

半年度报告 — 2021年3月31日（未经审核）

# 摩根亚洲股息基金

内地与香港互认基金系列



中国内地代理人:

**上投摩根**  
基金 管 理

基金管理人:

**摩根**  
资 产 管 理

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

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

内容	页
投资组合	1 - 2
投资组合持有变动表	2
金融衍生工具详情	3 - 15
财务状况表	16
综合收益表	16
可赎回份额持有人应占净资产变动表	17
现金流量表	17
财务报表之附注	18 - 27

投资组合

截至二零二一年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	占资产		单位数目	占资产	
		公允价值 美元	净值 百分比		公允价值 美元	净值 百分比
<b>上市投资 (99.8%)</b>						
<b>(I) 股票 (99.9%)</b>						
<b>澳大利亚 (17.6%)</b>						
Australia & NZ Bkg Group-AU List	827,077	17,751,799	1.3			
Australian Stock Exchange Ltd	195,057	10,555,555	0.8			
BHP Group Ltd	197,468	6,813,188	0.5			
BHP Group Plc	496,601	14,350,685	1.0			
Brambles Ltd	3,582,461	28,868,391	2.1			
Coles Group	958,694	11,690,330	0.8			
Goodman Group Stapled Sec	1,510,700	20,849,319	1.5			
Insurance Australia Group	2,575,356	9,179,913	0.7			
Macquarie Group Ltd	66,216	7,707,739	0.5			
Medibank Private Ltd	7,526,330	16,050,802	1.1			
Rio Tinto-AU List	469,109	39,570,628	2.8			
Telstra Corporation Limited	5,913,654	15,314,058	1.1			
Transurban Group Stapled Sec	2,961,179	30,041,688	2.1			
Viva Energy Group	2,394,395	3,063,801	0.2			
Westpac Banking	816,295	15,176,456	1.1			
<b>中国 (21.7%)</b>						
中国建设银行股份有限公司 H 股	36,606,000	30,793,592	2.2			
中国联塑集团控股有限公司	6,463,000	13,899,550	1.0			
中国人寿保险股份有限公司 H 股	5,788,000	11,956,509	0.9			
中国招商银行股份有限公司 H 股	2,963,500	22,623,301	1.6			
石药集团有限公司	6,378,000	7,711,568	0.5			
粤海投资有限公司	3,970,000	6,464,792	0.5			
海尔智家股份有限公司 H 股	6,366,401	25,467,406	1.8			
杭州老板电器股份有限公司 A 股 - C2	984,362	5,479,013	0.4			
中国工商银行股份有限公司 H 股	19,833,000	14,234,851	1.0			
内蒙古伊利实业集团股份有限公司 A 股 - C1	2,833,864	17,289,456	1.2			
江苏宁沪高速公路股份有限公司 H 股	9,108,000	11,340,409	0.8			
九阳股份有限公司 A 股 - C2	4,344,001	20,385,263	1.4			
美的集团股份有限公司 A 股 - C2	1,075,428	13,478,090	1.0			
中国平安保险 (集团) 股份有限公司 A 股 - C1	1,591,373	19,088,133	1.4			
中国平安保险 (集团) 股份有限公司 H 股	1,645,000	19,582,704	1.4			
中国邮政储蓄银行股份有限公司 H 股	20,464,000	15,293,151	1.1			
申洲国际集团控股有限公司	307,800	6,378,146	0.5			
中石化炼化工程 (集团) 股份有限公司 H 股	5,212,000	2,876,021	0.2			
康师傅控股有限公司	7,064,000	12,975,055	0.9			
滔搏国际控股有限公司	6,440,000	9,592,344	0.7			
百胜中国控股有限公司	297,850	17,393,372	1.2			
<b>香港 (12.8%)</b>						
ASM Pacific Technology Ltd	1,130,600	14,404,354	1.0			
中银香港 (控股) 有限公司	6,524,500	22,784,914	1.6			
华润置地有限公司	2,110,000	10,218,279	0.7			
长江基建集团有限公司	1,637,000	9,727,942	0.7			
中电控股有限公司	3,398,500	33,003,846	2.4			
香港宽频网络有限公司	3,720,000	5,416,512	0.4			
香港电讯信托与香港电讯有限公司合订单位	12,112,000	17,261,795	1.2			
香港交易及结算所有限公司	588,635	34,631,601	2.5			
昆仑能源有限公司	10,046,000	10,557,122	0.8			
太古股份有限公司 A 股	702,500	5,267,993	0.4			
信义玻璃控股有限公司	4,824,000	15,760,549	1.1			
<b>印度 (4.6%)</b>						
Infosys Technologies Ltd ADR	1,976,237	36,995,157	2.6			
Power Grid Corp of India	6,381,313	18,821,769	1.3			
Tata Consultancy Services	214,548	9,325,214	0.7			
<b>印度尼西亚 (3.5%)</b>						
Bank Rakyat Indonesia Persero	73,182,000	22,168,730	1.6			
Telkom Indonesia Persero	111,083,900	26,155,383	1.9			
<b>韩国 (11.0%)</b>						
BGF Retail Co	50,856	7,099,844	0.5			
Hana Financial Holdings	195,600	7,397,111	0.5			
Hyundai Motor Co	95,806	8,295,991	0.6			
KB Financial Group	339,437	16,855,630	1.2			
Samsung Electronics	1,515,509	109,001,487	7.8			
Samsung Electronics Pref	93,274	6,016,348	0.4			
<b>新加坡 (6.9%)</b>						
AIMS APAC REIT	8,419,519	8,083,641	0.6			
DBS Group Hldgs	2,031,528	43,530,583	3.1			
Mapletree Logistics Trust	16,016,162	23,006,246	1.6			
United Overseas Bank	1,159,900	22,298,465	1.6			
<b>台湾 (18.6%)</b>						
智邦科技股份有限公司	1,112,000	10,756,387	0.8			
研华股份有限公司	1,138,983	14,131,006	1.0			
日月光投资控股股份有限公司	5,780,000	21,776,539	1.5			
可成科技股份有限公司	517,000	3,832,247	0.3			
中租控股股份有限公司	1,807,000	12,476,045	0.9			
台达电子工业股份有限公司	784,000	7,913,363	0.6			
儒鸿企业股份有限公司	988,000	16,620,755	1.2			
统一超商股份有限公司	1,907,000	18,179,091	1.3			
瑞昱半导体股份有限公司	774,000	13,400,484	1.0			
台湾积体电路制造股份有限公司	6,100,000	125,493,288	8.9			
世界先进积体电路股份有限公司	1,285,000	4,863,842	0.3			
纬颖科技服务股份有限公司	403,000	11,906,529	0.8			
<b>泰国 (3.2%)</b>						
Advanced Information Service PCL (F)	1,896,100	10,527,147	0.7			
PTT PCL (F)	13,601,700	17,845,430	1.3			
Siam Commercial Bank (F)	2,317,700	8,269,554	0.6			
Tisco Financial Group PCL (F)	2,705,800	8,420,450	0.6			
		1,401,785,741	99.9			
<b>(II) 衍生性产品 (-0.1%)</b>						
<b>远期外汇合约 (-0.1%)</b>					(1,134,110)	(0.1)

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	公平值 美元	占资产 净值 百分比	持有占资产净值百分比	
			二零二一年 三月三十一日	二零二零年 九月三十日
总上市投资	1,400,651,631	99.8		
其他净资产	3,225,625	0.2		
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	<u>1,403,877,256</u>	<u>100.0</u>		
总投资, 按成本	<u>1,135,932,805</u>			
			<b>上市投资</b>	
			<b>股票</b>	
			中国	21.7
			台湾	18.6
			澳大利亚	17.6
			香港	12.8
			韩国	11.0
			新加坡	6.9
			印度	4.6
			印度尼西亚	3.5
			泰国	3.2
			<b>衍生性产品</b>	
			远期外汇合约	(0.1)
			<b>总上市投资</b>	99.8
			<b>其他净资产</b>	0.2
			<b>可赎回份额持有人应占净资产</b>	<u>100.0</u>
				<u>100.0</u>

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:

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
<b>截至二零二一年三月三十一日</b>				
未平仓合约:				
离岸人民币 2,800,000	美元 427,325	2021年4月1日	美林国际, 伦敦	574
离岸人民币 365,115	美元 55,722	2021年4月1日	美林国际, 伦敦	75
离岸人民币 128,842	美元 19,663	2021年4月1日	美林国际, 伦敦	26
美元 97,265	离岸人民币 640,067	2021年4月1日	美国道富银行	288
美元 71,179	英镑 51,690	2021年4月1日	美国道富银行	137
美元 26,524	离岸人民币 174,544	2021年4月1日	美国道富银行	79
澳元 259,089	美元 197,627	2021年4月7日	花旗银行, 伦敦	286
澳元 60,565	美元 46,206	2021年4月7日	花旗银行, 伦敦	75
离岸人民币 3,852,209	美元 588,460	2021年4月7日	高盛国际, 伦敦	1,568
离岸人民币 302,538	美元 46,216	2021年4月7日	高盛国际, 伦敦	123
离岸人民币 12,633	美元 1,930	2021年4月7日	高盛国际, 伦敦	5
美元 736,134	澳元 968,536	2021年4月7日	美国道富银行	1,576
美元 200,313	离岸人民币 1,317,888	2021年4月7日	高盛国际, 伦敦	470
美元 136,457	离岸人民币 897,768	2021年4月7日	高盛国际, 伦敦	320
美元 28,807	加元 36,387	2021年4月7日	渣打银行, 伦敦	144
美元 45,686	纽元 65,425	2021年4月7日	加拿大皇家银行	134
美元 6,536	离岸人民币 43,032	2021年4月7日	美国道富银行	21
美元 1,115	离岸人民币 7,342	2021年4月7日	美国道富银行	4
美元 1,093	离岸人民币 7,196	2021年4月7日	美国道富银行	3
美元 1,103	新加坡元 1,483	2021年4月7日	多伦多道明银行	0
美元 1,500	澳元 1,969	2021年4月7日	美国道富银行	0
美元 45,609	纽元 65,155	2021年4月8日	巴克莱银行, 伦敦	23
美元 2,569	离岸人民币 16,904	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	6
美元 34,893	澳元 45,817	2021年4月8日	美国道富银行	4
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 1,100	离岸人民币 7,238	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	3
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 4,841	欧元 4,120	2021年4月8日	加拿大皇家银行	1
纽元 111,653	美元 78,214	2021年4月9日	法国巴黎银行	18
离岸人民币 1,923,515	美元 293,053	2021年4月12日	高盛国际, 伦敦	114
离岸人民币 175,405	美元 26,723	2021年4月12日	高盛国际, 伦敦	10
离岸人民币 106,795	美元 16,271	2021年4月12日	高盛国际, 伦敦	6
澳元 6,037,508	美元 4,698,874	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	99,941
澳元 1,419,907	美元 1,098,751	2021年4月21日	法国巴黎银行	17,170
澳元 863,075	美元 673,240	2021年4月21日	法国巴黎银行	15,812
澳元 2,689,167	美元 2,063,231	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	14,820
澳元 1,286,397	美元 990,168	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	10,285
澳元 411,564	美元 321,542	2021年4月21日	法国巴黎银行	8,042
澳元 1,295,684	美元 994,237	2021年4月21日	美国道富银行	7,280
澳元 1,320,320	美元 1,012,657	2021年4月21日	法国巴黎银行	6,934
澳元 463,861	美元 359,297	2021年4月21日	法国巴黎银行	5,962
澳元 469,265	美元 361,987	2021年4月21日	法国巴黎银行	4,535
澳元 463,618	美元 357,424	2021年4月21日	加拿大皇家银行	4,274
澳元 251,089	美元 195,459	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	4,197
澳元 221,391	美元 172,594	2021年4月21日	美国道富银行	3,954
澳元 442,300	美元 340,539	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	3,628
澳元 267,799	美元 206,958	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	2,968
澳元 185,956	美元 144,078	2021年4月21日	加拿大皇家银行	2,430
澳元 135,019	美元 104,642	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1,795
澳元 213,813	美元 164,258	2021年4月21日	加拿大皇家银行	1,391

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 71,278	美元 55,609	2021年4月21日	法国巴黎银行		1,315
澳元 97,272	美元 75,348	2021年4月21日	加拿大皇家银行		1,253
澳元 952,184	美元 726,280	2021年4月21日	美国道富银行		975
澳元 777,231	美元 592,974	2021年4月21日	美国道富银行		936
澳元 169,870	美元 130,250	2021年4月21日	法国巴黎银行		855
澳元 58,646	美元 45,453	2021年4月21日	加拿大皇家银行		781
澳元 20,299	美元 15,766	2021年4月21日	法国巴黎银行		304
澳元 14,860	美元 11,594	2021年4月21日	法国巴黎银行		274
澳元 242,688	美元 185,109	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		247
澳元 15,785	美元 12,260	2021年4月21日	法国巴黎银行		236
澳元 364,903	美元 278,172	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		215
澳元 5,447	美元 4,255	2021年4月21日	法国巴黎银行		106
澳元 10,342	美元 7,977	2021年4月21日	法国巴黎银行		100
澳元 10,310	美元 7,938	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		85
澳元 3,607	美元 2,814	2021年4月21日	法国巴黎银行		66
澳元 5,139	美元 3,979	2021年4月21日	法国巴黎银行		64
澳元 4,621	美元 3,580	2021年4月21日	法国巴黎银行		59
澳元 5,157	美元 3,986	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		57
澳元 2,313	美元 1,807	2021年4月21日	法国巴黎银行		45
澳元 2,292	美元 1,776	2021年4月21日	美国道富银行		31
澳元 1,410	美元 1,100	2021年4月21日	法国巴黎银行		26
澳元 1,408	美元 1,098	2021年4月21日	法国巴黎银行		26
澳元 1,427	美元 1,113	2021年4月21日	美国道富银行		25
澳元 1,421	美元 1,106	2021年4月21日	美国道富银行		24
澳元 3,397	美元 2,610	2021年4月21日	加拿大皇家银行		22
澳元 1,426	美元 1,108	2021年4月21日	法国巴黎银行		21
澳元 1,423	美元 1,102	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		19
澳元 1,420	美元 1,101	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		19
澳元 1,416	美元 1,098	2021年4月21日	美国道富银行		19
澳元 1,411	美元 1,093	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		18
澳元 1,411	美元 1,093	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		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 1,420	美元 1,094	2021年4月21日	加拿大皇家银行		13
澳元 1,420	美元 1,091	2021年4月21日	法国巴黎银行		9
澳元 1,435	美元 1,101	2021年4月21日	法国巴黎银行		8
澳元 3,015	美元 2,300	2021年4月21日	美国道富银行		4
澳元 2,565	美元 1,956	2021年4月21日	法国巴黎银行		3
澳元 1,432	美元 1,092	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		1
加元 1,251,780	美元 999,264	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦		3,262
加元 714,520	美元 571,526	2021年4月21日	加拿大皇家银行		3,005
加元 133,383	美元 106,625	2021年4月21日	加拿大皇家银行		496
加元 46,273	美元 37,165	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		347
加元 65,429	美元 52,385	2021年4月21日	加拿大皇家银行		326
加元 43,225	美元 34,593	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		200
加元 25,363	美元 20,208	2021年4月21日	加拿大皇家银行		27
加元 1,373	美元 1,104	2021年4月21日	加拿大皇家银行		12
加元 7,426	美元 5,919	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		10
加元 1,374	美元 1,103	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		10
加元 1,370	美元 1,098	2021年4月21日	加拿大皇家银行		8
加元 1,370	美元 1,098	2021年4月21日	加拿大皇家银行		8
加元 1,374	美元 1,100	2021年4月21日	加拿大皇家银行		7
加元 1,383	美元 1,106	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		6
加元 1,383	美元 1,106	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		6
加元 2,098	美元 1,675	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦		5
加元 1,380	美元 1,100	2021年4月21日	美国道富银行		2
加元 1,378	美元 1,098	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		2
加元 45,225	美元 35,985	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		1
加元 1,391	美元 1,107	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		0
加元 1,877	美元 1,494	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		0
离岸人民币 56,794,462	美元 8,753,306	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	109,847	
离岸人民币 25,483,842	美元 3,897,409	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	19,064	
离岸人民币 13,408,738	美元 2,056,993	2021年4月21日	加拿大皇家银行	16,338	
离岸人民币 5,571,025	美元 858,969	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	11,123	
离岸人民币 5,727,234	美元 882,590	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	10,971	

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 5,020,246	美元 773,536	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	9,513
离岸人民币 5,869,626	美元 902,556	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	9,267
离岸人民币 4,575,609	美元 705,025	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	8,670
离岸人民币 9,131,229	美元 1,397,106	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	7,439
离岸人民币 4,280,064	美元 658,134	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	6,757
离岸人民币 4,080,129	美元 627,390	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	6,442
离岸人民币 8,327,227	美元 1,273,180	2021年4月21日	美国道富银行	5,872
离岸人民币 4,356,963	美元 668,466	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	5,386
离岸人民币 5,035,286	美元 771,624	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	5,312
离岸人民币 14,943,833	美元 2,279,568	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	5,290
离岸人民币 2,112,023	美元 325,251	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	3,825
离岸人民币 1,877,695	美元 289,164	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	3,401
离岸人民币 1,726,709	美元 265,701	2021年4月21日	美国道富银行	2,915
离岸人民币 2,717,976	美元 416,512	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	2,867
离岸人民币 2,287,646	美元 350,981	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	2,828
离岸人民币 3,113,956	美元 476,678	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,770
离岸人民币 1,443,585	美元 222,462	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	2,765
离岸人民币 1,392,545	美元 214,597	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	2,668
离岸人民币 3,546,881	美元 542,333	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	2,538
离岸人民币 2,092,092	美元 320,917	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,525
离岸人民币 1,599,539	美元 245,858	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,426
离岸人民币 2,157,008	美元 330,645	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	2,373
离岸人民币 2,057,293	美元 315,360	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	2,264
离岸人民币 2,509,257	美元 384,112	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,232
离岸人民币 1,470,025	美元 225,538	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1,817
离岸人民币 2,722,405	美元 416,013	2021年4月21日	多伦多道明银行	1,694
离岸人民币 2,013,993	美元 308,039	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1,533
离岸人民币 788,680	美元 121,553	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1,525
离岸人民币 11,940,560	美元 1,818,685	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1,470
离岸人民币 1,275,602	美元 195,469	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1,337
离岸人民币 1,066,372	美元 163,622	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,332
离岸人民币 1,099,445	美元 168,645	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	1,322
离岸人民币 1,036,813	美元 159,037	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	1,246
离岸人民币 668,564	美元 102,959	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1,211
离岸人民币 768,917	美元 118,187	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,166
离岸人民币 859,675	美元 131,862	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1,029
离岸人民币 929,901	美元 142,530	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1,010
离岸人民币 790,820	美元 121,331	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	978
离岸人民币 522,334	美元 80,375	2021年4月21日	美国道富银行	882
离岸人民币 1,268,702	美元 193,871	2021年4月21日	多伦多道明银行	790
离岸人民币 1,545,099	美元 235,792	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	646
离岸人民币 602,765	美元 92,370	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	636
离岸人民币 670,428	美元 102,623	2021年4月21日	美国道富银行	591
离岸人民币 533,551	美元 81,780	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	579
离岸人民币 651,443	美元 99,717	2021年4月21日	美国道富银行	575
离岸人民币 733,633	美元 112,200	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	549
离岸人民币 694,459	美元 106,208	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	520
离岸人民币 416,013	美元 63,810	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	498
离岸人民币 1,172,735	美元 178,966	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	489
离岸人民币 448,926	美元 68,809	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	487
离岸人民币 1,137,296	美元 173,558	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	474
离岸人民币 377,150	美元 57,864	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	466
离岸人民币 576,345	美元 88,152	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	439
离岸人民币 217,986	美元 33,610	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	435
离岸人民币 3,573,557	美元 544,203	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	349
离岸人民币 295,183	美元 45,233	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	309
离岸人民币 391,004	美元 59,799	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	292
离岸人民币 303,929	美元 46,525	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	270
离岸人民币 369,606	美元 56,514	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	265
离岸人民币 420,262	美元 64,221	2021年4月21日	多伦多道明银行	262
离岸人民币 995,537	美元 151,759	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	250
离岸人民币 196,560	美元 30,154	2021年4月21日	加拿大皇家银行	240
离岸人民币 952,501	美元 145,198	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	239
离岸人民币 1,146,853	美元 174,747	2021年4月21日	美国道富银行	209



