

年度报告 – 2021年9月30日（经审核）

摩根国际债券基金

内地与香港互认基金系列



中国内地代理人：

上投摩根
基金 管 理

基金管理人：

摩根
资 产 管 理

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

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

内容	页
投资组合 - 未经审计	1 - 4
投资组合持有变动表 - 未经审计	5
金融衍生工具详情 - 未经审计	6
金融衍生工具风险敞口信息 - 未经审计	6
财务状况表	7
综合收益表	7
可赎回份额持有人应占净资产变动表	8
现金流量表	8
财务报表之附注	9 - 45
独立核数师报告	46 - 47
管理人及受托人的责任声明	48
受托人对份额持有人的报告	48
业绩纪录 - 未经审计	48 - 49
经营与管理	50

投资组合

截至二零二一年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
上市投资 (95.4%)				Canada (Govt of) 0.5% 01/12/30	加元 7,000,000	5,074,867	0.5
(I) 债务证券 (73.6%)				Canada Govt of 0.25% 01/02/23	加元 13,000,000	10,243,252	0.9
澳大利亚 (3.3%)				Hydro-Quebec 4% 15/02/55	加元 300,000	298,870	0.0
APT Pipelines 4.2% 23/03/25-RegS	美元 500,000	544,482	0.0	Hydro-Quebec No19 6.5% 15/02/35	加元 1,700,000	1,976,522	0.2
APT Pipelines Ltd EMTN 2% 15/07/30-RegS	欧元 1,500,000	1,883,686	0.2	Ontario Prov of 2.6% 02/06/25	加元 600,000	502,879	0.0
Ausgrid Finance 4.35% 01/08/28-RegS	美元 500,000	566,462	0.1	Ontario Prov of 2.7% 02/06/29	加元 1,000,000	844,846	0.1
Ausgrid Finance Pty Ltd 3.85% 01/05/23-RegS	美元 500,000	527,086	0.0	Ontario Prov of 3.5% 02/06/24	加元 3,750,000	3,199,326	0.3
Ausnet Services Holdings Ser Emtn 11/03/81	欧元 719,000	841,807	0.1	Ontario Teachers 0.5% 06/05/25-RegS	欧元 4,009,000	4,775,897	0.4
Aust & Nz Banking Group VRN 22/07/30-RegS	美元 1,500,000	1,567,976	0.1	Quebec Prov of 2.6% 06/07/25	加元 2,700,000	2,261,303	0.2
Australia (Govt of) 1.75% 21/06/51-RegS	澳元 17,650,000	11,129,230	1.0	Quebec Prov of 3.75% 01/09/24	加元 1,250,000	1,072,914	0.1
Australian Government 0.5% 21/09/26-RegS	澳元 7,500,000	5,345,086	0.5	Quebec Prov of 4.2% 10/03/25-RegS	澳元 1,200,000	965,429	0.1
Australian Govt No150 3% 03/47-RegS	澳元 1,200,000	978,023	0.1	Transcanada Trust 15/03/77-RegS	美元 2,500,000	2,691,889	0.2
Macquarie Bank Ltd 03/03/36-144A	美元 1,500,000	1,489,788	0.1	开曼群岛 (0.5%)			
Macquarie Group 31/12/49	美元 2,000,000	2,201,496	0.2	Avolon Holdings Funding Ltd 144A 2.875% 15/02/25-RegS	美元 770,000	795,345	0.1
Mirvac Group 3.625% 18/03/27-RegS	美元 600,000	652,121	0.1	Avolon Holdings Funding Ltd 144A (4.25% 15/04/26-RegS	美元 1,700,000	1,862,463	0.1
Scentre Group 2 VRN 4.75% 9/80-RegS	美元 1,500,000	1,615,420	0.1	CK Hutchison Capit 17 31/12/49	美元 2,000,000	2,062,649	0.2
SGSP (Aust) 3.5% 07/07/27-RegS	美元 1,200,000	1,318,778	0.1	Sunny Optical Tech 3.75% 23/01/23-RegS	美元 1,250,000	1,298,799	0.1
SGSP (Aust) Stp Cpn 3.3% 09/04/23	美元 3,000,000	3,169,418	0.3	智利 (0.2%)			
SGSP Aus 3.25% 29/07/26- RegS	美元 2,000,000	2,164,054	0.2	Chile (Rep of) 0.55% 21/01/29	欧元 2,000,000	2,311,322	0.2
Woolworths Group Ltd EMTN 0.375% 15/11/28- RegS	欧元 826,000	949,306	0.1	中国 (10.2%)			
百慕大 (0.1%)				CCB Life Ins VRN 4.5% 21/4/77-RegS	美元 2,500,000	2,584,420	0.2
Tengizchevroil Fin Co Int 3.25% 15/08/30-RegS	美元 1,500,000	1,530,376	0.1	China (Govt of) INBK 3.01% 13/05/28	人民币 240,000,000	37,932,367	3.4
巴西 (0.2%)				China (Govt of) INBK 3.02% 27/05/31	人民币 310,000,000	49,066,762	4.4
Banco do Brasil 4.625% 15/1/25-RegS	美元 2,000,000	2,134,548	0.2	China (Govt of) INBK 3.03% 11/03/26	人民币 100,000,000	15,959,376	1.4
加拿大 (5.7%)				China Dev Bank1.25% 21/01/23-RegS	英镑 824,000	1,124,486	0.1
Bank of Montreal EMTN 1% 09/09/26-RegS	英镑 1,043,000	1,387,819	0.1	China Development Bank INBK 3% 17/06/24	人民币 50,000,000	7,857,039	0.7
British Columbia 2.2% 18/06/30	加元 1,000,000	812,620	0.1	哥伦比亚 (0.3%)			
British Columbia 4.3% 18/06/42	加元 1,000,000	1,013,906	0.1	Ecopetrol Sa 6.875% 29/04/30	美元 3,000,000	3,600,833	0.3
Canada (Govt of) 0.25% 01/03/26	加元 35,000,000	26,677,943	2.4				

投资组合 (续)
截至二零二一年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比
科特迪瓦(0.2%)				印度(1.0%)			
Ivory Coast 4.875%				HDFC Bank Ltd VRN 31/12/49			
30/01/32	欧元 1,800,000	2,122,266	0.2	Perp-RegS	美元 3,700,000	3,701,850	0.3
埃及(0.3%)				NTPC Ltd 4.75% 03/10/22-	美元 2,350,000	2,491,283	0.2
Arab Republic of Egypt				RegS			
3.875% 16/02/26-RegS	美元 3,500,000	3,313,414	0.3	NTPC Ltd Ser Emtn 2.75%			
法国(2.9%)				01/02/27-RegS	欧元 2,500,000	3,156,478	0.3
BPCE SA VRN 0.5%				State Bank of India 3.25%			
15/09/27-RegS	欧元 1,300,000	1,513,794	0.1	24/01/22-RegS	美元 1,459,000	1,479,329	0.2
Dexia Credit 0.75%				印度尼西亚(0.9%)			
07/05/23-RegS	美元 3,016,000	3,045,207	0.3	Bank Negara Indonesia VRN			
Dexia Credit 1% 18/10/27-				31/12/49 Perp-RegS	美元 1,900,000	1,904,607	0.2
RegS	欧元 1,000,000	1,242,813	0.1	Indonesia (Rep of) 1.3%			
Dexia Credit Local 1.25%				23/03/34	欧元 2,769,000	3,144,260	0.3
11/24-RegS	欧元 1,200,000	1,473,443	0.1	Perusahaan Listrik 2.875%	欧元 400,000	508,908	0.0
France OAT 3.5% 25/04/26	欧元 5,000,000	6,938,399	0.6	10/25-RegS			
France OAT 5.75% 25/10/32	欧元 7,444,000	14,398,881	1.3	Perusahaan Listrik Negar	美元 1,351,000	1,598,815	0.1
Societe Generale 4.25%				5.45% 21/05/28-RegS			
19/8/26-RegS	美元 2,000,000	2,194,639	0.2	Perusahaan Listrik 1.875%			
Societe Generale24/11/30-				11/31-RegS	欧元 1,500,000	1,726,086	0.2
RegS	欧元 1,500,000	1,767,027	0.2	Rep of Indonesia 1.45%			
德国(7.5%)				18/09/26	欧元 1,200,000	1,447,575	0.1
Bundeschatzanweisungen				跨国性(0.3%)			
0% 15/02/31-RegS	欧元 21,343,040	25,290,483	2.3	Corp Andina Fomento			
Bundeschatzanweisungen				2.375% 12/05/23	美元 3,000,000	3,111,348	0.3
0% 15/08/31-RegS	欧元 9,300,000	10,985,242	1.0	爱尔兰(0.6%)			
Bundesrep Deut 0%				AIB Group Plc VRN 31/12/49			
15/05/35-RegS	欧元 15,588,000	18,067,284	1.6	Perp-RegS	欧元 1,500,000	1,971,594	0.2
Bundesrep Deut 0%				Glencore Cap Fin DAC EMTN			
15/08/50-RegS	欧元 10,708,200	11,461,280	1.0	1.125% 10/03/28-RegS	欧元 1,500,000	1,783,416	0.1
Bundesrep Deut 0.5%				Ireland Treasury 1.3%			
15/02/25	欧元 9,000,000	10,886,431	1.0	15/05/33-RegS	欧元 667,322	870,334	0.1
Deutsche Bank Ag				Zurich Finance Ireland			
22/12/28-RegS	英镑 500,000	674,727	0.1	19/04/51-RegS	美元 2,500,000	2,527,915	0.2
Deutsche Bank Ag Ser Emtn				以色列(0.2%)			
17/02/27-RegS	欧元 2,100,000	2,465,334	0.2	Israel Electric 5%12/11/24-			
State of North Rhine2.15%				144A/RegS	美元 2,000,000	2,258,931	0.2
3/19-RegS	欧元 1,200,000	2,102,350	0.2	意大利(6.1%)			
Vonovia SE EMTN 0.375%				Intesa Sanpaolo Spa EMTN			
16/06/27-RegS	欧元 1,500,000	1,742,353	0.1	VRN 31/12/49 Perp-RegS	欧元 2,500,000	3,233,595	0.3
香港(0.5%)				Italy (Rep of) 0% 01/04/26-	欧元 3,000,000	3,466,341	0.3
AIA Group Ltd GMTN VRN				RegS			
31/12/49 Perp-RegS	美元 1,850,000	1,906,223	0.2	Italy (Rep of) 1.7% 01/09/51-	欧元 6,000,000	6,801,552	0.6
Airport Authority HK				RegS			
31/12/49-RegS	美元 4,000,000	4,010,425	0.3	Italy Rep of (BTP) 1.45%			
匈牙利(0.1%)				15/11/24	欧元 6,000,000	7,347,355	0.6
Hungary(Govt of) 2.125%				Italy Rep of (BTP) 6.5%			
22/09/31-RegS	美元 1,474,000	1,454,238	0.1	01/11/27	欧元 4,600,000	7,454,066	0.7
冰岛(0.2%)				Italy Rep of 0.5% 01/02/26-	欧元		
Iceland Rep of 0.5%				Regs	23,000,000	27,213,766	2.4
20/12/22-RegS	欧元 1,500,000	1,759,808	0.2	Italy Rep of 2.375% 17/10/24	美元 9,213,000	9,669,066	0.9
				UniCredit Spa VRN 3.875%			
				Perp-RegS	欧元 2,500,000	2,876,085	0.3

投资组合 (续)
截至二零二一年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百分比
日本(11.1%)				Mexico (Utd States of) 5% 27/04/51	美元 5,000,000	5,605,894	0.5
Dai-ichi Mutual Life 29/10/49	美元 3,200,000	3,581,360	0.3	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/29-RegS	欧元 3,000,000	3,548,264	0.3
Dev Bank of Japan 0.875% 10/25-RegS	欧元 400,000	486,128	0.1	Petroleos Mexicanos 7.69% 23/01/50	美元 3,000,000	2,888,372	0.3
Dev Bank of Japan 2% 19/10/21-RegS	美元 1,000,000	1,009,694	0.1	摩洛哥(0.1%)			
Japan (Govt of) 1.9% 20/09/30	日元 2,300,000,000	24,075,891	2.2	Kingdom of Morocco 2% 30/09/30-RegS	欧元 1,150,000	1,318,156	0.1
Japan Fin Org 3.375% 27/09/23-RegS	美元 1,000,000	1,056,266	0.1	荷兰(0.6%)			
JGB No1 (40Yr) 2.4% 20/03/48	日元 250,000,000	3,224,555	0.3	ABN Amro Bank NV VRN 31/12/49 Perp-RegS	欧元 2,600,000	3,242,543	0.3
JGB No10 (40Yr) 0.9% 20/03/57	日元 617,450,000	5,853,737	0.5	ING Groep NV VRN 31/12/49 Perp	美元 2,000,000	1,948,460	0.2
JGB No151 (20Yr) 1.2% 20/12/34	日元 209,800,000	2,130,782	0.2	Neder Waterscha 3.4% 22/07/25-RegS	澳元 1,800,000	1,431,177	0.1
JGB No160 (20Yr) 0.7% 20/03/37	日元 599,650,000	5,709,022	0.5	新西兰(0.5%)			
JGB No20 (30Yr) 2.5% 20/09/35	日元 3,440,400,000	40,469,437	3.6	Auckland Council 0.125% 09/29- RegS	欧元 3,000,000	3,458,482	0.3
JGB No37 (30Yr) 1.9% 20/09/42	日元 528,200,000	6,073,057	0.6	Westpac Sec Nz/London 0.1% 13/07/27-RegS	欧元 1,500,000	1,719,085	0.2
JGB No4 (40Yr) 2.2% 20/03/51	日元 1,153,350,000	14,551,330	1.3	巴拉圭(0.4%)			
JPN Bank for Intl 2.5% 01/06/22	美元 1,000,000	1,023,602	0.1	Republic of Paraguay 5.4% 30/03/50-RegS	美元 4,000,000	4,610,640	0.4
Nippon Life Insurance 5% 18/10/42-RegS	美元 2,000,000	2,126,898	0.2	菲律宾(0.1%)			
Nissan Motor Co 3.201% 17/09/28-RegS	欧元 1,900,000	2,478,228	0.2	Philippines (Rep of) 0.25% 28/04/25	欧元 1,447,000	1,681,476	0.1
Nomura Holdings Inc 2.172% 14/07/28	美元 3,800,000	3,785,905	0.3	葡萄牙(0.5%)			
Rakuten Group Inc VRN 31/12/49 Perp-RegS	欧元 3,000,000	3,579,080	0.3	Energias De Portugal SA VRN 14/03/82-RegS	欧元 1,500,000	1,713,780	0.2
Sumitomo Mitsui Finance 2.512% 22/01/25-RegS	美元 2,500,000	2,595,162	0.2	Obrigacoes Tes2.875%10/25- RegS/144A	欧元 2,700,000	3,646,581	0.3
肯尼亚(0.2%)				沙特阿拉伯(0.2%)			
Republic of Kenya 6.3% 23/01/34-RegS	美元 2,100,000	2,114,049	0.2	Saudi International Bond 0% 03/03/24-RegS	欧元 1,887,000	2,191,299	0.2
韩国(0.2%)				新加坡(0.3%)			
Shinhan Fin Grp VRN 3.34% 2/30-RegS	美元 2,000,000	2,092,245	0.2	Singapore Airlines Ltd 3% 20/07/26-RegS	美元 3,500,000	3,616,801	0.3
卢森堡(0.4%)				西班牙(0.4%)			
European Fin Stab 0.75% 05/27-RegS	欧元 1,550,000	1,905,230	0.2	Banco Santander Sa Ser Emtn 1.625% 22/10/30-RegS	欧元 1,500,000	1,827,302	0.2
European Inv Bank 4.875% 15/02/36	美元 800,000	1,105,257	0.1	Banco Santander SA VRN 31/12/49 Perp-RegS	欧元 2,000,000	2,268,056	0.2
Traton Finance Luxembg 0.125% 24/03/25-RegS	欧元 1,200,000	1,392,291	0.1	国际(0.6%)			
墨西哥(1.5%)				African Export-Import BA 2.634% 17/05/26-144A	美元 2,000,000	2,067,715	0.2
Cemex Sab De CV 3.875% 11/07/31-RegS	美元 3,000,000	3,031,383	0.3	Banque Ouest Africaine D Ser 2.75% 22/01/33-RegS	欧元 2,000,000	2,531,660	0.2
Cemex Sab De CV VRN 31/12/49 Perp-RegS	美元 1,683,000	1,721,767	0.1	European Union NGEU 0% 04/10/28-RegS	欧元 1,465,000	1,721,881	0.2

投资组合 (续)
截至二零二一年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比
泰国(0.2%)				维京群岛(0.4%)			
Kasikornbank 2.375% 06/04/22-RegS	美元 2,000,000	2,040,110	0.2	Baic Finance Inv Co Ltd 2% 16/03/24-RegS	美元 700,000	705,392	0.1
土耳其(0.3%)				Cheung Kong Infra Fin 1% 12/24-RegS			
Hyundai Assan Otomotiv 1.625% 12/07/26-RegS	美元 3,000,000	2,980,428	0.3	HKT Capital No4 3 14/07/26- RegS	欧元 1,330,000	1,584,573	0.1
英国(2.8%)				PCCW-HKT Cap No5 3.75% 8/3/23-RegS			
HSBC Holdings Plc 24/07/27	英镑 1,000,000	1,351,147	0.1				
Imperial Brands Fin Plc 3.125% 26/07/24-RegS	美元 2,080,000	2,201,177	0.2			823,751,368	73.6
St Engineering 1.5% 29/04/25-RegS	美元 1,000,000	1,016,553	0.1	(II) 集体投资计划(21.2%)			
Standard Chart 4.05% 12/04/26-RegS	美元 2,000,000	2,234,825	0.2	卢森堡(21.2%)			
UK Treasury 0 5/8% 2050 0.625% 22/10/50-RegS	英镑 18,330,000	20,297,809	1.8	JPMF-JPM Global Corporate Bond 'X' (dist)-USD*	2,133,393	236,742,647	21.2
UK Treasury 4 1/2% 2034 4.5% 07/09/34-RegS	英镑 2,500,000	4,725,237	0.4			236,742,647	21.2
美国(11.5%)				(III) 衍生性产品(0.6%)			
American Honda Finance 0.3% 07/07/28	欧元 1,500,000	1,728,882	0.2	远期外汇合约(0.4%)			
Edison Intl 4.125% 15/03/28	美元 2,000,000	2,137,997	0.2			4,888,310	0.4
Goldman Sachs Group Inc EMTN VRN 16/12/25- RegS	英镑 2,000,000	2,681,855	0.2	期货(0.2%)			
Hyundai Capital 3% 10/02/27-RegS	美元 2,000,000	2,113,371	0.2	Euro B0BL Future 08/12/21	(145)	136,119	0.0
Hyundai Capital America 1.8% 10/01/28-RegS	美元 2,000,000	1,966,662	0.2	Euro-Bund Future 08/12/21	160	(36,716)	(0.0)
Morgan Stanley VRN 29/10/27	欧元 3,000,000	3,503,131	0.3	Euro-BUXL 30Y Bnd 08/12/21	68	(536,687)	(0.1)
Southern Copper 7.5% 27/07/35	美元 1,500,000	2,166,875	0.2	JPN 10Y Bond (OSE) 13/12/21	9	(37,912)	(0.0)
US Treasury 0.125% 31/05/22	美元 5,000,000	5,003,633	0.4	Long Gilt Future 29/12/21	(282)	1,513,334	0.1
Us Treasury 0.75% 30/04/26	美元 67,500,000	67,212,028	6.0	US 10Yr Ultra Fut 21/12/21	(132)	378,469	0.0
Us Treasury 1.125% 15/02/31	美元 3,000,000	2,911,030	0.3	US 5Yr Note (CBT) 31/12/21	(1,895)	1,525,623	0.2
Us Treasury 1.375% 15/11/40	美元 11,750,000	10,617,207	1.0	US Long Bond (CBT) 21/12/21	343	(1,160,593)	(0.1)
Us Treasury 1.875% 15/02/51	美元 11,000,000	10,519,313	0.9	US Ultra Bond CBT 21/12/21	(81)	565,102	0.1
Us Treasury 2.25% 15/05/41	美元 1,567,500	1,643,276	0.2			7,235,049	0.6
US Treasury 2.875% 15/08/45	美元 6,000,000	6,942,188	0.6				
US Treasury 7.625% 15/02/25	美元 5,780,000	7,193,912	0.6				
				总上市投资		1,067,729,064	95.4
				其他净资产		51,134,286	4.6
				截至二零二一年九月三十日可赎回份 额持有人应占净资产		1,118,863,350	100.0
				总投资, 按成本		1,060,995,034	

