594	加元 983,148	2021年4月1日	汇丰银行, 伦敦	637
美元 24,059	纽元 34,395	2021年4月1日	美林国际, 伦敦	30
澳元 468,329	美元 357,230	2021年4月7日	花旗银行, 伦敦	516
离岸人民币 10,209,021	美元 1,559,522	2021年4月7日	高盛国际, 伦敦	4,155
离岸人民币 1,433,563	美元 218,990	2021年4月7日	高盛国际, 伦敦	583
离岸人民币 135,170	美元 20,648	2021年4月7日	高盛国际, 伦敦	55
离岸人民币 7,238	美元 1,103	2021年4月7日	美国道富银行	1
美元 943,947	离岸人民币 6,215,276	2021年4月7日	美国道富银行	2,965
美元 297,422	离岸人民币 1,958,332	2021年4月7日	美国道富银行	934
美元 91,510	离岸人民币 602,532	2021年4月7日	美国道富银行	287
美元 1,100	离岸人民币 7,238	2021年4月7日	高盛国际, 伦敦	3
美元 1,098	纽元 1,572	2021年4月7日	加拿大皇家银行	3
美元 1,096	澳元 1,442	2021年4月7日	美国道富银行	2
美元 498,948	离岸人民币 3,282,894	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	1,169
美元 172,755	离岸人民币 1,136,661	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	405
美元 40,428	离岸人民币 265,999	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	95
美元 14,949	纽元 21,411	2021年4月8日	多伦多道明银行	45
美元 1,100	离岸人民币 7,238	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	3
美元 1,102	纽元 1,575	2021年4月8日	巴克莱银行, 伦敦	1
美元 2,900	澳元 3,808	2021年4月8日	美国道富银行	0
纽元 18,287	美元 12,810	2021年4月9日	法国巴黎银行	3
美元 185,437	澳元 243,489	2021年4月9日	美林国际, 伦敦	25
离岸人民币 2,637,821	美元 401,879	2021年4月12日	高盛国际, 伦敦	156
离岸人民币 303,110	美元 46,180	2021年4月12日	高盛国际, 伦敦	18
离岸人民币 61,567	美元 9,380	2021年4月12日	高盛国际, 伦敦	4
澳元 1,856,848	美元 1,437,648	2021年4月21日	法国巴黎银行	23,237
澳元 1,347,557	美元 1,048,777	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	22,307
澳元 1,142,661	美元 889,566	2021年4月21日	美国道富银行	19,170
澳元 1,028,707	美元 798,976	2021年4月21日	法国巴黎银行	15,382
澳元 994,482	美元 770,246	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	12,722
澳元 974,138	美元 751,188	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	9,161
澳元 718,949	美元 555,648	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	8,005
澳元 566,718	美元 439,060	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	7,375
澳元 373,771	美元 292,015	2021年4月21日	法国巴黎银行	7,303
澳元 1,418,368	美元 1,087,548	2021年4月21日	法国巴黎银行	7,139
澳元 484,619	美元 375,590	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	6,442
澳元 591,373	美元 456,818	2021年4月21日	美国道富银行	6,353
澳元 396,581	美元 307,393	2021年4月21日	美国道富银行	5,307
澳元 782,278	美元 599,991	2021年4月21日	法国巴黎银行	4,109
澳元 631,757	美元 484,776	2021年4月21日	美国道富银行	3,550
澳元 163,438	美元 127,510	2021年4月21日	法国巴黎银行	3,014
澳元 363,606	美元 279,875	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	2,907
澳元 363,767	美元 279,096	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,005
澳元 206,985	美元 159,666	2021年4月21日	法国巴黎银行	2,000
澳元 98,548	美元 76,827	2021年4月21日	美国道富银行	1,760

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
澳元 90,023	美元 70,222	2021年4月21日	法国巴黎银行	1,649
澳元 642,355	美元 490,885	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,586
澳元 165,057	美元 127,250	2021年4月21日	加拿大皇家银行	1,521
澳元 657,785	美元 501,759	2021年4月21日	法国巴黎银行	706
澳元 82,279	美元 63,349	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	675
澳元 334,277	美元 255,037	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	409
澳元 301,009	美元 229,455	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	168
澳元 2,391	美元 1,853	2021年4月21日	加拿大皇家银行	32
澳元 1,427	美元 1,113	2021年4月21日	美国道富银行	25
澳元 1,426	美元 1,108	2021年4月21日	法国巴黎银行	21
澳元 1,420	美元 1,101	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	19
澳元 1,427	美元 1,106	2021年4月21日	加拿大皇家银行	18
澳元 1,420	美元 1,094	2021年4月21日	加拿大皇家银行	13
澳元 1,856	美元 1,426	2021年4月21日	加拿大皇家银行	12
澳元 1,420	美元 1,091	2021年4月21日	加拿大皇家银行	9
澳元 1,432	美元 1,092	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	1
加元 655,634	美元 524,706	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	3,038
加元 379,262	美元 303,655	2021年4月21日	加拿大皇家银行	1,888
加元 451,561	美元 360,971	2021年4月21日	加拿大皇家银行	1,678
加元 275,434	美元 220,801	2021年4月21日	加拿大皇家银行	1,647
加元 1,133,903	美元 903,757	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	1,545
加元 150,253	美元 120,845	2021年4月21日	加拿大皇家银行	1,293
加元 134,480	美元 107,352	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	350
加元 17,236	美元 13,844	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	129
加元 71,291	美元 56,804	2021年4月21日	美国道富银行	80
加元 402,650	美元 320,385	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	9
加元 1,370	美元 1,098	2021年4月21日	加拿大皇家银行	8
加元 1,383	美元 1,106	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	6
加元 1,368	美元 1,094	2021年4月21日	加拿大皇家银行	5
加元 1,378	美元 1,098	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	2
加元 1,380	美元 1,100	2021年4月21日	加拿大皇家银行	1
加元 1,391	美元 1,107	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	0
离岸人民币 246,763,417	美元 38,046,767	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	492,231
离岸人民币 35,211,015	美元 5,423,540	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	64,831
离岸人民币 31,779,513	美元 4,890,169	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	53,695
离岸人民币 16,823,985	美元 2,590,894	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	30,478
离岸人民币 14,370,305	美元 2,215,659	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	28,665
离岸人民币 13,113,316	美元 2,016,401	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	20,706
离岸人民币 10,569,401	美元 1,623,904	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	15,364
离岸人民币 12,691,038	美元 1,945,076	2021年4月21日	加拿大皇家银行	13,647
离岸人民币 5,538,430	美元 853,380	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	10,495
离岸人民币 5,611,095	美元 864,109	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	10,165
离岸人民币 4,986,336	美元 768,414	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	9,552
离岸人民币 14,656,618	美元 2,239,689	2021年4月21日	多伦多道明银行	9,122
离岸人民币 6,945,134	美元 1,065,552	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	8,583
离岸人民币 6,946,716	美元 1,065,594	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	8,384
离岸人民币 5,432,812	美元 835,052	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	8,241
离岸人民币 4,029,525	美元 621,285	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	8,038
离岸人民币 4,299,835	美元 661,927	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	7,542
离岸人民币 8,051,849	美元 1,232,561	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	7,163
离岸人民币 3,925,739	美元 604,564	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	7,112
离岸人民币 7,100,445	美元 1,086,775	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	6,169
离岸人民币 3,634,796	美元 559,315	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	6,141
离岸人民币 3,890,631	美元 598,011	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	5,902
离岸人民币 6,461,001	美元 989,037	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	5,747
离岸人民币 3,346,299	美元 514,922	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	5,654
离岸人民币 3,204,770	美元 493,350	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	5,621
离岸人民币 4,429,954	美元 679,484	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	5,296
离岸人民币 4,204,129	美元 645,003	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	5,183
离岸人民币 8,296,758	美元 1,267,834	2021年4月21日	多伦多道明银行	5,164
离岸人民币 6,859,595	美元 1,048,788	2021年4月21日	美国道富银行	4,837
离岸人民币 2,494,404	美元 384,346	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	4,727
离岸人民币 3,826,908	美元 587,129	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	4,718
离岸人民币 5,799,071	美元 886,704	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	4,152
离岸人民币 2,197,238	美元 337,864	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	3,469

