

年度报告 - 2021年9月30日 (经审核)

摩根亚洲总收益 债券基金



内地与香港互认基金系列

中国内地代理人:

上投摩根
基金 管理

基金管理人:

摩根
资产管理

此（等）报告并不构成购买组成本文件内容的任何基金单位之邀请，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 - 6
投资组合持有变动表 - 未经审计	7
金融衍生工具详情 - 未经审计	8
金融衍生工具风险敞口信息 - 未经审计	8
财务状况表	9
综合收益表	9
可赎回份额持有人应占净资产变动表	10
现金流量表	10
财务报表之附注	11 - 49
独立核数师报告	50 - 51
管理人及受托人的责任声明	52
受托人对份额持有人的报告	52
业绩纪录 - 未经审计	52 - 54
经营与管理	54

投资组合

(续)

截至二零二一年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资 产净 值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资 产净 值百 分比
上市投资(97.5%)				Goodman HK Fin 4.375% 19/06/24-RegS	美元 5,800,000	6,325,815	0.2
(1) 债务证券(97.5%)				Goodman HK Finance 3% 22/07/30-RegS	美元 2,300,000	2,359,416	0.1
百慕大(0.6%)				HPHT Finance 21.2% 19/03/26-RegS	美元 5,500,000	5,560,586	0.2
China Oil & Gas 4.7% 30/06/26-RegS	美元 4,400,000	4,544,784	0.2	KWG Group Holdings 6% 15/09/22-RegS	美元 2,000,000	1,970,491	0.1
China Oil & Gas 5.5% 25/01/23-RegS	美元 10,500,000	10,906,002	0.4	Longfor Grp 3.85% 13/01/32- RegS	美元 2,000,000	2,064,313	0.1
开曼群岛(14.1%)				Longfor Grp Hldg 4.5% 16/01/28-RegS	美元 11,600,000	12,585,652	0.5
Agile Group Hldgs VRN 6.875% 29/12/49-RegS	美元 2,000,000	1,831,867	0.1	Melco Resorts Fin 5.625% 07/27-RegS	美元 5,200,000	5,344,885	0.2
Agile Group Hldgs VRN 7.875%-RegS	美元 20,800,000	19,162,744	0.7	Melco Resorts Finance 5.375% 04/12/29-RegS	美元 2,000,000	2,070,938	0.1
Azure Orbit IV 4% 25/01/28- RegS	美元 700,000	755,032	0.0	Powerlong Real 5.95% 30/04/25-RegS	美元 8,400,000	8,298,242	0.3
Baidu Inc 3.425% 07/04/30- RegS	美元 1,000,000	1,078,840	0.0	Powerlong Real Est 7.125% 11/22-RegS	美元 8,300,000	8,555,740	0.3
CDBL Funding 2% 04/03/26- RegS	美元 5,800,000	5,835,148	0.2	Redsun Properties 10.5% 3/10/22-RegS	美元 10,000,000	9,766,807	0.4
Champion Mtn Ltd 2.95% 15/06/30-RegS	美元 11,600,000	12,094,985	0.4	Redsun Properties 9.7% 16/4/23-RegS	美元 6,200,000	5,821,114	0.2
China Aoyuan Group Ltd 6.2% 24/03/26-RegS	美元 2,000,000	1,543,347	0.1	Ronshine China 7.35% 15/12/23-RegS	美元 12,200,000	9,446,297	0.3
China Aoyuan Group Ltd 7.95% 19/02/23-RegS	美元 3,500,000	3,200,649	0.1	Ronshine China 8.1% 09/06/23-RegS	美元 4,700,000	3,337,940	0.1
China Aoyuan Group Ltd 8.5% 23/01/22-RegS	美元 2,000,000	1,985,199	0.1	Ronshine China 8.75% 25/10/22-RegS	美元 3,300,000	2,713,841	0.1
China Overseas 2.375% 2/3/25-RegS	美元 10,100,000	10,272,490	0.4	Sands China 5.125% 08/08/25	美元 4,500,000	4,884,998	0.2
China Resources VRN 3.75% Perp-RegS	美元 12,400,000	13,057,097	0.5	Sands China 5.4% 08/08/28	美元 4,300,000	4,788,394	0.2
China SCE Group Hldgs Ltd 5.875% 10/03/22-RegS	美元 2,000,000	1,980,904	0.1	Shimao Group Holdings 3.45% 11/01/31-RegS	美元 9,800,000	8,872,868	0.3
CIFI Hldgs Group VRN 5.375% 29/12/49-RegS	美元 4,500,000	4,484,373	0.2	Shui On Develop 5.5% 03/03/25-RegS	美元 18,300,000	17,977,934	0.7
CK Hutchison Intl 2.5% 8/5/30-RegS	美元 3,500,000	3,596,605	0.1	Shui On Develop Hldg VRN 6.4% 20/12/65	美元 4,300,000	4,364,223	0.2
CK Hutchison Intl 2.75% 6/9/29-RegS	美元 300,000	310,395	0.0	Shui On Development Hldg 5.75% 12/11/23-RegS	美元 13,400,000	13,732,419	0.5
CK Hutchison Intl 3.625% 04/29-RegS	美元 4,200,000	4,670,247	0.2	Sun Hung Kai Prop 3.75% 02/29-RegS	美元 6,000,000	6,620,370	0.2
Country Garden 2.7% 12/07/26-RegS	美元 11,300,000	10,624,667	0.4	Sunac China Hldgs 6.5% 9/07/23-RegS	美元 4,300,000	3,628,467	0.1
Country Garden 5.125% 17/01/25-RegS	美元 400,000	405,873	0.0	Sunac China Hldgs 7.95% 08/22-RegS	美元 9,000,000	8,373,845	0.3
Country Garden 5.625% 14/01/30-RegS	美元 4,000,000	4,144,857	0.1	Sunac China Hldgs 8.35% 19/4/23-RegS	美元 2,600,000	2,347,639	0.1
Country Garden 5.625% 15/12/26-RegS	美元 6,500,000	6,826,108	0.2	Sunac China Holdings Ltd 5.95% 26/04/24-RegS	美元 5,900,000	4,998,734	0.2
Country Garden 6.15% 17/09/25-RegS	美元 7,800,000	8,169,905	0.3	Sunac China Holdings Ltd 6.5% 26/01/26-RegS	美元 4,000,000	3,269,964	0.1
Country Garden 7.25% 08/04/26-RegS	美元 600,000	654,951	0.0	Sunac China Holdings Ltd 6.65% 03/08/24-RegS	美元 2,100,000	1,714,020	0.1
Foxconn Far East Ltd 2.5% 28/10/30-RegS	美元 12,200,000	12,314,131	0.4	Sunac China Holdings Ltd 7.95% 11/10/23-RegS	美元 1,000,000	879,086	0.0
FWD Ltd VRN 0% Perp-RegS	美元 18,300,000	17,696,997	0.6				