* 由管理人的关联人士发行和管理 (关联人士的定义, 参见附注 8)
在香港未获认可及並非供香港公众投资

投资组合持有变动表

(续)

截至二零二一年九月三十日止年度 (未经审计)

	持有占资产净值百分比			持有占资产净值百分比	
	2021	2020		2021	2020
上市投资			集体投资计划		
债务证券			卢森堡	21.2	26.3
美国	11.5	15.5	跨国性	-	2.5
日本	11.1	6.0	欧洲	-	1.0
中国	10.2	9.7	衍生性产品		
德国	7.5	4.5	远期外汇合约	0.4	0.2
意大利	6.1	6.4	期货	0.2	(0.0)
加拿大	5.7	2.5	总上市投资	<u>95.4</u>	<u>98.0</u>
澳大利亚	3.3	6.1	其他净资产	<u>4.6</u>	<u>2.0</u>
法国	2.9	2.2			
英国	2.8	4.5	截至九月三十日可赎回份额持有人 应占净资产	<u>100.0</u>	<u>100.0</u>
墨西哥	1.5	0.1			
印度	1.0	0.3			
印度尼西亚	0.9	0.3			
荷兰	0.6	0.8			
爱尔兰	0.6	0.1			
国际	0.6	0.0			
新西兰	0.5	1.8			
开曼群岛	0.5	0.4			
香港	0.5	0.3			
葡萄牙	0.5	0.3			
维京群岛	0.4	0.7			
西班牙	0.4	0.5			
卢森堡	0.4	0.2			
巴拉圭	0.4	-			
新加坡	0.3	0.5			
跨国性	0.3	0.4			
哥伦比亚	0.3	-			
埃及	0.3	-			
土耳其	0.3	-			
韩国	0.2	0.9			
以色列	0.2	0.2			
巴西	0.2	0.1			
冰岛	0.2	0.1			
泰国	0.2	0.1			
智利	0.2	-			
科特迪瓦	0.2	-			
肯尼亚	0.2	-			
沙特阿拉伯	0.2	-			
菲律宾	0.1	0.4			
匈牙利	0.1	0.3			
百慕大	0.1	0.2			
摩洛哥	0.1	-			
罗马尼亚	-	0.4			
卡塔尔	-	0.3			
奥地利	-	0.2			
希腊	-	0.2			
瑞典	-	0.2			
瑞士	-	0.2			
芬兰	-	0.1			
比利时	-	0.0			
阿拉伯联合酋长国	-	0.0			

金融衍生工具详情

截至二零二一年九月三十日 (未经审计)

(a) 远期外汇合约

截至二零二一年九月三十日，本基金持有之未平仓远期外汇合约，详情请参阅附注 11。

(b) 期货

截至二零二一年九月三十日，本基金持有之未平仓期货合约，详情请参阅附注 11。

金融衍生工具风险敞口信息

截至二零二一年九月三十日止年度 (未经审计)

截至二零二一年九月三十日止年度，本基金就任何目的而使用的金融衍生工具所产生的最低、最高及平均总敞口，占本基金资产净值总额的百分比列示如下。

	2021 占资产净值百分比
最低总敞口	65.4
最高总敞口	188.7
平均总敞口	92.9

截至二零二一年九月三十日止年度，本基金为非对冲目的而使用的金融衍生工具所产生的最低、最高及平均净敞口，占本基金资产净值总额的百分比列示如下。

	2021 占资产净值百分比
最低净敞口	2.1
最高净敞口	22.5
平均净敞口	12.3

财务状况表

截至二零二一年九月三十日

	2021 美元	2020 美元
资产		
银行现金	25,540,063	28,639,507
应收经纪款项	29,944,500	12,067,946
分配应收款项	5,646,183	25,435,048
保证金	2,645,936	1,190,875
衍生性产品 [附注 4(i)(a), 11]	14,618,790	12,329,811
投资 [附注 4(i)(a)]	1,060,494,015	1,512,467,160
股息、利息及其他应收款项	6,352,206	864,771
总资产	1,145,241,693	1,592,995,118
负债		
透支经纪款项	1,924,175	-
应付经纪款项	-	15,257,387
赎回应付款项	12,606,932	15,218,014
应付收益分配 [附注 6]	3,548,275	5,229,152
衍生性产品 [附注 4(i)(a), 11]	7,383,741	8,970,240
其他应付款项	915,220	1,226,932
总负债 (不含可赎回份额持有人 应占净资产)	26,378,343	45,901,725
可赎回份额持有人应占净资产 (附注 3)	1,118,863,350	1,547,093,393

由受托人及管理人于二零二二年一月二十五日批准

签署人:

东亚银行 (信托) 有限公司, 受托人

摩根基金 (亚洲) 有限公司, 管理人

综合收益表

截至二零二一年九月三十日止年度

	2021 美元	2020 美元
收入		
投资及衍生性产品净收益 [附注 5]	37,474,268	51,794,685
股息收入 [附注 8(a)]	5,979,339	10,175,094
汇兑净收益 / (亏损)	4,473,311	(890,816)
存款利息 [附注 8(h), 8(i)]	14,491	42,350
其他收入 [附注 8(h)]	128	47,776
	47,941,537	61,669,089
支出		
管理费用 [附注 8(d)]	11,591,675	9,257,118
托管费用及银行费用 [附注 8(h)]	480,500	509,156
受托人费用 [附注 8(f)]	260,440	208,164
基金注册登记机构费用 [附注 8(g)]	220,908	236,163
交易成本 [附注 8(h)]	84,028	56,288
印刷及出版支出	28,482	7,859
法律及专业费用	27,586	40,774
核数师酬金	26,405	40,204
其他经营费用	7,604	14,637
	12,727,628	10,370,363
净营业利润	35,213,909	50,798,726
财务成本		
收益分配 [附注 6]	(51,316,989)	(38,692,643)
利息支出 [附注 8(h)]	(17)	(640)
	(51,317,006)	(38,693,283)
除税前 (亏损) / 利润	(16,103,097)	12,105,443
税项 [附注 7]	(5,522)	(58,032)
可赎回份额持有人应占净资产及总 综合收益之 (减少) / 增加	(16,108,619)	12,047,411

可赎回份额持有人应占净资产变动表
截至二零二一年九月三十日止年度

	2021 美元	2020 美元
年初可赎回份额持有人应占净资产	1,547,093,393	1,030,798,393
分配可赎回份额 [附注 3]	851,664,351	1,561,557,385
赎回可赎回份额 [附注 3]	(1,263,785,775)	(1,057,309,796)
净(赎回)/分配	(412,121,424)	504,247,589
	1,134,971,969	1,535,045,982
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之(减少)/增加	(16,108,619)	12,047,411
年末可赎回份额持有人应占净资产	1,118,863,350	1,547,093,393

现金流量表
截至二零二一年九月三十日止年度

	2021 美元	2020 美元
经营业务		
购入投资及衍生性产品	(1,591,281,522)	(2,443,687,549)
出售投资及衍生性产品所得款项	2,043,611,516	1,977,343,853
透支经纪款项之增加	1,924,175	-
已收利息	17,894	46,935
已收股息	-	10,175,094
已付税项	(5,522)	(72,724)
已付交易费用	(84,792)	(59,646)
已付基金注册登记机构费用	(243,720)	(223,717)
已付受托人费用	(265,908)	(200,188)
保证金之增加	(1,455,061)	(868,032)
已付管理费用	(11,838,131)	(8,899,135)
其他	4,293,062	(2,664,905)
经营业务所产生/(运用)之现金净额	444,671,991	(469,110,014)
融资活动		
已付利息	(17)	(640)
分配可赎回份额所得款项	871,453,216	1,558,571,426
赎回可赎回份额付款	(1,266,396,857)	(1,047,640,073)
已付收益分配	(52,997,866)	(36,324,298)
融资活动所(运用)/产生之现金净额	(447,941,524)	474,606,415
现金及现金等价物之(减少)/增加	(3,269,533)	5,496,401
年初现金及现金等价物	28,639,507	22,744,035
现金及现金等价物之汇兑收益	170,089	399,071
年末现金及现金等价物	25,540,063	28,639,507
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	25,540,063	28,639,507

第九至四十五页之附注乃属本财务报表之一部分。

财务报表之附注

1 本基金

摩根国际债券基金（“本基金”）根据一九七九年四月三十日的信托契约（经修订）（“信托契约”）成立，受香港法律监管。本基金已获香港证券及期货事务监察委员会（“证监会”）认可。

二零二零年八月三十一日之前，本基金的投资目标旨在通过主要投资于环球投资级别债务证券，取得比环球债券市场更高的回报。

二零二零年八月三十一日之后，本基金的投资目标旨在通过主要投资（即至少为资产净值总额的 80%）于环球投资级别债务证券，取得比环球债券市场更高的回报。

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

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

2 主要会计政策

以下为本财务报表采纳之主要会计政策。除另有注明外，该等政策与所呈列年度采纳者一致。

(a) 财务报表之编制基础

本基金的财务报表乃按照香港会计师公会颁布的香港财务报告准则编制。财务报表乃按历史成本准则编制，并就按公允价值透过损益列账的金融资产及金融负债（包括衍生金融工具）之重估而做出调整。

管理人及受托人（“管理层”）按照香港财务报告准则编制财务报表时需作出若干关键会计估算、判断和假设。

于二零二零年十月一日生效的新准则及对现有准则的修订

没有于二零二零年十月一日开始的财政年度首次生效的新准则或对现有准则的修订对本基金产生重大影响。

于二零二零年十月一日后生效且并未提早采纳之新准则、对准则之修订和解释

若干新准则、准则修订及解释在二零二零年十月一日开始的年度期间生效，但在编制此等财务报表时并未提前采纳。此等新准则、准则修订及解释预期不会对本基金的财务报表产生重大影响。

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公允价值为负数的衍生性产品合约列示为按公允价值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、取消确认及计量

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

公允价值估计

公允价值指在计量日期，于一项有序交易中由市场与参与者出售一项资产而应收取或转让一项负债而应支付的价格。在活跃市场中买卖的金融资产和负债的公允价值，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。

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。

公允价值级次分层间的转拨

在公允价值级次分层之间的转拨视为于报告期间开始时已发生。

(c) 证券借贷

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

(d) 金融工具抵销

若存在法律上可行使的权利，可对已确认入账的项目进行抵销，且有意以净额方式结算，或将资产变现并同时清偿债务，则金融资产及负债可予抵销，并把净额于财务状况表内列账。

(e) 收入及支出

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

投资利息收入乃作为投资及衍生性产品净收益/亏损的一部分，在综合收益表确认。

银行现金利息收入乃按实际利息法在综合收益表确认。

支出乃按应计基准在综合收益表确认。

(f) 交易成本

交易成本是指为购入／出售按公允价值透过损益列账的金融资产或负债而发生的成本。这些成本包括支付给代理机构、经纪和交易商之手续费和佣金。交易成本于发生时在综合收益表支销。

(g) 外币交易

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

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

(h) 现金及现金等价物

为了编制现金流量表，现金及现金等价物指银行现金及于存放日期起在三个月或以内到期之银行存款，扣除本基金通常作为隔夜银行借款的某些短期银行借款。

(i) 保证金

为衍生性产品交易而存放在经纪处的保证金采用实际利率法以摊销成本列账。

(j) 应收／应付经纪款项

应收／应付经纪款项指就年末已签订合同但尚未付款的投资和衍生性产品的应收款项，及就已购投资和衍生性产品的应付款项。

该等金额按公允价值进行初始确认，并以摊余成本进行后续计量。于每一报告日期，若信贷风险自初始确认后显著增加，本基金应按与存续期预期信贷损失相当的金额，对应收经纪款项计量损失准备金。计量损失准备金需考虑的因素包括经纪出现重大财务困难、破产、进行财务重组或拖欠付款的可能性。

(k) 销售份额所得款项及赎回份额支付款项

每份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。

(l) 应付可赎回份额持有人的收益分配

拟分配至可赎回份额持有人的收益分配应于适当授权时在综合收益表中列账。就可赎回份额的收益分配在综合收益表中列账为财务成本。

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）

2021

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	14,436,547.412	9,382,696.758	235,151,461.228	4,111,393.284	588,271.460
总分配	7,231,214.673	5,249,569.815	154,142,462.719	1,640,596.784	512,824.503
总赎回	(11,077,861.965)	(8,030,295.862)	(204,307,742.896)	(2,272,129.467)	(285,747.655)
年末	10,589,900.120	6,601,970.711	184,986,181.051	3,479,860.601	815,348.308
	澳元	加元	港元	纽元	人民币
可赎回份额持有人应占净资产	103,503,535	64,649,781	1,822,410,378	34,047,082	11,241,640
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.77	9.79	9.85	9.78	13.79
	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元类别 (每半年派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	104,718,064.063	60,206,849.006	1,530,585.527	14,623,868.390	12,880,898.180
总分配	79,717,853.350	39,418,514.011	408,042.858	277,723.520	416,363.870
总赎回	(76,291,534.359)	(54,744,395.660)	(1,193,176.991)	(6,655,277.070)	(4,606,967.740)
年末	108,144,383.054	44,880,967.357	745,451.394	8,246,314.840	8,690,294.310
	人民币	美元	美元	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占净资产	1,043,345,225	440,323,336	16,518,894	86,921,823	83,732,936
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.65	9.81	22.16	10.54	9.64

2021

	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:				
年初	14,754,895.250	18,676,582.420	8,504,386.090	5,217,152.340
总分配	997,990.700	1,722,223.720	904,454.240	238,241.590
总赎回	(10,453,995.990)	(10,853,336.920)	(6,279,667.170)	(2,445,479.760)
年末	5,298,889.960	9,545,469.220	3,129,173.160	3,009,914.170
	人民币	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应占净 资产	60,642,379	95,607,461	34,354,133	30,226,878
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	11.44	10.02	10.98	10.04

2020

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	7,444,011.787	4,244,250.403	120,496,839.798	4,545,798.754	476,522.596
总分配	15,029,222.293	9,243,580.229	247,568,402.245	3,547,855.829	435,027.272
总赎回	(8,036,686.668)	(4,105,133.874)	(132,913,780.815)	(3,982,261.299)	(323,278.408)
年末	14,436,547.412	9,382,696.758	235,151,461.228	4,111,393.284	588,271.460
	澳元	加元	港元	纽元	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	144,971,464	94,447,093	2,370,635,364	41,329,678	7,863,998
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	10.04	10.07	10.08	10.05	13.37

2020

	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元类别 (每半年派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	71,664,480.866	34,591,420.909	585,059.950	47,956,241.690	12,459,676.480
总分配	77,967,755.976	69,744,956.491	1,754,090.034	12,703,135.020	9,934,891.110
总赎回	(44,914,172.779)	(44,129,528.394)	(808,564.457)	(46,035,508.320)	(9,513,669.410)
年末	<u>104,718,064.063</u>	<u>60,206,849.006</u>	<u>1,530,585.527</u>	<u>14,623,868.390</u>	<u>12,880,898.180</u>
	人民币	美元	美元	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	<u>1,041,227,933</u>	<u>607,211,274</u>	<u>34,884,729</u>	<u>161,056,618</u>	<u>134,157,374</u>
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	<u>9.94</u>	<u>10.09</u>	<u>22.79</u>	<u>11.01</u>	<u>10.42</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:					
年初	33,812,398.910	23,360,446.870	6,836,468.040	4,282,638.440	
总分配	21,040,404.320	8,987,149.180	6,746,662.090	3,307,105.220	
总赎回	(40,097,907.980)	(13,671,013.630)	(5,078,744.040)	(2,372,591.320)	
年末	<u>14,754,895.250</u>	<u>18,676,582.420</u>	<u>8,504,386.090</u>	<u>5,217,152.340</u>	
	人民币	人民币	美元	美元	
可赎回份额持有人应占 净资产	<u>163,705,196</u>	<u>192,660,573</u>	<u>92,719,432</u>	<u>53,851,477</u>	
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	<u>11.09</u>	<u>10.32</u>	<u>10.90</u>	<u>10.32</u>	

4 财务风险管理

(I) 财务风险因素

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

本基金于集体投资计划中持有的单位数目占集体投资计划的净资产值总额的百分比将根据集体投资计划的分配与赎回数量随时变化。本基金有可能会在任何时点持有集体投资计划的大多数已发行的份额。

(a) 市场风险

(i) 市场价格风险

本基金主要投资债务证券，此等债券须承担利率风险。利率风险请参阅附注 4(i)(a)(ii)。

(ii) 利率风险

利率风险指金融工具的价值或未来现金流量因市场利率变动而波动不定的风险。本基金须承担现行市场利率水平波动对其投资、衍生性产品及现金存款造成影响的风险。

下表按剩余到期日分类，概述截至九月三十日本基金须承担现行市场利率水平波动影响风险的金融资产及负债。

	1年以内 美元	1至5年 美元	5年以上 美元	无确定到期日 美元	总额 美元
<u>2021</u>					
银行现金	25,540,063	-	-	-	25,540,063
保证金	2,645,936	-	-	-	2,645,936
衍生性产品	2,346,739	-	-	-	2,346,739
投资（注*）	10,556,368	291,607,372	521,587,628	236,742,647	1,060,494,015
总利率敏感性缺口	41,089,106	291,607,372	521,587,628	236,742,647	1,091,026,753
<u>2020</u>					
银行现金	28,639,507	-	-	-	28,639,507
保证金	1,190,875	-	-	-	1,190,875
衍生性产品	(173,530)	-	-	-	(173,530)
投资（注*）	9,743,733	319,038,329	722,307,172	461,377,926	1,512,467,160
总利率敏感性缺口	39,400,585	319,038,329	722,307,172	461,377,926	1,542,124,012