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
离岸人民币 1,783,236	美元 274,804	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	3,416
离岸人民币 2,584,638	美元 396,546	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	3,194
离岸人民币 2,797,023	美元 428,752	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	3,077
离岸人民币 3,359,956	美元 514,310	2021年4月21日	美国道富银行	2,964
离岸人民币 2,475,296	美元 379,671	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,959
离岸人民币 2,701,388	美元 414,025	2021年4月21日	加拿大皇家银行	2,905
离岸人民币 2,758,625	美元 422,723	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	2,892
离岸人民币 2,276,167	美元 349,242	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	2,836
离岸人民币 2,274,447	美元 348,978	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	2,834
离岸人民币 28,179,386	美元 4,291,376	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	2,799
离岸人民币 2,114,775	美元 324,458	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,613
离岸人民币 2,365,552	美元 362,497	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,487
离岸人民币 3,070,947	美元 469,715	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,352
离岸人民币 1,801,226	美元 276,346	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,221
离岸人民币 1,404,028	美元 215,894	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,217
离岸人民币 17,225,489	美元 2,623,640	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	2,120
离岸人民币 2,879,302	美元 440,258	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	2,062
离岸人民币 2,582,177	美元 394,955	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,978
离岸人民币 2,167,459	美元 331,774	2021年4月21日	美国道富银行	1,912
离岸人民币 1,646,089	美元 252,247	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,731
离岸人民币 1,424,044	美元 218,442	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,719
离岸人民币 3,610,655	美元 551,006	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,506
离岸人民币 2,165,819	美元 330,960	2021年4月21日	多伦多道明银行	1,348
离岸人民币 1,168,291	美元 179,086	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1,285
离岸人民币 866,478	美元 132,776	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	908
离岸人民币 3,492,415	美元 532,381	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	875
离岸人民币 2,045,651	美元 312,178	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	853
离岸人民币 611,662	美元 93,819	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	731
离岸人民币 911,881	美元 139,476	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	698
离岸人民币 581,923	美元 89,174	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	612
离岸人民币 481,820	美元 73,928	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	600
离岸人民币 523,061	美元 80,152	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	548
离岸人民币 2,997,861	美元 456,774	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	534
离岸人民币 5,262,703	美元 801,445	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	523
离岸人民币 1,247,782	美元 190,418	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	520
离岸人民币 1,861,763	美元 283,805	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	467
离岸人民币 629,863	美元 96,309	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	451
离岸人民币 202,560	美元 31,135	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	307
离岸人民币 182,113	美元 28,023	2021年4月21日	美国道富银行	307
离岸人民币 239,853	美元 36,792	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	289
离岸人民币 1,607,144	美元 244,875	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	286
离岸人民币 196,961	美元 30,187	2021年4月21日	加拿大皇家银行	212
离岸人民币 103,618	美元 15,957	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	188
离岸人民币 115,279	美元 17,726	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	182
离岸人民币 148,213	美元 22,712	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	156
离岸人民币 64,121	美元 9,881	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	123
离岸人民币 48,781	美元 7,495	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	71
离岸人民币 606,338	美元 92,338	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	60
离岸人民币 30,416	美元 4,688	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	59
离岸人民币 331,626	美元 50,503	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	33
离岸人民币 32,703	美元 5,005	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	28
离岸人民币 17,932	美元 2,756	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	27
离岸人民币 15,806	美元 2,432	2021年4月21日	美国道富银行	27
离岸人民币 31,451	美元 4,810	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	24
离岸人民币 17,944	美元 2,752	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	22
离岸人民币 14,432	美元 2,218	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	22
离岸人民币 14,112	美元 2,165	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	18
离岸人民币 11,560	美元 1,773	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	14
离岸人民币 7,113	美元 1,095	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	12
离岸人民币 7,113	美元 1,095	2021年4月21日	美国道富银行	12
离岸人民币 7,163	美元 1,101	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	11
离岸人民币 9,347	美元 1,432	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	10
离岸人民币 8,354	美元 1,280	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	9
离岸人民币 7,162	美元 1,099	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	9
离岸人民币 7,151	美元 1,097	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	9

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
离岸人民币 7,138	美元 1,095	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	9
离岸人民币 7,138	美元 1,095	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	9
离岸人民币 7,155	美元 1,097	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	8
离岸人民币 7,155	美元 1,097	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	8
离岸人民币 7,154	美元 1,096	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	8
离岸人民币 7,154	美元 1,096	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	8
离岸人民币 7,154	美元 1,096	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	8
离岸人民币 7,151	美元 1,096	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	7
离岸人民币 51,385	美元 7,826	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	6
离岸人民币 7,177	美元 1,099	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	6
离岸人民币 7,165	美元 1,096	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	5
离岸人民币 7,165	美元 1,096	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	5
离岸人民币 7,165	美元 1,096	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	5
离岸人民币 7,177	美元 1,094	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1
英镑 589,887	美元 824,835	2021年4月21日	美国道富银行	10,915
英镑 56,443	美元 78,681	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	802
英镑 75,297	美元 104,588	2021年4月21日	多伦多道明银行	694
英镑 38,797	美元 54,119	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	588
英镑 26,193	美元 36,442	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	301
英镑 16,964	美元 23,676	2021年4月21日	加拿大皇家银行	269
英镑 23,414	美元 32,534	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	227
英镑 37,068	美元 51,246	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	101
英镑 9,521	美元 13,227	2021年4月21日	美国道富银行	89
英镑 6,968	美元 9,689	2021年4月21日	法国巴黎银行	76
英镑 18,026	美元 24,935	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	63
英镑 16,854	美元 23,287	2021年4月21日	加拿大皇家银行	32
英镑 9,990	美元 13,808	2021年4月21日	美国道富银行	24
英镑 791	美元 1,105	2021年4月21日	法国巴黎银行	14
英镑 845	美元 1,174	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	8
纽元 3,157,735	美元 2,264,614	2021年4月21日	多伦多道明银行	53,167
纽元 546,397	美元 397,645	2021年4月21日	法国巴黎银行	14,988
纽元 446,066	美元 324,724	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	12,332
纽元 636,866	美元 457,982	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	11,968
纽元 244,488	美元 177,222	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	6,000
纽元 355,982	美元 254,812	2021年4月21日	多伦多道明银行	5,509
纽元 231,843	美元 167,074	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	4,708
纽元 141,051	美元 102,644	2021年4月21日	美国道富银行	3,863
纽元 139,304	美元 101,091	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	3,533
纽元 257,796	美元 184,032	2021年4月21日	多伦多道明银行	3,491
纽元 195,249	美元 140,147	2021年4月21日	法国巴黎银行	3,408
纽元 179,697	美元 128,878	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	3,031
纽元 156,451	美元 111,898	2021年4月21日	美国道富银行	2,331
纽元 149,215	美元 106,813	2021年4月21日	多伦多道明银行	2,314
纽元 71,567	美元 52,083	2021年4月21日	法国巴黎银行	1,963
纽元 98,098	美元 70,443	2021年4月21日	美国道富银行	1,742
纽元 63,177	美元 45,443	2021年4月21日	法国巴黎银行	1,198
纽元 56,187	美元 40,134	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	785
纽元 52,430	美元 37,488	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	770
纽元 20,453	美元 14,654	2021年4月21日	美国道富银行	331
纽元 7,387	美元 5,323	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	150
纽元 10,115	美元 7,218	2021年4月21日	法国巴黎银行	135
纽元 1,535	美元 1,102	2021年4月21日	法国巴黎银行	27
纽元 1,526	美元 1,095	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	26
纽元 1,530	美元 1,095	2021年4月21日	法国巴黎银行	24
纽元 1,530	美元 1,095	2021年4月21日	法国巴黎银行	24
纽元 1,533	美元 1,078	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	4
美元 115,070,353	加元 146,035,370	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,125,466
美元 2,237,185	纽元 3,220,140	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	17,966
美元 1,374,569	加元 1,735,851	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	6,594
美元 1,455,470	离岸人民币 9,594,676	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	4,729
美元 463,721	加元 587,200	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	3,496
美元 731,749	加元 923,802	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	3,291
美元 360,412	加元 455,573	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,073
美元 809,323	离岸人民币 5,330,441	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1,908
美元 341,746	加元 431,654	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	1,708