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
开曼群岛 (续)				哥伦比亚(0.0%)			
Tencent Holdings 3.84% 22/04/51-RegS	美元 15,000,000	15,877,530	0.6	Rep of Colombia 4.375% 21/03/23	哥伦比亚比索 500,000,000	134,363	0.0
Times China Hldg Ltd 5.75% 14/01/27-RegS	美元 17,600,000	15,889,766	0.6	香港(11.9%)			
Times China Hldg Ltd 6.75% 08/07/25-RegS	美元 2,000,000	1,869,527	0.1	AIA Group 3.2% 16/09/40-RegS	美元 6,000,000	6,076,091	0.2
Times China Hldgs 6.75% 07/23-RegS	美元 4,500,000	4,436,120	0.2	AIA Group VRN 29/12/49- RegS	美元 9,500,000	9,788,715	0.4
Yuzhou Group 6.35% 13/01/27-RegS	美元 5,900,000	3,901,241	0.1	Airport Authority HK VRN 2.1% 31/12/49-RegS	美元 4,200,000	4,258,605	0.2
Yuzhou Group Hldgs 6% 25/10/23-RegS	美元 6,700,000	5,382,546	0.2	Airport Authority HK VRN 2.4% 31/12/49-RegS	美元 5,200,000	5,213,553	0.2
Yuzhou Group Hldgs 7.375% 1/26-RegS	美元 2,000,000	1,360,278	0.0	Anhui Transportation Hk 1.618% 26/08/26-RegS	美元 10,200,000	10,102,162	0.4
Yuzhou Group VRN 5.375% Perp-RegS	美元 15,900,000	10,438,477	0.4	Bank of Communication Hk VRN 2.304% 08/07/31-RegS	美元 14,250,000	14,097,910	0.5
Zhongsheng Group 3% 13/01/26-RegS	美元 6,900,000	7,030,824	0.3	Bank of East Asia VRN 5.625%Perp-RegS	美元 9,400,000	9,676,560	0.4
中国(7.2%)				Bank of East Asia VRN 4% 11/26-RegS	美元 11,900,000	12,116,811	0.4
Bank of China VRN 3.6% Perp-RegS	美元 14,800,000	15,550,360	0.6	Bank of East Asia VRN 5.825% 31/12/49-RegS	美元 6,200,000	6,640,844	0.2
Bank of Communication VRN 3.8% 31/12/49- RegS	美元 16,300,000	17,437,363	0.6	Bank of East Asia VRN 5.875% Perp-RegS	美元 3,000,000	3,127,045	0.1
CCB Life Ins VRN 4.5% 21/4/77-RegS	美元 15,000,000	15,506,520	0.6	CDBL Funding I 4.25% 02/12/24-RegS	美元 5,500,000	6,009,430	0.2
CDB Fin Leasing VRN 2.875% 9/30-RegS	美元 12,600,000	12,782,632	0.5	China Clean Energy 4.282% 12/25-RegS	美元 3,500,000	3,811,315	0.1
China CITIC Bk VRN 4.625% 2/29-RegS	美元 10,050,000	10,724,652	0.4	Chong Hing Bk VRN 3.876% 07/27-RegS	美元 17,800,000	18,057,109	0.7
China Constr VRN 2.45% 24/6/30-RegS	美元 5,100,000	5,207,597	0.2	Chong Hing Bk VRN 5.7% Perp-RegS	美元 6,300,000	6,582,406	0.2
China Govt 3.02% 27/05/31-RegS	人民币 210,000,000	33,238,772	1.2	CITIC Ltd 3.875% 28/02/27-RegS	美元 14,700,000	16,072,129	0.6
ENN Energy 2.625% 17/09/30-RegS	美元 6,800,000	6,757,808	0.2	CMB International Leasin 2% 04/02/26-RegS	美元 2,400,000	2,405,174	0.1
ICBC Ltd VRN 3.2% Perp- RegS	美元 7,500,000	7,518,407	0.3	CMB International Leasin 2.75% 12/08/30-RegS	美元 7,600,000	7,511,795	0.3
ICBC Ltd VRN 3.58% Perp- RegS	美元 13,500,000	13,926,246	0.5	CMB Wing Lung Bk VRN 3.75%11/27-RegS	美元 8,000,000	8,285,020	0.3
ICBCIL Finance 1.75% 25/08/25-RegS	美元 14,800,000	14,840,937	0.5	CNAC HK Finbrid VRN 3.35% Perp-RegS	美元 23,700,000	24,100,778	0.9
Kunming Rail 3.5% 12/12/22-RegS	美元 9,600,000	9,854,306	0.4	CNAC HK Finbridge 3.875% 06/29-RegS	美元 10,500,000	11,373,255	0.4
Kunming Traffic Inv 6.2% 6/22-RegS	美元 11,000,000	10,904,178	0.4	Gemdale Ever 5.6% 14/06/22-RegS	美元 1,400,000	1,446,793	0.1
RKPF Overseas 7.875% 01/02/23-RegS	美元 1,300,000	1,328,470	0.0	GLP China Holdings Ltd 2.95% 29/03/26-RegS	美元 9,400,000	9,485,069	0.3
Shougang Group 4% 23/05/24-RegS	美元 16,000,000	17,103,252	0.6	HBIS Group HK 3.75% 18/12/22-RegS	美元 7,000,000	7,122,207	0.3
Zhengzhou Real 3.95% 09/10/22-RegS	美元 4,400,000	4,588,387	0.2	HK Intl (Qingdao) 3.9% 11/22-RegS	美元 7,600,000	7,867,267	0.3
				HK Intl (Qingdao) 4.25% 12/22-RegS	美元 9,900,000	10,308,994	0.4

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
香港 (续)				印度尼西亚 (9.7%)			
HK Red Star Macal 3.375% 21/09/22-RegS	美元 9,500,000	8,606,406	0.3	Adaro Indonesia 4.25% 31/10/24-RegS	美元 10,000,000	10,375,464	0.4
ICBCIL Finance 3.625% 19/05/26-RegS	美元 13,000,000	14,167,552	0.5	Bank Mandiri 4.75% 13/5/25- RegS	美元 3,500,000	3,946,864	0.1
Jinan Urb Const Intl Inv 2.4% 23/09/26-RegS	美元 5,800,000	5,823,428	0.2	Bank Negara Indonesia VRN 4.3% 31/12/49-RegS	美元 15,500,000	15,537,580	0.6
Lenovo Group Ltd 3.421% 02/11/30-RegS	美元 7,700,000	8,140,903	0.3	Bank Tabungan Negara 4.2% 1/25-RegS	美元 6,300,000	6,505,212	0.2
MCC Holding HK Corp VRN 31/12/49-RegS	美元 10,600,000	10,951,846	0.4	Bk Mandiri Persero 3.75% 11/4/24-RegS	美元 2,200,000	2,369,658	0.1
MTR Corp 1.625% 19/08/30- RegS	美元 9,600,000	9,376,040	0.3	Hutama Karya 3.75% 11/05/30-RegS	美元 12,500,000	13,733,067	0.5
Weichai Intl HK VRN 3.75% Perp-RegS	美元 14,500,000	14,837,558	0.5	Hyundai Motor Manu Indo 1.75% 06/05/26-RegS	美元 6,900,000	6,922,415	0.2
Xiaomi Best Time Intl 3.375% 29/04/2030-RegS	美元 15,900,000	16,618,219	0.6	Indonesia Asahan 6.757% 11/48-RegS	美元 12,200,000	16,019,533	0.6
Xiaomi Best Time Intl 4.1% 14/07/51-RegS	美元 4,700,000	4,831,217	0.2	Indonesia Asahan Alumini 5.8% 15/05/50-RegS	美元 12,000,000	14,335,513	0.5
Yango Justice Intl 10.25% 3/22-RegS	美元 10,100,000	8,416,556	0.3	Indonesia Gov 8.25% 印尼盾	200,000,000,000	16,172,909	0.6
Yango Justice Intl 9.25% 15/04/23-RegS	美元 2,000,000	1,677,066	0.1	Indonesia Gov NoFR59 7% 印尼盾	130,000,000,000	9,974,172	0.4
				Indonesia Govt NoFR64 6.125% 15/05/28 印尼盾	273,000,000,000	19,879,712	0.7
				Indonesia Govt NoFR71 9% 15/03/29 印尼盾	200,000,000,000	16,410,274	0.6
				Indonesia Govt NoFR87 6.5% 15/02/31 印尼盾	345,000,000,000	24,581,398	0.9
				Pelabuhan Indonesia 5.375% 5/45-RegS	美元 15,000,000	18,080,379	0.7
				Pertamina Persero 5.625% 20/05/43	美元 5,000,000	6,047,339	0.2
				Perusahaan Listrik 4% 30/06/50-RegS	美元 10,000,000	9,701,111	0.4
				Perusahaan Listrik 5.375%01/29-RegS	美元 7,000,000	8,183,729	0.3
				Perusahaan Listrik Neg 4.375% 05/02/50-RegS	美元 9,000,000	9,126,815	0.3
				Perusahaan Listrik Neg 4.875% 17/07/49-RegS	美元 3,000,000	3,240,813	0.1
				Perusahaan Listrik Neg 6.25% 25/01/49-RegS	美元 2,000,000	2,556,167	0.1
				Perusahaan Listrik Negar 5.25% 24/10/42-RegS	美元 2,000,000	2,286,452	0.1
				Perusahaan Listrik Negar 6.15% 21/05/48-RegS	美元 13,000,000	16,366,458	0.6
				PT Pertamina 4.175% 21/01/50-RegS	美元 13,000,000	13,235,535	0.5
				泽西市 (0.2%)			
				West China Cement 4.95% 08/07/26-RegS	美元 7,000,000	6,899,001	0.2
				韩国 (3.9%)			
				Busan Bank 3.625% 25/07/26-RegS	美元 17,700,000	18,901,349	0.7