注：

* 投资的票面息率范围介乎年率 0.00% - 7.69%（二零二零年：年率 0.00% - 10.50%）。

截至九月三十日，本基金投资及衍生性产品之公平值如下：

	2021		2020	
	投资之公平值 美元	占资产净值百分比	投资之公平值 美元	占资产净值百分比
上市投资				
资产				
债券证券				
- 美国	128,341,360	11.5	239,872,120	15.5
- 日本	123,810,134	11.1	92,083,675	6.0
- 中国	114,524,450	10.2	150,125,750	9.7
- 德国	83,675,484	7.5	69,008,934	4.5
- 意大利	68,061,826	6.1	98,483,654	6.4
- 加拿大	63,800,282	5.7	39,090,673	2.5
- 澳大利亚	36,944,219	3.3	93,708,565	6.1
- 其他	204,593,613	18.2	268,715,863	17.3
	823,751,368	73.6	1,051,089,234	68.0
集体投资计划				
- 卢森堡	236,742,647	21.2	406,632,528	26.3
- 其他	-	-	54,745,398	3.5
	236,742,647	21.2	461,377,926	29.8
衍生性产品				
- 远期外汇合约	10,500,143	0.9	11,675,921	0.8
- 期货	4,118,647	0.4	653,890	0.0
	14,618,790	1.3	12,329,811	0.8
	1,075,112,805	96.1	1,524,796,971	98.6
负债				
衍生性产品				
- 远期外汇合约	(5,611,833)	(0.5)	(8,142,820)	(0.6)
- 期货	(1,771,908)	(0.2)	(827,420)	(0.0)
	(7,383,741)	(0.7)	(8,970,240)	(0.6)
总上市投资	1,067,729,064	95.4	1,515,826,731	98.0

有关衍生性产品的风险亦请参阅附注 11。

投资管理主要通过本基金的修正久期定期监控本基金的利率风险敏感度。修正久期计量某项债券的价格相对于利率变动的敏感度。于二零二一年九月三十日，投资管理人估计本基金的修正久期为 7.41（二零二零年：8.86）。为了披露相关敏感度，采用的利率合理变动百分比为二十五个基点，不包括不大可能出现或“最恶劣”情况或“压力测试”下之变动，也不代表投资管理人对本基金未来回报的预测。若利率上升二十五个基点，其他变量保持稳定，则将致使本基金的资产净值减少约 20,726,944 美元（二零二零年：34,268,119 美元）。若利率下降二十五个基点，则将致使本基金的资产净值增加相同金额。

任何现金及现金等价物及保证金均以短期市场利率进行存放/借入。由于现行市场利率水平平稳且波动较低，投资管理人认为本基金不存在重大风险。

(iii) 汇兑风险

本基金持有以若干币种计价的资产及负债。香港财务报告准则第 7 号认为与非货币资产及负债相关的外汇承担属于市场价格风险，而非汇兑风险。但是，投资管理人所监控所有以外币计价的资产及负债（包括货币及非货币资产及负债）的汇兑风险承担。

本基金订立了若干远期外汇合约，以对冲若干外汇承担以维持有限的非美元风险承担。年末未平仓远期外汇合约请参阅附注 11(a)。

下表概述截至九月三十日本基金的汇兑风险承担、外币合理变动百分比以及对本基金资产净值的估计影响。

汇兑风险承担净值 (注*)	美元 等值	与美元比较之合理 变动百分比 (注**)	估计对资产净值的 影响 美元
<u>2021</u>			
澳元	74,196,560	+0.8	593,572
加元	51,456,347	+5.4	2,778,643
人民币 (离岸)	75,694,915	+5.1	3,860,441
人民币 (在岸)	110,815,542	+5.4	5,984,039
欧元	92,932	-1.2	(1,115)
港元	(565,079)	-0.4	2,260
日元	(212,064)	-5.4	11,451
韩元	3	-1.2	(0)
墨西哥新比索	1	+7.5	0
纽元	23,490,755	+4.4	1,033,593
挪威克朗	1,146	+7.2	83
英镑	(969,402)	+4.3	(41,684)
土耳其里拉	121	-13.3	(16)
	<u>334,001,777</u>		<u>14,221,267</u>
<u>2020</u>			
澳元	103,967,281	+6.3	6,549,939
加元	71,505,532	-0.9	(643,550)
人民币 (离岸)	62,515,893	+5.2	3,250,826
人民币 (在岸)	144,655,388	+4.8	6,943,459
欧元	1,258,166	+7.6	95,621
港元	4,240,682	+1.2	50,888
日元	(113,359)	+2.4	(2,721)
韩元	3	+2.3	0
墨西哥新比索	1	-10.6	(0)
纽元	28,262,686	+5.4	1,526,185
挪威克朗	1,074	-2.9	(31)
英镑	(210,660)	+4.9	(10,322)
土耳其里拉	140	-26.7	(37)
	<u>416,082,827</u>		<u>17,760,257</u>

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

注：

* 资产及负债汇兑风险承担净值包括货币及非货币资产及负债。

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

(b) 信贷风险

信贷风险指交易对手无法于到期日支付全数金额的风险。

管理人会参考交易对手的违约历史及其信贷评级等因素进行信贷风险监控。由于过去 5 年内，本基金在分配应收款项、应收经纪款项或股息、利息及其他应收款项等应收款项未发生历史违约，故管理人认为该等应收款项不存在重大信贷风险。总体而言，由于该等工具违约风险较低，且本基金交易对手均有足够能力在短期内履行其合同义务，故管理人认为违约概率近乎零。因此，未对十二个月内的预期信贷损失确认损失准备金。

截至九月三十日，在信用增级前本基金的最高信贷风险承担列示如下：

	2021 美元	2020 美元
银行现金	25,540,063	28,639,507
应收经纪款项	29,944,500	12,067,946
分配应收款项	5,646,183	25,435,048
保证金	2,645,936	1,190,875
经纪发行的衍生性产品	10,500,143	11,675,921
投资 - 债务证券	823,751,368	1,051,089,234
股息、利息及其他应收款项	6,352,206	864,771
	<u>904,380,399</u>	<u>1,130,963,302</u>

所有投资及衍生性产品交易均由经核准的经纪按照货银交付原则进行结算。由于本基金的托管银行只会在收取款项后始交付有关投资及衍生性产品，所以违约风险甚低。就购买而言，本基金的托管银行会在收到投资及衍生性产品后即时付款。若任何一方不能履行其责任，交易将告失效。

本基金主要投资债务证券，因此，本基金须承担信贷风险，即发行机构可能无法于到期时偿还本金及利息。本基金通过参考信贷评级机构提供的信贷评级及信贷展望（如有）以及内部信贷分析，持续管理并监控债务证券之信贷风险。

下表概述截至九月三十日按照信贷评级的债务证券。

	2021 占资产净值百分比	2020 占资产净值百分比
标准普尔(AAA)/穆迪(Aaa)/惠誉(AAA)	23.2	24.2
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	7.5	8.7
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	13.7	10.1
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	11.6	10.0
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	3.1	0.7
标准普尔(B)/穆迪(B)/惠誉(B)	0.9	-
未评级	13.6	14.3
	<u>73.6</u>	<u>68.0</u>

截至九月三十日，按照发行机构的信贷评级，下表概述上述未评级债务证券。

	2021 占资产净值百分比	2020 占资产净值百分比
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	10.0	9.9
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	3.3	4.4
未评级	0.3	-
	<u>13.6</u>	<u>14.3</u>

下表概述本基金截至九月三十日存放金融资产的银行/经纪/托管的信贷评级。

	2021 交易对手风险承担 美元	2020 交易对手风险承担 美元
银行结余		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	25,540,063	23,754,638
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	-	4,884,869
存放经纪之保证金及经纪持有/发行的衍生性产品		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	5,572,309	264,793
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	11,692,417	13,255,893
托管机构的投资余额		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	<u>1,060,494,015</u>	<u>1,512,467,160</u>

(c) 流动性风险

本基金须面对份额每日赎回的风险，而其大多数投资资产均在活跃市场交易，并可随时出售。管理人亦可将任何一个交易日之赎回份额总数限制为本基金已发行份额的百分之十或更高。

在投资限制和指南的规限下，本基金有能力订立借款安排。

下表概述本基金的金融负债，按九月三十日距约定到期日的尚余期间分为有关期限组别。下表所载金额乃约定未折现现金流量。

	2021		2020	
	1个月以内 美元	1至12个月 美元	1个月以内 美元	1至12个月 美元
透支经纪款项	1,924,175	-	-	-
应付经纪款项	-	-	15,257,387	-
赎回应付款项	12,606,932	-	15,218,014	-
应付收益分配	3,548,275	-	5,229,152	-
衍生性产品	4,553,877	2,829,864	5,955,734	3,014,506
其他应付款项	915,220	-	1,226,932	-
可赎回份额持有人应占净资产	<u>1,118,863,350</u>	<u>-</u>	<u>1,547,093,393</u>	<u>-</u>
总金融负债	<u>1,142,411,829</u>	<u>2,829,864</u>	<u>1,589,980,612</u>	<u>3,014,506</u>

投资管理人通过投资于预期一般在一个月内变现到期的资产和借入短期银行借款以偿还金融负债来管理本基金的流动性风险。

(d) 受总抵销安排及类似协议规限的对销与金额

截至二零二一年及二零二零年九月三十日，本基金受制于与若干衍生品交易对手的总净额结算协议。

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

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

	财务状况表中列示的经确认金融资产总额 美元	受总抵销安排及类似协议规限的相关金额		净额 美元
		金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	
<u>2021</u>				
<u>资产</u>				
保证金	2,645,936	-	(2,645,936)	-
衍生性产品	14,094,081	(4,987,496)	-	9,106,585
按公允价值透过损益列账的金融资产	<u>16,740,017</u>	<u>(4,987,496)</u>	<u>(2,645,936)</u>	<u>9,106,585</u>
	财务状况表中列示的经确认金融负债总额 美元	受总抵销安排及类似协议规限的相关金额		净额 美元
		金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	
<u>负债</u>				
透支经纪款项	1,924,175	-	(1,924,175)	-
衍生性产品	6,465,550	(4,987,496)	(721,761)	756,293
按公允价值透过损益列账的金融负债	<u>8,389,725</u>	<u>(4,987,496)</u>	<u>(2,645,936)</u>	<u>756,293</u>

	财务状况表中列	受总抵销安排及类似协议限制的		净额
	示的经确认金融	金融工具	相关金额	
	资产总额	抵押品及保证金	美元	美元
	美元	美元	美元	
2020				
资产				
保证金	1,190,875	-	-	1,190,875
衍生性产品	12,400,788	(4,876,829)	-	7,523,959
按公允价值透过损益列账的金融资产	13,591,663	(4,876,829)	-	8,714,834
	财务状况表中列	受总抵销安排及类似协议限制的		净额
	示的经确认金融	金融工具	相关金额	
	负债总额	抵押品及保证金	美元	美元
	美元	美元	美元	
负债				
衍生性产品	5,816,530	(4,876,829)	-	939,701
按公允价值透过损益列账的金融负债	5,816,530	(4,876,829)	-	939,701

(II) 资本风险管理

本基金的资本是以可赎回份额持有人应占净资产显示，基金的认购/申购和赎回乃由份额持有人决定。本基金以保障为份额持有人提供回报和长期资本增值为目标。

为了维持资本结构，本基金的政策执行如下：

- 监测相对于流动性资产的分配和赎回活动。
- 为了保护份额持有人在特殊情况下的利益，管理人亦可将任何一个交易日之赎回份额总数限制为本基金已发行份额的百分之十或更高。
- 按照宪制性文件，监测基金的投资指南及限制条件，以透过分散投资维持足够的资金流动性。

(III) 公允价值估计

截至二零二一年及二零二零年九月三十日，管理层认为资产及负债的账面价值与公允价值相若。

香港财务报告准则第 13 号要求本基金根据公允价值级次进行分类从而反映公允价值在计量时所使用的输入值的重要性。公允价值级次分层如下：

- 第一层次—相同资产或负债在活跃市场中的报价（未经调整）。
- 第二层次—直接（即按照价格）或间接（即源于价格）地使用除第一层次中的资产或负债的市场报价以外的其他可观察输入值。
- 第三层次—资产或负债使用了非基于可观察市场数据（即不可观察的输入值）。

下表概述本基金截至九月三十日的投资及衍生性产品（按类别）按公允价值级次计量之公平值：

上市投资	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总额 美元
<u>2021</u>				
<u>资产</u>				
债务证券	-	823,751,368	-	823,751,368
集体投资计划	236,742,647	-	-	236,742,647
衍生性产品	4,118,647	10,500,143	-	14,618,790
按公允价值透过损益列账的总金融资产	240,861,294	834,251,511	-	1,075,112,805
<u>负债</u>				
衍生性产品	1,771,908	5,611,833	-	7,383,741
按公允价值透过损益列账的总金融负债	1,771,908	5,611,833	-	7,383,741
<u>2020</u>				
<u>资产</u>				
债务证券	-	1,051,089,234	-	1,051,089,234
集体投资计划	461,377,926	-	-	461,377,926
衍生性产品	653,890	11,675,921	-	12,329,811
按公允价值透过损益列账的总金融资产	462,031,816	1,062,765,155	-	1,524,796,971
<u>负债</u>				
衍生性产品	827,420	8,142,820	-	8,970,240
按公允价值透过损益列账的总金融负债	827,420	8,142,820	-	8,970,240

由于投资价值是基于活跃市场的报价，因此分类为第一层次，并包括活跃上市股票证券、集体投资计划及交易所交易衍生性产品。本基金没有调整这些工具的报价。

于非活跃市场交易的金融投资但以市场报价、交易商/经纪报价或其他报价来源作为可观察输入值，此等投资分类为第二层次。

被分类为第三层次的投资，由于其交易次数疏落，故此有显著的不可观察输入值。

截至二零二一年及二零二零年九月三十日止年度，公允价值层次之间并无转拨。

截至二零二一年及二零二零年九月三十日，以摊余成本计量的资产和负债，其账面价值为其公平值的合理约数。

5 投资及衍生性产品净收益

	2021 美元	2020 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益/亏损之变动	(44,722,289)	24,649,653
投资及衍生性产品销售之实现收益	82,196,557	27,145,032
	37,474,268	51,794,685