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 334,044	美元 51,046	2021年4月21日	多伦多道明银行	208
离岸人民币 175,805	美元 26,940	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	184
离岸人民币 98,457	美元 15,162	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	178
离岸人民币 930,631	美元 141,801	2021年4月21日	美国道富银行	170
离岸人民币 83,191	美元 12,827	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	166
离岸人民币 90,074	美元 13,871	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	163
离岸人民币 121,176	美元 18,588	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	146
离岸人民币 1,489,681	美元 226,858	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	145
离岸人民币 674,213	美元 102,730	2021年4月21日	美国道富银行	123
离岸人民币 81,212	美元 12,483	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	123
离岸人民币 141,676	美元 21,677	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	115
离岸人民币 72,073	美元 11,083	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	114
离岸人民币 65,314	美元 10,050	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	110
离岸人民币 56,067	美元 8,628	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	95
离岸人民币 125,997	美元 19,264	2021年4月21日	美国道富银行	89
离岸人民币 71,250	美元 10,932	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	88
离岸人民币 222,634	美元 33,961	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	79
离岸人民币 63,088	美元 9,680	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	79
离岸人民币 105,013	美元 16,057	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	75
离岸人民币 43,702	美元 6,719	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	68
离岸人民币 53,385	美元 8,188	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	64
离岸人民币 51,047	美元 7,830	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	61
离岸人民币 47,964	美元 7,357	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	57
离岸人民币 32,354	美元 4,979	2021年4月21日	美国道富银行	55
离岸人民币 51,504	美元 7,892	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	54
离岸人民币 46,902	美元 7,187	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	49
离岸人民币 23,230	美元 3,580	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	45
离岸人民币 24,391	美元 3,756	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	44
离岸人民币 34,241	美元 5,253	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	42
离岸人民币 25,037	美元 3,853	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	42
离岸人民币 23,255	美元 3,581	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	42
离岸人民币 94,755	美元 14,460	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	40
离岸人民币 21,001	美元 3,236	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	40
离岸人民币 24,558	美元 3,776	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	39
离岸人民币 30,109	美元 4,619	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	36
离岸人民币 29,269	美元 4,490	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	35
离岸人民币 31,468	美元 4,822	2021年4月21日	美国道富银行	33
离岸人民币 31,160	美元 4,775	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	33
离岸人民币 327,605	美元 49,890	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	32
离岸人民币 18,800	美元 2,891	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	29
离岸人民币 22,471	美元 3,448	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	28
离岸人民币 21,769	美元 3,339	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	26
离岸人民币 191,392	美元 29,151	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	24
离岸人民币 133,917	美元 20,405	2021年4月21日	美国道富银行	24
离岸人民币 23,104	美元 3,537	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	21
离岸人民币 19,486	美元 2,987	2021年4月21日	加拿大皇家银行	21
离岸人民币 11,513	美元 1,773	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	21
离岸人民币 199,189	美元 30,334	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	19
离岸人民币 24,347	美元 3,724	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	19
离岸人民币 17,922	美元 2,747	2021年4月21日	加拿大皇家银行	19
离岸人民币 24,007	美元 3,671	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	17
离岸人民币 13,809	美元 2,118	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	17
离岸人民币 15,198	美元 2,329	2021年4月21日	美国道富银行	16
离岸人民币 35,488	美元 5,416	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	15
离岸人民币 12,494	美元 1,917	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	15
离岸人民币 7,966	美元 1,228	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	15
离岸人民币 7,128	美元 1,099	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	14
离岸人民币 7,125	美元 1,098	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	14
离岸人民币 7,125	美元 1,098	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	14
离岸人民币 7,125	美元 1,098	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	14
离岸人民币 7,125	美元 1,098	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	14
离岸人民币 10,536	美元 1,617	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	13
离岸人民币 8,571	美元 1,317	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	13
离岸人民币 7,118	美元 1,096	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	13

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 7,118	美元 1,096	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	13
离岸人民币 16,674	美元 2,550	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	12
离岸人民币 11,538	美元 1,768	2021年4月21日	加拿大皇家银行	12
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	花旗银行, 伦敦	12
离岸人民币 9,201	美元 1,412	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	11
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 7,163	美元 1,101	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	11
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 16,005	美元 2,446	2021年4月21日	多伦多道明银行	10
离岸人民币 7,162	美元 1,099	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 7,160	美元 1,098	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	9
离岸人民币 7,152	美元 1,097	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
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	美国道富银行	8
离岸人民币 7,155	美元 1,097	2021年4月21日	美国道富银行	8
离岸人民币 7,155	美元 1,097	2021年4月21日	美国道富银行	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	高盛国际, 伦敦	8
离岸人民币 7,154	美元 1,096	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	8
离岸人民币 7,154	美元 1,096	2021年4月21日	美国道富银行	8
离岸人民币 7,152	美元 1,096	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	8
离岸人民币 66,160	美元 10,075	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	7
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 7,151	美元 1,096	2021年4月21日	美国道富银行	7
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 12,401	美元 1,892	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	5
离岸人民币 7,165	美元 1,096	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	5
离岸人民币 7,122	美元 1,089	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	5
离岸人民币 19,821	美元 3,020	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	4
离岸人民币 7,202	美元 1,100	2021年4月21日	多伦多道明银行	4
离岸人民币 18,154	美元 2,766	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	3
离岸人民币 20,363	美元 3,101	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	2
离岸人民币 7,177	美元 1,094	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1
离岸人民币 7,177	美元 1,094	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1
离岸人民币 7,172	美元 1,092	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1
欧元 626,266	美元 756,184	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	19,844
欧元 165,427	美元 201,031	2021年4月21日	美国道富银行	6,529
欧元 290,409	美元 346,300	2021年4月21日	法国巴黎银行	4,849
欧元 165,678	美元 197,572	2021年4月21日	加拿大皇家银行	2,775
欧元 159,181	美元 189,513	2021年4月21日	法国巴黎银行	2,355
欧元 136,919	美元 162,525	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,541
欧元 114,109	美元 135,124	2021年4月21日	多伦多道明银行	958
欧元 188,208	美元 222,226	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	939
欧元 18,509	美元 22,370	2021年4月21日	多伦多道明银行	608
欧元 8,228	美元 9,812	2021年4月21日	加拿大皇家银行	137
欧元 9,466	美元 11,261	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	131
欧元 5,885	美元 7,030	2021年4月21日	美国道富银行	111
欧元 1,990	美元 2,399	2021年4月21日	美国道富银行	59
欧元 2,941	美元 3,507	2021年4月21日	法国巴黎银行	49
欧元 3,587	美元 4,261	2021年4月21日	法国巴黎银行	44
欧元 2,715	美元 3,231	2021年4月21日	美国道富银行	39
欧元 900	美元 1,093	2021年4月21日	美国道富银行	35
欧元 935	美元 1,129	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	30
欧元 911	美元 1,098	2021年4月21日	美国道富银行	27
欧元 925	美元 1,107	2021年4月21日	多伦多道明银行	20
欧元 1,490	美元 1,768	2021年4月21日	美国道富银行	17
欧元 914	美元 1,089	2021年4月21日	美国道富银行	15
欧元 926	美元 1,102	2021年4月21日	加拿大皇家银行	14
欧元 1,980	美元 2,333	2021年4月21日	多伦多道明银行	5
英镑 1,552,230	美元 2,165,254	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	23,508