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
韩国 (续)				荷兰(1.7%)			
Heungkuk Life VRN 4.475%				Greenko Dutch Bv 3.85%			
11/47-RegS	美元 17,500,000	18,137,024	0.7	29/03/26	美元 12,000,000	12,044,153	0.4
Hyundai Capital Services				Minejesa Capital 5.625%			
1.25% 08/02/26-RegS	美元 3,500,000	3,454,935	0.1	10/08/37-RegS	美元 2,000,000	2,131,438	0.1
Kookmin Bank 4.5% 01/02/29-RegS	美元 9,900,000	11,287,733	0.4	Royal Capital VRN 4.875% Perp-RegS	美元 16,200,000	17,289,788	0.6
Korea Inv & Secs 2.125%				Minejesa Capital 4.625%			
19/07/26-RegS	美元 14,000,000	14,106,316	0.5	08/30-RegS	美元 16,000,000	16,718,593	0.6
Shinhan Bank 3.75%				巴基斯坦(0.6%)			
20/09/27-RegS	美元 6,000,000	6,555,827	0.3	Islamic Rep Pakistan 6.875%			
Shinhan Fin Grp VRN 3.34%				12/27-RegS	美元 15,000,000	15,460,392	0.6
2/30-RegS	美元 11,200,000	11,716,573	0.4	菲律宾(2.7%)			
Shinhan Fin Grp VRN 31/12/49-RegS	美元 8,000,000	8,041,006	0.3	Megaworld Corp 4.125%			
Woori Bank VRN 4.25% Perp-RegS	美元 12,900,000	13,695,709	0.5	30/07/27-RegS	美元 14,400,000	15,547,544	0.6
马来西亚(2.4%)				Metropolitan Bank 2.125%			
Axiata SPV5 Labuan Ltd				01/26-RegS	美元 17,000,000	17,432,414	0.6
3.064% 19/08/50-RegS	美元 5,000,000	4,807,918	0.2	PLDT Inc 2.5% 23/01/31-RegS	美元 3,600,000	3,628,459	0.1
GOHL Capital 4.25% 24/01/27-RegS	美元 16,900,000	17,956,854	0.7	Rizal Comm Bank VRN 6.5% Perp-RegS	美元 15,500,000	16,616,851	0.6
Malaysia Government 3.75%				SMC Global Power Hld VRN 5.95% 31/12/49-RegS	美元 1,100,000	1,136,434	0.1
22/05/40-RegS	林吉特 75,000,000	17,382,581	0.6	SMC Global Power Hld VRN 6.5% 31/12/49-RegS	美元 7,300,000	7,685,810	0.3
Malaysia Government 4.254%				SMC Global Power Hld VRN 7% 31/12/49-RegS	美元 10,000,000	10,776,461	0.4
31/05/35-RegS	林吉特 33,000,000	8,292,461	0.3	新加坡(6.2%)			
Malaysia Investmt Issu 3.422% 30/09/27	林吉特 13,000,000	3,137,732	0.1	Abja Investment 5.45%			
Malaysian Government 3.733%				24/01/28-RegS	美元 9,200,000	10,139,210	0.4
15/06/28-RegS	林吉特 20,000,000	4,954,644	0.2	BOC Aviation 3.25%			
TNB Global Vent 4.851%				29/04/25-RegS	美元 4,800,000	5,107,412	0.2
1/11/28-RegS	美元 7,100,000	8,374,123	0.3	Continuum Energy 4.5%			
毛里求斯(1.8%)				09/02/27	美元 9,400,000	9,728,336	0.4
Azure Power Energy 3.575%				DBS Grp Hldgs VRN 3.3%			
19/08/26-Regs	美元 6,100,000	6,219,992	0.2	Perp-RegS	美元 9,000,000	9,285,090	0.3
Azure Power Solar 5.65%				GLP Pte 3.875% 04/06/25-RegS	美元 19,600,000	20,831,836	0.8
12/24-RegS	美元 8,750,000	9,380,863	0.4	Indika Energy 5.875%			
Greenko Mauritius 6.25%				09/11/24-RegS	美元 15,600,000	16,108,460	0.6
21/2/23-RegS	美元 13,500,000	13,955,807	0.5	Indika Energy Capital Iv 8.25% 22/10/25-RegS	美元 5,200,000	5,604,833	0.2
Greenko Solar 5.55%				Jollibee Worldwide P VRN 3.9% 31/12/49-RegS	美元 2,000,000	2,028,973	0.1
29/01/25-RegS	美元 3,300,000	3,410,020	0.1	LLPL Capital Pte 6.875%			
India Green Energy Hld 5.375% 29/04/24-RegS	美元 5,000,000	5,316,312	0.2	4/2/39-RegS	美元 13,800,000	14,706,742	0.5
India Green Power Hol 4% 22/02/27	美元 10,150,000	10,270,108	0.4	Medco Bell 6.375% 30/01/27-RegS	美元 4,000,000	4,083,288	0.1
墨西哥(1.8%)				Medco Oak Tree 7.375%			
Mexican Bds Desarr Nom20 8.5% 05/29	墨西哥比索 5,189,000	27,719,533	1.0	14/05/26-RegS	美元 3,000,000	3,280,893	0.1
Mexico Utd States 7.75% 29/05/31	墨西哥比索 4,400,000	22,495,188	0.8	Medco Platinum 6.75%			
蒙古(0.3%)				30/01/25-RegS	美元 17,600,000	18,441,412	0.7
Mongolia Intl Bond 3.5%				OCBC VRN 1.832% 10/09/30-RegS	美元 15,300,000	15,288,199	0.6
07/07/27-RegS	美元 6,000,000	5,892,520	0.2				
Mongolia Intl Bond 4.45%							
07/07/31-RegS	美元 2,000,000	1,966,033	0.1				

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	占资产			单位数目	占资产		
		公允价值 美元	净值百 分比			公允价值 美元	净值百 分比	
新加坡 (续)								
Parkway Pantai VRN 4.25% Perp-RegS	美元 13,800,000	14,035,919	0.5	Castle Peak Pwr Fin 2.125% 03/03/31-RegS	美元 6,900,000	6,762,261	0.2	
PSA Intl Pte 2.25% 30/04/30-RegS	美元 3,000,000	3,092,159	0.1	Castle Peak Pwr Fin 2.2% 06/30-RegS	美元 7,200,000	7,161,300	0.3	
United Overseas VRN 3.875%PERP-RegS	美元 16,000,000	16,877,320	0.6	CCCI Treasure VRN 3.425% Perp-RegS	美元 6,000,000	6,187,833	0.2	
斯里兰卡(0.5%)								
Rep of Sri Lanka 6.2% 11/05/27-RegS	美元 4,000,000	2,558,764	0.1	CCCI Treasure VRN 3.65% Perp-RegS	美元 4,200,000	4,357,607	0.2	
Rep of Sri Lanka 6.75% 18/04/28-RegS	美元 5,000,000	3,217,513	0.1	Central Plaza Dev VRN 5.75% 31/12/49-RegS	美元 9,900,000	9,176,131	0.3	
Rep of Sri Lanka 6.85% 03/11/25-RegS	美元 2,000,000	1,321,322	0.0	Champion Path Holdings 4.5% 27/01/26-RegS	美元 1,400,000	1,444,446	0.1	
Rep of Sri Lanka 6.85% 14/03/24-RegS	美元 7,000,000	4,509,153	0.2	Champion Path Holdings 4.85% 27/01/28-RegS	美元 2,800,000	2,858,829	0.1	
Rep of Sri Lanka 7.55% 28/03/30-RegS	美元 3,000,000	1,841,128	0.1	Champion Sin VRN 8.125% Perp-RegS	美元 18,000,000	18,455,865	0.7	
国际(1.3%)								
Corp Andina Fomento 6.77% 5/28-RegS	哥伦比亚比索 46,000,000,000	12,000,250	0.4	China Railway Xunjie 3.25%7/26-RegS	美元 6,500,000	6,926,156	0.3	
Intl Bk Recon & Develop 6.75% 04/02/24-RegS	巴西雷亚尔 99,755,000	18,342,307	0.7	Chinaalco Capital Hlgs 2.125% 03/06/26-RegS	美元 5,700,000	5,700,708	0.2	
Intl Finance Corp 6.2% 27/07/22-RegS	巴西雷亚尔 34,890,000	6,362,930	0.2	Chouzhou Intl Inv 3.15%11/8/23-RegS	美元 14,600,000	14,939,143	0.5	
泰国(2.6%)								
Bangkok Bank VRN 5% 31/12/49-RegS	美元 9,000,000	9,381,250	0.3	Chouzhou Intl Inv 4.5% 30/5/22-RegS	美元 2,200,000	2,278,025	0.1	
Kasikornbank VRN 3.343% 10/31-RegS	美元 13,100,000	13,432,703	0.5	CLP Power HK Fin 2.125% 06/30-RegS	美元 12,100,000	12,038,429	0.4	
Krung Thai Bank/Caym VRN 4.4% 31/12/49-RegS	美元 13,200,000	13,213,178	0.5	CN Huaneng VRN 2.85% 31/12/49-RegS	美元 5,900,000	6,076,331	0.2	
Thai Oil Trsry Center 3.5% 17/10/49-RegS	美元 9,000,000	8,053,645	0.3	CN Huaneng VRN 3.08% 29/12/49-RegS	美元 5,900,000	6,120,614	0.2	
Thailand Govt Bond 2.875% 17/12/28	泰铢 870,000,000	28,423,114	1.0	CNPC Global Cap 2% 23/06/30-RegS	美元 22,100,000	21,591,466	0.8	
美国(1.6%)								
Inter American Devel Bk 5% 12/02/24-RegS	印度卢比 500,000,000	6,943,056	0.2	CNPC Global Cap 1.35% 23/06/25-RegS	美元 6,500,000	6,485,840	0.2	
TSV Infl Ix N/B 0.125% 15/07/31-RegS	美元 33,028,400	37,084,164	1.4	Dianjian Haiyu VRN 3.45% Perp-RegS	美元 6,400,000	6,531,339	0.2	
维京群岛(22.3%)								
Ampeace Ltd 2.25% 22/10/30-RegS	美元 5,800,000	5,758,284	0.2	Dianjian Haiyu VRN 4.3% Perp-RegS	美元 2,100,000	2,221,315	0.1	
BAIC Finance Inv 2% 16/03/24-RegS	美元 2,700,000	2,720,796	0.1	Easy Tactic 8.125% 11/07/24- RegS	美元 5,100,000	3,473,093	0.1	
Beijing Capital 2.8% 22/10/30-RegS	美元 13,400,000	13,506,813	0.5	Easy Tactic 8.125% 27/02/23- RegS	美元 5,200,000	3,799,326	0.1	
Bluestar Fin Hldgs 3.375% 7/24-RegS	美元 19,700,000	20,777,181	0.8	ENN Clean Energy 3.375% 12/05/26-RegS	美元 7,300,000	7,454,630	0.3	
Bluestar Fin Hldgs VRN 3.875% 31/12/49-RegS	美元 10,800,000	11,155,763	0.4	Fortune Star 5% 18/05/26- RegS	美元 14,500,000	14,630,590	0.5	
CAS Capital Nol VRN 4% 31/12/49-RegS	美元 19,700,000	20,143,797	0.7	Fortune Star 5.95% 29/01/23-RegS	美元 4,500,000	4,608,159	0.2	
				Fortune Star 6.75% 02/07/23-RegS	美元 15,400,000	16,197,066	0.6	
				Franshion Brilliant VRN 4% Perp-RegS	美元 12,700,000	12,755,522	0.5	
				Gemstones Intl 12% 10/03/23-RegS	美元 26,000,000	24,755,665	0.9	
				Greenland Global 5.9% 12/02/23-RegS	美元 20,400,000	15,238,097	0.6	
				Greenland Global 6.25% 12/22-RegS	美元 6,100,000	5,556,997	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	占资产			单位数目	占资产	
		公平值 美元	净值百 分比			公平值 美元	净值百 分比
维京群岛 (续)				UHI Capital Ltd 3% 12/06/24- RegS	美元 9,000,000	9,464,772	0.3
Guangzhou Metro 1.507% 17/9/25-RegS	美元 5,000,000	4,907,350	0.2	Health Driven 5.5% 17/08/23- RegS	美元 3,900,000	3,920,230	0.1
Haitian Bvll Int Invst 2.8% 04/11/23-RegS	美元 12,400,000	12,721,809	0.5			2,668,285,291	97.5
HKT Capital No43 14/07/26- RegS	美元 5,200,000	5,502,207	0.2				
Hopson Capital International 5.8% 12/01/22-RegS	美元 17,400,000	17,488,995	0.6	(II) 衍生性产品 (-0.1%)			
Huarong Fin 2017 VRN 4% Perp-RegS	美元 20,100,000	19,014,600	0.7	远期外汇合约 (-0.2%)		(5,386,884)	(0.2)
Huarong Fin 2019 3.375% 02/30-RegS	美元 11,100,000	9,445,753	0.3	期货 (0.1%)			
Huarong Fin 2019 4.5% 29/05/29-RegS	美元 7,500,000	7,033,125	0.3	US 10yr Note (CBT) Fut 12/21	(371)	515,922	0.0
Huarong Finance 2019 3.875% 13/11/29-RegS	美元 6,169,000	5,551,200	0.2	US 5yr Note (CBT) Fut 12/21	(1,416)	829,686	0.1
Hysan (MTN) 2.875% 02/06/27-RegS	美元 14,000,000	14,824,299	0.5	US Long Bond (CBT) Fut 12/21	72	(92,250)	(0.0)
JIC Zhixin 3.5% 24/11/27- RegS	美元 2,000,000	2,186,144	0.1			(4,133,526)	(0.1)
King Power Cap 5.625% 03/11/24-RegS	美元 3,900,000	4,479,579	0.2	总上市投资		2,664,151,765	97.4
Minmetals Boun VRN 3.375% Perp-RegS	美元 5,200,000	5,398,900	0.2	其他净资产		71,351,858	2.6
Minmetals Bounteous 4.2% 07/26-RegS	美元 10,000,000	10,963,417	0.4	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		2,735,503,623	100.0
New Metro Global 4.5% 02/05/26-RegS	美元 15,000,000	13,904,025	0.5				
New Metro Global 4.8% 15/12/24-RegS	美元 7,700,000	7,384,048	0.3	总投资, 按成本		2,661,725,855	
New Metro Global 6.5% 20/05/22-RegS	美元 1,850,000	1,871,404	0.1				
New Metro Global 7.5% 12/21-RegS	美元 8,000,000	8,157,664	0.3				
NWD MTN Ltd 4.125% 18/07/29-RegS	美元 16,400,000	16,550,135	0.6				
RKPF Overseas 2019 A 5.9% 05/03/25-RegS	美元 2,000,000	1,970,192	0.1				
RKPF Overseas 2020 A 5.2% 12/01/26-RegS	美元 14,900,000	13,959,886	0.5				
RKPF Overseas 6.7% 30/09/24-RegS	美元 17,100,000	17,139,862	0.6				
RongXingDa Dev 8% 24/04/22-RegS	美元 14,671,000	7,998,202	0.3				
SD Iron & Steel Xinheng 4.8% 28/07/24-RegS	美元 8,800,000	8,911,100	0.3				
SD Iron & Steel Xinheng 6.85% 25/09/22-RegS	美元 9,300,000	9,612,031	0.4				
Sinopec Grp 2018 2.15% 13/5/25-RegS	美元 6,900,000	7,130,023	0.3				
Sinopec Grp 2018 2.7% 13/05/30-RegS	美元 11,900,000	12,336,730	0.5				
Studio City Fin 5% 15/01/29- RegS	美元 3,200,000	2,989,026	0.1				
Studio City Finance 6% 15/7/25-RegS	美元 11,500,000	11,546,192	0.4				
Talent Yield 3.125% 06/05/31-RegS	美元 5,400,000	5,677,786	0.2				