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。

本年末未结转未分配收入（二零二零年：无）。

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2021 美元	2020 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 0.0300	15,532,724.626	(326,420)	
加元对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	加元 0.0301	10,768,268.700	(242,500)	
港元类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	港元 0.0310	257,026,392.219	(1,027,655)	
纽元对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	纽元 0.0309	4,436,865.111	(90,609)	
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 0.0542	106,802,319.116	(861,322)	
美元类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0310	67,641,658.335	(2,096,891)	
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 0.0315	12,571,710.000	(59,139)	
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 0.0562	17,942,181.780	(150,584)	
PRC 美元份额（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0317	5,162,583.950	(163,654)	
澳元对冲类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	澳元 0.0291	16,344,179.735	(351,860)	
加元对冲类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	加元 0.0299	10,761,199.966	(247,975)	
港元类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	港元 0.0310	274,712,409.393	(1,098,734)	
纽元对冲类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	纽元 0.0306	4,452,255.286	(95,858)	
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 0.0521	113,862,990.402	(903,131)	
美元类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0310	67,380,016.374	(2,088,781)	
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 0.0311	12,337,463.560	(58,414)	
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 0.0540	16,848,565.810	(138,512)	
PRC 美元份额（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0317	4,932,013.930	(156,345)	
澳元对冲类别（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	澳元 0.0266	16,414,088.450	(335,538)	
加元对冲类别（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	加元 0.0280	10,882,028.471	(238,828)	
港元类别（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	港元 0.0310	283,536,272.040	(1,133,800)	
纽元对冲类别（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	纽元 0.0295	4,391,643.910	(93,324)	
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 0.0522	116,777,407.195	(937,221)	
美元类别（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0310	69,049,204.797	(2,140,525)	
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 0.0308	10,902,956.930	(51,631)	
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 0.0541	14,679,537.300	(122,102)	
PRC 美元份额（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0317	4,446,741.780	(140,962)	
澳元对冲类别（每月派息）	2021年1月29日	2021年2月8日	澳元 0.0257	14,655,034.248	(288,860)	
加元对冲类别（每月派息）	2021年1月29日	2021年2月8日	加元 0.0268	11,132,799.728	(233,002)	
港元类别（每月派息）	2021年1月29日	2021年2月8日	港元 0.0290	271,086,704.217	(1,013,976)	
纽元对冲类别（每月派息）	2021年1月29日	2021年2月9日	纽元 0.0273	4,315,658.363	(84,369)	
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 0.0472	128,827,175.308	(939,110)	
美元类别（每月派息）	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0290	66,274,857.547	(1,921,971)	
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 0.0285	10,625,698.960	(46,770)	
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 0.0490	13,231,520.350	(100,132)	
PRC 美元份额（每月派息）	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0297	4,194,363.440	(124,573)	
澳元对冲类别（每月派息）	2021年2月26日	2021年3月8日	澳元 0.0274	14,251,894.864	(310,742)	
加元对冲类别（每月派息）	2021年2月26日	2021年3月8日	加元 0.0283	10,540,614.426	(238,325)	
港元类别（每月派息）	2021年2月26日	2021年3月8日	港元 0.0290	270,142,813.913	(1,010,322)	
纽元对冲类别（每月派息）	2021年2月26日	2021年3月8日	纽元 0.0290	4,282,591.106	(92,388)	
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 0.0489	124,189,269.449	(939,794)	
美元类别（每月派息）	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0290	64,453,268.392	(1,869,145)	
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 0.0285	10,528,193.990	(46,434)	
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 0.0507	12,235,851.560	(96,002)	
PRC 美元份额（每月派息）	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0297	3,981,638.970	(118,255)	
澳元对冲类别（每月派息）	2021年3月31日	2021年4月13日	澳元 0.0275	13,391,010.952	(280,480)	
加元对冲类别（每月派息）	2021年3月31日	2021年4月13日	加元 0.0282	9,594,537.748	(215,273)	
港元类别（每月派息）	2021年3月31日	2021年4月13日	港元 0.0291	258,187,355.537	(966,403)	
纽元对冲类别（每月派息）	2021年3月31日	2021年4月13日	纽元 0.0293	3,813,250.327	(78,249)	
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 0.0506	119,123,116.914	(918,678)	
美元类别（每月派息）	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0290	60,358,507.946	(1,750,397)	
美元类别（每半年派息）	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.4048	645,443.959	(261,276)	
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 0.0287	10,227,686.550	(44,738)	
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 0.0526	11,813,447.690	(94,706)	
PRC 美元份额（每月派息）	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0297	3,883,144.300	(115,329)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2021 美元	2020 美元
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	澳元 0.0255	12,379,772.833	(245,176)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	加元 0.0262	9,025,419.338	(192,343)	
港元类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	港元 0.0271	244,896,850.896	(854,882)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	纽元 0.0277	3,619,612.309	(72,561)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	人民币 0.0498	124,433,025.600	(958,332)	
美元类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	美元 0.0270	56,692,754.372	(1,530,704)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	人民币 0.0267	9,613,410.440	(39,695)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	人民币 0.0518	10,904,413.590	(87,354)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	美元 0.0277	3,745,308.420	(103,745)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	澳元 0.0257	11,470,234.602	(227,265)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	加元 0.0267	8,166,048.482	(180,491)	
港元类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	港元 0.0270	233,723,576.850	(813,056)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	纽元 0.0279	3,479,249.552	(70,377)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	人民币 0.0465	122,338,428.675	(893,262)	
美元类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	美元 0.0270	51,691,757.095	(1,395,677)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	人民币 0.0264	9,598,518.640	(39,790)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	人民币 0.0482	10,413,577.340	(78,815)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	美元 0.0276	3,625,674.600	(100,069)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	澳元 0.0255	11,122,577.004	(213,131)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	加元 0.0271	7,949,577.318	(173,877)	
港元类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	港元 0.0270	224,198,270.758	(779,683)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	纽元 0.0278	3,397,332.484	(66,046)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	人民币 0.0451	120,913,510.000	(843,457)	
美元类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	美元 0.0270	49,012,989.512	(1,323,351)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	人民币 0.0266	9,195,290.230	(37,832)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	人民币 0.0468	10,052,751.470	(72,768)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	美元 0.0277	3,504,404.360	(97,072)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	澳元 0.0244	10,687,832.554	(192,993)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	加元 0.0260	7,439,594.513	(155,401)	
港元类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	港元 0.0261	215,466,323.446	(723,604)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	纽元 0.0266	3,344,419.589	(62,371)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	人民币 0.0487	117,791,812.468	(888,430)	
美元类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	美元 0.0260	46,924,939.854	(1,220,048)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	人民币 0.0256	9,094,166.210	(36,056)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	人民币 0.0506	9,842,758.650	(77,134)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	美元 0.0266	3,302,913.630	(87,858)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	澳元 0.0245	10,943,929.171	(195,692)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	加元 0.0263	7,012,010.557	(146,496)	
港元类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	港元 0.0261	200,364,450.791	(671,643)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	纽元 0.0270	3,601,749.280	(68,151)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	人民币 0.0504	108,776,047.444	(848,314)	
美元类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	美元 0.0260	44,320,242.025	(1,152,326)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	人民币 0.0257	8,878,591.400	(35,308)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	人民币 0.0524	9,971,256.730	(80,849)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	美元 0.0266	3,128,225.430	(83,211)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	澳元 0.0244	11,138,774.000	(196,325)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月12日	加元 0.0264	6,581,743.968	(137,158)	
港元类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	港元 0.0261	185,308,100.572	(621,292)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	纽元 0.0261	3,479,860.601	(62,655)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	人民币 0.0529	109,205,003.365	(895,095)	
美元类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月12日	美元 0.0260	44,929,570.718	(1,168,169)	
美元类别 (每半年派息)	2021年9月30日	2021年10月12日	美元 0.3643	745,452.002	(271,568)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	人民币 0.0257	8,690,294.310	(34,605)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	人民币 0.0550	9,545,459.320	(81,345)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月12日	美元 0.0266	3,009,884.880	(80,063)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	澳元 0.0206	7,153,969.309	(101,532)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	加元 0.0272	4,627,905.911	(95,773)	
港元类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	港元 0.0233	121,517,635.558	(485,283)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	纽元 0.0233	4,558,286.239	(68,111)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	人民币 0.0376	77,176,638.149	(411,921)	
美元类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0310	36,662,785.099	(1,136,547)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	人民币 0.0334	13,611,028.980	(64,532)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	人民币 0.0390	24,594,510.770	(136,158)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0317	4,700,366.190	(149,002)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2021 美元	2020 美元
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	澳元 0.0228	7,185,455.570		(110,814)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	加元 0.0301	4,745,699.786		(107,544)
港元类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	港元 0.0313	118,720,579.280		(474,715)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	纽元 0.0252	4,515,811.532		(73,047)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	人民币 0.0387	76,906,211.381		(423,370)
美元类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0310	35,665,719.957		(1,105,638)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	人民币 0.0332	15,162,912.980		(71,609)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	人民币 0.0402	24,943,263.780		(142,635)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0317	5,063,086.040		(160,500)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	澳元 0.0232	7,255,327.126		(118,324)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	加元 0.0283	4,573,084.848		(99,802)
港元类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	港元 0.0312	111,512,310.091		(446,519)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	纽元 0.0260	4,231,913.170		(74,232)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	人民币 0.0399	74,288,379.840		(425,662)
美元类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0310	32,688,515.208		(1,013,345)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	人民币 0.0330	11,970,052.880		(56,713)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	人民币 0.0414	24,064,372.580		(143,036)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0317	5,057,076.960		(160,309)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	澳元 0.0235	6,746,411.679		(106,135)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	加元 0.0292	4,810,247.051		(106,203)
港元类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	港元 0.0311	101,266,892.770		(405,594)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	纽元 0.0262	4,177,859.990		(70,837)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	人民币 0.0394	71,660,833.058		(403,187)
美元类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	美元 0.0310	32,845,276.613		(1,018,204)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	人民币 0.0324	12,665,592.640		(58,487)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	人民币 0.0409	24,797,800.430		(144,552)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	美元 0.0317	5,251,269.770		(166,465)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	澳元 0.0249	7,338,354.473		(117,812)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	加元 0.0316	5,181,938.890		(121,987)
港元类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	港元 0.0311	108,881,517.981		(434,517)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	纽元 0.0270	4,202,456.163		(70,377)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	人民币 0.0399	69,076,332.699		(394,287)
美元类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0310	35,384,344.684		(1,096,915)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	人民币 0.0331	13,776,444.580		(65,234)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	人民币 0.0413	25,862,121.550		(152,800)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0317	5,521,209.440		(175,022)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	澳元 0.0280	8,010,632.850		(137,281)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	加元 0.0303	5,854,661.599		(124,633)
港元类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	港元 0.0310	114,149,127.027		(456,543)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	纽元 0.0320	3,199,124.278		(60,691)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	人民币 0.0375	66,807,543.367		(353,444)
美元类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0310	32,612,036.518		(1,010,974)
美元类别 (每半年派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.4158	1,112,721.022		(462,669)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	人民币 0.0336	14,679,647.460		(69,586)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	人民币 0.0390	24,792,279.520		(136,410)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0317	5,807,473.640		(184,097)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	澳元 0.0293	8,527,715.365		(163,297)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	加元 0.0276	6,079,385.331		(120,466)
港元类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	港元 0.0310	126,971,875.543		(507,851)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	纽元 0.0333	3,757,054.438		(76,405)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	人民币 0.0312	73,099,565.124		(322,156)
美元类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	美元 0.0310	36,113,874.333		(1,119,531)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	人民币 0.0334	14,809,240.790		(69,868)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	人民币 0.0323	23,394,201.090		(106,735)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	美元 0.0317	5,775,947.080		(183,098)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月9日	澳元 0.0298	10,075,154.922		(199,299)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月9日	加元 0.0303	6,491,437.239		(142,303)
港元类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月9日	港元 0.0310	151,210,638.388		(604,765)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	纽元 0.0327	3,916,079.675		(79,299)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	人民币 0.0407	77,363,912.715		(439,506)
美元类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	美元 0.0310	41,846,817.761		(1,297,252)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	人民币 0.0335	14,614,078.130		(68,336)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	人民币 0.0422	23,162,117.390		(136,434)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	美元 0.0317	5,778,546.130		(183,180)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2021 美元	2020 美元
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	澳元 0.0306	11,403,352.592		(240,247)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	加元 0.0306	7,208,953.028		(161,963)
港元类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	港元 0.0310	164,341,379.685		(657,327)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	纽元 0.0325	3,940,199.337		(82,436)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	人民币 0.0478	79,256,835.337		(536,023)
美元类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	美元 0.0310	48,187,265.112		(1,493,806)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	人民币 0.0334	14,456,004.670		(68,315)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	人民币 0.0497	22,328,034.630		(157,009)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	美元 0.0317	5,738,969.710		(181,925)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	澳元 0.0293	11,922,964.487		(250,531)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	加元 0.0298	7,916,660.532		(176,123)
港元类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	港元 0.0310	182,345,108.655		(729,362)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	纽元 0.0310	4,123,461.851		(85,152)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	人民币 0.0475	87,819,094.067		(597,858)
美元类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	美元 0.0310	51,122,098.065		(1,584,786)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	人民币 0.0330	14,244,001.870		(67,369)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	人民币 0.0493	20,701,110.940		(146,270)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	美元 0.0317	5,531,898.660		(175,361)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	澳元 0.0294	12,983,027.231		(282,287)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	加元 0.0301	8,540,055.506		(197,287)
港元类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	港元 0.0310	206,948,933.992		(827,780)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	纽元 0.0311	4,038,648.829		(84,894)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	人民币 0.0515	97,758,516.769		(735,064)
美元类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	美元 0.0310	57,183,663.456		(1,772,693)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	人民币 0.0326	13,913,860.920		(66,226)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	人民币 0.0534	19,795,870.580		(154,340)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	美元 0.0317	5,355,201.180		(169,760)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月12日	澳元 0.0294	14,411,445.830		(303,684)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月13日	加元 0.0301	9,435,124.508		(212,613)
港元类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月12日	港元 0.0310	235,008,619.651		(940,034)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月12日	纽元 0.0316	4,111,393.284		(85,877)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月12日	人民币 0.0512	104,736,919.708		(790,199)
美元类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月13日	美元 0.0310	60,300,233.772		(1,869,308)
美元类别 (每半年派息)	2020年9月30日	2020年10月13日	美元 0.4281	1,529,645.288		(654,841)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月12日	人民币 0.0321	12,880,898.180		(60,928)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月12日	人民币 0.0531	18,676,582.420		(146,137)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月13日	美元 0.0317	5,221,798.270		(165,531)
可赎回份额持有人之总收益分配					(51,316,989)	(38,692,643)

7 税项

由于本基金根据香港证券及期货条例第 104 条获认可为集体投资计划，根据香港税务条例第 26A(1A)条，本基金获豁免缴纳香港利得税，因此并无税项拨备。

截至二零二一年及二零二零年九月三十日止年度，已就若干收到的利息收入预扣或缴付海外税项。

8 与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之交易

以下是本基金与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之间于年度内订立的重大关联方交易摘要。受托人及管理人之关联人士是根据香港证券及期货事务监察委员会所颁布的单位信托及互惠基金守则（“证监会守则”）中的定义。所有该等交易均于正常业务过程中按一般商业条款订立。

(a) 以下为与管理人的关联人士之投资交易：

本基金投资于管理人的关联人士管理的各类基金（“相关基金”）。本基金应付相关基金的所有认购/申购和赎回费用均由管理人的关联人士管理的相关基金的管理人豁免。

截至二零二一年九月三十日止年度，综合收益表中的股息收入为 5,979,339 美元（二零二零年：10,175,094 美元），为管理人的关联人士发行和管理的集体投资计划的投资分配。

公司名称	占本基金本年 投资买卖总价值		占本基金本年 支付佣金		平均佣金率 百分比
	美元	值百分比	美元	金百分比	
<u>2021</u>					
JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l.	486,134,454	4.44	-	-	-
J.P. Morgan Securities plc	526,452,042*	4.81	6,683	8.51	0.00
<u>2020</u>					
JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l.	433,450,412	5.48	-	-	-
J.P. Morgan Securities plc	9,817,570	0.12	-	-	-

* 于二零二一年度内，该等金额包括期货交易总计 514,967,795 美元。

(b) 与管理人及其关联人士之年末结余：

	2021 美元	2020 美元
银行现金	25,540,063	23,754,638
应收款项	35,923,852	6,071,033
应付款项	(847,407)	(6,879,414)

于二零二一年九月三十日，本基金的投资结余 236,742,647 美元（二零二零年：461,377,926 美元），为管理人及其关联人士发行和管理的集体投资计划的投资。

于二零二一年九月三十日，本基金的投资结余 1,060,494,015 美元（二零二零年：1,512,467,160 美元），为托管人摩根大通银行（管理人的关联人士）持有的投资。

(c) 截至二零二一年九月三十日止年度，扣除支付给代理机构的佣金后，管理人取得本基金销售及赎回收益为 4,603 美元（二零二零年：8,899 美元）。

(d) 支付给摩根基金（亚洲）有限公司之管理费按本基金资产净值的年率百分之零点八计算。此管理费于每个交易日累计，并于每月月底支付。如果本基金投资管理或其关联人管理的集体投资计划，在考虑针对该集体投资计划中归属于本基金的利益已征收的管理费以后，相应减少支付给管理人的管理费用。

(e) 本基金允许受托人及其关联人士、管理人及其关联人士认购/申购及赎回本基金份额。

于本年度内，管理人及其若干董事以及公司集团成员持有本基金份额，并有权获取本基金份额之交易利润，详情如下：

	年初	本年度内因 董事任命而 增加	总分配	总赎回	本年度内因 董事离任而 减少	年末	交易利润 美元
<u>2021</u>							
<u>管理人董事</u>							
- 美元类别（每月派息）	-	6,419.963	19.095	(6,419.963)	-	19.095	1,002
<u>摩根资产管理（亚太）有限公司</u>							
- 美元类别（每半年派息）	636.835	不适用	739.553	-	不适用	1,376.388	-
<u>2020</u>							
<u>摩根资产管理（亚太）有限公司</u>							
- 美元类别（每半年派息）	-	不适用	636.835	-	不适用	636.835	-

(f) 受托人费用按本基金资产净值的年率百分之零点零一八计算。受托人费用于每个交易日累计，并于每月月底支付。

(g) 摩根基金（亚洲）有限公司，即登记代理人及管理人，根据本基金份额持有人的数量及发生交易的数量收取注册费。与受托人商定的收费比率为本基金资产净值的年率介乎百分之零点零一五至百分之零点五不等。基金注册登记机构费用于每季季末支付。

(h) 截至二零二一年及二零二零年九月三十日止年度，除附注 8(d)和 8(g)披露的管理费用及基金注册登记机构费用外，已收/（已付）管理人摩根基金（亚洲）有限公司及其关联人士的金额列示如下：

	2021 美元	2020 美元
存款利息	16,140	39,119
其他收入	127	31
利息支出	-	(319)
交易成本	(13,695)	(19,553)
托管费用及银行费用	(382,004)	(391,707)
	<u><u> </u></u>	<u><u> </u></u>

(i) 截至二零二一年及二零二零年九月三十日止年度，除附注8(f)披露的受托人费用外，已收受托人东亚银行(信托)有限公司及其关联人士的金额列示如下：

	2021 美元	2020 美元
存款利息	-	6
	<u><u> </u></u>	<u><u> </u></u>

9 借款

截至二零二一年及二零二零年九月三十日止年度，本基金的无抵押短期银行借款之长期均在 7 天内。所有交易均为按一般商业条款下进行的正常业务流程。

10 非金钱收益/佣金共享安排

截至二零二一年及二零二零年九月三十日止年度，投资管理及其关联人士未有就本基金通过经纪或交易商指示交易而签订任何非金钱收益/佣金共享安排。

11 衍生性产品

(a) 以下为截至九月三十日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
<u>2021</u>				
未平仓合约：				
加元 288,414	美元 228,136	2021年10月4日	法国巴黎银行	474
纽元 43,726	美元 30,623	2021年10月4日	高盛国际, 伦敦	459
纽元 10,512	美元 7,369	2021年10月4日	Citibank N.A., 伦敦	117
美元 420,033	加元 533,328	2021年10月4日	多伦多道明银行	953
澳元 28,433,740	美元 20,841,875	2021年10月5日	高盛国际, 伦敦	302,507
澳元 2,982,024	美元 2,171,425	2021年10月5日	美国道富银行	17,334
澳元 1,684,254	美元 1,220,687	2021年10月5日	法国巴黎银行	4,051
加元 68,096,607	美元 54,141,112	2021年10月5日	Barclays Bank PLC, 伦敦	388,753
欧元 125,534,823	美元 148,568,806	2021年10月5日	法国巴黎银行	3,071,435
欧元 91,051,176	美元 107,771,605	2021年10月5日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,241,471
欧元 5,006,271	美元 5,898,130	2021年10月5日	Citibank N.A., 伦敦	95,762
欧元 2,376,541	美元 2,814,538	2021年10月5日	Barclays Bank PLC, 伦敦	60,079
欧元 2,752,912	美元 3,228,051	2021年10月5日	法国巴黎银行	37,371
欧元 1,464,890	美元 1,730,210	2021年10月5日	法国巴黎银行	32,373
欧元 893,639	美元 1,047,376	2021年10月5日	渣打银行, 伦敦	11,630
英镑 26,194,864	美元 36,105,188	2021年10月5日	HSBC Bank Plc, 伦敦	785,264
英镑 1,637,392	美元 2,256,409	2021年10月5日	加拿大皇家银行	48,627
日元 11,512,895,089	美元 104,817,813	2021年10月5日	法国巴黎银行	1,630,376
美元 102,784,529	日元 11,512,895,089	2021年10月5日	高盛国际, 伦敦	402,908
美元 53,458,998	加元 68,096,607	2021年10月5日	法国巴黎银行	293,361
美元 20,473,714	澳元 28,433,740	2021年10月5日	渣打银行, 伦敦	65,654
美元 33,892,018	英镑 25,183,547	2021年10月5日	Barclays Bank PLC, 伦敦	64,294
美元 27,006	澳元 37,568	2021年10月5日	HSBC Bank Plc, 伦敦	131
美元 3,891,908	澳元 5,388,489	2021年10月6日	美国道富银行	526
美元 1,096	加元 1,397	2021年10月6日	加拿大皇家银行	7
美元 1,105	澳元 1,530	2021年10月7日	美国道富银行	0
美元 60,666	离岸人民币 392,377	2021年10月8日	多伦多道明银行	102
美元 1,516	离岸人民币 9,805	2021年10月8日	美国道富银行	2
美元 1,772	离岸人民币 11,466	2021年10月12日	美国道富银行	3
美元 1,098	离岸人民币 7,108	2021年10月12日	美国道富银行	3
离岸人民币 7,169	美元 1,112	2021年10月15日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2
澳元 1,465,488	美元 1,080,578	2021年10月21日	美国道富银行	21,895
澳元 575,028	美元 426,073	2021年10月21日	美国道富银行	10,667
澳元 470,246	美元 346,714	2021年10月21日	加拿大皇家银行	7,004
澳元 447,162	美元 329,093	2021年10月21日	多伦多道明银行	6,059
澳元 251,938	美元 187,557	2021年10月21日	美国道富银行	5,555
澳元 268,126	美元 198,671	2021年10月21日	美国道富银行	4,974
澳元 313,569	美元 230,743	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	4,218
澳元 155,748	美元 115,744	2021年10月21日	美国道富银行	3,230
澳元 519,584	美元 378,258	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	2,905
澳元 235,290	美元 172,403	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,428
澳元 208,389	美元 152,840	2021年10月21日	美国道富银行	2,297
澳元 375,391	美元 273,092	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	1,906
澳元 204,104	美元 149,185	2021年10月21日	美国道富银行	1,738
澳元 306,257	美元 222,973	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	1,729
澳元 126,272	美元 92,594	2021年10月21日	加拿大皇家银行	1,374
澳元 62,782	美元 46,344	2021年10月21日	加拿大皇家银行	989
澳元 104,699	美元 76,530	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	894
澳元 231,566	美元 168,079	2021年10月21日	多伦多道明银行	793
澳元 75,777	美元 55,527	2021年10月21日	美国道富银行	785
澳元 116,021	美元 84,490	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	675
澳元 214,629	美元 155,381	2021年10月21日	法国巴黎银行	331
澳元 18,393	美元 13,562	2021年10月21日	美国道富银行	275
澳元 74,478	美元 54,032	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	228
澳元 11,032	美元 8,134	2021年10月21日	加拿大皇家银行	164
澳元 7,325	美元 5,373	2021年10月21日	美国道富银行	81