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 125,567	加元 159,183	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,090
美元 290,233	加元 365,950	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	942
美元 127,753	澳元 168,751	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	789
美元 107,006	英镑 77,974	2021年4月21日	法国巴黎银行	581
美元 138,494	离岸人民币 912,975	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	450
美元 168,992	澳元 222,353	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	380
美元 52,240	加元 66,112	2021年4月21日	法国巴黎银行	364
美元 94,066	离岸人民币 620,100	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	306
美元 106,433	离岸人民币 701,000	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	251
美元 61,779	加元 77,932	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	229
美元 157,591	纽元 225,334	2021年4月21日	多伦多道明银行	216
美元 195,372	加元 245,801	2021年4月21日	美国道富银行	204
美元 55,499	加元 70,000	2021年4月21日	法国巴黎银行	197
美元 65,207	离岸人民币 429,471	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	154
美元 20,831	英镑 15,183	2021年4月21日	美国道富银行	119
美元 275,092	加元 345,836	2021年4月21日	多伦多道明银行	79
美元 6,783	加元 8,588	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	50
美元 15,104	离岸人民币 99,568	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	49
美元 123,436	英镑 89,492	2021年4月21日	加拿大皇家银行	45
美元 2,593	加元 3,278	2021年4月21日	法国巴黎银行	15
美元 6,286	纽元 8,987	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	8
加元 96,929	美元 77,141	2021年5月21日	加拿大皇家银行	16
加元 5,173	美元 4,117	2021年5月21日	加拿大皇家银行	1
离岸人民币 3,247,355	美元 493,338	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦	263
离岸人民币 883,675	美元 134,248	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦	71
离岸人民币 7,234	美元 1,099	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦	1
离岸人民币 7,234	美元 1,099	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦	1
离岸人民币 349,929,423	美元 53,495,386	2021年6月3日	香港上海汇丰银行有限公司	415,193
离岸人民币 216,221,379	美元 33,000,000	2021年6月3日	花旗银行, 伦敦	201,750
离岸人民币 157,842,325	美元 24,137,525	2021年6月3日	高盛国际, 伦敦	194,694
离岸人民币 117,424,350	美元 18,000,000	2021年6月3日	高盛国际, 伦敦	188,102
离岸人民币 224,112,972	美元 34,000,000	2021年6月3日	花旗银行, 伦敦	4,688
欧元 57,522,774	美元 68,692,557	2021年6月3日	渣打银行, 伦敦	996,191
印尼盾 257,184,000,000	美元 18,000,000	2021年6月3日	渣打银行, 伦敦	380,273
印尼盾 1,008,449,659,348	美元 69,404,657	2021年6月3日	渣打银行, 伦敦	315,569
印度卢比 4,341,330,240	美元 59,276,816	2021年6月3日	花旗银行, 伦敦	399,679
印度卢比 1,211,883,750	美元 16,500,000	2021年6月3日	渣打银行, 伦敦	64,428
新加坡元 68,650,192	美元 52,000,000	2021年6月3日	花旗银行, 伦敦	922,014
新加坡元 44,327,382	美元 33,000,000	2021年6月3日	香港上海汇丰银行有限公司	18,980
台币 936,540,000	美元 33,000,000	2021年6月3日	花旗银行, 伦敦	166,213
美元 16,953,884	俄罗斯卢布 1,296,641,500	2021年6月3日	花旗银行, 伦敦	81,007
美元 25,000,000	离岸人民币 164,823,625	2021年6月3日	香港上海汇丰银行有限公司	1,813
			未实现总收益	6,833,431
				-----
澳元 168,751	美元 127,744	2021年4月1日	美林国际, 伦敦	(785)
加元 70,000	美元 55,498	2021年4月1日	法国巴黎银行	(197)
纽元 3,220,140	美元 2,237,354	2021年4月1日	汇丰银行, 伦敦	(17,871)
美元 190,724	离岸人民币 1,247,782	2021年4月1日	高盛国际, 伦敦	(548)
美元 501,715	澳元 657,785	2021年4月1日	法国巴黎银行	(712)
美元 312,678	离岸人民币 2,045,651	2021年4月1日	高盛国际, 伦敦	(898)
美元 551,890	离岸人民币 3,610,655	2021年4月1日	高盛国际, 伦敦	(1,586)
加元 77,932	美元 61,778	2021年4月7日	美林国际, 伦敦	(229)
加元 431,654	美元 341,740	2021年4月7日	渣打银行, 伦敦	(1,706)
英镑 89,492	美元 123,431	2021年4月7日	加拿大皇家银行	(43)
纽元 8,987	美元 6,286	2021年4月7日	高盛国际, 伦敦	(8)
美元 4,117	加元 5,173	2021年4月7日	加拿大皇家银行	(1)
美元 255,022	澳元 334,277	2021年4月7日	花旗银行, 伦敦	(411)
澳元 222,353	美元 168,981	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	(380)
离岸人民币 99,568	美元 15,119	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	(49)