投资组合持有变动表

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	
	2021	2020
上市投资		
债务证券		
维京群岛	22.3	20.8
开曼群岛	14.1	11.9
香港	11.9	10.4
印度尼西亚	9.7	11.3
中国	7.2	12.2
新加坡	6.2	5.9
印度	4.1	5.0
韩国	3.9	5.1
菲律宾	2.7	1.7
泰国	2.6	0.5
马来西亚	2.4	2.9
毛里求斯	1.8	1.5
墨西哥	1.8	1.1
荷兰	1.7	1.3
美国	1.6	0.4
国际	1.3	0.4
百慕大	0.6	1.0
巴基斯坦	0.6	0.8
斯里兰卡	0.5	0.3
蒙古	0.3	-
泽西市	0.2	-
哥伦比亚	0.0	0.0
巴哈马群岛	-	0.5
英国	-	0.3
越南	-	0.3
卢森堡	-	0.2
衍生性产品		
期货	0.1	(0.0)
远期外汇合约	(0.2)	0.1
总上市投资	<u>97.4</u>	<u>95.9</u>
其他净资产	<u>2.6</u>	<u>4.1</u>
截至九月三十日可赎回份额持有人应占净资产	<u><u>100.0</u></u>	<u><u>100.0</u></u>

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	14.6
最高总敞口	137.2
平均总敞口	45.0

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	2.5
最高净敞口	12.9
平均净敞口	6.9

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	101,180,556	167,618,765
应收经纪款项	180,000	-
分配应收款项	10,504,265	17,442,187
保证金	1,329,609	1,517,682
衍生性产品 [附注 40(a), 11]	10,612,400	14,308,682
投资 [附注 40(a)]	2,668,285,291	2,970,845,481
利息及其他应收款项	3,516	8,777
总资产	<u>2,792,095,637</u>	<u>3,171,741,574</u>
负债		
透支经纪款项	-	391,036
应付经纪款项	-	8,008,676
赎回应付款项	27,404,073	38,349,734
应付收益分配 [附注 6]	11,544,210	10,520,730
衍生性产品 [附注 40(a), 11]	14,745,926	12,715,877
其他应付款项	2,897,805	3,351,092
总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)	<u>56,592,014</u>	<u>73,337,145</u>
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	<u>2,735,503,623</u>	<u>3,098,404,429</u>

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:

汇丰机构信托服务(亚洲)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]	167,913,769	209,323,235
存款利息 [附注 8(i), 8(j)]	240,230	1,336,753
汇兑净亏损	(2,412,689)	(7,374,627)
其他收入 [附注 8(i)]	1,177,135	717,427
	<u>166,918,445</u>	<u>204,002,788</u>
支出		
管理费用 [附注 8(e)]	32,755,978	31,199,004
受托人费用 [附注 8(g)]	835,686	797,965
托管费用及银行费用 [附注 8(i), 8(j)]	745,812	731,902
基金注册登记机构费用 [附注 8(h)]	478,388	450,237
交易成本 [附注 8(i)]	76,398	1,543,640
法律及专业费用	58,390	42,297
印刷及出版支出	31,748	14,435
核数师酬金	26,005	34,904
估值费用 [附注 8(e)]	17,150	17,430
其他经营费用	28,660	36,242
	<u>35,054,215</u>	<u>34,868,056</u>
净经营利润	<u>131,864,230</u>	<u>169,134,732</u>
财务成本		
收益分配 [附注 6]	(142,721,548)	(106,873,456)
利息支出 [附注 8(i)]	(324)	(2,896)
	<u>(142,721,872)</u>	<u>(106,876,352)</u>
除税前(亏损)/利润	<u>(10,857,642)</u>	<u>62,258,380</u>
税项 [附注 7]	(1,362,190)	(1,423,547)
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之(减少)/增加	<u>(12,219,832)</u>	<u>60,834,833</u>

第十一至四十九页之附注乃属本财务报表之一部分。

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	3,098,404,429	3,314,484,481
分配可赎回份额 [附注 3]	2,042,778,892	2,375,810,397
赎回可赎回份额 [附注 3]	(2,393,459,866)	(2,652,725,282)
净赎回	(350,680,974)	(276,914,885)
	2,747,723,455	3,037,569,596
可赎回份额持有人应占净资产及 总综合收益之(减少)/增加	(12,219,832)	60,834,833
年末可赎回份额持有人应占净资产	2,735,503,623	3,098,404,429

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	(2,398,852,507)	(3,521,251,907)
出售投资及衍生性产品所得款项	2,866,864,121	3,932,903,593
已收利息	241,852	1,339,887
保证金之减少	188,073	2,796,164
已付交易费用	(76,942)	(1,544,510)
透支经纪款项之减少	(391,036)	(84,653)
已付基金注册登记机构费用	(489,084)	(457,226)
已付受托人费用	(840,324)	(804,315)
已付税项	(1,801,555)	(1,756,994)
已付管理费用	(32,960,859)	(31,422,431)
其他	(2,617,309)	(7,774,562)
经营业务所产生之现金净额	429,264,430	371,943,046
融资活动		
已付利息	(324)	(2,896)
分配可赎回份额所得款项	2,049,716,814	2,388,965,047
赎回可赎回份额付款	(2,404,405,527)	(2,640,602,511)
已付收益分配	(141,698,068)	(104,979,982)
融资活动所运用之现金净额	(496,387,105)	(356,620,342)
现金及现金等价物之(减少)/增加	(67,122,675)	15,322,704
年初现金及现金等价物	167,618,765	152,014,642
现金及现金等价物之汇兑收益	684,466	281,419
年末现金及现金等价物	101,180,556	167,618,765
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	101,180,556	167,618,765