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2,809	美元2,075	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	46
澳元2,089	美元1,552	2021年10月21日	美国道富银行	43
澳元1,485	美元1,106	2021年10月21日	美国道富银行	33
澳元1,485	美元1,106	2021年10月21日	美国道富银行	33
澳元1,492	美元1,106	2021年10月21日	美国道富银行	28
澳元1,495	美元1,103	2021年10月21日	加拿大皇家银行	24
澳元1,480	美元1,093	2021年10月21日	多伦多道明银行	24
澳元1,491	美元1,100	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	23
澳元1,489	美元1,096	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	20
澳元1,507	美元1,105	2021年10月21日	美国道富银行	17
澳元1,492	美元1,094	2021年10月21日	美国道富银行	16
澳元1,492	美元1,094	2021年10月21日	加拿大皇家银行	16
澳元1,501	美元1,100	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	15
澳元1,516	美元1,108	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	13
澳元1,507	美元1,102	2021年10月21日	美国道富银行	13
澳元1,507	美元1,102	2021年10月21日	加拿大皇家银行	13
澳元4,917	美元3,564	2021年10月21日	美国道富银行	12
澳元1,501	美元1,093	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	8
澳元20,876	美元15,083	2021年10月21日	美国道富银行	2
澳元1,517	美元1,096	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	0
加元392,134	美元313,379	2021年10月21日	加拿大皇家银行	3,853
加元360,043	美元286,578	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	2,383
加元530,601	美元420,682	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	1,859
加元184,416	美元147,378	2021年10月21日	加拿大皇家银行	1,812
加元171,968	美元136,621	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	880
加元316,934	美元250,710	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	543
加元263,591	美元208,571	2021年10月21日	加拿大皇家银行	509
加元189,923	美元150,275	2021年10月21日	美国道富银行	362
加元185,061	美元146,430	2021年10月21日	法国巴黎银行	355
加元101,182	美元80,081	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	214
加元173,514	美元137,136	2021年10月21日	美国道富银行	176
加元49,731	美元39,319	2021年10月21日	美国道富银行	65
加元1,382	美元1,104	2021年10月21日	加拿大皇家银行	14
加元1,391	美元1,102	2021年10月21日	法国巴黎银行	4
加元1,385	美元1,096	2021年10月21日	美国道富银行	3
加元1,473	美元1,165	2021年10月21日	美国道富银行	2
离岸人民币6,350,181	美元984,358	2021年10月21日	美国道富银行	1,963
离岸人民币5,483,493	美元850,010	2021年10月21日	美国道富银行	1,695
离岸人民币1,441,377	美元223,609	2021年10月21日	美国道富银行	623
离岸人民币1,766,823	美元273,880	2021年10月21日	美国道富银行	546
离岸人民币775,327	美元120,281	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	335
离岸人民币758,794	美元117,716	2021年10月21日	美国道富银行	328
离岸人民币515,399	美元79,893	2021年10月21日	美国道富银行	159
离岸人民币980,326	美元151,815	2021年10月21日	美国道富银行	155
离岸人民币348,070	美元53,932	2021年10月21日	美国道富银行	84
离岸人民币228,072	美元35,354	2021年10月21日	美国道富银行	71
离岸人民币223,152	美元34,591	2021年10月21日	美国道富银行	69
离岸人民币246,802	美元38,220	2021年10月21日	美国道富银行	39
离岸人民币63,606	美元9,868	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	28
离岸人民币45,103	美元6,997	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	20
离岸人民币1,482,156	美元229,305	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	11
离岸人民币20,599	美元3,193	2021年10月21日	美国道富银行	6
离岸人民币26,635	美元4,125	2021年10月21日	美国道富银行	4
离岸人民币9,186	美元1,425	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4
离岸人民币7,935	美元1,231	2021年10月21日	美国道富银行	3
离岸人民币272,738	美元42,196	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	2
离岸人民币7,093	美元1,100	2021年10月21日	美国道富银行	2
离岸人民币7,093	美元1,100	2021年10月21日	美国道富银行	2
离岸人民币7,087	美元1,098	2021年10月21日	美国道富银行	2
离岸人民币7,087	美元1,098	2021年10月21日	多伦多道明银行	2
离岸人民币7,087	美元1,098	2021年10月21日	多伦多道明银行	2
离岸人民币102,242	美元15,818	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1
离岸人民币7,746	美元1,200	2021年10月21日	美国道富银行	1
离岸人民币7,094	美元1,099	2021年10月21日	美国道富银行	1
离岸人民币7,094	美元1,099	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1

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7,094	美元1,099	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1
离岸人民币7,080	美元1,095	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	0
离岸人民币7,080	美元1,095	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	0
纽元536,290	美元378,558	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	8,636
纽元156,311	美元110,992	2021年10月21日	法国巴黎银行	3,172
纽元509,185	美元354,146	2021年10月21日	加拿大皇家银行	2,920
纽元98,156	美元69,881	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	2,175
纽元97,196	美元69,198	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	2,154
纽元163,155	美元114,687	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,145
纽元89,918	美元63,899	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,876
纽元86,178	美元61,056	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,612
纽元99,821	美元69,966	2021年10月21日	美国道富银行	1,111
纽元57,791	美元40,959	2021年10月21日	加拿大皇家银行	1,096
纽元79,962	美元56,239	2021年10月21日	美国道富银行	1,083
纽元75,596	美元53,206	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,062
纽元69,300	美元48,755	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	954
纽元50,508	美元35,715	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	875
纽元29,371	美元20,939	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	680
纽元24,837	美元17,636	2021年10月21日	美国道富银行	504
纽元18,607	美元13,043	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	209
纽元129,677	美元89,627	2021年10月21日	多伦多道明银行	178
纽元13,696	美元9,581	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	134
纽元4,968	美元3,547	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	121
纽元1,545	美元1,103	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	38
纽元1,856	美元1,316	2021年10月21日	法国巴黎银行	35
纽元1,542	美元1,095	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	31
纽元1,567	美元1,110	2021年10月21日	法国巴黎银行	30
纽元1,563	美元1,105	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	27
纽元1,570	美元1,108	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	25
纽元1,570	美元1,105	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	22
纽元1,565	美元1,095	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	15
美元165,647,136	离岸人民币1,073,194,666	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	379,754
美元15,644,532	离岸人民币101,357,793	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	35,866
美元10,423,207	离岸人民币67,529,873	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	23,896
美元2,023,065	离岸人民币13,107,030	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	4,638
美元234,058	加元300,000	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	2,743
美元353,848	离岸人民币2,294,122	2021年10月21日	加拿大皇家银行	1,060
美元193,205	离岸人民币1,255,377	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,006
美元339,207	离岸人民币2,199,092	2021年10月21日	美国道富银行	1,000
美元1,127,839	离岸人民币7,296,749	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	993
美元125,479	加元160,000	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	815
美元234,640	加元298,000	2021年10月21日	加拿大皇家银行	582
美元187,830	离岸人民币1,217,508	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	522
美元180,351	离岸人民币1,168,438	2021年10月21日	法国巴黎银行	410
美元215,229	离岸人民币1,393,395	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	334
美元80,382	离岸人民币521,199	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	249
美元49,943	澳元69,470	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	242
美元77,191	离岸人民币500,200	2021年10月21日	美国道富银行	191
美元67,901	离岸人民币440,000	2021年10月21日	美国道富银行	168
美元1,083,957	离岸人民币7,007,657	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	152
美元108,174	离岸人民币700,200	2021年10月21日	美国道富银行	150
美元126,938	离岸人民币821,355	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	128
美元71,338	离岸人民币461,768	2021年10月21日	美国道富银行	99
美元31,931	离岸人民币207,018	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	96
美元46,644	离岸人民币302,108	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	93
美元76,502	离岸人民币494,889	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	59
美元24,070	离岸人民币155,945	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	55
美元39,214	离岸人民币253,732	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	40
美元15,779	离岸人民币102,199	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	31
美元71,307	离岸人民币88,802	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	31
美元12,924	加元16,409	2021年10月21日	加拿大皇家银行	28
美元6,125	离岸人民币39,683	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	14
美元12,960	离岸人民币83,847	2021年10月21日	美国道富银行	11
美元3,649	离岸人民币23,663	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	11
美元8,749	离岸人民币56,605	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	8

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1,803	加元2,295	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	8
美元2,486	离岸人民币16,109	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	6
美元2,105	离岸人民币20,100	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	5
美元2,007	离岸人民币12,999	2021年10月21日	加拿大皇家银行	4
美元2,578	离岸人民币16,677	2021年10月21日	美国道富银行	2
美元1,715	离岸人民币11,097	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	2
美元1,119	离岸人民币7,243	2021年10月21日	美国道富银行	2
美元1,105	离岸人民币7,161	2021年10月21日	美国道富银行	2
美元1,473	离岸人民币9,529	2021年10月21日	美国道富银行	1
美元1,225	离岸人民币7,927	2021年10月21日	美国道富银行	1
美元1,140	离岸人民币7,380	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1
美元1,034	离岸人民币6,693	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1
美元528	离岸人民币3,423	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	1
美元216	离岸人民币1,398	2021年10月21日	美国道富银行	1
欧元215,482,587	美元250,221,375	2021年11月3日	法国巴黎银行	331,822
美元8,328,022	离岸人民币54,017,150	2021年11月3日	HSBC Bank Plc, 伦敦	19,664
离岸人民币10,321,819	美元1,594,512	2021年11月19日	多伦多道明银行	1,397
离岸人民币7,120	美元1,101	2021年11月19日	美国道富银行	2
美元158,084	加元200,296	2021年11月19日	法国巴黎银行	10
			未实现总收益	10,500,143

加元16,409	美元12,925	2021年10月4日	加拿大皇家银行	(28)
美元150,279	加元189,923	2021年10月4日	美国道富银行	(362)
美元354,183	纽元509,185	2021年10月4日	加拿大皇家银行	(2,924)
美元155,370	澳元214,629	2021年10月5日	法国巴黎银行	(331)
美元1,727,746	欧元1,475,457	2021年10月5日	加拿大皇家银行	(17,661)
美元1,640,523	英镑1,201,780	2021年10月5日	Citibank N.A., 伦敦	(20,100)
美元2,372,976	欧元2,014,022	2021年10月5日	多伦多道明银行	(38,684)
美元2,000,831	英镑1,446,929	2021年10月5日	Citibank N.A., 伦敦	(49,861)
美元11,960,260	欧元10,108,185	2021年10月5日	美国道富银行	(244,671)
美元250,085,083	欧元215,482,587	2021年10月5日	法国巴黎银行	(336,455)
加元298,000	美元234,645	2021年10月6日	加拿大皇家银行	(482)
澳元69,470	美元49,940	2021年10月7日	渣打银行, 伦敦	(242)
加元200,296	美元158,093	2021年10月7日	法国巴黎银行	(10)
离岸人民币461,768	美元71,403	2021年10月8日	美国道富银行	(111)
离岸人民币440,000	美元67,966	2021年10月8日	美国道富银行	(177)
离岸人民币500,200	美元77,265	2021年10月8日	美国道富银行	(202)
离岸人民币747,133,049	美元115,346,905	2021年10月8日	渣打银行, 伦敦	(361,742)
离岸人民币700,200	美元108,244	2021年10月12日	美国道富银行	(161)
澳元37,568	美元27,008	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(131)
澳元305,313	美元220,073	2021年10月21日	法国巴黎银行	(488)
加元1,397	美元1,096	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(7)
加元1,897	美元1,480	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(17)
加元38,180	美元30,073	2021年10月21日	美国道富银行	(64)
加元173,502	美元136,647	2021年10月21日	多伦多道明银行	(305)
加元243,953	美元191,856	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(705)
加元533,328	美元420,023	2021年10月21日	多伦多道明银行	(953)
加元152,772	美元119,302	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(1,286)
加元266,721	美元209,185	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,347)
加元766,435	美元602,233	2021年10月21日	美国道富银行	(2,742)
加元1,461,130	美元1,138,408	2021年10月21日	美国道富银行	(14,914)
离岸人民币7,108	美元1,099	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1)
离岸人民币7,108	美元1,099	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1)
离岸人民币7,108	美元1,098	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(1)
离岸人民币7,107	美元1,099	2021年10月21日	美国道富银行	(1)
离岸人民币7,107	美元1,099	2021年10月21日	美国道富银行	(1)
离岸人民币7,107	美元1,099	2021年10月21日	美国道富银行	(1)
离岸人民币7,069	美元1,093	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1)
离岸人民币7,069	美元1,093	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(1)
离岸人民币7,069	美元1,093	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(1)
离岸人民币16,240	美元2,510	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2)

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9,805	美元1,515	2021年10月21日	美国道富银行	(2)
离岸人民币7,109	美元1,097	2021年10月21日	美国道富银行	(2)
离岸人民币7,109	美元1,097	2021年10月21日	美国道富银行	(2)
离岸人民币7,109	美元1,097	2021年10月21日	美国道富银行	(2)
离岸人民币7,108	美元1,097	2021年10月21日	美国道富银行	(2)
离岸人民币7,106	美元1,098	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币7,097	美元1,096	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(2)
离岸人民币7,095	美元1,096	2021年10月21日	美国道富银行	(2)
离岸人民币11,466	美元1,771	2021年10月21日	美国道富银行	(3)
离岸人民币8,678	美元1,340	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(3)
离岸人民币8,289	美元1,129	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(3)
离岸人民币7,268	美元1,122	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(3)
离岸人民币7,121	美元1,098	2021年10月21日	美国道富银行	(3)
离岸人民币7,109	美元1,096	2021年10月21日	美国道富银行	(3)
离岸人民币7,100	美元1,096	2021年10月21日	美国道富银行	(3)
离岸人民币7,100	美元1,096	2021年10月21日	美国道富银行	(3)
离岸人民币7,098	美元1,095	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(3)
离岸人民币7,098	美元1,095	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(3)
离岸人民币7,098	美元1,095	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币7,098	美元1,095	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币7,098	美元1,095	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币7,098	美元1,095	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3)
离岸人民币7,098	美元1,095	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
离岸人民币40,206	美元6,214	2021年10月21日	美国道富银行	(5)
离岸人民币12,055	美元1,859	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(5)
离岸人民币7,114	美元1,095	2021年10月21日	多伦多道明银行	(6)
离岸人民币7,128	美元1,096	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(7)
离岸人民币65,609	美元10,142	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(8)
离岸人民币41,951	美元6,481	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(9)
离岸人民币46,058	美元7,115	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(10)
离岸人民币71,425	美元11,038	2021年10月21日	美国道富银行	(11)
离岸人民币16,011	美元2,462	2021年10月21日	多伦多道明银行	(15)
离岸人民币78,552	美元12,135	2021年10月21日	法国巴黎银行	(17)
离岸人民币46,055	美元7,103	2021年10月21日	美国道富银行	(22)
离岸人民币32,628	美元5,022	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(26)
离岸人民币177,223	美元27,378	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(38)
离岸人民币251,712	美元38,901	2021年10月21日	美国道富银行	(40)
离岸人民币114,808	美元17,717	2021年10月21日	美国道富银行	(44)
离岸人民币238,871	美元36,902	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(52)
离岸人民币113,752	美元17,546	2021年10月21日	美国道富银行	(52)
离岸人民币394,613	美元60,994	2021年10月21日	美国道富银行	(54)
离岸人民币264,992	美元40,941	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(54)
离岸人民币171,838	美元26,529	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(55)
离岸人民币276,041	美元42,645	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(60)
离岸人民币223,405	美元34,494	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(67)
离岸人民币356,797	美元55,120	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(78)
离岸人民币81,788	美元12,575	2021年10月21日	多伦多道明银行	(78)
离岸人民币367,532	美元56,774	2021年10月21日	美国道富银行	(84)
离岸人民币433,788	美元67,019	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(89)
离岸人民币392,377	美元60,609	2021年10月21日	多伦多道明银行	(93)
离岸人民币144,690	美元22,269	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(115)
离岸人民币277,275	美元42,777	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(119)
离岸人民币330,946	美元51,057	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(142)
离岸人民币378,778	美元58,454	2021年10月21日	美国道富银行	(145)
离岸人民币318,395	美元49,112	2021年10月21日	美国道富银行	(145)
离岸人民币432,054	美元66,692	2021年10月21日	美国道富银行	(148)
离岸人民币1,084,579	美元167,617	2021年10月21日	美国道富银行	(171)
离岸人民币218,647	美元33,651	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(174)
离岸人民币663,344	美元102,422	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(200)
离岸人民币1,058,042	美元163,465	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(218)
离岸人民币1,002,717	美元154,893	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(231)
离岸人民币1,702,221	美元263,094	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(245)
离岸人民币1,151,905	美元177,939	2021年10月21日	美国道富银行	(265)
离岸人民币2,021,601	美元312,473	2021年10月21日	美国道富银行	(275)