交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
离岸人民币 620,100	美元 94,161	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	(306)
离岸人民币 912,975	美元 138,633	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	(450)
离岸人民币 9,594,676	美元 1,456,930	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	(4,728)
美元 1,103	离岸人民币 7,234	2021年4月8日	高盛国际, 伦敦	(1)
离岸人民币 429,471	美元 65,262	2021年4月9日	花旗银行, 伦敦	(159)
离岸人民币 701,000	美元 106,523	2021年4月9日	花旗银行, 伦敦	(259)
离岸人民币 5,330,441	美元 810,010	2021年4月9日	花旗银行, 伦敦	(1,969)
美元 1,103	离岸人民币 7,234	2021年4月9日	高盛国际, 伦敦	(1)
美元 77,138	加元 96,929	2021年4月9日	加拿大皇家银行	(16)
美元 134,680	离岸人民币 883,675	2021年4月9日	高盛国际, 伦敦	(71)
美元 494,926	离岸人民币 3,247,355	2021年4月9日	高盛国际, 伦敦	(261)
澳元 1,442	美元 1,096	2021年4月21日	美国道富银行	(2)
澳元 492,756	美元 373,032	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(2,314)
加元 8,728	美元 6,912	2021年4月21日	法国巴黎银行	(32)
加元 19,479	美元 15,430	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(68)
加元 26,571	美元 20,984	2021年4月21日	法国巴黎银行	(157)
加元 72,788	美元 57,732	2021年4月21日	法国巴黎银行	(183)
加元 84,677	美元 66,912	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(463)
加元 983,148	美元 781,628	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(633)
加元 112,570	美元 88,918	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(651)
加元 406,696	美元 322,933	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(662)
加元 146,533	美元 115,592	2021年4月21日	法国巴黎银行	(1,000)
加元 226,827	美元 179,330	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(1,149)
加元 423,729	美元 335,982	2021年4月21日	美国道富银行	(1,166)
加元 235,537	美元 186,050	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(1,360)
加元 602,042	美元 476,874	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(2,151)
加元 385,959	美元 304,794	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(2,301)
加元 521,364	美元 412,451	2021年4月21日	法国巴黎银行	(2,382)
加元 356,115	美元 279,987	2021年4月21日	法国巴黎银行	(3,363)
加元 815,293	美元 643,939	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(4,764)
加元 1,430,116	美元 1,131,205	2021年4月21日	法国巴黎银行	(6,695)
离岸人民币 7,238	美元 1,099	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(3)
离岸人民币 7,238	美元 1,099	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(3)
离岸人民币 57,709	美元 8,776	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(7)
离岸人民币 265,999	美元 40,387	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(95)
离岸人民币 602,532	美元 91,410	2021年4月21日	美国道富银行	(288)
离岸人民币 1,136,661	美元 172,582	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(405)
离岸人民币 2,016,343	美元 306,363	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(502)
离岸人民币 3,556,156	美元 540,321	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(885)
离岸人民币 1,958,332	美元 297,099	2021年4月21日	美国道富银行	(937)
离岸人民币 3,282,894	美元 498,449	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,169)
离岸人民币 12,527,682	美元 1,905,142	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,426)
离岸人民币 6,215,276	美元 942,920	2021年4月21日	美国道富银行	(2,973)
英镑 3,052	美元 4,188	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(23)
纽元 1,572	美元 1,098	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(3)
纽元 34,395	美元 24,057	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(30)
纽元 21,411	美元 14,949	2021年4月21日	多伦多道明银行	(45)
纽元 268,289	美元 187,593	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(297)
纽元 58,022	美元 40,314	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(321)
纽元 185,508	美元 129,536	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(380)
美元 2,609	离岸人民币 17,130	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(2)
美元 1,160	澳元 1,521	2021年4月21日	美国道富银行	(2)
美元 4,511	英镑 3,265	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(6)
美元 1,292	离岸人民币 8,443	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(8)
美元 1,896	离岸人民币 12,403	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(9)
美元 1,180	离岸人民币 7,690	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(10)
美元 2,975	离岸人民币 19,471	2021年4月21日	多伦多道明银行	(12)
美元 1,590	离岸人民币 10,365	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(12)
美元 2,814	离岸人民币 18,384	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(16)
美元 2,484	澳元 3,239	2021年4月21日	法国巴黎银行	(17)
美元 3,794	离岸人民币 24,813	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(18)
美元 1,469	离岸人民币 9,534	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(18)
美元 1,105	澳元 1,427	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(18)
美元 3,336	离岸人民币 21,793	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(19)
美元 2,090	澳元 2,714	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(22)