第十一至四十九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

摩根亚洲总收益债券基金（“本基金”）根据二零零四年十一月三十日的信托契约（经修订）（“信托契约”）成立，受香港法律监管。本基金已获香港证券及期货事务监察委员会（“证监会”）认可。

二零二零年四月三十日之前，本基金之投资目标为通过一个主要投资于亚洲债券及其他债务证券之主动管理组合，致力提供具竞争力的总回报（包括资本增长及定息收益）。

二零二零年四月三十日之后，本基金之投资目标为通过一个主要投资（即至少为资产净值总额的 70%）于亚洲债券及其他债务证券之主动管理组合，致力提供具竞争力的总回报（包括资本增长及定息收益）。

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

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

2 主要会计政策

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

本基金之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。

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。

信贷违约的掉期是以庄家逐日盯市制度的报价和估值变化为基础的，如有，将会入账为综合收益表中的未实现收益或亏损。

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

公允价值级次分层间的转授

在公允价值级次分层之间的转授视为于报告期间开始时已发生。

(c) 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。

(d) 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。

银行现金及短期存款利息收入乃按实际利率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。

(e) 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。

(f) **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。

(g) **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。

(h) **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。

(i) **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。

(j) **销售份额所得款项及赎回份额支付款项**

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

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

(k) **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	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	23,139,739.418	15,637,072.647	510,399.441	422,240,159.913	10,763,076.055
总分配	16,206,340.663	7,595,503.923	518,643.141	354,182,209.391	4,088,819.913
总赎回	(16,351,020.738)	(8,330,625.316)	(426,904.318)	(321,842,661.276)	(5,644,812.691)
年末	22,995,059.343	14,901,951.254	602,138.264	454,579,708.028	9,207,083.277
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净资产	191,366,724	125,506,796	5,300,020	4,079,907,047	76,304,693
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	8.32	8.42	8.80	8.98	8.29
	人民币	人民币	美元	美元	人民币
已发行份额数目:					
年初	1,116,424.680	403,471,907.385	195,694.858	68,929,752.615	187,806,607.220
总分配	1,368,619.657	263,021,737.884	5,359,382.530	51,811,902.550	27,597,545.200
总赎回	(1,402,717.767)	(194,602,684.981)	(4,600,634.487)	(57,302,725.771)	(157,304,824.930)
年末	1,082,326.570	471,890,960.288	954,442.901	63,438,929.394	58,099,327.490
	人民币	人民币	美元	美元	人民币
可赎回份额持有人应占净资产	15,519,544	4,067,566,571	12,949,102	652,534,891	791,153,106
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	14.34	8.62	13.57	10.29	13.62

2021

	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	77,860,626.410	41,449,894.640	3,677,328.270
总分配	13,626,532.440	28,114,061.900	788,677.190
总赎回	(30,098,723.660)	(38,658,023.040)	(1,220,771.440)
年末	61,388,435.190	30,905,933.500	3,245,234.020
	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应占净 资产	571,858,247	374,577,855	30,423,683
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	9.32	12.12	9.37

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	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	23,120,286.731	15,239,581.017	397,919.405	413,104,210.370	10,008,306.114
总分配	16,064,592.019	8,111,720.074	378,971.776	304,797,019.002	5,438,385.076
总赎回	(16,045,139.332)	(7,714,228.444)	(266,491.740)	(295,661,069.459)	(4,683,615.135)
年末	23,139,739.418	15,637,072.647	510,399.441	422,240,159.913	10,763,076.055
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净 资产	200,080,050	136,678,850	4,665,897	3,917,117,050	92,667,985
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	8.65	8.74	9.14	9.28	8.61

2020

	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲 份额(累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	7,498,386.140	417,317,877.377	208,910.265	51,306,924.587	455,943,516.850
总分配	273,944.590	152,391,440.568	65,239.111	66,923,555.375	335,233,595.110
总赎回	(6,655,906.050)	(166,237,410.560)	(78,454.518)	(49,300,727.347)	(603,370,504.740)
年末	<u>1,116,424.680</u>	<u>403,471,907.385</u>	<u>195,694.858</u>	<u>68,929,752.615</u>	<u>187,806,607.220</u>
	人民币	人民币	美元	美元	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	<u>15,430,879</u>	<u>3,618,794,584</u>	<u>2,621,058</u>	<u>736,162,668</u>	<u>2,461,936,140</u>
可赎回份额持有人应占净 资产(每份额)	<u>13.82</u>	<u>8.97</u>	<u>13.39</u>	<u>10.68</u>	<u>13.11</u>
	PRC 人民币对冲份额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额		
已发行份额数目:					
年初	89,548,206.750	38,078,109.890	3,869,878.100		
总分配	29,768,566.130	21,759,339.160	1,473,634.290		
总赎回	(41,456,146.470)	(18,387,554.410)	(1,666,184.120)		
年末	<u>77,860,626.410</u>	<u>41,449,894.640</u>	<u>3,677,328.270</u>		
	人民币	美元	美元		
可赎回份额持有人应占净 资产	<u>754,021,450</u>	<u>495,983,658</u>	<u>35,772,394</u>		
可赎回份额持有人应占净 资产(每份额)	<u>9.68</u>	<u>11.97</u>	<u>9.73</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。

(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 40(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	总额 美元
<u>2021</u>				
银行现金	101,180,556	-	-	101,180,556
保证金	1,329,609	-	-	1,329,609
衍生性产品	1,253,358	-	-	1,253,358
投资（注*）	97,453,623	918,702,484	1,652,129,184	2,668,285,291
总利率敏感性缺口	201,127,146	918,702,484	1,652,129,184	2,772,048,814
<u>2020</u>				
银行现金	167,618,765	-	-	167,618,765
保证金	1,517,682	-	-	1,517,682
衍生性产品	(76,688)	-	-	(76,688)
投资（注*）	144,082,610	1,302,224,761	1,524,538,110	2,970,845,481
总利率敏感性缺口	313,142,369	1,302,224,761	1,524,538,110	3,139,905,240

注：

* 投资的票面息率范围介乎年率 0.00% - 12.00%（二零二零年：年率 0.00% - 13.75%）。

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				
债务证券				
- 维京群岛	609,886,103	22.3	644,286,435	20.8
- 开曼群岛	385,558,758	14.1	370,345,123	11.9
- 香港	324,983,828	11.9	321,030,970	10.4
- 印度尼西亚	265,588,569	9.7	349,240,956	11.3
- 中国	197,269,887	7.2	378,577,213	12.2
- 新加坡	168,640,082	6.2	184,402,968	5.9
- 印度	113,291,939	4.1	156,154,625	5.0
- 韩国	105,896,472	3.9	157,383,430	5.1
- 其他	497,169,653	18.1	409,423,761	13.2
	2,668,285,291	97.5	2,970,845,481	95.8
衍生性产品				
- 远期外汇合约	9,266,792	0.3	14,308,682	0.5
- 期货	1,345,608	0.1	-	-
	2,678,897,691	97.9	2,985,154,163	96.3
负债				
衍生性产品				
- 远期外汇合约	(14,653,676)	(0.5)	(12,639,189)	(0.4)
- 期货	(92,250)	(0.0)	(76,688)	(0.0)
	(14,745,926)	(0.5)	(12,715,877)	(0.4)
总上市投资	2,664,151,765	97.4	2,972,438,286	95.9

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 4.21（二零二零年：4.42）。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 28,791,176 美元（二零二零年：34,237,369 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	145,620,669	+0.8	1,164,965
巴西雷亚尔	15,445,128	+3.4	525,134
加元	99,264,030	+5.4	5,360,258
人民币 (离岸)	759,550,871	+5.1	38,737,094
人民币 (在岸)	33,242,998	+5.4	1,795,122
哥伦比亚比索	12,134,613	+1.1	133,481
欧元	6,782,906	-1.2	(81,395)
港元	(1,361,823)	-0.4	5,447
印度卢比	48,030,722	-0.6	(288,184)
印尼盾	74,763,068	+4.0	2,990,523
日元	339,136	-5.4	(18,313)
韩元	54,786,403	-1.2	(657,437)
马来西亚林吉特	20,056,013	-0.7	(140,392)
墨西哥新比索	30,410,449	+7.5	2,280,784
纽元	59,742,479	+4.4	2,628,669
新加坡元	(45,461,288)	+0.6	(272,768)
英镑	7,234,138	+4.3	311,068
台币	(27,098,326)	+4.0	(1,083,933)
泰铢	28,423,114	-6.3	(1,790,656)
	<u>1,312,905,300</u>		<u>51,599,467</u>
<u>2020</u>			
澳元	143,852,947	+6.3	9,062,736
巴西雷亚尔	28,883,071	-26.1	(7,538,482)
加元	102,512,616	-0.9	(922,614)
人民币 (离岸)	913,763,073	+5.2	47,515,680
人民币 (在岸)	173,497,894	+4.8	8,327,899
哥伦比亚比索	13,671,944	-9.8	(1,339,851)
欧元	(15,200,806)	+7.6	(1,155,261)
港元	74,833,494	+1.2	898,002
印度卢比	33,497,673	-3.9	(1,306,409)
印尼盾	80,756,185	-4.6	(3,714,785)
日元	14,887,455	+2.4	357,299
韩元	43,769,358	+2.3	1,006,695
马来西亚林吉特	55,258,876	+0.8	442,071
墨西哥新比索	49,431,268	-10.6	(5,239,714)
纽元	61,310,831	+5.4	3,310,785
秘鲁新索尔	(58)	-5.9	3
菲律宾比索	(30,051,026)	+6.9	(2,073,521)
新加坡元	684,386	+1.3	8,897
英镑	6,149,552	+4.9	301,328
台币	14,412,997	+7.1	1,023,323
越南盾	7,835,101	+0.1	7,835
	<u>1,773,756,831</u>		<u>48,971,916</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方向变动。