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
英镑 337,977	美元 469,505	2021年4月21日	美国道富银行	3,170
英镑 257,951	美元 358,420	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	2,503
英镑 373,924	美元 517,764	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,828
英镑 709,164	美元 980,210	2021年4月21日	美国道富银行	1,715
英镑 93,728	美元 130,730	2021年4月21日	加拿大皇家银行	1,405
英镑 339,638	美元 469,274	2021年4月21日	加拿大皇家银行	646
英镑 302,194	美元 417,490	2021年4月21日	加拿大皇家银行	527
英镑 20,593	美元 28,788	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	374
英镑 60,984	美元 84,311	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	166
英镑 7,783	美元 10,875	2021年4月21日	法国巴黎银行	136
英镑 7,962	美元 11,105	2021年4月21日	加拿大皇家银行	119
英镑 20,288	美元 28,110	2021年4月21日	美国道富银行	117
英镑 5,946	美元 8,320	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	116
英镑 10,283	美元 14,260	2021年4月21日	美国道富银行	71
英镑 2,973	美元 4,124	2021年4月21日	加拿大皇家银行	22
英镑 7,266	美元 10,045	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	20
英镑 1,113	美元 1,555	2021年4月21日	法国巴黎银行	19
英镑 1,241	美元 1,731	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	18
英镑 1,644	美元 2,283	2021年4月21日	多伦多道明银行	15
英镑 831	美元 1,162	2021年4月21日	美国道富银行	15
英镑 791	美元 1,107	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	15
英镑 789	美元 1,102	2021年4月21日	加拿大皇家银行	14
英镑 789	美元 1,102	2021年4月21日	加拿大皇家银行	14
英镑 793	美元 1,102	2021年4月21日	法国巴黎银行	8
英镑 787	美元 1,094	2021年4月21日	法国巴黎银行	8
英镑 792	美元 1,098	2021年4月21日	美国道富银行	5
英镑 1,784	美元 2,464	2021年4月21日	加拿大皇家银行	3
纽元 1,560,970	美元 1,136,009	2021年4月21日	法国巴黎银行	42,819
纽元 706,255	美元 505,133	2021年4月21日	美国道富银行	10,524
纽元 380,971	美元 273,156	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	6,352
纽元 328,838	美元 235,393	2021年4月21日	多伦多道明银行	5,099
纽元 337,320	美元 240,801	2021年4月21日	多伦多道明银行	4,567
纽元 83,022	美元 60,385	2021年4月21日	美国道富银行	2,243
纽元 115,001	美元 82,475	2021年4月21日	多伦多道明银行	1,936
纽元 77,983	美元 55,975	2021年4月21日	法国巴黎银行	1,361
纽元 71,165	美元 50,988	2021年4月21日	法国巴黎银行	1,149
纽元 38,633	美元 28,035	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	980
纽元 45,852	美元 33,043	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	932
纽元 43,181	美元 31,052	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	811
纽元 50,636	美元 36,169	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	707
纽元 210,373	美元 147,935	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	605
纽元 30,679	美元 21,936	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	450
纽元 15,299	美元 11,134	2021年4月21日	美国道富银行	419
纽元 16,308	美元 11,730	2021年4月21日	法国巴黎银行	309
纽元 3,492	美元 2,542	2021年4月21日	法国巴黎银行	96
纽元 3,660	美元 2,656	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	93
纽元 4,515	美元 3,254	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	92
纽元 6,558	美元 4,681	2021年4月21日	法国巴黎银行	89
纽元 4,739	美元 3,408	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	89
纽元 4,638	美元 3,317	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	68
纽元 3,069	美元 2,204	2021年4月21日	美国道富银行	55
纽元 1,950	美元 1,419	2021年4月21日	美国道富银行	53
纽元 2,426	美元 1,740	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	41
纽元 1,513	美元 1,101	2021年4月21日	法国巴黎银行	41
纽元 1,479	美元 1,076	2021年4月21日	美国道富银行	40
纽元 1,511	美元 1,097	2021年4月21日	美国道富银行	38
纽元 1,894	美元 1,358	2021年4月21日	多伦多道明银行	32
纽元 1,534	美元 1,105	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	31
纽元 1,536	美元 1,105	2021年4月21日	法国巴黎银行	29
纽元 1,555	美元 1,116	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 1,529	美元 1,096	2021年4月21日	美国道富银行	25
纽元 1,529	美元 1,096	2021年4月21日	美国道富银行	25
纽元 1,530	美元 1,095	2021年4月21日	美国道富银行	24

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
纽元 1,541	美元 1,099	2021年4月21日	法国巴黎银行	21
纽元 1,533	美元 1,078	2021年4月21日	法国巴黎银行	4
纽元 1,533	美元 1,078	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	4
新加坡元 364,253	美元 274,185	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	3,110
新加坡元 84,701	美元 63,145	2021年4月21日	多伦多道明银行	111
新加坡元 165,763	美元 123,454	2021年4月21日	美国道富银行	94
新加坡元 1,464	美元 1,100	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	11
美元 65,683,425	加元 83,358,598	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	642,429
美元 7,485,593	新加坡元 10,096,208	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	27,960
美元 1,133,700	加元 1,441,953	2021年4月21日	法国巴黎银行	13,617
美元 1,227,258	加元 1,549,764	2021年4月21日	加拿大皇家银行	5,841
美元 562,605	加元 712,006	2021年4月21日	法国巴黎银行	3,916
美元 1,581,602	离岸人民币 10,416,899	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	3,729
美元 628,301	加元 792,907	2021年4月21日	多伦多道明银行	2,591
美元 281,883	加元 357,347	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,447
美元 2,282,334	离岸人民币 15,007,990	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1,708
美元 246,244	加元 311,311	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,456
美元 619,551	加元 780,250	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,270
美元 148,852	加元 188,154	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	856
美元 274,804	纽元 393,518	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	788
美元 230,187	离岸人民币 1,517,426	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	748
美元 229,380	加元 289,222	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	745
美元 519,556	新加坡元 699,080	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	696
美元 99,026	澳元 130,805	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	612
美元 258,311	欧元 220,189	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	579
美元 118,843	加元 150,079	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	570
美元 299,148	纽元 427,830	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	474
美元 177,519	离岸人民币 1,168,351	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	291
美元 38,496	加元 48,747	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	290
美元 126,779	澳元 166,810	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	285
美元 169,634	离岸人民币 1,116,455	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	278
美元 31,703	加元 40,138	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	234
美元 47,020	加元 59,360	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	211
美元 74,680	新加坡元 100,540	2021年4月21日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	141
美元 150,219	新加坡元 201,989	2021年4月21日	加拿大皇家银行	101
美元 24,787	离岸人民币 163,400	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	81
美元 23,800	离岸人民币 156,893	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	77
美元 13,153	英镑 9,585	2021年4月21日	法国巴黎银行	71
美元 14,433	新加坡元 19,460	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	49
美元 175,652	英镑 127,339	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	48
美元 15,701	离岸人民币 103,411	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	37
美元 34,752	离岸人民币 228,519	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	26
美元 7,628	离岸人民币 50,282	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	25
美元 4,695	新加坡元 6,339	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	23
美元 2,539	澳元 3,355	2021年4月21日	多伦多道明银行	16
美元 1,960	加元 2,480	2021年4月21日	法国巴黎银行	14
美元 4,474	离岸人民币 29,468	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	11
美元 2,076	纽元 2,973	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	6
美元 13,793	英镑 10,000	2021年4月21日	加拿大皇家银行	5
美元 1,281	英镑 930	2021年4月21日	加拿大皇家银行	2
加元 261,916	美元 208,446	2021年5月21日	加拿大皇家银行	42
加元 1,389	美元 1,106	2021年5月21日	加拿大皇家银行	0
离岸人民币 599,728	美元 91,111	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦	49
离岸人民币 139,015	美元 21,119	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦	11
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	美国道富银行	1
离岸人民币 7,234	美元 1,099	2021年5月21日	美国道富银行	1
纽元 1,575	美元 1,103	2021年5月21日	花旗银行, 伦敦	1
美元 776,441	澳元 1,020,541	2021年5月21日	多伦多道明银行	1,023
美元 407,008	加元 512,640	2021年5月21日	法国巴黎银行	894
美元 373,889	英镑 271,556	2021年5月21日	法国巴黎银行	834
美元 148,366	欧元 126,430	2021年5月21日	多伦多道明银行	381
美元 200,376	纽元 286,384	2021年5月21日	法国巴黎银行	170
美元 48,478	新加坡元 65,189	2021年5月21日	法国巴黎银行	28

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 15,150	澳元 19,889	2021年5月21日	美林国际, 伦敦	2
美元 14,726	英镑 10,672	2021年5月21日	加拿大皇家银行	1
			未实现总收益	1,429,896
美元 130,805	美元 99,019	2021年4月1日	美林国际, 伦敦	(608)
美元 1,956	澳元 2,565	2021年4月1日	法国巴黎银行	(3)
美元 1,896	离岸人民币 12,401	2021年4月1日	高盛国际, 伦敦	(5)
美元 5,424	离岸人民币 35,488	2021年4月1日	高盛国际, 伦敦	(16)
美元 592,919	澳元 777,231	2021年4月1日	美国道富银行	(941)
英镑 930	美元 1,281	2021年4月7日	加拿大皇家银行	(2)
英镑 10,000	美元 13,792	2021年4月7日	加拿大皇家银行	(5)
新加坡元 19,460	美元 14,434	2021年4月7日	花旗银行, 伦敦	(49)
美元 1,106	加元 1,389	2021年4月7日	加拿大皇家银行	(0)
美元 1,103	离岸人民币 7,234	2021年4月7日	美国道富银行	(1)
美元 1,103	离岸人民币 7,234	2021年4月7日	美国道富银行	(1)
美元 1,103	纽元 1,575	2021年4月7日	花旗银行, 伦敦	(1)
澳元 166,810	美元 126,771	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	(285)
离岸人民币 50,282	美元 7,635	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	(25)
离岸人民币 156,893	美元 23,824	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	(77)
离岸人民币 163,400	美元 24,812	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	(81)
离岸人民币 1,517,426	美元 230,418	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	(748)
欧元 220,189	美元 258,242	2021年4月8日	渣打银行, 伦敦	(579)
美元 208,437	加元 261,916	2021年4月8日	加拿大皇家银行	(43)
美元 91,412	离岸人民币 599,728	2021年4月8日	高盛国际, 伦敦	(49)
澳元 19,889	美元 15,147	2021年4月9日	美林国际, 伦敦	(2)
离岸人民币 29,468	美元 4,478	2021年4月9日	花旗银行, 伦敦	(11)
离岸人民币 103,411	美元 15,714	2021年4月9日	花旗银行, 伦敦	(38)
离岸人民币 10,416,899	美元 1,582,944	2021年4月9日	花旗银行, 伦敦	(3,848)
英镑 10,672	美元 14,724	2021年4月9日	加拿大皇家银行	(1)
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 21,187	离岸人民币 139,015	2021年4月9日	高盛国际, 伦敦	(11)
澳元 3,176	美元 2,414	2021年4月21日	美国道富银行	(5)
澳元 73,593	美元 55,720	2021年4月21日	美国道富银行	(338)
澳元 968,536	美元 736,187	2021年4月21日	美国道富银行	(1,572)
澳元 1,561,538	美元 1,186,047	2021年4月21日	法国巴黎银行	(3,418)
加元 1,381	美元 1,095	2021年4月21日	美国道富银行	(4)
加元 1,485	美元 1,178	2021年4月21日	法国巴黎银行	(4)
加元 1,389	美元 1,100	2021年4月21日	法国巴黎银行	(5)
加元 1,393	美元 1,102	2021年4月21日	法国巴黎银行	(7)
加元 1,377	美元 1,088	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(8)
加元 1,393	美元 1,100	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(8)
加元 1,387	美元 1,094	2021年4月21日	法国巴黎银行	(9)
加元 4,380	美元 3,465	2021年4月21日	法国巴黎银行	(20)
加元 7,170	美元 5,680	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(25)
加元 7,594	美元 6,016	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(27)
加元 6,785	美元 5,352	2021年4月21日	法国巴黎银行	(46)
加元 16,176	美元 12,797	2021年4月21日	法国巴黎银行	(74)
加元 472,351	美元 375,728	2021年4月21日	多伦多道明银行	(107)
加元 49,064	美元 38,904	2021年4月21日	美国道富银行	(135)
加元 36,387	美元 28,808	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(144)
加元 70,256	美元 55,494	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(406)
加元 775,015	美元 615,943	2021年4月21日	美国道富银行	(712)
加元 777,850	美元 616,176	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(2,735)
加元 638,949	美元 505,155	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(3,237)
加元 615,057	美元 485,715	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(3,668)
加元 724,519	美元 572,516	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(3,961)
加元 1,347,545	美元 1,064,421	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(7,778)
加元 3,016,145	美元 2,382,228	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(17,625)
离岸人民币 7,196	美元 1,092	2021年4月21日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 7,196	美元 1,092	2021年4月21日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 7,238	美元 1,099	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(3)