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959,174	美元104,098	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(289)
离岸人民币675,175	美元104,140	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(312)
离岸人民币880,244	美元135,800	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(377)
离岸人民币437,189	美元67,220	2021年10月21日	多伦多道明银行	(415)
离岸人民币1,177,330	美元181,586	2021年10月21日	美国道富银行	(551)
离岸人民币3,025,497	美元467,398	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(657)
离岸人民币2,341,901	美元361,501	2021年10月21日	美国道富银行	(799)
离岸人民币3,958,663	美元611,553	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(866)
离岸人民币1,266,740	美元194,977	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(992)
离岸人民币3,663,859	美元565,097	2021年10月21日	美国道富银行	(1,715)
离岸人民币2,448,663	美元376,867	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,949)
离岸人民币4,324,944	美元667,120	2021年10月21日	美国道富银行	(1,964)
美元9,794	离岸人民币63,308	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
美元4,245	离岸人民币27,438	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(0)
美元3,340	离岸人民币21,569	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3)
美元15,570	离岸人民币100,604	2021年10月21日	美国道富银行	(6)
美元23,114	离岸人民币149,348	2021年10月21日	美国道富银行	(9)
美元3,103	离岸人民币20,000	2021年10月21日	美国道富银行	(9)
美元3,833	离岸人民币24,712	2021年10月21日	多伦多道明银行	(10)
美元16,420	离岸人民币105,974	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(25)
美元138,365	澳元191,494	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(28)
美元15,866	离岸人民币102,330	2021年10月21日	美国道富银行	(35)
美元13,795	离岸人民币88,921	2021年10月21日	美国道富银行	(38)
美元15,645	离岸人民币100,849	2021年10月21日	美国道富银行	(44)
美元1,424	美元2,000	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(44)
美元23,947	离岸人民币154,450	2021年10月21日	美国道富银行	(53)
美元3,606	澳元4,900	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(66)
美元2,609	美元3,683	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(69)
美元74,020	离岸人民币478,011	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(70)
美元61,562	加元77,891	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(80)
美元285,808	离岸人民币1,846,709	2021年10月21日	美国道富银行	(116)
美元7,368	美元10,512	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(117)
美元77,300	离岸人民币498,276	2021年10月21日	美国道富银行	(215)
美元14,594	澳元19,900	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(218)
美元91,085	加元115,116	2021年10月21日	美国道富银行	(220)
美元131,015	离岸人民币845,181	2021年10月21日	美国道富银行	(262)
美元179,345	离岸人民币1,157,473	2021年10月21日	美国道富银行	(280)
美元11,992	澳元16,138	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(334)
美元17,500	美元24,868	2021年10月21日	美国道富银行	(347)
美元15,214	澳元20,533	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(381)
美元87,004	加元109,711	2021年10月21日	美国道富银行	(406)
美元30,620	美元43,726	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(458)
美元228,129	加元288,414	2021年10月21日	法国巴黎银行	(474)
美元256,873	离岸人民币1,656,728	2021年10月21日	美国道富银行	(572)
美元44,572	澳元60,782	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(662)
美元34,578	澳元46,900	2021年10月21日	法国巴黎银行	(697)
美元41,179	美元58,598	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(759)
美元106,416	澳元146,174	2021年10月21日	法国巴黎银行	(819)
美元44,241	澳元60,000	2021年10月21日	法国巴黎银行	(897)
美元42,052	美元59,114	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,276)
美元40,267	美元56,397	2021年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,366)
美元131,420	澳元179,559	2021年10月21日	美国道富银行	(1,705)
美元75,063	澳元100,830	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(2,222)
美元315,532	澳元433,699	2021年10月21日	美国道富银行	(2,223)
美元126,824	澳元171,559	2021年10月21日	多伦多道明银行	(2,888)
美元1,220,759	澳元1,684,254	2021年10月21日	法国巴黎银行	(4,037)
美元388,997	澳元532,196	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(4,533)
美元717,061	澳元971,658	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(15,125)
美元2,171,563	澳元2,982,024	2021年10月21日	美国道富银行	(17,319)
美元55,468,650	加元69,863,319	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(323,034)
美元25,836,359	美元36,310,378	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(790,186)
美元80,803,659	澳元108,714,460	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2,267,246)
澳元28,433,740	美元20,476,217	2021年11月3日	渣打银行, 伦敦	(65,796)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
加元68,096,607	美元53,456,980	2021年11月3日	法国巴黎银行	(293,174)
离岸人民币42,262,442	美元6,517,167	2021年11月3日	加拿大皇家银行	(13,973)
离岸人民币747,133,049	美元115,283,544	2021年11月3日	美国道富银行	(176,676)
英镑25,183,547	美元33,893,453	2021年11月3日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(64,193)
美元2,049,649	欧元1,759,470	2021年11月3日	加拿大皇家银行	(9,237)
美元2,203,802	欧元1,884,566	2021年11月3日	多伦多道明银行	(18,220)
日元11,512,895,089	美元102,805,823	2021年11月4日	高盛国际, 伦敦	(403,356)
美元869,645	日元95,592,984	2021年11月4日	渣打银行, 伦敦	(12,686)
澳元1,530	美元1,105	2021年11月19日	美国道富银行	(0)
澳元1,530	美元1,105	2021年11月19日	美国道富银行	(0)
澳元5,388,489	美元3,892,635	2021年11月19日	美国道富银行	(543)
美元1,109	离岸人民币7,169	2021年11月19日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2)
			未实现总亏损	(5,611,833)
			未实现净收益	4,888,310

2020

未平仓合约:

加元37,579,625	美元28,756,278	2020年10月5日	美林国际, 伦敦	621,499
欧元227,439,382	美元271,009,035	2020年10月5日	Citibank N.A., 伦敦	4,290,871
欧元3,456,165	美元4,058,004	2020年10月5日	高盛国际, 伦敦	4,960
欧元572,330	美元673,675	2020年10月5日	加拿大皇家银行	2,504
欧元755,357	美元886,874	2020年10月5日	渣打银行, 伦敦	1,067
英镑47,103,861	美元62,534,237	2020年10月5日	高盛国际, 伦敦	1,638,366
纽元22,093,965	美元14,856,223	2020年10月5日	渣打银行, 伦敦	252,112
纽元14,446,451	美元9,660,847	2020年10月5日	美林国际, 伦敦	111,743
纽元1,423	美元941	2020年10月5日	高盛国际, 伦敦	0
美元60,381,379	英镑47,103,861	2020年10月5日	高盛国际, 伦敦	514,492
美元79,274,761	日元8,377,653,720	2020年10月5日	高盛国际, 伦敦	114,634
美元28,054,298	加元37,579,625	2020年10月5日	Citibank N.A., 伦敦	80,478
美元24,077,393	纽元36,540,415	2020年10月5日	HSBC Bank Plc, 伦敦	75,821
美元56,442	纽元86,274	2020年10月5日	法国巴黎银行	586
美元3,538	纽元5,411	2020年10月5日	渣打银行, 伦敦	39
美元2,765	加元3,708	2020年10月5日	高盛国际, 伦敦	11
美元1,107	纽元1,681	2020年10月5日	加拿大皇家银行	5
澳元93,201,627	美元68,137,100	2020年10月6日	高盛国际, 伦敦	1,330,174
美元66,363,333	澳元93,201,627	2020年10月6日	美林国际, 伦敦	443,562
美元15,455	澳元21,567	2020年10月6日	法国巴黎银行	4
美元1,190	纽元1,800	2020年10月6日	高盛国际, 伦敦	0
美元2,481,922	离岸人民币16,996,041	2020年10月9日	美国道富银行	22,542
美元239,689	离岸人民币1,635,773	2020年10月9日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,351
美元44,214	离岸人民币301,742	2020年10月9日	HSBC Bank Plc, 伦敦	249
美元1,099	离岸人民币7,522	2020年10月9日	法国巴黎银行	9
美元22,019	离岸人民币150,285	2020年10月13日	HSBC Bank Plc, 伦敦	126
澳元4,532,834	美元3,352,191	2020年10月21日	美国道富银行	103,055
澳元466,457	美元341,350	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	6,994
澳元286,419	美元211,399	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	6,093
澳元381,986	美元279,630	2020年10月21日	美国道富银行	5,823
澳元466,668	美元339,693	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	5,185
澳元409,932	美元298,457	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4,617
澳元290,454	美元211,877	2020年10月21日	法国巴黎银行	3,680
澳元302,906	美元220,040	2020年10月21日	美国道富银行	2,917
澳元194,783	美元142,333	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	2,713
澳元302,496	美元219,205	2020年10月21日	加拿大皇家银行	2,376
澳元86,717	美元63,339	2020年10月21日	法国巴黎银行	1,180
澳元96,636	美元70,272	2020年10月21日	法国巴黎银行	1,003
澳元63,346	美元46,393	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	987
澳元56,561	美元41,474	2020年10月21日	加拿大皇家银行	931
澳元60,581	美元44,187	2020年10月21日	法国巴黎银行	763
澳元157,679	美元113,612	2020年10月21日	法国巴黎银行	587

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15,443	美元11,284	2020年10月21日	法国巴黎银行	215
澳元13,842	美元10,088	2020年10月21日	美国道富银行	165
澳元6,980	美元5,167	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	164
澳元9,268	美元6,769	2020年10月21日	法国巴黎银行	126
澳元134,069	美元96,219	2020年10月21日	美国道富银行	119
澳元6,249	美元4,544	2020年10月21日	法国巴黎银行	65
澳元3,746	美元2,747	2020年10月21日	加拿大皇家银行	62
澳元4,842	美元3,532	2020年10月21日	法国巴黎银行	61
澳元4,574	美元3,330	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	52
澳元7,497	美元5,425	2020年10月21日	法国巴黎银行	51
澳元2,844	美元2,074	2020年10月21日	法国巴黎银行	36
澳元9,544	美元6,877	2020年10月21日	美国道富银行	36
澳元1,510	美元1,103	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	21
澳元1,512	美元1,103	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	19
澳元1,512	美元1,103	2020年10月21日	美国道富银行	19
澳元1,500	美元1,093	2020年10月21日	美国道富银行	18
澳元1,998	美元1,448	2020年10月21日	加拿大皇家银行	16
澳元1,509	美元1,098	2020年10月21日	加拿大皇家银行	16
澳元5,095	美元3,656	2020年10月21日	美国道富银行	5
澳元1,526	美元1,095	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	1
加元1,464,922	美元1,112,852	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	16,107
加元676,985	美元513,980	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	7,141
加元316,010	美元242,003	2020年10月21日	加拿大皇家银行	5,415
加元257,055	美元196,822	2020年10月21日	加拿大皇家银行	4,372
加元202,103	美元153,851	2020年10月21日	加拿大皇家银行	2,543
加元181,962	美元138,135	2020年10月21日	加拿大皇家银行	1,905
加元104,226	美元79,686	2020年10月21日	加拿大皇家银行	1,655
加元104,304	美元79,135	2020年10月21日	加拿大皇家银行	1,046
加元30,595	美元23,205	2020年10月21日	加拿大皇家银行	299
加元22,229	美元16,877	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	234
加元58,944	美元44,315	2020年10月21日	加拿大皇家银行	185
加元19,274	美元14,588	2020年10月21日	加拿大皇家银行	159
加元12,997	美元9,857	2020年10月21日	加拿大皇家银行	127
加元5,821	美元4,462	2020年10月21日	加拿大皇家银行	104
加元8,384	美元6,365	2020年10月21日	加拿大皇家银行	88
加元6,253	美元4,768	2020年10月21日	加拿大皇家银行	87
加元4,754	美元3,622	2020年10月21日	加拿大皇家银行	63
加元4,981	美元3,784	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	55
加元4,301	美元3,260	2020年10月21日	加拿大皇家银行	40
加元1,837	美元1,413	2020年10月21日	美国道富银行	38
加元2,527	美元1,927	2020年10月21日	加拿大皇家银行	35
加元21,704	美元16,280	2020年10月21日	美国道富银行	31
加元1,435	美元1,099	2020年10月21日	加拿大皇家银行	24
加元1,851	美元1,406	2020年10月21日	加拿大皇家银行	19
加元1,929	美元1,464	2020年10月21日	加拿大皇家银行	19
加元2,221	美元1,681	2020年10月21日	加拿大皇家银行	18
加元1,451	美元1,101	2020年10月21日	加拿大皇家银行	15
加元1,449	美元1,100	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	15
加元1,453	美元1,103	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	15
加元5,773	美元4,331	2020年10月21日	加拿大皇家银行	8
加元1,495	美元1,124	2020年10月21日	加拿大皇家银行	5
加元1,463	美元1,098	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	2
加元2,296	美元1,718	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	0
离岸人民币1,657,710	美元244,830	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	701
离岸人民币3,098,260	美元456,809	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	531
离岸人民币1,149,464	美元169,766	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	486
离岸人民币980,665	美元144,698	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	277
离岸人民币772,621	美元114,001	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	218

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779,623	美元114,948	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	134
离岸人民币283,197	美元41,755	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	49
离岸人民币97,976	美元14,456	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	28
离岸人民币30,486	美元4,495	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	5
离岸人民币8,695	美元1,284	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	4
离岸人民币7,458	美元1,101	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3
离岸人民币7,475	美元1,104	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3
离岸人民币7,458	美元1,101	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3
离岸人民币7,433	美元1,097	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2
离岸人民币7,433	美元1,097	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2
离岸人民币7,433	美元1,097	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2
离岸人民币7,440	美元1,097	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	1
离岸人民币7,440	美元1,097	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	1
离岸人民币7,440	美元1,097	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	1
离岸人民币7,489	美元1,102	2020年10月21日	法国巴黎银行	0
纽元302,631	美元204,376	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	4,336
纽元152,822	美元103,200	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	2,185
纽元164,805	美元110,885	2020年10月21日	美国道富银行	1,949
纽元220,435	美元147,297	2020年10月21日	美国道富银行	1,589
纽元84,115	美元56,987	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	1,387
纽元84,842	美元56,558	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	477
纽元26,058	美元17,389	2020年10月21日	美国道富银行	164
纽元30,121	美元19,999	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	88
纽元5,117	美元3,459	2020年10月21日	法国巴黎银行	77
纽元3,622	美元2,450	2020年10月21日	美国道富银行	56
纽元5,022	美元3,371	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	51
纽元2,999	美元2,032	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	49
纽元6,453	美元4,311	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	46
纽元3,352	美元2,237	2020年10月21日	法国巴黎银行	22
纽元1,629	美元1,096	2020年10月21日	加拿大皇家银行	19
纽元1,629	美元1,096	2020年10月21日	美国道富银行	19
纽元1,629	美元1,095	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	18
纽元1,646	美元1,102	2020年10月21日	法国巴黎银行	14
纽元1,657	美元1,106	2020年10月21日	美国道富银行	10
纽元1,657	美元1,106	2020年10月21日	美国道富银行	10
纽元1,673	美元1,116	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	10
纽元1,624	美元1,081	2020年10月21日	法国巴黎银行	7
纽元1,652	美元1,098	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	5
美元143,080,988	离岸人民币980,018,917	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	1,246,050
美元30,064,076	离岸人民币205,920,881	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	261,820
美元25,939,595	离岸人民币177,670,661	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	225,901
美元1,934,688	离岸人民币13,280,976	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	21,200
美元1,586,851	离岸人民币10,904,333	2020年10月21日	美国道富银行	19,029
美元1,902,563	澳元2,673,851	2020年10月21日	法国巴黎银行	14,053
美元652,844	澳元930,298	2020年10月21日	加拿大皇家银行	13,993
美元1,426,651	离岸人民币9,770,891	2020年10月21日	法国巴黎银行	12,304
美元1,374,951	离岸人民币9,417,592	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	11,974
美元518,282	澳元737,877	2020年10月21日	加拿大皇家银行	10,627
美元807,691	离岸人民币5,543,945	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	8,764
美元715,931	离岸人民币4,912,677	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	7,558
美元791,354	离岸人民币5,420,115	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	6,864
美元637,919	离岸人民币4,370,007	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	5,650
美元405,123	纽元620,856	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	5,263
美元319,108	澳元452,489	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	5,235
美元431,666	离岸人民币2,963,754	2020年10月21日	法国巴黎银行	4,806
美元818,301	离岸人民币5,588,029	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	4,644
美元413,653	离岸人民币2,838,475	2020年10月21日	美国道富银行	4,369
美元468,628	离岸人民币3,210,629	2020年10月21日	美国道富银行	4,200

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443,850	澳元624,553	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	3,830
美元385,165	离岸人民币2,640,096	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	3,641
美元354,258	离岸人民币2,427,331	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	3,214
美元455,694	离岸人民币3,112,838	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	2,732
美元278,350	离岸人民币1,906,828	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	2,468
美元390,683	离岸人民币2,665,887	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,920
美元168,448	离岸人民币1,156,215	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,828
美元151,778	离岸人民币1,042,397	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,735
美元242,972	纽元369,665	2020年10月21日	美国道富银行	1,377
美元459,856	加元615,878	2020年10月21日	加拿大皇家银行	1,234
美元313,322	加元420,090	2020年10月21日	法国巴黎银行	1,187
美元293,733	离岸人民币2,002,473	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	1,170
美元89,253	离岸人民币612,799	2020年10月21日	法国巴黎银行	994
美元84,232	离岸人民币577,995	2020年10月21日	美国道富银行	890
美元212,933	离岸人民币1,451,633	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	848
美元56,915	离岸人民币390,771	2020年10月21日	法国巴黎银行	634
美元38,825	离岸人民币266,417	2020年10月21日	美国道富银行	410
美元46,107	离岸人民币315,850	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	408
美元98,248	加元131,714	2020年10月21日	加拿大皇家银行	363
美元86,115	加元115,430	2020年10月21日	加拿大皇家银行	304
美元22,246	离岸人民币152,365	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	192
美元18,970	离岸人民币130,000	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	175
美元14,550	离岸人民币99,985	2020年10月21日	美国道富银行	174
美元15,913	离岸人民币108,704	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	96
美元9,933	离岸人民币68,054	2020年10月21日	美国道富银行	89
美元7,565	离岸人民币51,745	2020年10月21日	美国道富银行	56
美元10,917	纽元16,589	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	48
美元5,045	离岸人民币34,564	2020年10月21日	美国道富银行	45
美元5,132	离岸人民币35,151	2020年10月21日	法国巴黎银行	45
美元3,753	离岸人民币25,756	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	40
美元3,580	离岸人民币24,578	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	40
美元3,361	离岸人民币23,078	2020年10月21日	法国巴黎银行	37
美元6,406	离岸人民币43,742	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	36
美元199,699	加元266,782	2020年10月21日	法国巴黎银行	33
美元66,177	离岸人民币449,579	2020年10月21日	美国道富银行	32
美元308,029	离岸人民币2,091,813	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	30
美元4,497	离岸人民币30,722	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	27
美元2,038	离岸人民币13,982	2020年10月21日	美国道富银行	22
美元1,254	纽元1,921	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	16
美元1,129	离岸人民币7,748	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	12
美元1,098	离岸人民币7,520	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	10
美元1,141	离岸人民币7,816	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	10
美元1,090	离岸人民币7,466	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	10
美元974	澳元1,370	2020年10月21日	加拿大皇家银行	9
美元995	离岸人民币6,815	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	9
美元1,253	离岸人民币8,574	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	9
美元1,003	离岸人民币6,871	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	9
美元1,104	离岸人民币7,551	2020年10月21日	美国道富银行	8
美元920	离岸人民币6,304	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	8
美元1,555	离岸人民币10,609	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	8
美元945	离岸人民币6,475	2020年10月21日	法国巴黎银行	8
美元876	离岸人民币6,000	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	8
美元728	离岸人民币5,000	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	8
美元799	离岸人民币5,475	2020年10月21日	美国道富银行	7
美元773	离岸人民币5,300	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	7
美元1,046	离岸人民币5,146	2020年10月21日	美国道富银行	6
美元659	离岸人民币4,519	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	6
美元1,498	离岸人民币10,210	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	6