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，本基金在应收经纪款项、分配应收款项或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，在信用评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	101,180,556	167,618,765
应收经纪款项	180,000	-
分配应收款项	10,504,265	17,442,187
保证金	1,329,609	1,517,682
经纪发行的衍生性产品	9,266,792	14,308,682
投资 - 债务证券	2,668,285,291	2,970,845,481
利息及其他应收款项	3,516	8,777
	2,790,750,029	3,171,741,574

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)	2.3	0.5
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	1.7	1.7
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	13.7	19.4
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	39.1	32.5
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	22.2	18.0
标准普尔(B)/穆迪(B)/惠誉(B)	6.5	8.0
标准普尔(CCC)/穆迪(Caa)/惠誉(CCC)	0.8	-
未评级	11.2	15.7
	97.5	95.8

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(AAA)/穆迪(Aaa)/惠誉(AAA)	0.2	-
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	1.9	6.2
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	2.5	4.8
未评级	6.6	4.7
	<u>11.2</u>	<u>15.7</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)	7,859,392	5,671,317
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	93,321,164	161,947,448
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)	1,471,889	879,255
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	10,470,120	14,947,109
托管机构的投资余额		
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	<u>2,668,285,291</u>	<u>2,970,845,481</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	-	-	391,036	-
应付经纪款项	-	-	8,008,676	-
赎回应付款项	27,404,073	-	38,349,734	-
应付收益分配	11,544,210	-	10,520,730	-
衍生性产品	14,648,363	97,563	6,554,157	6,161,720
其他应付款项	2,897,805	-	3,351,092	-
可赎回份额持有人应占净资产	2,735,503,623	-	3,098,404,429	-
总金融负债	<u>2,791,998,074</u>	<u>97,563</u>	<u>3,165,579,854</u>	<u>6,161,720</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	1,329,609	-	(1,328,549)	1,060
衍生性产品	10,544,438	(6,611,814)	-	3,932,624
按公允价值透过损益列账的金融资产	<u>11,874,047</u>	<u>(6,611,814)</u>	<u>(1,328,549)</u>	<u>3,933,684</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>				
衍生性产品	12,927,177	(6,611,814)	(1,328,549)	4,986,814
按公允价值透过损益列账的金融负债	<u>12,927,177</u>	<u>(6,611,814)</u>	<u>(1,328,549)</u>	<u>4,986,814</u>

	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限制的相 关金额		净额 美元
		金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	
2020				
资产				
保证金	1,517,682	-	(1,517,682)	-
衍生性产品	13,916,316	(4,667,817)	-	9,248,499
按公允价值透过损益列账的金融资产	<u>15,433,998</u>	<u>(4,667,817)</u>	<u>(1,517,682)</u>	<u>9,248,499</u>
负债				
透支经纪款项	391,036	-	(391,036)	-
衍生性产品	7,349,822	(4,667,817)	(1,126,646)	1,555,359
按公允价值透过损益列账的金融负债	<u>7,740,858</u>	<u>(4,667,817)</u>	<u>(1,517,682)</u>	<u>1,555,359</u>

(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。
- 按照限制性文件，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）按公平值级次计量之公平值：

	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总额 美元
上市投资				
<u>2021</u>				
<u>资产</u>				
债务证券	-	2,668,285,291	-	2,668,285,291
衍生性产品	1,345,608	9,266,792	-	10,612,400
按公平值透过损益列账的总金融资产	1,345,608	2,677,552,083	-	2,678,897,691
<u>负债</u>				
衍生性产品	92,250	14,653,676	-	14,745,926
按公平值透过损益列账的总金融负债	92,250	14,653,676	-	14,745,926
<u>2020</u>				
<u>资产</u>				
债务证券	-	2,970,845,481	-	2,970,845,481
衍生性产品	-	14,308,682	-	14,308,682
按公平值透过损益列账的总金融资产	-	2,985,154,163	-	2,985,154,163
<u>负债</u>				
衍生性产品	76,688	12,639,189	-	12,715,877
按公平值透过损益列账的总金融负债	76,688	12,639,189	-	12,715,877

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，公平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	(80,408,226)	27,540,509
投资及衍生性产品销售之实现收益	248,321,995	181,782,726
	167,913,769	209,323,235

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 0.0349	23,084,466.386	(564,356)	
加元对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	加元 0.0353	16,151,109.143	(426,556)	
英镑对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	英镑 0.0363	516,526.972	(24,169)	
港元类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	港元 0.0382	440,467,908.960	(2,170,129)	
纽元对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	纽元 0.0355	10,788,959.064	(252,785)	
人民币对冲类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	人民币 0.0584	410,675,897.533	(3,568,597)	
美元类别（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0440	71,069,638.609	(3,127,064)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	人民币 0.0630	77,925,800.540	(730,478)	
PRC 美元份额（每月派息）	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0401	3,723,020.140	(149,293)	
澳元对冲类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	澳元 0.0341	24,367,922.114	(614,734)	
加元对冲类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	加元 0.0351	16,153,143.936	(436,958)	
英镑对冲类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	英镑 0.0361	570,102.852	(27,465)	
港元类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	港元 0.0382	471,232,405.452	(2,322,495)	
纽元对冲类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	纽元 0.0353	10,632,017.284	(264,068)	
人民币对冲类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	人民币 0.0565	429,024,551.741	(3,690,295)	
美元类别（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0440	74,333,057.194	(3,270,655)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	人民币 0.0609	76,715,140.290	(711,261)	
PRC 美元份额（每月派息）	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0401	3,683,340.710	(147,702)	
澳元对冲类别（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	澳元 0.0318	24,540,427.789	(599,726)	
加元对冲类别（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	加元 0.0335	16,198,172.444	(425,332)	
英镑对冲类别（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	英镑 0.0328	611,338.068	(27,290)	
港元类别（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	港元 0.0382	471,963,350.121	(2,325,617)	
纽元对冲类别（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	纽元 0.0343	10,523,473.158	(260,014)	
人民币对冲类别（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	人民币 0.0566	439,266,135.113	(3,822,583)	
美元类别（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0440	73,085,260.411	(3,215,752)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	人民币 0.0612	74,058,810.000	(696,853)	
PRC 美元份额（每月派息）	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0401	3,667,262.340	(147,057)	
澳元对冲类别（每月派息）	2021年1月29日	2021年2月8日	澳元 0.0328	24,993,739.522	(628,742)	
加元对冲类别（每月派息）	2021年1月29日	2021年2月8日	加元 0.0342	16,130,109.173	(430,808)	
英镑对冲类别（每月派息）	2021年1月29日	2021年2月8日	英镑 0.0346	730,981.397	(34,701)	
港元类别（每月派息）	2021年1月29日	2021年2月8日	港元 0.0383	505,446,087.819	(2,496,867)	
纽元对冲类别（每月派息）	2021年1月29日	2021年2月9日	纽元 0.0341	10,641,472.357	(259,854)	
人民币对冲类别（每月派息）	2021年1月29日	2021年2月8日	人民币 0.0540	466,387,814.988	(3,889,626)	
美元类别（每月派息）	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0440	76,032,676.976	(3,345,438)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2021年1月29日	2021年2月8日	人民币 0.0584	74,475,661.540	(671,729)	
PRC 美元份额（每月派息）	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0401	3,545,702.910	(142,183)	
澳元对冲类别（每月派息）	2021年2月26日	2021年3月8日	澳元 0.0343	26,997,331.026	(736,871)	
加元对冲类别（每月派息）	2021年2月26日	2021年3月8日	加元 0.0355	16,517,482.812	(468,478)	
英镑对冲类别（每月派息）	2021年2月26日	2021年3月8日	英镑 0.0365	755,143.127	(38,953)	
港元类别（每月派息）	2021年2月26日	2021年3月8日	港元 0.0382	521,363,238.548	(2,568,457)	
纽元对冲类别（每月派息）	2021年2月26日	2021年3月8日	纽元 0.0356	11,045,285.746	(292,491)	
人民币对冲类别（每月派息）	2021年2月26日	2021年3月8日	人民币 0.0555	487,034,944.886	(4,183,048)	
美元类别（每月派息）	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0440	78,716,651.290	(3,463,533)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2021年2月26日	2021年3月8日	人民币 0.0601	73,590,179.970	(684,438)	
PRC 美元份额（每月派息）	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0401	3,618,474.700	(145,101)	
澳元对冲类别（每月派息）	2021年3月31日	2021年4月13日	澳元 0.0343	26,649,326.974	(696,203)	
加元对冲类别（每月派息）	2021年3月31日	2021年4月13日	加元 0.0353	16,505,216.408	(463,567)	
英镑对冲类别（每月派息）	2021年3月31日	2021年4月13日	英镑 0.0363	711,203.884	(35,619)	
港元类别（每月派息）	2021年3月31日	2021年4月13日	港元 0.0383	519,421,996.791	(2,558,877)	
纽元对冲类别（每月派息）	2021年3月31日	2021年4月13日	纽元 0.0358	11,128,895.344	(279,300)	
人民币对冲类别（每月派息）	2021年3月31日	2021年4月13日	人民币 0.0573	495,182,226.693	(4,324,505)	
美元类别（每月派息）	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0440	76,797,893.233	(3,379,107)	
PRC 人民币对冲份额（每月派息）	2021年3月31日	2021年4月13日	人民币 0.0620	72,211,245.890	(682,360)	
PRC 美元份额（每月派息）	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0401	3,652,846.370	(146,479)	