交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 1,766	离岸人民币 11,452	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(23)
美元 3,396	离岸人民币 22,135	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(27)
美元 23,534	离岸人民币 154,456	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(28)
美元 2,403	离岸人民币 15,583	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(31)
美元 6,371	离岸人民币 41,642	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(34)
美元 3,586	离岸人民币 23,331	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(35)
美元 3,081	离岸人民币 20,000	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(37)
美元 2,892	离岸人民币 18,761	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(37)
美元 2,981	离岸人民币 19,334	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(39)
美元 34,259	加元 43,000	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(45)
美元 5,688	离岸人民币 37,080	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(45)
美元 4,458	英镑 3,198	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(45)
美元 13,625	英镑 9,840	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(48)
美元 10,372	离岸人民币 67,835	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(49)
美元 20,627	离岸人民币 135,170	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(56)
美元 1,496	纽元 2,056	2021年4月21日	美国道富银行	(56)
美元 14,380	离岸人民币 94,105	2021年4月21日	多伦多道明银行	(59)
美元 116,673	离岸人民币 766,159	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(72)
美元 6,872	澳元 8,925	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(73)
美元 9,583	离岸人民币 62,452	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(79)
美元 8,766	离岸人民币 57,015	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(89)
美元 161,839	离岸人民币 1,062,752	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(100)
美元 19,309	离岸人民币 126,000	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(133)
美元 14,619	英镑 10,472	2021年4月21日	美国道富银行	(170)
美元 22,250	英镑 16,000	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(173)
美元 8,275	澳元 10,630	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(178)
美元 150,557	离岸人民币 988,104	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(179)
美元 27,603	英镑 19,857	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(204)
美元 52,567	离岸人民币 344,006	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(214)
美元 192,116	离岸人民币 1,260,854	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(229)
美元 34,631	离岸人民币 226,002	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(236)
美元 32,240	加元 40,218	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(240)
美元 52,387	离岸人民币 342,500	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(262)
美元 26,712	离岸人民币 173,791	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(263)
美元 197,727	加元 248,087	2021年4月21日	多伦多道明银行	(332)
美元 50,581	离岸人民币 330,012	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(357)
美元 54,648	离岸人民币 356,632	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(373)
美元 27,180	澳元 35,166	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(393)
美元 69,902	离岸人民币 456,656	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(404)
美元 115,428	纽元 164,155	2021年4月21日	多伦多道明银行	(465)
美元 61,602	离岸人民币 401,500	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(499)
美元 357,250	澳元 468,329	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(511)
美元 689,738	澳元 904,803	2021年4月21日	美国道富银行	(525)
美元 67,253	离岸人民币 438,457	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(525)
美元 92,181	离岸人民币 602,200	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(533)
美元 419,754	澳元 550,316	2021年4月21日	美国道富银行	(564)
美元 218,763	离岸人民币 1,433,563	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(592)
美元 87,984	离岸人民币 574,150	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(605)
美元 89,601	英镑 64,497	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(610)
美元 135,870	离岸人民币 888,578	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(638)
美元 32,205	纽元 44,979	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(705)
美元 60,524	离岸人民币 393,046	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(707)
美元 63,215	澳元 82,000	2021年4月21日	多伦多道明银行	(753)
美元 74,929	离岸人民币 487,333	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(763)
美元 68,074	离岸人民币 442,079	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(795)
美元 102,455	离岸人民币 667,985	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(796)
美元 1,357,010	离岸人民币 8,911,117	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(841)
美元 72,640	离岸人民币 471,536	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(878)
美元 34,206	纽元 47,573	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(889)
美元 69,305	英镑 49,564	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(917)
美元 179,569	加元 224,497	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(944)
美元 121,308	离岸人民币 790,635	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(982)
美元 90,905	离岸人民币 590,763	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(998)
美元 58,603	澳元 75,607	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,011)
美元 868,430	离岸人民币 5,699,480	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,035)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 63,635	纽元 89,177	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,182)
美元 96,914	澳元 125,636	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(1,214)
美元 252,061	离岸人民币 1,648,137	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(1,234)
美元 170,809	离岸人民币 1,113,555	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(1,339)
美元 166,616	离岸人民币 1,085,991	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,341)
美元 198,390	澳元 258,664	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,359)
美元 138,507	离岸人民币 901,130	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,365)
美元 173,224	离岸人民币 1,129,092	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,389)
美元 120,107	英镑 85,962	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,498)
美元 178,802	离岸人民币 1,163,451	2021年4月21日	美国道富银行	(1,738)
美元 223,463	离岸人民币 1,456,554	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,792)
美元 260,646	离岸人民币 1,700,565	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,840)
美元 633,135	加元 793,091	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(2,097)
美元 77,031	纽元 106,903	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(2,164)
美元 445,833	离岸人民币 2,915,139	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(2,182)
美元 341,991	离岸人民币 2,232,528	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(2,226)
美元 349,115	澳元 455,315	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(2,289)
美元 297,864	离岸人民币 1,942,006	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(2,313)
美元 138,743	澳元 179,074	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(2,337)
美元 369,691	加元 461,662	2021年4月21日	多伦多道明银行	(2,361)
美元 302,931	离岸人民币 1,974,897	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(2,374)
美元 299,608	离岸人民币 1,952,822	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(2,411)
美元 485,063	离岸人民币 3,171,302	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(2,427)
美元 105,362	纽元 146,948	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(2,450)
美元 200,793	离岸人民币 1,302,700	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(2,537)
美元 201,233	离岸人民币 1,305,559	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(2,542)
美元 324,105	离岸人民币 2,108,923	2021年4月21日	美国道富银行	(3,151)
美元 384,108	澳元 500,000	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(3,245)
美元 130,997	澳元 167,653	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(3,291)
美元 199,603	澳元 257,685	2021年4月21日	美国道富银行	(3,317)
美元 116,335	纽元 160,940	2021年4月21日	多伦多道明银行	(3,625)
美元 926,422	离岸人民币 6,062,607	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(3,763)
美元 161,413	纽元 225,065	2021年4月21日	美国道富银行	(3,794)
美元 426,022	加元 530,441	2021年4月21日	多伦多道明银行	(3,966)
美元 618,207	离岸人民币 4,035,677	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(4,023)
美元 177,321	澳元 227,464	2021年4月21日	法国巴黎银行	(4,055)
美元 3,016,074	离岸人民币 19,791,104	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(4,098)
美元 1,557,909	离岸人民币 10,209,021	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(4,214)
美元 275,936	澳元 356,590	2021年4月21日	法国巴黎银行	(4,312)
美元 630,452	离岸人民币 4,110,409	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(4,896)
美元 212,306	纽元 295,903	2021年4月21日	多伦多道明银行	(5,077)
美元 739,505	离岸人民币 4,824,845	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(5,220)
美元 1,043,354	离岸人民币 6,821,370	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(5,221)
美元 301,344	澳元 387,606	2021年4月21日	美国道富银行	(6,094)
美元 1,322,281	离岸人民币 8,647,622	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(6,213)
美元 403,815	澳元 521,581	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(6,513)
美元 316,623	澳元 406,726	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(6,809)
美元 282,233	纽元 393,082	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(6,948)
美元 1,287,478	离岸人民币 8,410,861	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(7,442)
美元 700,715	加元 871,225	2021年4月21日	法国巴黎银行	(7,508)
美元 983,633	离岸人民币 6,411,414	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(7,890)
美元 1,061,155	离岸人民币 6,917,257	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(8,428)
美元 863,434	离岸人民币 5,617,532	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(8,511)
美元 1,251,811	离岸人民币 8,169,251	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(8,546)
美元 1,608,430	离岸人民币 10,512,399	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(8,564)
美元 1,083,506	离岸人民币 7,061,858	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(8,773)
美元 1,200,665	离岸人民币 7,827,777	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(9,368)
美元 586,259	澳元 755,794	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(10,550)
美元 1,352,929	离岸人民币 8,818,285	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(10,888)
美元 1,137,874	离岸人民币 7,400,125	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(11,661)
美元 1,946,140	离岸人民币 12,699,713	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(13,391)
美元 1,163,198	离岸人民币 7,553,920	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(13,578)
美元 830,727	澳元 1,069,609	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(15,976)
美元 2,158,929	离岸人民币 14,069,548	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(17,707)
美元 1,641,945	离岸人民币 10,670,427	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(18,030)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／ (亏损) 美元
美元 1,845,742	离岸人民币 11,981,415	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(22,309)
美元 619,526	纽元 851,799	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(22,988)
美元 9,652,698	英镑 6,978,705	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(23,572)
美元 2,512,549	离岸人民币 16,341,435	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(25,572)
美元 1,143,713	澳元 1,466,319	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(26,778)
美元 1,366,086	澳元 1,751,024	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(32,284)
美元 1,023,347	纽元 1,406,308	2021年4月21日	法国巴黎银行	(38,471)
美元 4,786,518	离岸人民币 31,053,891	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(60,475)
美元 110,399,582	离岸人民币 724,428,254	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(149,987)
美元 247,054,886	离岸人民币 1,621,143,282	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(335,645)
美元 180,266,336	澳元 235,897,593	2021年4月21日	法国巴黎银行	(576,770)
美元 674,568,056	离岸人民币 4,426,431,260	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(916,459)
美元 68,367,285	纽元 96,153,124	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,028,656)
澳元 3,808	美元 2,900	2021年5月21日	美国道富银行	(0)
澳元 243,489	美元 185,472	2021年5月21日	美林国际, 伦敦	(23)
纽元 1,575	美元 1,102	2021年5月21日	巴克莱银行, 伦敦	(1)
美元 1,100	离岸人民币 7,238	2021年5月21日	美国道富银行	(1)
美元 12,809	纽元 18,287	2021年5月21日	法国巴黎银行	(3)
美元 9,353	离岸人民币 61,567	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦	(4)
美元 46,045	离岸人民币 303,110	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦	(21)
美元 400,711	离岸人民币 2,637,821	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦	(187)
美元 16,500,000	新加坡元 22,171,001	2021年6月3日	香港上海汇丰银行有限公司	(4,051)
美元 20,208,403	印尼盾 293,789,763,635	2021年6月3日	渣打银行, 伦敦	(80,808)
美元 50,021,067	韩元 56,466,781,629	2021年6月3日	花旗银行, 伦敦	(131,846)
美元 16,936,063	离岸人民币 110,443,050	2021年6月3日	花旗银行, 伦敦	(183,147)
美元 18,000,000	新加坡元 23,865,264	2021年6月3日	花旗银行, 伦敦	(243,464)
美元 33,232,172	新加坡元 44,196,595	2021年6月3日	渣打银行, 伦敦	(348,461)
美元 67,361,532	台币 1,901,158,000	2021年6月3日	美林国际, 伦敦	(709,583)
巴西雷亚尔 50,143,498	美元 8,500,000	2021年6月29日	渣打银行, 伦敦	(328,231)
			未实现总亏损	(5,728,104)
			未实现净收益	1,105,327