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58,239	离岸人民币395,497	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	6
美元9,329	离岸人民币63,382	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	5
美元554	离岸人民币3,795	2020年10月21日	法国巴黎银行	5
美元49,472	离岸人民币335,963	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	5
美元932	离岸人民币6,364	2020年10月21日	美国道富银行	5
美元755	纽元1,149	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	4
美元732	离岸人民币5,000	2020年10月21日	法国巴黎银行	4
美元3,439	离岸人民币23,364	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	2
美元1,835	离岸人民币12,465	2020年10月21日	美国道富银行	1
美元1,096	离岸人民币7,446	2020年10月21日	美国道富银行	1
美元1,574	离岸人民币10,693	2020年10月21日	美国道富银行	1
美元2,121	离岸人民币14,398	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	0
美元3,599	离岸人民币24,442	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	0
美元1,036	离岸人民币7,039	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	0
美元943	离岸人民币6,397	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	0
欧元124,317,093	美元145,914,888	2020年11月4日	美林国际, 伦敦	28,779
欧元103,334,582	美元121,266,800	2020年11月4日	HSBC Bank Plc, 伦敦	3,668
美元2,383,840	欧元2,033,250	2020年11月4日	加拿大皇家银行	2,178
加元529,328	美元396,393	2020年11月20日	加拿大皇家银行	41
加元6,641	美元5,722	2020年11月20日	加拿大皇家银行	1
离岸人民币7,505	美元1,102	2020年11月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	0
纽元1,800	美元1,190	2020年11月20日	高盛国际, 伦敦	0
美元182,937	澳元255,245	2020年11月20日	美林国际, 伦敦	49
美元941	纽元1,423	2020年11月20日	美林国际, 伦敦	0
美元1,088	离岸人民币7,403	2020年11月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	0
			未实现总收益	11,675,921

加元115,430	美元86,111	2020年10月5日	加拿大皇家银行	(308)
加元131,714	美元98,243	2020年10月5日	加拿大皇家银行	(368)
加元615,878	美元459,832	2020年10月5日	加拿大皇家银行	(1,258)
日元8,377,653,720	美元79,364,355	2020年10月5日	法国巴黎银行	(25,044)
纽元1,423	美元941	2020年10月5日	美林国际, 伦敦	(0)
纽元620,856	美元405,131	2020年10月5日	渣打银行, 伦敦	(5,255)
美元121,191,263	欧元103,334,582	2020年10月5日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(10,798)
美元2,937,918	欧元2,483,569	2020年10月5日	Barclays Bank Plc, 伦敦	(25,435)
美元2,477,993	欧元2,087,990	2020年10月5日	渣打银行, 伦敦	(29,406)
美元145,823,950	欧元124,317,093	2020年10月5日	美林国际, 伦敦	(37,294)
澳元452,489	美元319,098	2020年10月6日	高盛国际, 伦敦	(5,246)
澳元737,877	美元518,263	2020年10月6日	加拿大皇家银行	(10,647)
澳元930,298	美元652,817	2020年10月6日	加拿大皇家银行	(14,021)
澳元2,673,851	美元1,902,515	2020年10月6日	法国巴黎银行	(14,102)
加元420,090	美元313,307	2020年10月6日	法国巴黎银行	(1,202)
纽元16,589	美元10,917	2020年10月6日	渣打银行, 伦敦	(48)
美元1,190	纽元1,800	2020年10月6日	高盛国际, 伦敦	(0)
美元5,722	加元7,641	2020年10月6日	加拿大皇家银行	(1)
澳元255,245	美元182,917	2020年10月7日	美林国际, 伦敦	(43)
美元396,342	加元529,328	2020年10月7日	加拿大皇家银行	(50)
离岸人民币30,722	美元4,502	2020年10月9日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(25)
离岸人民币315,850	美元46,146	2020年10月9日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(396)
离岸人民币3,112,838	美元456,123	2020年10月9日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2,571)
离岸人民币4,370,007	美元638,464	2020年10月9日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(5,481)
离岸人民币6,200,000	美元906,657	2020年10月9日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(6,949)
离岸人民币9,770,891	美元1,428,054	2020年10月9日	法国巴黎银行	(11,742)
离岸人民币1,008,124,986	美元146,532,137	2020年10月9日	高盛国际, 伦敦	(2,020,826)
离岸人民币108,704	美元15,922	2020年10月13日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(96)
离岸人民币152,365	美元22,261	2020年10月13日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(191)

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5,000	美元733	2020年10月14日	法国巴黎银行	(4)
澳元1,533	美元1,089	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(9)
澳元3,369	美元2,394	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(21)
澳元7,846	美元5,511	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(113)
澳元18,697	美元13,287	2020年10月21日	法国巴黎银行	(114)
澳元293,393	美元205,700	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(4,605)
加元2,296	美元1,718	2020年10月21日	美国道富银行	(0)
加元3,226	美元2,406	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(9)
加元3,708	美元2,765	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(11)
加元193,913	美元144,591	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(587)
加元276,432	美元206,214	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(743)
离岸人民币7,483	美元1,101	2020年10月21日	美国道富银行	(1)
离岸人民币7,623	美元1,122	2020年10月21日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币7,489	美元1,102	2020年10月21日	法国巴黎银行	(0)
离岸人民币7,483	美元1,101	2020年10月21日	美国道富银行	(1)
离岸人民币8,412	美元1,238	2020年10月21日	美国道富银行	(1)
离岸人民币7,483	美元1,101	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
离岸人民币19,802	美元2,914	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币26,833	美元3,949	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2)
离岸人民币15,471	美元2,277	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
离岸人民币7,446	美元1,092	2020年10月21日	美国道富银行	(4)
离岸人民币7,519	美元1,102	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(5)
离岸人民币7,519	美元1,102	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(5)
离岸人民币7,519	美元1,102	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(5)
离岸人民币7,519	美元1,102	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(5)
离岸人民币7,460	美元1,092	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
离岸人民币7,460	美元1,092	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
离岸人民币7,460	美元1,092	2020年10月21日	美国道富银行	(6)
离岸人民币7,534	美元1,102	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(8)
离岸人民币7,534	美元1,102	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(8)
离岸人民币7,522	美元1,098	2020年10月21日	法国巴黎银行	(9)
离岸人民币7,535	美元1,099	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(10)
离岸人民币7,512	美元1,096	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(10)
离岸人民币7,535	美元1,100	2020年10月21日	法国巴黎银行	(10)
离岸人民币7,534	美元1,100	2020年10月21日	美国道富银行	(10)
离岸人民币7,512	美元1,096	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(10)
离岸人民币7,530	美元1,099	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(10)
离岸人民币7,499	美元1,095	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(10)
离岸人民币7,535	美元1,099	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(10)
离岸人民币7,535	美元1,100	2020年10月21日	法国巴黎银行	(10)
离岸人民币7,517	美元1,097	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(10)
离岸人民币7,516	美元1,095	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(12)
离岸人民币7,516	美元1,095	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(12)
离岸人民币7,516	美元1,095	2020年10月21日	美国道富银行	(12)
离岸人民币7,528	美元1,097	2020年10月21日	法国巴黎银行	(12)
离岸人民币7,528	美元1,097	2020年10月21日	法国巴黎银行	(12)
离岸人民币7,528	美元1,095	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(12)
离岸人民币7,528	美元1,097	2020年10月21日	法国巴黎银行	(12)
离岸人民币7,528	美元1,097	2020年10月21日	法国巴黎银行	(12)
离岸人民币13,087	美元1,915	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
离岸人民币9,834	美元1,435	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(13)
离岸人民币13,939	美元2,037	2020年10月21日	美国道富银行	(16)
离岸人民币391,228	美元57,588	2020年10月21日	法国巴黎银行	(28)
离岸人民币40,592	美元5,949	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(29)
离岸人民币24,168	美元3,519	2020年10月21日	美国道富银行	(40)
离岸人民币37,039	美元5,407	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(47)
离岸人民币51,745	美元7,566	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(55)
离岸人民币35,929	美元5,234	2020年10月21日	法国巴黎银行	(57)

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52,335	美元7,638	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(70)
离岸人民币840,390	美元123,688	2020年10月21日	美国道富银行	(75)
离岸人民币968,006	美元142,471	2020年10月21日	美国道富银行	(86)
离岸人民币67,493	美元9,853	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(87)
离岸人民币68,075	美元9,938	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(87)
离岸人民币156,953	美元23,024	2020年10月21日	美国道富银行	(91)
离岸人民币107,349	美元15,719	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(91)
离岸人民币60,915	美元8,874	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(97)
离岸人民币87,352	美元12,755	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(109)
离岸人民币150,285	美元22,007	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(125)
离岸人民币98,568	美元14,384	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(132)
离岸人民币92,612	美元13,495	2020年10月21日	美国道富银行	(144)
离岸人民币175,577	美元25,711	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(146)
离岸人民币129,378	美元18,887	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(166)
离岸人民币337,495	美元49,507	2020年10月21日	美国道富银行	(195)
离岸人民币123,641	美元18,012	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(197)
离岸人民币169,502	美元24,730	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(233)
离岸人民币301,742	美元44,173	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(265)
离岸人民币177,430	美元25,847	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(283)
离岸人民币265,794	美元38,789	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(354)
离岸人民币483,884	美元70,853	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(409)
离岸人民币506,110	美元74,113	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(422)
离岸人民币337,143	美元49,228	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(423)
离岸人民币640,142	美元93,814	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(459)
离岸人民币358,300	美元52,306	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(460)
离岸人民币372,038	美元54,305	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(484)
离岸人民币395,611	美元57,765	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(496)
离岸人民币337,676	美元49,168	2020年10月21日	美国道富银行	(561)
离岸人民币1,065,613	美元156,315	2020年10月21日	美国道富银行	(616)
离岸人民币465,993	美元67,987	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(639)
离岸人民币505,919	美元73,844	2020年10月21日	美国道富银行	(662)
离岸人民币1,193,057	美元175,010	2020年10月21日	美国道富银行	(690)
离岸人民币881,882	美元129,129	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(745)
离岸人民币1,200,602	美元175,950	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(861)
离岸人民币694,180	美元101,347	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(885)
离岸人民币822,468	美元120,098	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(1,026)
离岸人民币817,453	美元119,344	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,042)
离岸人民币603,229	美元87,781	2020年10月21日	美国道富银行	(1,055)
离岸人民币712,590	美元103,802	2020年10月21日	法国巴黎银行	(1,140)
离岸人民币933,211	美元136,262	2020年10月21日	美国道富银行	(1,171)
离岸人民币685,236	美元99,715	2020年10月21日	美国道富银行	(1,199)
离岸人民币991,512	美元144,782	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(1,237)
离岸人民币1,036,601	美元151,359	2020年10月21日	美国道富银行	(1,301)
离岸人民币983,257	美元143,494	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(1,309)
离岸人民币1,006,501	美元146,884	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(1,342)
离岸人民币1,043,784	美元152,325	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(1,392)
离岸人民币1,635,773	美元239,464	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,435)
离岸人民币1,129,769	美元164,876	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(1,504)
离岸人民币1,209,499	美元176,482	2020年10月21日	法国巴黎银行	(1,639)
离岸人民币1,060,306	美元154,505	2020年10月21日	美国道富银行	(1,645)
离岸人民币1,633,796	美元238,470	2020年10月21日	美国道富银行	(2,137)
离岸人民币1,406,927	美元205,013	2020年10月21日	美国道富银行	(2,183)
离岸人民币1,784,286	美元260,448	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(2,322)
离岸人民币2,046,731	美元298,852	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(2,568)
离岸人民币3,453,608	美元505,693	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2,916)
离岸人民币2,140,859	美元311,723	2020年10月21日	美国道富银行	(3,561)
离岸人民币2,928,699	美元427,476	2020年10月21日	美国道富银行	(3,831)
离岸人民币2,935,906	美元428,431	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3,937)

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5,613,135	美元819,033	2020年10月21日	法国巴黎银行	(7,607)
离岸人民币6,098,186	美元889,705	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(8,368)
离岸人民币5,762,383	美元839,679	2020年10月21日	美国道富银行	(8,941)
纽元1,681	美元1,107	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(5)
纽元1,656	美元1,089	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(6)
纽元4,240	美元2,767	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(36)
纽元5,411	美元3,538	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(39)
纽元59,590	美元38,890	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(500)
纽元86,274	美元56,441	2020年10月21日	法国巴黎银行	(586)
纽元85,534	美元55,947	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(591)
纽元1,946,794	美元1,279,857	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(6,973)
美元3,599	离岸人民币24,442	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(0)
美元1,036	离岸人民币7,039	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(0)
美元2,121	离岸人民币14,398	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(0)
美元943	离岸人民币6,397	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(0)
美元1,043	离岸人民币7,066	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(2)
美元841	离岸人民币5,693	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(2)
美元1,166	离岸人民币7,898	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3)
美元957	纽元1,434	2020年10月21日	法国巴黎银行	(9)
美元644	加元845	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(11)
美元1,100	加元1,451	2020年10月21日	法国巴黎银行	(14)
美元1,055	加元1,390	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(15)
美元1,053	澳元1,444	2020年10月21日	美国道富银行	(17)
美元1,055	澳元1,444	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(20)
美元1,413	加元1,837	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(38)
美元21,510	纽元32,401	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(92)
美元3,321	澳元4,499	2020年10月21日	法国巴黎银行	(96)
美元41,058	离岸人民币278,000	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(118)
美元46,210	离岸人民币312,859	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(136)
美元54,459	离岸人民币368,704	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(161)
美元5,167	澳元6,980	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(164)
美元20,675	纽元30,945	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(221)
美元17,915	加元23,599	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(247)
美元235,907	澳元328,715	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(284)
美元65,666	纽元98,887	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(302)
美元47,153	纽元70,815	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(344)
美元186,985	加元249,292	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(347)
美元58,135	纽元87,221	2020年10月21日	多伦多道明银行	(482)
美元145,858	加元194,067	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(565)
美元88,292	纽元132,669	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(597)
美元344,803	离岸人民币2,336,572	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(699)
美元75,526	纽元113,190	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(707)
美元267,408	离岸人民币1,810,430	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(788)
美元51,247	纽元76,026	2020年10月21日	多伦多道明银行	(994)
美元76,753	加元101,165	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(1,014)
美元110,737	纽元165,970	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(1,031)
美元50,181	纽元74,310	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,062)
美元111,333	加元147,098	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(1,205)
美元118,569	加元156,672	2020年10月21日	法国巴黎银行	(1,273)
美元78,724	澳元107,995	2020年10月21日	美国道富银行	(1,313)
美元320,847	加元426,787	2020年10月21日	法国巴黎银行	(1,324)
美元279,203	澳元387,532	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(1,419)
美元206,494	澳元286,083	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(1,429)
美元123,610	加元162,861	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(1,680)
美元102,458	澳元140,472	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(1,767)
美元170,979	澳元235,920	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,871)
美元142,557	纽元212,059	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(2,386)
美元224,292	澳元309,522	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(2,426)

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167,523	纽元249,504	2020年10月21日	法国巴黎银行	(2,600)
美元224,082	加元295,582	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(2,788)
美元124,530	加元170,489	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(2,879)
美元196,898	澳元260,579	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(2,947)
美元2,732,776	离岸人民币18,535,818	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(3,028)
美元114,088	澳元154,569	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(3,293)
美元224,856	澳元309,026	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(3,346)
美元178,485	澳元243,581	2020年10月21日	美国道富银行	(3,885)
美元253,629	纽元377,115	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(4,356)
美元253,027	纽元374,830	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(5,264)
美元358,280	纽元533,898	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(5,373)
美元604,230	澳元834,967	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(5,725)
美元422,737	加元556,900	2020年10月21日	法国巴黎银行	(5,801)
美元317,207	澳元434,322	2020年10月21日	美国道富银行	(5,885)
美元443,826	加元584,569	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(6,176)
美元265,579	纽元392,027	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(6,449)
美元291,608	加元380,845	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(6,480)
美元398,640	加元523,301	2020年10月21日	美国道富银行	(6,859)
美元379,526	加元497,749	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(6,875)
美元424,901	加元557,708	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(7,361)
美元359,975	加元470,817	2020年10月21日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(7,487)
美元568,169	澳元780,511	2020年10月21日	法国巴黎银行	(8,697)
美元432,261	加元556,035	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(10,719)
美元717,929	澳元986,035	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(11,138)
美元673,642	澳元923,535	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(11,651)
美元562,081	澳元767,866	2020年10月21日	美国道富银行	(11,674)
美元975,057	加元1,283,584	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(14,075)
美元942,532	澳元1,293,459	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(15,380)
美元1,565,476	加元2,064,602	2020年10月21日	法国巴黎银行	(19,768)
美元930,284	澳元1,268,766	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(20,830)
美元1,609,804	加元2,120,915	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(21,936)
美元1,285,300	澳元1,759,032	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(24,424)
美元4,361,319	澳元5,897,914	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(133,685)
美元27,376,638	纽元40,822,469	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(392,979)
美元65,930,179	加元86,418,490	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(1,231,105)
美元95,508,374	澳元131,052,048	2020年10月21日	多伦多道明银行	(1,570,160)
澳元3,317,960	美元2,365,868	2020年11月4日	美林国际, 伦敦	(12,777)
澳元93,201,627	美元66,367,853	2020年11月4日	美林国际, 伦敦	(448,393)
加元37,579,625	美元28,056,937	2020年11月4日	Citibank N.A., 伦敦	(79,948)
离岸人民币1,336,101	美元195,867	2020年11月4日	高盛国际, 伦敦	(699)
离岸人民币1,974,756	美元288,858	2020年11月4日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(1,667)
离岸人民币997,328,945	美元145,821,970	2020年11月4日	美林国际, 伦敦	(904,469)
欧元6,177,685	美元7,239,322	2020年11月4日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(10,191)
欧元2,059,317	美元2,400,999	2020年11月4日	Deutsche Bank AG, 伦敦	(15,610)
英镑47,103,861	美元60,390,776	2020年11月4日	高盛国际, 伦敦	(514,515)
日元8,377,653,720	美元79,300,875	2020年11月4日	高盛国际, 伦敦	(118,328)
纽元36,540,415	美元24,077,200	2020年11月4日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(76,015)
美元900,434	日元94,514,153	2020年11月4日	多伦多道明银行	(4,449)
澳元21,567	美元15,457	2020年11月20日	法国巴黎银行	(5)
离岸人民币7,505	美元1,102	2020年11月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(0)
离岸人民币133,024	美元19,541	2020年11月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(8)
离岸人民币222,209	美元32,641	2020年11月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(12)
纽元1,800	美元1,190	2020年11月20日	高盛国际, 伦敦	(0)
美元941	纽元1,423	2020年11月20日	美林国际, 伦敦	(0)
美元1,088	离岸人民币7,403	2020年11月20日	HSBC Bank Plc, 伦敦	(0)