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 7,238	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	花旗银行, 伦敦	(3)
离岸人民币 7,238	美元 1,099	2021年4月21日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 7,238	美元 1,099	2021年4月21日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 7,342	美元 1,114	2021年4月21日	美国道富银行	(4)
离岸人民币 16,904	美元 2,567	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(6)
离岸人民币 19,167	美元 2,908	2021年4月21日	美国道富银行	(9)
离岸人民币 43,032	美元 6,528	2021年4月21日	美国道富银行	(21)
离岸人民币 174,544	美元 26,480	2021年4月21日	美国道富银行	(84)
离岸人民币 640,067	美元 97,105	2021年4月21日	美国道富银行	(306)
离岸人民币 897,768	美元 136,309	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(321)
离岸人民币 1,317,888	美元 200,096	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(472)
英镑 794	美元 1,095	2021年4月21日	美国道富银行	(0)
英镑 1,974	美元 2,718	2021年4月21日	美国道富银行	(5)
英镑 802	美元 1,100	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(6)
英镑 799	美元 1,096	2021年4月21日	法国巴黎银行	(7)
英镑 1,769	美元 2,427	2021年4月21日	美国道富银行	(13)
英镑 168,413	美元 232,301	2021年4月21日	美国道富银行	(73)
英镑 51,690	美元 71,185	2021年4月21日	美国道富银行	(136)
英镑 32,981	美元 45,265	2021年4月21日	美国道富银行	(243)
英镑 38,180	美元 52,396	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(284)
英镑 254,273	美元 348,855	2021年4月21日	美国道富银行	(1,988)
英镑 415,317	美元 569,685	2021年4月21日	美国道富银行	(3,364)
纽元 3,196	美元 2,220	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(18)
纽元 21,684	美元 15,141	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(44)
纽元 65,425	美元 45,685	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(134)
纽元 260,941	美元 182,493	2021年4月21日	多伦多道明银行	(251)
纽元 259,096	美元 180,020	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(1,432)
纽元 437,384	美元 304,672	2021年4月21日	多伦多道明银行	(1,640)
新加坡元 7,581	美元 5,620	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(21)
新加坡元 56,809	美元 42,228	2021年4月21日	法国巴黎银行	(48)
新加坡元 77,125	美元 57,253	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(142)
新加坡元 93,527	美元 69,436	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(166)
新加坡元 75,647	美元 56,035	2021年4月21日	法国巴黎银行	(261)
美元 1,166	澳元 1,529	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(1)
美元 814	离岸人民币 5,340	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(1)
美元 3,903	离岸人民币 25,632	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(2)
美元 2,803	离岸人民币 18,398	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(3)
美元 1,142	离岸人民币 7,482	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(3)
美元 6,662	离岸人民币 43,749	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(4)
美元 102,456	加元 128,761	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(5)
美元 1,928	离岸人民币 12,633	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(5)
美元 1,437	离岸人民币 9,396	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(7)
美元 1,988	离岸人民币 13,007	2021年4月21日	多伦多道明银行	(8)
美元 1,690	离岸人民币 11,051	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(8)
美元 1,382	加元 1,724	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(10)
美元 1,903	离岸人民币 12,431	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(11)
美元 1,612	英镑 1,161	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(11)
美元 1,532	离岸人民币 10,000	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(11)
美元 1,397	离岸人民币 9,107	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(11)
美元 9,802	英镑 7,095	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(12)
美元 2,426	离岸人民币 15,862	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(12)
美元 1,423	离岸人民币 9,276	2021年4月21日	美国道富银行	(12)
美元 1,839	离岸人民币 12,000	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(13)
美元 1,987	离岸人民币 12,950	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(16)
美元 1,388	英镑 993	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(17)
美元 4,520	离岸人民币 29,579	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(18)
美元 1,941	加元 2,416	2021年4月21日	多伦多道明银行	(18)
美元 3,367	离岸人民币 21,995	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(19)
美元 2,045	离岸人民币 13,307	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(20)
美元 4,461	离岸人民币 29,171	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(21)
美元 19,632	离岸人民币 128,842	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(23)
美元 3,169	英镑 2,280	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(23)
美元 3,043	离岸人民币 19,835	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(24)



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 5,167	离岸人民币 33,792	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(25)
美元 4,967	离岸人民币 32,477	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(25)
美元 3,052	离岸人民币 19,890	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(25)
美元 1,453	澳元 1,864	2021年4月21日	法国巴黎银行	(33)
美元 5,142	离岸人民币 33,556	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(35)
美元 4,949	离岸人民币 32,266	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(39)
美元 1,754	欧元 1,455	2021年4月21日	美国道富银行	(43)
美元 4,150	澳元 5,390	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(44)
美元 30,792	加元 38,634	2021年4月21日	多伦多道明银行	(52)
美元 2,584	纽元 3,600	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(63)
美元 8,286	离岸人民币 54,022	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(65)
美元 55,633	离岸人民币 365,115	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(66)
美元 108,979	离岸人民币 715,632	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(68)
美元 46,208	澳元 60,565	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(74)
美元 9,206	离岸人民币 60,000	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(75)
美元 19,141	离岸人民币 125,139	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(96)
美元 11,272	新加坡元 15,000	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(109)
美元 3,223	纽元 4,429	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(121)
美元 46,168	离岸人民币 302,538	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(125)
美元 107,013	加元 134,317	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(141)
美元 33,576	离岸人民币 219,514	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(168)
美元 6,942	欧元 5,755	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(176)
美元 25,778	离岸人民币 168,216	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(177)
美元 30,426	离岸人民币 198,368	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(236)
美元 25,657	离岸人民币 166,923	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(253)
美元 21,597	澳元 28,015	2021年4月21日	多伦多道明银行	(257)
美元 12,846	澳元 16,502	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(276)
美元 14,284	纽元 20,000	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(277)
美元 197,638	澳元 259,089	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(283)
美元 23,272	离岸人民币 150,983	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(294)
美元 35,159	澳元 45,767	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(297)
美元 24,612	离岸人民币 159,675	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(311)
美元 32,584	欧元 27,429	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(334)
美元 70,817	英镑 51,072	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(348)
美元 27,944	英镑 20,000	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(349)
美元 15,639	纽元 21,828	2021年4月21日	法国巴黎银行	(352)
美元 49,096	加元 61,245	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(365)
美元 29,470	离岸人民币 191,193	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(372)
美元 36,888	离岸人民币 239,920	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(375)
美元 31,104	离岸人民币 201,907	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(376)
美元 35,186	离岸人民币 228,647	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(389)
美元 55,993	离岸人民币 365,323	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(395)
美元 31,870	离岸人民币 206,763	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(403)
美元 222,416	欧元 188,812	2021年4月21日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	(419)
美元 36,419	离岸人民币 236,510	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(425)
美元 215,746	英镑 156,049	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(431)
美元 66,555	澳元 86,801	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(436)
美元 42,765	离岸人民币 277,915	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(470)
美元 58,617	离岸人民币 382,059	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(472)
美元 426,636	离岸人民币 2,800,000	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(508)
美元 42,037	离岸人民币 272,877	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(508)
美元 46,589	离岸人民币 302,766	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(512)
美元 88,409	加元 110,463	2021年4月21日	法国巴黎银行	(516)
美元 80,738	英镑 58,120	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(545)
美元 24,327	澳元 31,207	2021年4月21日	法国巴黎银行	(556)
美元 26,370	纽元 36,830	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(577)
美元 47,057	英镑 33,672	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(596)
美元 63,051	离岸人民币 410,376	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(597)
美元 129,432	离岸人民币 846,475	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(608)
美元 74,168	离岸人民币 483,346	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(608)
美元 138,034	加元 172,685	2021年4月21日	法国巴黎银行	(634)
美元 94,050	离岸人民币 613,765	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(642)