(b) 期货

以下为截至二零二一年三月三十一日之未平仓期货合约:

	标的资产	交易对手	未实现收益／ (亏损) 美元
<u>截至二零二一年三月三十一日</u>			
US 10yr Note (CBT) Fut 06/21	US Treasury N/B 2.75 15/02/28	花旗集团全球市场公司伦敦分行	717,984
US 5yr Note (CBT) Fut 06/21	US Treasury N/B 0.25 31/08/25	花旗集团全球市场公司伦敦分行	1,030,179
		未实现总收益	1,748,163
		未实现总亏损	(1,052,469)
		未实现净收益	695,694

**抵押品持有情况**

截至二零二一年三月三十一日 (未经审计)

抵押品提供方	抵押品的性质	到期期限	计价货币	抵押品所涵盖资产净值百分比	抵押品价值 美元
渣打银行, 伦敦	现金	不适用	美元	0.0	90,000
				0.0	90,000

**现金抵押品再投资详情**

截至二零二一年三月三十一日止期间, 未进行现金抵押品再投资。

**托管/保管安排**

现金抵押证券托管人	收到/持有的抵押品金额 二零二一年三月三十一日 美元	计划下提供的抵押品所占比例 二零二一年三月三十一日 %
隔离账户 香港上海汇丰银行有限公司	90,000	100.0

财务状况表

截至二零二一年三月三十一日 (未经审计)

	二零二一年 三月三十一日 美元	二零二零年 九月三十日 美元
<b>资产</b>		
银行现金	119,757,904	167,618,765
现金抵押	90,000	-
应收经纪款项	5,991,457	-
分配应收款项	16,677,382	17,442,187
保证金	867,011	1,517,682
衍生产品	8,581,594	14,308,682
投资	3,187,030,810	2,970,845,481
可退回税项	101,649	-
利息及其他应收款项	2,674	8,777
<b>总资产</b>	<b>3,339,100,481</b>	<b>3,171,741,574</b>
<b>负债</b>		
透支经纪款项	-	391,036
应付经纪款项	8,690,000	8,008,676
赎回应付款项	18,720,265	38,349,734
应付收益分配 [附注 6]	12,565,747	10,520,730
衍生产品	6,780,573	12,715,877
其他应付款项	3,420,134	3,351,092
<b>总负债 (不含可赎回份额持有人 应占净资产)</b>	<b>50,176,719</b>	<b>73,337,145</b>
<b>可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]</b>	<b>3,288,923,762</b>	<b>3,098,404,429</b>

综合收益表

截至二零二一年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元	二零一九年 十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元
<b>收入</b>		
投资及衍生性产品净收益 / (亏损) [附注 4]	148,985,958	(159,762,127)
汇兑净亏损	(1,412,556)	(5,345,739)
存款利息	136,281	1,134,193
其他收益	1,163,534	336,264
<b>支出</b>		
管理费用 [附注 5(a)]	17,119,302	16,191,955
受托人费用 [附注 5(b)]	435,482	414,701
托管费用及银行费用 [附注 5(a), 5(b)]	290,918	309,079
基金注册登记机构费用 [附注 5(a)]	130,792	122,194
法律及专业费用	45,905	37,299
交易成本 [附注 5(b)]	43,310	1,499,836
印刷及出版支出	21,807	1,453
核数师酬金	13,013	17,542
估值费用 [附注 5(a)]	8,470	8,680
其他经营费用	10,002	5,296
<b>净经营利润 / (亏损)</b>	<b>130,754,216</b>	<b>(182,245,444)</b>
<b>财务成本</b>		
收益分配 [附注 6]	(71,066,349)	(52,363,876)
利息支出 [附注 5(b)]	(324)	(2,885)
	(71,066,673)	(52,366,761)
<b>除税前利润 / (亏损)</b>	<b>59,687,543</b>	<b>(234,612,205)</b>
税项 [附注 7]	(986,023)	(1,101,579)
<b>可赎回份额持有人应占净 资产及总综合收益之增 加 / (减少)</b>	<b>58,701,520</b>	<b>(235,713,784)</b>

可赎回份额持有人应占净资产变动表  
截至二零二一年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元	二零一九年 十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元
期初可赎回份额持有人应占净资产	3,098,404,429	3,314,484,481
分配可赎回份额(附注 3)	1,510,901,452	1,193,349,128
赎回可赎回份额(附注 3)	(1,379,083,639)	(1,659,897,610)
<b>净分配 / (赎回)</b>	<u>131,817,813</u>	<u>(466,548,482)</u>
	3,230,222,242	2,847,935,999
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>58,701,520</u>	<u>(235,713,784)</u>
期末可赎回份额持有人应占净资产	<u><u>3,288,923,762</u></u>	<u><u>2,612,222,215</u></u>

现金流量表  
截至二零二一年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元	二零一九年 十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元
<b>经营业务</b>		
购入投资及衍生性产品	(1,475,262,065)	(2,082,394,121)
出售投资及衍生性产品所得 款项	1,402,544,345	2,690,996,589
已收利息	138,746	1,136,594
保证金之减少	650,671	816,296
已付交易成本	(44,596)	(1,501,992)
现金抵押之增加	(90,000)	-
已付基金注册登记机构费用	(248,342)	(246,733)
透支经纪款项之(减少) / 增 加	(391,036)	8,101,017
已付受托人费用	(424,175)	(419,096)
已付税项	(1,527,037)	(1,535,621)
已付管理费用	(16,696,611)	(16,394,928)
其他	(937,858)	(5,311,104)
<b>经营业务所(运用) / 产生 之现金净额</b>	<u>(92,287,958)</u>	<u>593,246,901</u>
<b>融资活动</b>		
已付利息	(324)	(2,885)
分配可赎回份额所得款项	1,511,666,257	1,175,999,487
赎回可赎回份额付款	(1,398,713,108)	(1,672,565,718)
已付收益分配	(69,021,332)	(53,102,102)
<b>融资活动所产生 / (运用) 之现金净额</b>	<u>43,931,493</u>	<u>(549,671,218)</u>
<b>现金及现金等价物之(减 少) / 增加</b>	<u>(48,356,465)</u>	<u>43,575,683</u>
期初现金及现金等价物	167,618,765	152,014,642
现金及现金等价物之汇兑收 益 / (亏损)	495,604	(66,196)
<b>期末现金及现金等价物</b>	<u><u>119,757,904</u></u>	<u><u>195,524,129</u></u>
<b>现金及现金等价物余额分析:</b>		
银行现金	<u><u>119,757,904</u></u>	<u><u>195,524,129</u></u>

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。

二零二零年四月三十日之前，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）。

二零二零年四月三十日之后，本基金之投资目标为通过一个主要投资（即至少为资产净值总额的 70%）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 主要会计政策概览

(a) 中期财务报表之会计政策

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二零二零年九月三十日止年度财务报表所采纳的会计政策和计算方法一致。

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公允价值为负数的衍生性产品合约列示为按公允价值透过损益列账的负债。

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、终止确认及计量

投资及衍生性产品之买卖于交易日确认。投资及衍生性产品先以公允价值确认，其后以公允价值重新计量。投资及衍生性产品所产生之已实现及未实现收益及亏损确认于综合收益表内。当收取投资及衍生性产品现金流量的权利已终止或本基金已转移差不多所有风险和回报时，即终止确认投资及衍生性产品。