未实现总亏损 (8,142,820)

未实现净收益 3,533,101

(b) 以下为截至九月三十日之未平仓期货合约：

	长仓/ (短 仓) 的合约 数目	合约金额 美元	交割日期	标的资产	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
<u>2021</u>						
Euro-BOBL Future 08/12/2021	(145)	(22,674,683)	2021年12月	5-year debt instruments issued by the Federal Republic of Germany, the Republic of Italy, the Republic of France, the Kingdom of Spain or the Swiss Confederation	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	136,119
Long Gilt Future 29/12/2021	(282)	(47,586,373)	2021年12月	10-year U.K. Gilts	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	1,513,334
US 10Yr Ultra Fut 21/12/2021	(132)	(19,173,000)	2021年12月	10-year U.S. Treasury notes	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	378,469
US 5Yr Note (CBT) 31/12/2021	(1,895)	(232,596,446)	2021年12月	5-year U.S. Treasury notes	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	1,525,623
US Ultra Bond (CBT) 21/12/2021	(81)	(15,476,063)	2021年12月	30-year U.S. Treasury bonds	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	565,102
					未实现总收益	4,118,647

Euro-Bund Future 08/12/2021	160	31,490,062	2021年12月	10-year debt instruments issued by the Federal Republic of Germany, the Republic of Italy, the Republic of France, the Kingdom of Spain or the Swiss Confederation	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	(36,716)
Euro-BUXL 30Y Bd 08/12/2021	68	16,024,941	2021年12月	30-year debt instruments issued by the Federal Republic of Germany, the Republic of Italy, the Republic of France, the Kingdom of Spain or the Swiss Confederation	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	(536,687)
JPN 10Y Bond (OSE) 13/12/2021	9	12,209,993	2021年12月	10-year Japanese Government Bonds	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	(37,912)
US Long Bond(CBT) 21/12/2021	343	54,612,031	2021年12月	20-year U.S. Treasury bonds	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	(1,160,593)
					未实现总亏损	(1,771,908)

					未实现净收益	2,346,739
						=====

	长仓/ (短 仓) 的合 约数目	合约金额 美元	交割日期	标的资产	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
<u>2020</u>						
Euro-BTP (EUX) Fut 12/2020	185	31,728,121	2020年12月	10-year debt instruments issued by the Federal Republic of Germany, the Republic of Italy, the Republic of France, the Kingdom of Spain or the Swiss Confederation	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	287,921
JGB 10Yr Bond (OSE) Fut 12/2020	88	126,642,282	2020年12月	10-year Japanese Government Bonds	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	200,133
US 5Yr Note (CBT) Fut 12/2020	730	91,917,258	2020年12月	5-year U.S. Treasury notes	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	85,555
US Ultra Bond (CBT) Fut 12/2020	(67)	(14,941,719)	2020年12月	30-year U.S. Treasury bonds	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	80,281
					未实现总收益	<u>653,890</u>
Aust 10 Yr Bond (SFE) Fut 12/2020	(52)	(5,505,506)	2020年12月	Australia 10-Year bonds 30-year debt instruments issued by the Federal Republic of Germany, the Republic of Italy, the Republic of France, the Kingdom of Spain or the Swiss Confederation	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	(62,514)
Euro BUXL 30Yr Bd (EUX) Fut 12/2020	(86)	(21,988,642)	2020年12月	5-year debt instruments issued by the Federal Republic of Germany, the Republic of Italy, the Republic of France, the Kingdom of Spain or the Swiss Confederation	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	(468,169)
Euro-BOBL (EUX) Fut 12/2020	(260)	(41,170,686)	2020年12月	10-year debt instruments issued by the Federal Republic of Germany, the Republic of Italy, the Republic of France, the Kingdom of Spain or the Swiss Confederation	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	(41,160)
Euro-Bund (EUX) Fut 12/2020	(32)	(6,512,054)	2020年12月	10-year debt instruments issued by the Federal Republic of Germany, the Republic of Italy, the Republic of France, the Kingdom of Spain or the Swiss Confederation	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	(36,774)
Euro-OAT (EUX) Fut 12/2020	(58)	(11,368,056)	2020年12月	10-year debt instruments issued by the Federal Republic of Germany, the Republic of Italy, the Republic of France, the Kingdom of Spain or the Swiss Confederation	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	(95,653)
Long Gilt (LIF) Fut 12/2020	344	60,566,361	2020年12月	10-year U.K. Gilts	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	(35,087)
US 10Yr Note (CBT) Fut 12/2020	(397)	(55,305,844)	2020年12月	10-year U.S. Treasury notes	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	(88,063)
					未实现总亏损	<u>(827,420)</u>
					未实现净亏损	<u>(173,530)</u>

独立核数师报告

致摩根国际债券基金（“贵基金”）份额持有人

就财务报表审计作出的报告

意见

我们已审计的内容

摩根国际债券基金列载于第七页至第四十五页的财务报表，包括：

- 于二零二一年九月三十日的财务状况表；
- 截至该日止年度的综合收益表；
- 截至该日止年度的可赎回份额持有人应占净资产变动表；
- 截至该日止年度的现金流量表；及
- 财务报表附注，包括主要会计政策及其他解释信息。

我们的意见

我们认为，该等财务报表已根据香港会计师公会颁布的《香港财务报告准则》真实而中肯地反映了贵基金于二零二一年九月三十日的财务状况及其截至该日止年度的财务交易及现金流量。

意见的基础

我们已根据香港会计师公会颁布的《香港审计准则》进行审计。我们在该等准则下承担的责任已在本报告“核数师就审计财务报表承担的责任”部分中作进一步阐述。

我们相信，我们所获得的审计凭证能充足及适当地为我们的审计意见提供基础。

独立性

根据香港会计师公会颁布的《专业会计师道德守则》（“守则”），我们独立于贵基金，并已履行守则中的其他专业道德责任。

其他信息

贵基金受托人及管理人（“管理层”）须对其他信息负责。其他信息包括年报内的所有信息，但不包括财务报表及我们的核数师报告。

我们对财务报表的意见不涵盖其他信息，我们亦不对该等其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中所了解的情况存在重大抵触或者似乎存在重大错误陈述的迹象。

基于我们已执行的工作，如果我们认为其他信息存在重大错误陈述，我们需要报告该事实。在这方面，我们没有任何报告。

管理层就财务报表需承担的责任

贵基金管理层须负责根据香港会计师公会颁布的《香港财务报告准则》拟备真实而中肯的财务报表，并对其认为为使财务报表的拟备不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述所需的内部控制负责。

在拟备财务报表时，贵基金管理层负责评估贵基金持续经营的能力，并在适用情况下披露与持续经营有关的事项，以及使用持续经营为会计基础，除非管理层有意将贵基金清盘或停止经营或别无其他实际的替代方案。

此外，贵基金管理层负责确保财务报表已遵照一九七九年四月三十日订立的信托契约（经修订）（“信托契约”）以及香港证券及期货事务监察委员会颁布的单位信托及互惠基金守则（“证监会守则”）附录 E 的相关披露条文适当地拟备。

核数师就审计财务报表承担的责任

我们的目标，是对财务报表整体是否不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述取得合理保证，并出具包括我们意见的核数师报告。我们仅向阁下（作为整体）报告我们的意见，除此之外本报告别无其他目的。我们不会就本报告的内容向任何其他人士负上或承担任何责任。合理保证是高水平的保证，但不能保证按照《香港审计准则》进行的审计，在某一重大错误陈述存在时总能发现。错误陈述可以由欺诈或错误所引起，如果合理预期它们单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依赖财务报表所作出的经济决定，则有关的错误陈述可以被视作重大。此外，我们必须评估贵基金的财务报表在所有重大方面是否已根据信托契约及证监会守则附录 E 的相关披露条文适当地拟备。

在根据《香港审计准则》进行审计的过程中，我们运用了专业判断，保持了专业怀疑态度。我们亦：

- 识别和评估由于欺诈或错误而导致财务报表存在重大错误陈述的风险，设计及执行审计程序以应对这些风险，以及获取充足和适当的审计凭证，作为我们意见的基础。由于欺诈可能涉及串谋、伪造、蓄意遗漏、虚假陈述，或凌驾于内部控制之上，因此未能发现因欺诈而导致的重大错误陈述的风险高于未能发现因错误而导致的重大错误陈述的风险。
- 了解与审计相关的内部控制，以设计适当的审计程序，但目的并非对贵基金内部控制的有效性发表意见。
- 评价管理层所采用会计政策的恰当性及作出会计估计及相关披露的合理性。

独立核数师报告（续）

致摩根国际债券基金（“贵基金”）份额持有人

核数师就审计财务报表承担的责任（续）

- 对管理层采用持续经营会计基础的恰当性作出结论。根据所获取的审计凭证，确定是否存在与事项或情况有关的重大不确定性，从而可能导致对贵基金的持续经营能力产生重大疑虑。如果我们认为存在重大不确定性，则有必要在核数师报告中提请使用者注意财务报表中的相关披露。假若有关的披露不足，则我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于核数师报告日止所取得的审计凭证。然而，未来事项或情况可能导致贵基金不能持续经营。
- 评价财务报表的整体列报方式、结构和内容，包括披露，以及财务报表是否中肯反映交易和事项。

除其他事项外，我们与管理层沟通了计划的审计范围、时间安排、重大审计发现等，包括我们在审计中识别出的内部控制的任何重大缺陷。

根据信托契约与证监会守则附录 E 的相关披露条文就相关事项作出的报告

我们认为，财务报表在各重大方面已根据信托契约及证监会守则附录 E 的相关披露条文适当地拟备。

罗兵咸永道会计师事务所

执业会计师

香港，二零二二年一月二十五日

管理人及受托人的责任声明

管理人的责任

基金管理人务必遵照香港证券及期货事务监察委员会所颁布的单位信托及互惠基金守则和信托契约编制各年度会计期间的财务报表，该等财务报表真实而中肯地反映基金于该期末的财务状况及截至该日止年度的财务交易。编制该等财务报表时，管理人务必：

- 选择并贯彻地应用适当的会计政策；
- 作出审慎和合理的判断；及
- 按持续营运的基准编制财务报表，除非该假设不恰当。

管理人亦务必遵照信托契约，采取合理措施预防和监测欺诈及其他不法行为。

受托人的责任

基金受托人务必：

- 确保管理人遵照信托契约管理本基金且确保投资及借款能力符合要求；
- 确保已保留充分的会计记录及其他记录；
- 保护本基金的财产及附带权利；及
- 就每一个会计年度，向份额持有人报告关于管理人管理本基金的行为操守。

受托人对份额持有人的报告

本受托人谨确认管理人于截至二零二一年九月三十日止财政年度在各个重要方面均依照一九七九年四月三十日所订立之信托契约（经修订）之条款管理本基金。

东亚银行（信托）有限公司，受托人

二零二二年一月二十五日

业绩记录 - 未经审计

资产净值

财务期结算日	本基金资产净值	每份额资产净值
30/9/21		
- 澳元对冲类别（每月派息）	澳元103,503,535	澳元9.77
- 加元对冲类别（每月派息）	加元64,649,781	加元9.79
- 港元类别（每月派息）	港元1,822,410,378	港元9.85
- 纽元对冲类别（每月派息）	纽元34,047,082	纽元9.78
- 人民币对冲类别（累计）	人民币11,241,640	人民币13.79
- 人民币对冲类别（每月派息）	人民币1,043,345,225	人民币9.65
- 美元类别（每月派息）	美元440,323,336	美元9.81
- 美元类别（每半年派息）	美元16,518,894	美元22.16
- PRC 人民币份额（累计）	人民币86,921,823	人民币10.54
- PRC 人民币份额（每月派息）	人民币83,732,936	人民币9.64
- PRC 人民币对冲份额（累计）	人民币60,642,379	人民币11.44
- PRC 人民币对冲份额（每月派息）	人民币95,607,461	人民币10.02
- PRC 美元份额（累计）	美元34,354,133	美元10.98
- PRC 美元份额（每月派息）	美元30,226,878	美元10.04
30/9/20		
- 澳元对冲类别（每月派息）	澳元144,971,464	澳元10.04
- 加元对冲类别（每月派息）	加元94,447,093	加元10.07
- 港元类别（每月派息）	港元2,370,635,364	港元10.08
- 纽元对冲类别（每月派息）	纽元41,329,678	纽元10.05
- 人民币对冲类别（累计）	人民币7,863,998	人民币13.37
- 人民币对冲类别（每月派息）	人民币1,041,227,933	人民币9.94
- 美元类别（每月派息）	美元607,211,274	美元10.09
- 美元类别（每半年派息）	美元34,884,729	美元22.79
- PRC 人民币份额（累计）	人民币161,056,618	人民币11.01
- PRC 人民币份额（每月派息）	人民币134,157,374	人民币10.42
- PRC 人民币对冲份额（累计）	人民币163,705,196	人民币11.09
- PRC 人民币对冲份额（每月派息）	人民币192,660,573	人民币10.32
- PRC 美元份额（累计）	美元92,719,432	美元10.90
- PRC 美元份额（每月派息）	美元53,851,477	美元10.32
30/9/19		
- 澳元对冲类别（每月派息）	澳元75,379,036	澳元10.13
- 加元对冲类别（每月派息）	加元42,996,672	加元10.13
- 港元类别（每月派息）	港元1,235,343,698	港元10.25
- 纽元对冲类别（每月派息）	纽元46,035,618	纽元10.13
- 人民币对冲类别（累计）	人民币6,094,496	人民币12.79
- 人民币对冲类别（每月派息）	人民币717,124,629	人民币10.01
- 美元类别（每月派息）	美元350,740,212	美元10.14
- 美元类别（每半年派息）	美元13,405,615	美元22.91
- PRC 人民币份额（累计）	人民币538,799,669	人民币11.24
- PRC 人民币份额（每月派息）	人民币137,346,857	人民币11.02
- PRC 人民币对冲份额（累计）	人民币358,901,326	人民币10.61
- PRC 人民币对冲份额（每月派息）	人民币242,583,238	人民币10.38
- PRC 美元份额（累计）	美元72,249,710	美元10.57
- PRC 美元份额（每月派息）	美元44,456,561	美元10.38

业绩记录 - 未经审计 (续)

(续)

最高卖出价/最低买入价

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价	财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
30/9/21			30/9/16		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元10.15	澳元9.77	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元10.64	澳元9.81
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元10.17	加元9.79	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元10.66	加元9.82
- 港元类别 (每月派息)	港元10.20	港元9.83	- 港元类别 (每月派息)	港元10.69	港元9.83
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元10.16	纽元9.78	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元10.67	纽元9.83
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币13.93	人民币13.34	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币11.42	人民币10.10
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币10.06	人民币9.65	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币10.60	人民币9.73
- 美元类别 (每月派息)	美元10.20	美元9.81	- 美元类别 (每月派息)	美元10.68	美元9.82
- 美元类别 (每半年派息)	美元23.20	美元22.16	- 美元类别 (每半年派息)	美元24.31	美元22.30
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币10.98	人民币10.33	30/9/15		
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币10.38	人民币9.55	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元10.38	澳元9.86
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币11.57	人民币11.10	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元10.38	加元9.85
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币10.45	人民币10.02	- 港元类别 (每月派息)	港元10.37	港元9.86
- PRC 美元份额 (累计)	美元11.15	美元10.83	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元10.40	纽元9.87
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元10.44	美元10.04	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币10.41	人民币9.89
30/9/20			- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币10.38	人民币9.86
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元10.32	澳元9.55	- 美元类别 (每月派息)	美元10.38	美元9.86
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元10.33	加元9.59	- 美元类别 (每半年派息)	美元24.94	美元22.38
- 港元类别 (每月派息)	港元10.36	港元9.64	30/9/14		
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元10.32	纽元9.56	- 美元类别 (每半年派息)	美元25.48	美元23.46
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币13.42	人民币12.39	30/9/13		
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币10.19	人民币9.51	- 美元类别 (每半年派息)	美元26.36	美元23.04
- 美元类别 (每月派息)	美元10.33	美元9.63	30/9/12		
- 美元类别 (每半年派息)	美元23.71	美元22.11			
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币11.50	人民币10.76			
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币11.08	人民币10.38			
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币11.14	人民币10.29			
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币10.58	人民币9.87			
- PRC 美元份额 (累计)	美元10.99	美元10.19			
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元10.58	美元9.86			
30/9/19					
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元10.25	澳元9.41			
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元10.26	加元9.43			
- 港元类别 (每月派息)	港元10.40	港元9.54			
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元10.26	纽元9.43			
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币12.88	人民币11.41			
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币10.15	人民币9.31			
- 美元类别 (每月派息)	美元10.28	美元9.45			
- 美元类别 (每半年派息)	美元23.55	美元21.37			
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币11.39	人民币9.90			
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币11.22	人民币9.90			
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币10.69	人民币9.96			
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币10.53	人民币9.96			
- PRC 美元份额 (累计)	美元10.65	美元9.96			
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元10.52	美元9.96			
30/9/18					
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元9.82	澳元9.49			
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元9.83	加元9.50			
- 港元类别 (每月派息)	港元9.93	港元9.61			
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元9.83	纽元9.50			
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币11.58	人民币11.29			
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币9.74	人民币9.39			
- 美元类别 (每月派息)	美元9.85	美元9.52			
- 美元类别 (每半年派息)	美元22.38	美元21.52			
30/9/17					
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元10.49	澳元9.69			
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元10.51	加元9.69			
- 港元类别 (每月派息)	港元10.53	港元9.74			
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元10.51	纽元9.70			
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币11.38	人民币10.63			
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币10.43	人民币9.59			
- 美元类别 (每月派息)	美元10.52	美元9.72			
- 美元类别 (每半年派息)	美元23.79	美元22.15			

经营与管理

管理人及服务提供者

摩根基金（亚洲）有限公司
香港
中环干诺道中 8 号
遮打大厦 21 楼

投资管理人

摩根资产管理（亚太）
有限公司
香港
中环干诺道中 8 号
遮打大厦 21 楼

管理人董事

于二零二二年一月二十五日
Ayaz Hatim EBRAHIM
Daniel James WATKINS
Edwin Tsun Kay CHAN
Elka Kit Yee LEUNG
Ka Li NG
Stiofan Seamus DEBURCA

受托人

东亚银行（信托）
有限公司
香港
九龙观塘
观塘道 418 号
创纪之城五期
东亚银行中心 32 楼

基金注册登记机构

East Asia International
Trustees Limited
East Asia Chambers
P.O. Box 901
Road Town, Tortola
British Virgin Islands

核数师

罗兵咸永道会计师事务所
执业会计师
香港
中环德辅道中 1 号
太子大厦 22 楼