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 55,318	欧元 46,500	2021年4月21日	多伦多道明银行	(645)
美元 72,700	新加坡元 96,774	2021年4月21日	法国巴黎银行	(681)
美元 27,388	纽元 38,091	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(712)
美元 101,223	离岸人民币 660,421	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(714)
美元 21,890	纽元 30,096	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(812)
美元 70,349	离岸人民币 456,724	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(841)
美元 111,370	英镑 80,088	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(866)
美元 72,716	离岸人民币 472,027	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(879)
美元 179,225	离岸人民币 1,171,760	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(897)
美元 127,183	离岸人民币 829,205	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(988)
美元 157,089	英镑 113,076	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,069)
美元 269,684	离岸人民币 1,764,843	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(1,095)
美元 132,797	新加坡元 176,948	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,113)
美元 271,762	英镑 196,146	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(1,122)
美元 98,897	离岸人民币 642,245	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(1,154)
美元 114,560	英镑 82,138	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,227)
美元 203,939	加元 254,728	2021年4月21日	法国巴黎银行	(1,260)
美元 143,358	新加坡元 190,904	2021年4月21日	美国道富银行	(1,288)
美元 96,923	澳元 125,404	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,400)
美元 69,051	纽元 96,582	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,412)
美元 186,497	离岸人民币 1,215,872	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,455)
美元 212,425	离岸人民币 1,386,197	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,462)
美元 578,280	英镑 418,045	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(1,467)
美元 313,962	离岸人民币 2,052,657	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(1,571)
美元 236,741	欧元 200,000	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(1,589)
美元 587,852	离岸人民币 3,852,209	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(1,590)
美元 147,337	离岸人民币 957,490	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,618)
美元 70,199	澳元 90,000	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(1,644)
美元 264,367	英镑 190,335	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(1,746)
美元 90,769	澳元 116,870	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,746)
美元 133,137	英镑 95,214	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,762)
美元 149,971	离岸人民币 972,978	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(1,895)
美元 185,900	离岸人民币 1,208,279	2021年4月21日	美国道富银行	(2,014)
美元 256,637	离岸人民币 1,672,739	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(2,065)
美元 194,618	离岸人民币 1,264,939	2021年4月21日	美国道富银行	(2,109)
美元 188,486	离岸人民币 1,224,045	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(2,200)
美元 166,946	欧元 140,000	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(2,339)
美元 589,951	纽元 838,997	2021年4月21日	多伦多道明银行	(2,379)
美元 174,585	欧元 146,451	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(2,393)
美元 372,714	离岸人民币 2,433,089	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(2,426)
美元 100,481	欧元 83,376	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(2,450)
美元 766,293	加元 959,889	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(2,539)
美元 399,100	离岸人民币 2,605,338	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(2,597)
美元 323,992	离岸人民币 2,111,650	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(2,623)
美元 210,673	欧元 176,935	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(2,639)
美元 398,667	离岸人民币 2,601,680	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(2,722)
美元 108,682	欧元 90,097	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(2,750)
美元 166,243	澳元 214,568	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(2,801)
美元 361,329	离岸人民币 2,355,787	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(2,806)
美元 179,189	欧元 150,000	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(2,824)
美元 281,882	英镑 202,218	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(2,864)
美元 4,996,140	离岸人民币 32,808,294	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(3,097)
美元 90,386	纽元 124,211	2021年4月21日	法国巴黎银行	(3,398)
美元 316,511	离岸人民币 2,056,897	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(3,476)
美元 221,296	澳元 285,691	2021年4月21日	美国道富银行	(3,678)
美元 1,171,799	澳元 1,533,375	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(3,786)
美元 355,474	离岸人民币 2,309,134	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(4,050)
美元 869,676	离岸人民币 5,687,622	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(4,086)
美元 253,750	澳元 327,751	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(4,093)
美元 366,899	离岸人民币 2,383,355	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(4,180)
美元 369,897	离岸人民币 2,401,642	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(4,395)
美元 447,874	离岸人民币 2,913,885	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(4,415)
美元 388,701	离岸人民币 2,523,732	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(4,618)
美元 312,816	欧元 262,002	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(4,764)



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 3,653,543	离岸人民币 23,974,091	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(4,964)
美元 200,340	欧元 165,959	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(5,211)
美元 222,327	纽元 310,000	2021年4月21日	美国道富银行	(5,225)
美元 746,461	离岸人民币 4,870,227	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(5,269)
美元 311,783	澳元 402,280	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(5,356)
美元 160,738	纽元 221,481	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(5,629)
美元 230,016	纽元 320,356	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(5,662)
美元 216,676	纽元 301,261	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(5,695)
美元 565,271	英镑 405,424	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(5,872)
美元 1,098,271	离岸人民币 7,174,809	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(6,348)
美元 817,546	离岸人民币 5,328,845	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(6,557)
美元 253,223	欧元 209,518	2021年4月21日	法国巴黎银行	(6,880)
美元 674,867	英镑 484,107	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(6,902)
美元 893,960	离岸人民币 5,828,199	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(6,975)
美元 285,306	澳元 365,141	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(7,169)
美元 691,967	澳元 898,706	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(7,399)
美元 461,552	欧元 386,180	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(7,496)
美元 267,065	纽元 370,630	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(7,503)
美元 1,110,815	澳元 1,448,299	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(7,607)
美元 441,820	澳元 570,015	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(7,624)
美元 361,523	澳元 464,404	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(7,774)
美元 448,776	纽元 628,908	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(8,335)
美元 1,326,505	加元 1,656,510	2021年4月21日	多伦多道明银行	(8,471)
美元 489,685	欧元 409,140	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(8,634)
美元 854,997	离岸人民币 5,560,835	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(8,702)
美元 1,218,339	英镑 876,460	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(9,012)
美元 398,146	欧元 330,482	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(9,578)
美元 426,861	纽元 595,291	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(9,963)
美元 372,199	欧元 307,778	2021年4月21日	多伦多道明银行	(10,325)
美元 1,139,412	欧元 960,002	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(10,677)
美元 300,791	纽元 413,452	2021年4月21日	多伦多道明银行	(11,239)
美元 838,377	英镑 599,357	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(11,752)
美元 1,050,073	英镑 752,407	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(11,912)
美元 1,018,560	离岸人民币 6,608,194	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(12,869)
美元 1,082,781	离岸人民币 7,028,748	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(13,087)
美元 1,154,915	英镑 826,817	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(14,083)
美元 1,161,123	澳元 1,505,243	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(14,539)
美元 636,220	纽元 886,737	2021年4月21日	多伦多道明银行	(15,214)
美元 536,332	纽元 739,902	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(18,159)
美元 591,178	纽元 815,269	2021年4月21日	法国巴黎银行	(20,224)
美元 1,862,257	离岸人民币 12,101,365	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(20,570)
美元 20,125,721	离岸人民币 132,062,465	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(27,343)
美元 21,081,544	离岸人民币 138,334,456	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(28,641)
美元 2,245,544	澳元 2,906,964	2021年4月21日	美国道富银行	(31,230)
美元 1,269,815	澳元 1,625,482	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(31,642)
美元 4,190,240	离岸人民币 27,272,750	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(39,644)
美元 4,919,061	离岸人民币 32,057,080	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(40,345)
美元 2,580,577	澳元 3,326,831	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(46,439)
美元 4,544,222	离岸人民币 29,502,259	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(54,320)
美元 2,440,014	澳元 3,131,379	2021年4月21日	法国巴黎银行	(54,758)
美元 59,753,828	英镑 43,193,547	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(155,933)
美元 21,103,319	欧元 17,736,175	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(249,798)
美元 239,902,243	离岸人民币 1,574,208,534	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(325,928)
美元 127,607,069	澳元 166,987,366	2021年4月21日	法国巴黎银行	(408,284)
美元 30,767,292	纽元 43,271,738	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(462,925)
澳元 1,969	美元 1,500	2021年5月21日	美国道富银行	(0)
澳元 45,817	美元 34,900	2021年5月21日	美国道富银行	(4)
欧元 4,120	美元 4,846	2021年5月21日	加拿大皇家银行	(1)
纽元 65,155	美元 45,604	2021年5月21日	巴克莱银行, 伦敦	(22)
新加坡元 1,483	美元 1,103	2021年5月21日	多伦多道明银行	(0)
美元 16,223	离岸人民币 106,795	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦	(8)
美元 114,556	离岸人民币 754,392	2021年5月21日	法国巴黎银行	(9)
美元 115,792	离岸人民币 762,531	2021年5月21日	法国巴黎银行	(10)

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 26,646	离岸人民币 175,405	2021 年 5 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(12)
美元 23,407	离岸人民币 154,058	2021 年 5 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(15)
美元 78,207	美元 111,653	2021 年 5 月 21 日	法国巴黎银行	(19)
美元 292,201	离岸人民币 1,923,515	2021 年 5 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(136)
美元 1,514,325	离岸人民币 9,966,909	2021 年 5 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(957)
			未实现总亏损	<u>(2,564,006)</u>
			未实现净亏损	<u><u>(1,134,110)</u></u>

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	14,102,268	9,423,325
应收经纪款项	7,406,819	2,527,209
分配应收款项	7,452,623	10,085,233
衍生性产品	1,429,896	2,299,462
投资	1,401,785,741	1,090,958,385
股息及其他应收款项	5,781,850	3,170,657
<b>总资产</b>	<u>1,437,959,197</u>	<u>1,118,464,271</u>
<b>负债</b>		
应付经纪款项	20,687,225	2,641,801
赎回应付款项	4,337,696	3,041,826
应付收益分配 [附注 6]	4,529,619	4,056,178
应付税项	102,137	-
衍生性产品	2,564,006	4,599,154
其他应付款项	1,861,258	1,521,890
<b>总负债 (不含可赎回份额持有人 应占净资产)</b>	<u>34,081,941</u>	<u>15,860,849</u>
<b>可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]</b>	<u>1,403,877,256</u>	<u>1,102,603,422</u>

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]	326,104,041	(279,585,968)
股息收入	15,311,150	17,653,087
存款利息	34,211	144,012
汇兑净亏损	(687,715)	(1,179,700)
其他收益	1,488,906	-
	<u>342,250,593</u>	<u>(262,968,569)</u>
<b>支出</b>		
管理费用 [附注 5(a)]	9,133,575	9,794,527
交易成本 [附注 5(a), 5(b)]	1,671,133	2,354,322
托管费用及银行费用 [附注 5(a), 5(b)]	217,286	215,728
受托人费用 [附注 5(b)]	168,800	178,526
基金注册登记机构费用 [附注 5(a)]	59,247	59,700
法律及专业费用	23,268	39,808
核数师酬金	20,695	18,527
估值费用 [附注 5(a)]	8,540	8,680
印刷及出版支出	6,084	601
其他经营费用	11,589	17,054
	<u>11,320,217</u>	<u>12,687,473</u>
<b>净经营利润/(亏损)</b>	<u>330,930,376</u>	<u>(275,656,042)</u>
<b>财务成本</b>		
收益分配 [附注 6]	(25,077,245)	(30,219,749)
利息支出 [附注 5(b)]	(6,300)	(3,767)
	<u>(25,083,545)</u>	<u>(30,223,516)</u>
<b>除税前利润/(亏损)</b>	<u>305,846,831</u>	<u>(305,879,558)</u>
税项	(1,915,377)	(1,599,599)
<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>	<u>303,931,454</u>	<u>(307,479,157)</u>