公允价值估计

公允价值指在计量日期，于一项有序交易中由市场参与者出售一项资产而应收取或转让一项负债而应支付的价格。在活跃市场中买卖的金融资产和负债的公允价值，按最后成交价计算。当被投资公司的证券交易暂停，该投资的价值按基金管理人估计的公允价值计算。

债务证券及货币市场的公允价值按包括应计利息的报价计算。

集体投资计划的投资以基于相关基金管理人决定的各基金每份额净资产价值得出的公允价值而计算，或如集体投资计划为上市或在交易所买卖，则以最后成交价计算。

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。

**(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）**

二零二零年十月一日至二零二一年三月三十一日

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	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:					
期初	23,139,739.418	15,637,072.647	510,399.441	422,240,159.913	10,763,076.055
总分配	11,287,135.966	4,459,775.113	351,389.262	241,817,876.727	2,977,209.341
总赎回	(7,806,010.663)	(3,602,734.321)	(150,584.819)	(144,204,747.303)	(2,609,379.496)
期末	26,620,864.721	16,494,113.439	711,203.884	519,853,289.337	11,130,905.900



二零二零年十月一日至二零二一年三月三十一日

	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:					
期初	1,116,424.680	403,471,907.385	195,694.858	68,929,752.615	187,806,607.220
总分配	1,345,320.201	161,976,536.796	5,273,592.718	38,998,973.447	20,705,155.450
总赎回	(1,131,207.625)	(70,329,688.376)	(39,186.369)	(31,063,491.305)	(116,062,418.620)
期末	<u>1,330,537.256</u>	<u>495,118,755.805</u>	<u>5,430,101.207</u>	<u>76,865,234.757</u>	<u>92,449,344.050</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:			
期初	77,860,626.410	41,449,894.640	3,677,328.270
总分配	9,543,866.960	24,918,384.050	581,198.190
总赎回	(15,186,974.600)	(32,995,701.030)	(605,629.000)
期末	<u>72,217,518.770</u>	<u>33,372,577.660</u>	<u>3,652,897.460</u>

二零一九年十月一日至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	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:					
期初	23,120,286.731	15,239,581.017	397,919.405	413,104,210.370	10,008,306.114
总分配	6,664,712.240	3,522,969.374	129,609.249	138,906,144.089	2,221,471.717
总赎回	(9,038,565.401)	(4,270,005.234)	(175,100.224)	(190,496,486.547)	(2,737,661.171)
期末	<u>20,746,433.570</u>	<u>14,492,545.157</u>	<u>352,428.430</u>	<u>361,513,867.912</u>	<u>9,492,116.660</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:					
期初	7,498,386.140	417,317,877.377	208,910.265	51,306,924.587	455,943,516.850
总分配	111,636.878	65,625,776.660	41,766.579	29,794,702.548	236,997,042.020
总赎回	(6,353,079.236)	(108,223,982.484)	(41,916.732)	(30,819,026.305)	(388,265,111.040)
期末	<u>1,256,943.782</u>	<u>374,719,671.553</u>	<u>208,760.112</u>	<u>50,282,600.830</u>	<u>304,675,447.830</u>

二零一九年十月一日至二零二零年三月三十一日

	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:			
期初	89,548,206.750	38,078,109.890	3,869,878.100
总分配	13,456,980.140	6,757,599.670	690,537.490
总赎回	(28,106,850.720)	(9,596,146.120)	(1,200,354.500)
期末	<u>74,898,336.170</u>	<u>35,239,563.440</u>	<u>3,360,061.090</u>

二零二一年三月三十一日

	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	英镑对冲类别 (每月派息) 英镑	港元类别 (每月派息) 港元	纽元对冲类别 (每月派息) 纽元
可赎回份额持有人应占 净资产	<u>228,802,084</u>	<u>143,450,913</u>	<u>6,466,245</u>	<u>4,813,191,693</u>	<u>95,321,288</u>
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	<u>8.59</u>	<u>8.70</u>	<u>9.09</u>	<u>9.26</u>	<u>8.56</u>
	人民币对冲类别 (累计) 人民币	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	美元类别 (累计) 美元	美元类别 (每月派息) 美元	PRC 人民币对冲份 额 (累计) 人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	<u>18,961,568</u>	<u>4,411,731,657</u>	<u>74,167,790</u>	<u>816,713,144</u>	<u>1,251,070,316</u>
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	<u>14.25</u>	<u>8.91</u>	<u>13.66</u>	<u>10.63</u>	<u>13.53</u>
	PRC 人民币对冲份额 (每月派息) 人民币	PRC 美元份额 (累计) 美元	PRC 美元份额 (每月派息) 美元		
可赎回份额持有人应占 净资产	<u>695,541,438</u>	<u>407,506,044</u>	<u>35,378,497</u>		
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	<u>9.63</u>	<u>12.21</u>	<u>9.69</u>		

二零二零年九月三十日

	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	英镑对冲类别 (每月派息) 英镑	港元类别 (每月派息) 港元	纽元对冲类别 (每月派息) 纽元
可赎回份额持有人应占 净资产	200,080,050	136,678,850	4,665,897	3,917,117,050	92,667,985
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	8.65	8.74	9.14	9.28	8.61
	人民币对冲类别 (累计) 人民币	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	美元类别 (累计) 美元	美元类别 (每月派息) 美元	PRC 人民币对冲份 额 (累计) 人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	15,430,879	3,618,794,584	2,621,058	736,162,668	2,461,936,140
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	13.82	8.97	13.39	10.68	13.11
	PRC 人民币对冲份额 (每月派息) 人民币	PRC 美元份额 (累计) 美元	PRC 美元份额 (每月派息) 美元		
可赎回份额持有人应占 净资产	754,021,450	495,983,658	35,772,394		
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	9.68	11.97	9.73		

4 投资及衍生性产品净收益 / (亏损)

	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元	二零一九年 十月一日至 二零二零年 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	(18,409,098)	(258,411,184)
投资及衍生性产品销售之实现收益	167,395,056	98,649,057
	<u>148,985,958</u>	<u>(159,762,127)</u>

5 与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之交易

(a) 截至二零二一年三月三十一日及二零二零年三月三十一日止期间，支付给管理人，摩根基金（亚洲）有限公司，及其关联人士的金額如下：

	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元	二零一九年 十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元
管理费用	17,119,302	16,191,955
基金注册登记机构费用	130,792	122,194
托管费用及银行费用	10,580	20,660
估值费用	8,470	8,680

(b) 截至二零二一年三月三十一日及二零二零年三月三十一日止期间，支付给受托人，汇丰机构信托服务（亚洲）有限公司，及其关联人士的金額如下：

	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元	二零一九年 十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元
受托人费用	435,482	414,701
托管费用及银行费用	248,573	245,584
交易成本	5,830	60,428
利息支出	324	778