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 0.0354	26,888,639.616	(718,377)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	加元 0.0244	16,521,488.439	(475,729)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	英镑 0.3367	713,761.836	(36,532)	
港元类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	港元 0.0383	518,433,228.606	(2,557,674)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	纽元 0.0362	10,910,320.091	(285,828)	
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 0.0583	492,866,038.868	(4,443,737)	
美元类别 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	美元 0.0440	75,550,662.600	(3,324,229)	
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 0.0629	71,542,249.850	(695,928)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年4月30日	2021年5月10日	美元 0.0401	3,567,525.480	(143,058)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	澳元 0.0345	25,751,909.625	(684,944)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	加元 0.0358	16,236,013.634	(481,167)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	英镑 0.0372	670,934.114	(35,388)	
港元类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	港元 0.0383	513,524,830.536	(2,534,046)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	纽元 0.0364	10,260,289.675	(270,769)	
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 0.0552	492,053,202.963	(4,264,950)	
美元类别 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	美元 0.0440	73,986,797.766	(3,255,419)	
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 0.0597	66,473,763.940	(623,143)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年5月31日	2021年6月8日	美元 0.0401	3,495,311.580	(140,162)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	澳元 0.0344	26,197,647.751	(677,206)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	加元 0.0362	15,538,127.591	(453,979)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	英镑 0.0372	693,444.677	(35,685)	
港元类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	港元 0.0383	495,368,306.895	(2,443,711)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	纽元 0.0363	10,099,294.233	(256,366)	
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 0.0547	482,986,294.909	(4,010,626)	
美元类别 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	美元 0.0440	70,688,186.340	(3,110,280)	
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 0.0581	62,995,495.440	(566,105)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年6月30日	2021年7月9日	美元 0.0401	3,466,483.660	(139,006)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	澳元 0.0343	25,450,495.822	(646,028)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	加元 0.0361	15,210,453.189	(441,148)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	英镑 0.0370	723,760.965	(37,425)	
港元类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	港元 0.0383	475,257,812.341	(2,342,120)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	纽元 0.0361	10,122,426.302	(256,196)	
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 0.0577	481,497,490.463	(4,302,780)	
美元类别 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	美元 0.0440	67,498,000.222	(2,969,912)	
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 0.0624	62,419,383.250	(603,231)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年7月30日	2021年8月9日	美元 0.0401	3,399,242.170	(136,310)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	澳元 0.0344	24,280,205.026	(609,599)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	加元 0.0363	15,530,647.585	(447,839)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	英镑 0.0370	607,556.909	(30,926)	
港元类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	港元 0.0384	467,579,076.241	(2,306,022)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	纽元 0.0364	9,724,544.514	(248,065)	
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 0.0592	479,794,426.121	(4,395,109)	
美元类别 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	美元 0.0440	66,626,117.029	(2,931,549)	
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 0.0640	61,376,603.970	(610,396)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年8月31日	2021年9月8日	美元 0.0401	3,274,064.690	(131,290)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	澳元 0.0343	23,030,574.588	(570,619)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	加元 0.0364	14,901,951.254	(428,173)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	英镑 0.0371	605,528.264	(30,291)	
港元类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	港元 0.0384	454,206,931.236	(2,240,505)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月11日	纽元 0.0356	9,207,083.277	(226,114)	
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 0.0613	473,440,969.334	(4,496,736)	
美元类别 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月12日	美元 0.0440	63,421,254.299	(2,790,535)	
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 0.0663	61,388,199.980	(630,622)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年9月30日	2021年10月12日	美元 0.0401	3,257,234.020	(130,615)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	澳元 0.0268	23,442,122.852	(432,832)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	加元 0.0329	15,742,362.405	(394,053)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	英镑 0.0268	366,162.865	(12,698)	
港元类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	港元 0.0387	415,807,481.174	(2,053,121)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	纽元 0.0291	10,588,479.865	(197,660)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	人民币 0.0435	421,515,916.177	(2,602,819)	
美元类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0440	50,606,831.446	(2,226,701)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	人民币 0.0470	90,829,498.130	(605,990)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0401	3,928,976.590	(157,552)	

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 0.0289	22,939,509.536		(448,421)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	加元 0.0354	15,522,256.213		(413,693)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	英镑 0.0294	383,656.743		(14,590)
港元类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	港元 0.0386	427,034,239.174		(2,105,780)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	纽元 0.0308	10,659,973.708		(210,753)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	人民币 0.0445	422,314,748.468		(2,673,277)
美元类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0440	53,345,028.968		(2,347,181)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	人民币 0.0480	91,959,604.780		(627,894)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0401	4,008,155.380		(160,727)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	澳元 0.0292	22,247,756.735		(456,661)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	加元 0.0339	15,204,514.645		(397,481)
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	英镑 0.0262	382,834.915		(13,288)
港元类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	港元 0.0384	408,102,380.680		(2,011,234)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	纽元 0.0314	10,667,041.355		(225,971)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	人民币 0.0456	422,721,567.091		(2,767,507)
美元类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0440	53,382,022.125		(2,348,809)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	人民币 0.0492	90,516,377.590		(639,384)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0401	3,914,306.040		(156,964)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	澳元 0.0294	20,901,261.467		(411,375)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	加元 0.0346	14,721,069.863		(385,126)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	英镑 0.0283	395,425.420		(14,751)
港元类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	港元 0.0383	403,451,258.238		(1,990,004)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月11日	纽元 0.0316	9,919,775.710		(202,859)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	人民币 0.0452	411,180,327.535		(2,653,989)
美元类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	美元 0.0440	55,750,551.417		(2,453,024)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	人民币 0.0488	86,532,175.840		(601,847)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	美元 0.0401	3,899,616.430		(156,375)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	澳元 0.0308	20,877,039.084		(414,582)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	加元 0.0360	14,852,277.163		(407,169)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	英镑 0.0301	420,407.886		(16,163)
港元类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	港元 0.0383	405,314,084.477		(1,991,971)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	纽元 0.0324	9,832,147.373		(197,588)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	人民币 0.0455	410,048,435.667		(2,669,052)
美元类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0440	55,380,210.297		(2,436,729)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	人民币 0.0491	87,120,529.080		(611,945)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0401	3,923,101.970		(157,316)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	澳元 0.0334	20,740,149.608		(423,980)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	加元 0.0355	14,492,545.157		(361,461)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	英镑 0.0302	352,428.430		(13,197)
港元类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	港元 0.0383	360,895,423.773		(1,783,315)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	纽元 0.0365	9,504,003.386		(205,657)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	人民币 0.0430	374,722,559.945		(2,273,225)
美元类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0440	50,053,030.584		(2,202,333)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	人民币 0.0464	75,025,476.730		(491,124)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0401	3,360,061.090		(134,738)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	澳元 0.0343	20,509,681.003		(459,761)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	加元 0.0333	14,678,993.567		(350,943)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	英镑 0.0338	351,806.498		(14,788)
港元类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	港元 0.0382	354,980,740.200		(1,749,587)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	纽元 0.0376	9,145,788.980		(210,009)
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 0.0375	371,732,734.622		(1,969,062)
美元类别 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	美元 0.0440	49,293,229.644		(2,168,902)
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 0.0405	76,651,505.160		(438,504)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年4月29日	2020年5月11日	美元 0.0401	3,365,672.400		(134,963)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月9日	澳元 0.0348	21,071,369.399		(486,754)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月9日	加元 0.0356	14,648,890.831		(377,297)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	英镑 0.0365	356,782.665		(16,100)
港元类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	港元 0.0382	354,344,996.678		(1,746,353)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	纽元 0.0371	9,137,231.668		(209,920)
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 0.0449	372,728,407.214		(2,388,017)
美元类别 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	美元 0.0450	51,681,256.528		(2,273,975)
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 0.0496	76,628,555.100		(530,523)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年5月29日	2020年6月8日	美元 0.0401	3,417,616.110		(137,046)