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	1,102,603,422	1,384,436,816
分配可赎回份额(附注 3)	439,200,135	277,251,164
赎回可赎回份额(附注 3)	(441,857,755)	(359,611,725)
<b>净赎回</b>	(2,657,620)	(82,360,561)
	1,099,945,802	1,302,076,255
可赎回份额持有人应占净资产及 总综合收益之增加/(减少)	303,931,454	(307,479,157)
期末可赎回份额持有人 应占净资产	1,403,877,256	994,597,098

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	(508,268,462)	(637,270,024)
出售投资及衍生性产品所得 款项	535,507,701	782,070,411
已收股息	12,687,082	18,479,945
已收利息	31,876	145,492
已付基金注册登记机构费用	(115,263)	(120,325)
已付受托人费用	(160,038)	(184,256)
已付交易成本	(1,636,033)	(2,384,157)
已付税项	(1,813,240)	(1,748,907)
已付管理费用	(8,666,492)	(10,159,512)
其他	126,403	(1,303,240)
<b>经营业务所产生之现金净额</b>	27,693,534	147,525,427
<b>融资活动</b>		
已付利息	(6,300)	(3,767)
分配可赎回份额所得款项	441,832,745	279,450,786
赎回可赎回份额付款	(440,561,885)	(360,095,478)
已付收益分配	(24,603,804)	(30,505,074)
<b>融资活动所运用之现金净额</b>	(23,339,244)	(111,153,533)
<b>现金及现金等价物之增加</b>	4,354,290	36,371,894
期初现金及现金等价物	9,423,325	15,713,579
现金及现金等价物之汇兑收益 /(亏损)	324,653	(227,553)
<b>期末现金及现金等价物</b>	14,102,268	51,857,920
<b>现金及现金等价物余额分析:</b>		
银行现金	14,102,268	51,857,920

财务报表之附注

1 本基金

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

二零二零年四月三十日之前，本基金的投资目标为通过主要投资于亚太区（日本除外）内的、投资管理预期会派发股息公司的股票，以提供收益及长期资本增长。本基金所持有的此等股票将根据公司的过往派息纪录及公告，以及其长期资本增长潜力而挑选。

二零二零年四月三十日之后，本基金的投资目标为通过主要投资（即至少为资产净值总额的 70%）于亚太区（日本除外）内的、投资管理预期会派发股息公司的股票，以提供收益及长期资本增长。本基金所持有的此等股票将根据公司的过往派息纪录及公告，以及其长期资本增长潜力而挑选。

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

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

2 主要会计政策概览

(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。

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。卖空被分类为按公允价值透过损益列账的金融负债。

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。

确认、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，按最后交易价计算。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。在非活跃市场中进行金融工具交易时，以市场报价、交易商/经纪报价或其他获可观察输入值支持的报价来源作为估值。

债务证券的公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平值而计算，或如集体投资计划为上市或在交易所买卖，则以最后交易价计算。

未平仓期货和掉期合约是以在估值日的长短仓最后交易价估值。最后交易价与合约价格之间的差额在综合收益表确认。

未平仓期权是以在估值日的长短仓最后交易价估值。最后交易价与溢价金额/合约价格之间的差额在综合收益表确认。

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

**(c) 外币交易**

*功能及呈列货币*

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

*交易及结余*

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按期/年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

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

**(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	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	18,288,390.411	8,291,310.412	1,353,952.956	3,644,545.871	1,315,720.065
总分配	4,409,953.397	2,527,738.536	963,321.863	1,507,634.658	1,477,054.217
总赎回	(6,023,674.342)	(2,685,564.570)	(399,819.919)	(934,577.742)	(1,208,549.872)
期末	16,674,669.466	8,133,484.378	1,917,454.900	4,217,602.787	1,584,224.410

	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	新加坡元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
期初	160,240,761.757	4,742,186.011	972,733.833	141,673,624.018	666,937.330
总分配	63,871,731.456	1,451,061.653	600,958.092	37,267,020.407	475,877.448
总赎回	(55,750,423.019)	(1,610,941.928)	(216,530.845)	(32,550,449.178)	(107,316.766)
期末	168,362,070.194	4,582,305.736	1,357,161.080	146,390,195.247	1,035,498.012

	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每季派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	293,253.873	34,126,677.797	10,021,705.390	914,860.915	3,171,514.040
总分配	414,246.610	13,004,817.938	2,209,257.386	143,259.988	1,206,760.180
总赎回	(222,648.472)	(12,847,857.397)	(265,582.840)	(45,442.005)	(1,407,861.030)
期末	484,852.011	34,283,638.338	11,965,379.936	1,012,678.898	2,970,413.190

	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额	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:					
期初	3,359,026.210	18,955,920.350	22,429,544.450	3,652,162.510	3,347,321.140
总分配	33,391.350	3,488,716.840	1,895,685.360	653,847.720	464,347.960
总赎回	(1,205,063.200)	(12,017,681.210)	(13,065,192.710)	(1,841,830.240)	(2,061,847.890)
期末	2,187,354.360	10,426,955.980	11,260,037.100	2,464,179.990	1,749,821.210

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	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	21,946,697.689	8,993,396.991	1,308,102.363	4,081,327.210	1,303,569.977
总分配	4,444,954.891	1,494,901.433	245,291.428	826,319.977	26,660.012
总赎回	(6,198,742.661)	(2,004,417.645)	(181,412.356)	(919,622.198)	(17,035.292)
期末	<u>20,192,909.919</u>	<u>8,483,880.779</u>	<u>1,371,981.435</u>	<u>3,988,024.989</u>	<u>1,313,194.697</u>

	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	新加坡元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
期初	188,901,398.104	5,243,144.814	1,245,112.340	167,755,889.102	858,356.178
总分配	41,865,810.382	902,478.640	72,926.459	14,759,271.457	198,397.279
总赎回	(57,670,516.540)	(1,173,019.256)	(272,938.300)	(28,016,745.793)	(123,491.215)
期末	<u>173,096,691.946</u>	<u>4,972,604.198</u>	<u>1,045,100.499</u>	<u>154,498,414.766</u>	<u>933,262.242</u>

	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
期初	282,082.535	42,455,259.956	8,990,171.597	4,896,425.720	3,716,417.790
总分配	32,935.350	9,611,481.838	1,106,540.721	1,361,970.610	1,374,296.440
总赎回	(95,719.421)	(13,250,770.628)	(429,738.978)	(2,423,794.600)	(1,188,921.800)
期末	<u>219,298.464</u>	<u>38,815,971.166</u>	<u>9,666,973.340</u>	<u>3,834,601.730</u>	<u>3,901,792.430</u>

	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:				
期初	29,018,058.960	31,592,315.030	4,102,671.470	3,116,898.470
总分配	10,335,001.650	6,283,569.640	1,138,115.080	1,186,949.230
总赎回	(17,176,820.650)	(8,539,351.360)	(1,133,663.320)	(781,405.240)
期末	<u>22,176,239.960</u>	<u>29,336,533.310</u>	<u>4,107,123.230</u>	<u>3,522,442.460</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	欧元对冲类别 (每月派息) 欧元	英镑对冲类别 (每月派息) 英镑	港元类别 (累计) 港元
可赎回份额持有人应占 净资产	162,915,789	82,248,387	20,311,154	43,826,829	24,233,750
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	9.77	10.11	10.59	10.39	15.30
	港元类别 (每月派息) 港元	纽元对冲类别 (每月派息) 纽元	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	新加坡元对冲类别 (每月派息) 新加坡元
可赎回份额持有人应占 净资产	1,788,280,754	45,640,885	24,403,953	1,601,635,220	10,650,778
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	10.62	9.96	17.98	10.94	10.29
	美元类别 (累计) 美元	美元类别 (每月派息) 美元	美元 C 类别 (每月派息) 美元	美元 C 类别 (每季派息) 美元	PRC 人民币份额 (累计) 人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	7,436,898	363,731,788	132,306,958	12,338,440	34,040,918
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	15.34	10.61	11.06	12.18	11.46
	PRC 人民币份额 (每月派息) 人民币	PRC 人民币对冲份 额 (累计) 人民币	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	22,829,109	124,649,290	119,199,250	28,843,839	18,666,529
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	10.44	11.95	10.59	11.71	10.67

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	欧元对冲类别 (每月派息) 欧元	英镑对冲类别 (每月派息) 英镑	港元类别 (累计) 港元
可赎回份额持有人应占 净资产	142,122,799	66,613,896	11,380,303	30,083,335	15,620,126
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	7.77	8.03	8.41	8.25	11.87
	港元类别 (每月派息) 港元	纽元对冲类别 (每月派息) 纽元	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	新加坡元对冲类别 (每月派息) 新加坡元
可赎回份额持有人应占 净资产	1,345,765,273	37,561,058	13,466,808	1,231,267,494	5,439,360
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	8.40	7.92	13.84	8.69	8.16
	美元类别 (累计) 美元	美元类别 (每月派息) 美元	美元 C 类别 (每月派息) 美元	美元 C 类别 (每季派息) 美元	PRC 人民币份额 (累计) 人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	3,502,317	287,170,267	87,566,453	8,827,529	29,249,658
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	11.94	8.41	8.74	9.65	9.22
	PRC 人民币份额 (每月派息) 人民币	PRC 人民币对冲份 额 (累计) 人民币	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	28,757,606	174,448,284	188,653,747	33,288,437	28,328,391
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	8.56	9.20	8.41	9.11	8.46