6 收益分配

二零二零年八月三十一日之前，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	二零二零年	二零一九年
					十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元	十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元
澳元对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	澳元 0.0349	23,084,466.386	(564,356)	
加元对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	加元 0.0353	16,151,109.143	(426,556)	
英镑对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	英镑 0.0363	516,526.972	(24,169)	
港元对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	港元 0.0382	440,467,908.960	(2,170,129)	
纽元对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	纽元 0.0355	10,788,959.064	(252,785)	
人民币对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	人民币 0.0584	410,675,897.533	(3,568,597)	
美元类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0440	71,069,638.609	(3,127,064)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	人民币 0.0630	77,925,800.540	(730,478)	
PRC 美元份额（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0401	3,723,020.140	(149,293)	
澳元对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年12月8日	澳元 0.0341	24,367,922.114	(614,734)	
加元对冲类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	加元 0.0351	16,153,143.936	(436,958)	
英镑对冲类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	英镑 0.0361	570,102.852	(27,465)	
港元对冲类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	港元 0.0382	471,232,405.452	(2,322,495)	
纽元对冲类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	纽元 0.0353	10,632,017.284	(264,068)	
人民币对冲类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	人民币 0.0565	429,024,551.741	(3,690,295)	
美元类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0440	74,333,057.194	(3,270,655)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	人民币 0.0609	76,715,140.290	(711,261)	
PRC 美元份额（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0401	3,683,340.710	(147,702)	
澳元对冲类别（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	澳元 0.0318	24,540,427.789	(599,726)	
加元对冲类别（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	加元 0.0335	16,198,172.444	(425,332)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零二零年	二零一九年
					十月一日至 二零二一年 三月三十一日	十月一日至 二零二零年 三月三十一日
					美元	美元
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	英镑 0.0328	611,338.068		(27,290)
港元类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	港币 0.0382	471,963,350.121		(2,325,617)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	纽元 0.0343	10,523,473.158		(260,014)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	人民币 0.0566	439,266,135.113		(3,822,583)
美元类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0440	73,085,260.411		(3,215,752)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	人民币 0.0612	74,058,810.000		(696,653)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0401	3,667,262.340		(147,057)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	澳元 0.0328	24,993,739.522		(628,742)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	加元 0.0342	16,130,109.173		(430,808)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	英镑 0.0346	730,981.397		(34,701)
港元类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	港币 0.0383	505,446,087.819		(2,496,867)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月9日	纽元 0.0341	10,641,472.357		(259,854)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	人民币 0.0540	466,387,814.988		(3,889,626)
美元类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0440	76,032,676.976		(3,345,438)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	人民币 0.0584	74,475,661.540		(671,729)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0401	3,545,702.910		(142,183)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	澳元 0.0343	26,997,331.026		(736,871)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	加元 0.0355	16,517,482.812		(468,478)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	英镑 0.0365	755,143.127		(38,953)
港元类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	港币 0.0382	521,363,238.548		(2,568,457)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	纽元 0.0356	11,045,285.746		(292,491)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	人民币 0.0555	487,034,944.886		(4,183,048)
美元类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0440	78,716,651.290		(3,463,533)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	人民币 0.0601	73,590,179.970		(684,438)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0401	3,618,474.700		(145,101)
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	澳元 0.0343	26,649,326.974		(696,203)
加元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	加元 0.0353	16,505,216.408		(463,567)
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	英镑 0.0363	711,203.884		(35,619)
港元类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	港币 0.0383	519,421,996.791		(2,558,877)
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	纽元 0.0358	11,128,895.344		(279,030)
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	人民币 0.0573	495,182,226.693		(4,324,505)
美元类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0440	76,797,893.233		(3,379,107)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	人民币 0.0620	72,211,245.890		(682,360)
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0401	3,652,846.370		(146,479)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	澳元 0.0268	23,442,122.852		(432,832)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	加元 0.0329	15,742,362.405		(394,053)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	英镑 0.0268	366,162.865		(12,698)
港元类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	港币 0.0387	415,807,481.174		(2,053,121)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	纽元 0.0291	10,588,479.865		(197,600)
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 0.0435	421,515,916.177		(2,602,819)
美元类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0440	50,606,831.446		(2,226,701)
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 0.0470	90,829,498.130		(605,990)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0401	3,928,976.590		(157,552)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	澳元 0.0289	22,939,509.536		(448,421)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	加元 0.0354	15,522,256.213		(413,693)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	英镑 0.0294	383,656.743		(14,590)
港元类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	港币 0.0386	427,034,239.174		(2,105,780)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	纽元 0.0308	10,659,973.708		(210,753)
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 0.0445	422,314,748.468		(2,673,277)
美元类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0440	53,345,028.968		(2,347,181)
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 0.0480	91,959,604.780		(627,894)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0401	4,008,155.380		(160,727)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	澳元 0.0292	22,247,756.735		(456,661)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	加元 0.0339	15,204,514.645		(397,481)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	英镑 0.0262	382,834.915		(13,288)
港元类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	港币 0.0384	408,102,380.680		(2,011,234)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	纽元 0.0314	10,667,041.355		(225,971)
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 0.0456	422,721,567.091		(2,767,507)
美元类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0440	53,382,022.125		(2,348,809)
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 0.0492	90,516,377.590		(639,384)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0401	3,914,306.040		(156,964)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	澳元 0.0294	20,901,261.467		(411,375)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	加元 0.0346	14,721,069.863		(385,126)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	英镑 0.0283	395,425.420		(14,751)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零二零年	二零一九年
					十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元	十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元
港元类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	港元 0.0383	403,451,258.238		(1,990,004)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月11日	纽元 0.0316	9,919,775.710		(202,859)
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 0.0452	411,180,327.535		(2,653,989)
美元类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	美元 0.0440	55,750,551.417		(2,453,024)
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 0.0488	86,532,175.840		(601,847)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	美元 0.0401	3,899,616.430		(156,375)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	澳元 0.0308	20,877,039.084		(414,582)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	加元 0.0368	14,852,277.163		(407,169)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	英镑 0.0301	420,407.886		(16,163)
港元类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	港元 0.0383	405,314,084.477		(1,991,971)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	纽元 0.0324	9,832,147.373		(197,588)
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 0.0455	410,048,435.667		(2,669,052)
美元类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0440	55,380,210.297		(2,436,729)
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 0.0491	87,120,529.080		(611,945)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0401	3,923,101.970		(157,316)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	澳元 0.0334	20,740,149.608		(423,980)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	加元 0.0355	14,492,545.157		(361,461)
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	352,428.430		(13,197)
港元类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	港元 0.0383	360,895,423.773		(1,783,315)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	纽元 0.0365	9,504,003.386		(205,657)
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 0.0430	374,722,559.945		(2,273,225)
美元类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0440	50,053,030.584		(2,202,333)
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 0.0464	75,025,476.730		(491,124)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0401	3,360,061.090		(134,738)
可赎回份额持有人的总收益分配					(71,066,349)	(52,363,876)

## 7 税项

截至二零二一年三月三十一日及二零二零年三月三十一日止期间取得的部分利息收入和产生的资本收益的境外税已经预扣或支付。

### 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，外国投资者从中国取得的股利和利息应按百分之十缴纳企业所得税，但不包括已明确地获得免税的政府债券利息以及外国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内地债券市场买卖的债券中产生的已获暂时豁免的利息收入。中国企业如作为付款方须在付款时扣缴此类税款。对于源自中国但不适用于明确免税规定的股利和利息，若付款方未预先扣税，则按 10% 全额计提税项准备。

根据中华人民共和国税法，外国投资者出售中国证券所实现的收益一般须按百分之十缴纳企业所得税。然而，目前出售中国 A 股 (包括透过沪港通及深港通买卖的股票) 的收益暂时免征企业所得税。对于出售目前并未明确豁免企业所得税的若干中国证券所获得的收益，按百分之十全额计提税项准备。

### 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，因此并未计提香港税项准备。