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	228,502,796	(146,901,168)
投资及衍生性产品销售之实现收益／（亏损）	97,601,245	(132,684,800)
	<u>326,104,041</u>	<u>(279,585,968)</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	9,133,575	9,794,527
基金注册登记机构费用	59,247	59,700
交易成本	37,963	41,031
托管费用及银行费用	10,600	16,311
估值费用	8,540	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
托管费用及银行费用	167,191	176,627
受托人费用	168,800	178,526
交易成本	74,360	42,484
利息支出	6,300	3,767

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 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
澳元对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	澳元 0.0271	18,130,864.663	(344,188)	
加元对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	加元 0.0280	8,217,444.236	(172,145)	
欧元对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	欧元 0.0242	1,448,171.156	(40,855)	
英镑对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	英镑 0.0281	3,668,935.473	(132,892)	
港元类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	港元 0.0299	157,012,691.849	(605,499)	
纽元对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	纽元 0.0282	4,712,611.666	(87,711)	
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 0.0524	138,442,834.269	(1,079,412)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	新加坡元 0.0289	667,206.200	(14,093)	

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
美元类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0300	33,114,715.026	(993,441)	
美元 C 类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0312	10,142,601.086	(316,449)	
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 0.0507	21,940,601.490	(165,517)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	人民币 0.0300	3,248,728.270	(14,502)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0302	3,303,691.880	(99,771)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	澳元 0.0262	18,178,187.874	(352,343)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	加元 0.0277	8,143,545.335	(173,848)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	欧元 0.0236	1,431,590.794	(40,369)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	英镑 0.0278	3,606,368.780	(133,793)	
港元类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	港元 0.0300	153,550,044.827	(594,330)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	纽元 0.0280	4,523,399.746	(89,115)	
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 0.0519	135,785,584.270	(1,072,881)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	新加坡元 0.0288	662,939.258	(14,271)	
美元类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0300	32,804,916.544	(984,147)	
美元 C 类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0312	10,772,583.813	(336,105)	
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 0.0502	19,254,783.000	(147,154)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	人民币 0.0296	3,119,868.550	(14,059)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0302	2,957,904.430	(89,329)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	澳元 0.0238	17,648,021.240	(322,788)	
加元对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	加元 0.0259	7,833,493.004	(159,028)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	欧元 0.0196	1,330,799.135	(32,084)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	英镑 0.0244	3,588,262.790	(119,156)	
港元类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	港元 0.0300	149,885,150.500	(580,025)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	纽元 0.0269	4,327,775.733	(83,861)	
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 0.0527	134,317,479.700	(1,088,318)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	新加坡元 0.0289	670,744.269	(14,655)	
美元类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0300	31,002,691.630	(930,081)	
美元 C 类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0312	11,217,718.590	(349,993)	
美元 C 类别 (每季派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.1038	972,273.489	(100,922)	
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 0.0510	17,167,688.390	(134,615)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	人民币 0.0294	3,061,758.030	(13,840)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0302	2,423,718.730	(73,196)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	澳元 0.0254	17,654,301.191	(343,915)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	加元 0.0274	8,027,996.922	(171,782)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	欧元 0.0218	1,604,385.409	(42,399)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	英镑 0.0268	3,899,423.311	(143,380)	
港元类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	港元 0.0309	158,086,930.089	(630,052)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月9日	纽元 0.0275	4,479,419.801	(88,212)	
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 0.0529	140,928,247.916	(1,151,385)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	新加坡元 0.0300	885,825.193	(19,993)	
美元类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0310	31,953,681.669	(990,564)	
美元 C 类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0323	11,430,041.680	(369,190)	
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 0.0513	12,528,610.260	(99,263)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	人民币 0.0300	2,495,597.930	(11,563)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0312	1,935,597.120	(60,391)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	澳元 0.0271	16,777,212.437	(361,798)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	加元 0.0289	8,092,320.726	(186,848)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	欧元 0.0244	1,645,791.402	(49,088)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	英镑 0.0292	4,082,717.117	(168,481)	
港元类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	港元 0.0309	163,576,622.364	(651,851)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	纽元 0.0292	4,263,504.170	(92,605)	
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 0.0554	140,825,770.339	(1,207,346)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	新加坡元 0.0302	963,996.629	(22,043)	
美元类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0310	33,301,097.103	(1,032,334)	
美元 C 类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0323	11,611,261.651	(375,044)	
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 0.0536	12,209,374.600	(101,274)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	人民币 0.0300	2,252,172.940	(10,456)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0312	1,781,672.260	(55,588)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	澳元 0.0272	16,677,125.909	(345,498)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	加元 0.0287	8,159,278.541	(186,316)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	欧元 0.0234	1,917,454.900	(52,734)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	英镑 0.0288	4,216,663.798	(167,551)	
港元类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	港元 0.0310	168,406,366.110	(671,507)	

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
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	纽元 0.0295	4,577,870.688	(94,580)	
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 0.0570	146,428,971.124	(1,272,092)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	新加坡元 0.0312	1,035,498.012	(24,045)	
美元类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0310	34,219,177.614	(1,060,794)	
美元 C 类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0323	11,965,379.936	(386,482)	
美元 C 类别 (每季派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0174	1,012,678.898	(108,762)	
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 0.0552	11,250,640.290	(94,653)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	人民币 0.0302	2,187,354.360	(10,068)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0312	1,747,983.370	(54,537)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	澳元 0.0259	21,497,886.443		(383,604)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	加元 0.0325	8,688,516.168		(214,841)
欧元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	欧元 0.0153	1,268,840.344		(21,659)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	英镑 0.0255	3,900,821.874		(128,715)
港元类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	港元 0.0374	183,588,964.677		(876,051)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	纽元 0.0287	5,307,394.133		(97,684)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	人民币 0.0454	165,042,911.445		(1,063,637)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	新加坡元 0.0325	862,081.544		(20,587)
美元类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0370	41,920,140.497		(1,551,045)
美元 C 类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0382	8,976,545.159		(342,904)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	人民币 0.0438	32,331,147.540		(201,019)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	人民币 0.0393	3,794,647.750		(21,169)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0372	3,250,644.460		(120,924)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	澳元 0.0279	21,856,926.904		(412,474)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	加元 0.0351	8,530,411.815		(225,423)
欧元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	欧元 0.0185	1,218,225.316		(24,849)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	英镑 0.0281	3,854,922.261		(140,116)
港元类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	港元 0.0373	188,305,315.416		(897,293)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	纽元 0.0304	4,997,371.978		(97,518)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	人民币 0.0463	162,349,758.888		(1,069,253)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	新加坡元 0.0332	850,814.858		(20,657)
美元类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0370	42,150,679.905		(1,559,575)
美元 C 类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0382	8,963,402.453		(342,402)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	人民币 0.0448	32,373,273.020		(206,306)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	人民币 0.0390	3,974,554.370		(22,050)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0372	3,331,667.400		(123,938)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	澳元 0.0280	21,514,995.203		(423,471)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	加元 0.0334	8,718,385.056		(224,557)
欧元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	欧元 0.0141	1,198,332.439		(18,966)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	英镑 0.0246	3,903,609.275		(127,214)
港元类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	港元 0.0371	181,516,019.990		(864,473)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	纽元 0.0309	4,833,491.655		(100,762)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	人民币 0.0478	160,763,330.419		(1,103,277)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	新加坡元 0.0336	895,266.724		(22,371)
美元类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0370	41,734,980.126		(1,544,194)
美元 C 类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0382	9,059,697.954		(346,081)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	人民币 0.0462	31,266,284.420		(207,390)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	人民币 0.0389	3,707,393.410		(20,706)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0372	3,270,476.900		(121,662)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	澳元 0.0282	20,409,757.916		(385,305)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	加元 0.0342	8,523,041.496		(220,398)
欧元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	欧元 0.0162	1,252,139.247		(22,479)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	英镑 0.0267	3,795,507.118		(133,586)
港元类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	港元 0.0370	177,716,716.622		(846,826)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	纽元 0.0311	4,903,264.004		(98,685)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	人民币 0.0475	156,960,000.635		(1,064,660)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	新加坡元 0.0339	896,036.521		(22,255)
美元类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	美元 0.0370	42,677,698.349		(1,579,075)
美元 C 类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	美元 0.0382	9,351,897.029		(357,242)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	人民币 0.0459	29,474,721.900		(192,820)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	人民币 0.0381	3,600,051.810		(19,549)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	美元 0.0372	3,365,838.750		(125,209)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	澳元 0.0299	20,075,354.162		(387,013)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	加元 0.0364	8,678,595.819		(235,334)

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
欧元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	欧元 0.0198	1,384,719.168		(30,117)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	英镑 0.0290	3,881,162.432		(143,765)
港元类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	港元 0.0370	175,619,975.338		(833,812)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	纽元 0.0320	4,979,132.868		(98,826)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	人民币 0.0473	154,964,767.378		(1,048,587)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	新加坡元 0.0347	932,631.172		(23,187)
美元类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0370	41,110,711.028		(1,521,096)
美元 C 类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0383	9,449,461.782		(361,915)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	人民币 0.0457	28,427,169.360		(185,849)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	人民币 0.0389	3,903,590.650		(21,723)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0372	3,470,967.750		(129,120)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	澳元 0.0322	20,195,447.589		(398,012)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	加元 0.0348	8,483,880.779		(207,426)
欧元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	欧元 0.0246	1,371,981.435		(37,033)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	英镑 0.0302	3,985,244.616		(149,233)
港元类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	港元 0.0369	173,212,545.913		(824,620)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	纽元 0.0355	4,975,834.382		(104,722)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	人民币 0.0432	154,369,753.878		(940,828)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	新加坡元 0.0342	933,262.242		(22,416)
美元类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0370	38,968,349.450		(1,441,829)
美元 C 类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0383	9,666,973.340		(370,245)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	人民币 0.0418	29,080,757.410		(171,493)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	人民币 0.0396	3,901,792.430		(21,798)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0372	3,522,680.950		(131,044)
可赎回份额持有人之总收益分配					(25,077,245)	(30,219,749)