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 0.0353	22,139,220.413		(538,073)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	加元 0.0357	14,950,196.237		(391,866)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	英镑 0.0363	373,978.518		(16,774)
港元类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	港元 0.0382	360,552,540.709		(1,777,072)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	纽元 0.0368	9,018,733.424		(213,654)
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 0.0524	371,927,245.380		(2,757,453)
美元类别 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	美元 0.0440	55,679,479.903		(2,449,897)
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 0.0566	74,745,311.800		(598,576)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年6月30日	2020年7月9日	美元 0.0401	3,536,790.040		(141,825)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	澳元 0.0345	23,070,971.328		(570,815)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	加元 0.0351	14,516,586.724		(380,390)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	英镑 0.0359	404,839.674		(19,076)
港元类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	港元 0.0382	375,555,838.884		(1,851,079)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	纽元 0.0356	9,160,825.010		(217,248)
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 0.0521	376,333,279.141		(2,810,128)
美元类别 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	美元 0.0440	62,882,422.327		(2,766,827)
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 0.0564	70,977,108.590		(573,737)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年7月31日	2020年8月10日	美元 0.0401	3,551,302.640		(142,407)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	澳元 0.0344	23,681,995.364		(602,482)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	加元 0.0353	15,034,677.504		(407,325)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	英镑 0.0363	468,597.172		(22,776)
港元类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	港元 0.0382	391,191,800.697		(1,928,160)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	纽元 0.0357	10,362,845.488		(250,052)
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 0.0559	387,553,591.942		(3,163,056)
美元类别 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	美元 0.0440	65,985,545.167		(2,903,364)
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 0.0603	77,889,388.150		(685,739)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年8月31日	2020年9月8日	美元 0.0401	3,653,233.210		(146,495)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月12日	澳元 0.0344	23,092,224.573		(569,366)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月13日	加元 0.0353	15,745,512.214		(416,168)
英镑对冲类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月12日	英镑 0.0357	510,399.441		(23,556)
港元类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月12日	港元 0.0382	422,002,482.359		(2,080,064)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月12日	纽元 0.0361	10,762,145.751		(256,807)
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 0.0556	402,801,067.949		(3,300,140)
美元类别 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月13日	美元 0.0440	69,028,558.583		(3,037,257)
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 0.0601	77,959,972.350		(690,420)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年9月30日	2020年10月13日	美元 0.0400	3,675,296.850		(147,012)
可赎回份额持有人之总收益分配					(142,721,548)	(106,873,456)

7 税项

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和所得的资本收益预扣或缴付海外税项。

中国税项

本基金持有若干中国证券之投资。根据中华人民共和国税法，海外投资者从中国获得的股息和利息应缴付百分之十的企业所得税，但政府债券利息根据规定获豁免缴纳所得税，而海外机构投资者于二零一八年十一月七日至二零二五年十二月三十一日期间从中国本地债券市场中买卖债券所得的债券利息亦暂时获豁免缴纳所得税。在中国支付相关款项的单位有责任在支付该等款项时预扣此税项。若源自中国的股息和利息未获得特别税项豁免且支付单位未预扣税项，则全额计提百分之十的中国税项拨备。

根据中华人民共和国税法，海外投资者出售中国证交所实现的收益通常需缴纳百分之十的企业所得税。但目前，出售中国 A 股（包括在沪港通深港通机制下买卖的股份）所得收益获暂时豁免缴纳企业所得税。若出售部分中国证交所收益目前未经明确认定获豁免缴纳企业所得税，则全额计提百分之十的中国税项拨备。

香港税项

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

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) 以下为与受托人、管理人及其关联人士之投资交易：

公司名称	投资买卖 总价值 美元	占本基金本年 度之总交易价 值百分比	支付佣金 美元	占本基金本年 度支付之 总佣金百分比	平均佣金率 百分比
<u>2021</u>					
汇丰银行（中国）有限公司	212,042,979	2.41	-	-	-
HSBC Securities & Capital Markets (India) Private Limited	97,344,318	1.11	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司	608,409,112	6.91	-	-	-
<u>2020</u>					
汇丰银行（中国）有限公司	357,983,724	4.04	-	-	-
HSBC Securities & Capital Markets (India) Private Limited	143,521,457	1.62	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司	962,160,146	10.85	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司（首尔）	24,232,017	0.27	-	-	-

(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	7,859,392	5,671,317
应收款项	3,516	5,139
应付款项	(2,484,539)	(2,721,327)

(c) 截至二零二一年九月三十日止年度，本基金与受托人之关联人士签订了远期外汇合约，实现收益 19,676,042 美元（二零二零年：实现收益 74,556,950 美元）。

(d) 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 4,592 美元（二零二零年：6,854 美元）。

(e) 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一计算。此管理费于每个交易日累计，并于每月月底支付。

此外，如果本基金的资产净值超过 500 万美元但低于 2,000 万美元，则管理人就每次评估收取估值费用 40 美元；如果本基金的资产净值超过 2,000 万美元，则管理人就每次评估收取估值费用 70 美元。

- (f) 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	总分配	总赎回	年末	交易利润 美元
<u>2021</u>					
<u>摩根资产管理（亚太）有限公司</u>					
- 美元类别（累计）	38,517.346	7,935.647	(11,512.031)	34,940.962	18,371
<u>JPMorgan Asset Management (S) Limited</u>					
- 美元类别（累计）	223.693	-	-	223.693	-
<u>2020</u>					
<u>摩根资产管理（亚太）有限公司</u>					
- 美元类别（累计）	24,878.244	16,465.658	(2,826.556)	38,517.346	3,695
<u>JPMorgan Asset Management (S) Limited</u>					
- 美元类别（累计）	-	223.693	-	223.693	-

- (g) 受托人费用按本基金资产净值的首 4,000 万美元，以本基金资产净值的年率百分之零点零六计算；资产净值介乎 4,000 万美元至 7,000 万美元，按年率百分之零点零四计算；超过 7,000 万美元时，按年率百分之零点零二五计算。受托人费用于每个交易日累计，并于每月月底支付。
- (h) 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。
- (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(e)和 8(h)披露的管理费用、估值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
其他收入	1,122,735	483,427
存款利息	67,803	83,423
托管费用及银行费用	(19,692)	(57,153)

- (j) 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(g)披露的受托人费用外，已收/（已付）受托人汇丰机构信托服务（亚洲）有限公司及其关联人士的金额列示如下：

	2021 美元	2020 美元
存款利息	33,866	66,095
交易成本	(13,907)	(70,765)
托管费用及银行费用	(579,766)	(527,584)
利息支出	(324)	(789)

9 借款

截至二零二一年九月三十日止年度，本基金从香港上海汇丰银行有限公司（受托人之关联人士）借入无抵押短期借款。截至二零二零年九月三十日止年度，本基金从香港上海汇丰银行有限公司（受托人之关联人士）等不同金融机构借入无抵押短期借款。所有银行借款的久期均在 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，投资管理人士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
2021				
未平仓合约：				
美元 14,742	加元 18,716	2021年10月4日	加拿大皇家银行	31
澳元 632,932	美元 458,726	2021年10月5日	法国巴黎银行	1,522
美元 246,765	加元 313,318	2021年10月5日	Citibank N.A., 伦敦	554
美元 283,094	澳元 393,873	2021年10月6日	法国巴黎银行	1,425
美元 77,537	加元 98,850	2021年10月6日	加拿大皇家银行	491
美元 215,546	澳元 298,430	2021年10月7日	美国道富银行	29
美元 1,107	加元 1,402	2021年10月7日	法国巴黎银行	0
美元 39,755	英镑 29,485	2021年10月7日	加拿大皇家银行	2
韩元 17,345,036,705	美元 15,025,413	2021年10月8日	高盛国际, 伦敦	377,586
菲律宾比索 762,292,161	美元 15,059,110	2021年10月8日	高盛国际, 伦敦	117,897
泰铢 489,537,184	美元 14,772,282	2021年10月8日	渣打银行, 伦敦	304,758
美元 15,109,250	离岸人民币 97,844,493	2021年10月8日	美林国际, 伦敦	43,947
美元 125,271	离岸人民币 810,233	2021年10月8日	多伦多道明银行	210
美元 77,326	离岸人民币 500,067	2021年10月8日	美国道富银行	120
美元 1,100	离岸人民币 7,113	2021年10月8日	美国道富银行	2
美元 1,100	离岸人民币 7,113	2021年10月8日	美国道富银行	2
美元 14,841,270	菲律宾比索 762,292,161	2021年10月8日	Citibank N.A., 伦敦	99,943
美元 15,032,960	新加坡元 20,431,837	2021年10月8日	高盛国际, 伦敦	16,809
美元 1,593	离岸人民币 10,312	2021年10月12日	美国道富银行	4
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 245,349	美元 38,015	2021年10月15日	HSBC Bank PLC, 伦敦	39
澳元 2,776,742	美元 2,051,204	2021年10月21日	多伦多道明银行	45,258
澳元 2,944,197	美元 2,144,017	2021年10月21日	美国道富银行	17,099
澳元 469,457	美元 349,491	2021年10月21日	美国道富银行	10,351
澳元 488,374	美元 361,866	2021年10月21日	美国道富银行	9,060
澳元 875,136	美元 641,236	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	9,029
澳元 555,004	美元 409,537	2021年10月21日	加拿大皇家银行	8,596
澳元 393,550	美元 290,166	2021年10月21日	加拿大皇家银行	5,862
澳元 349,272	美元 257,822	2021年10月21日	加拿大皇家银行	5,504
澳元 258,654	美元 192,219	2021年10月21日	美国道富银行	5,364
澳元 550,286	美元 402,757	2021年10月21日	美国道富银行	5,225
澳元 432,085	美元 315,965	2021年10月21日	多伦多道明银行	3,823
澳元 1,046,298	美元 759,048	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	3,192
澳元 778,876	美元 565,821	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	3,153
澳元 192,298	美元 141,523	2021年10月21日	多伦多道明银行	2,606
澳元 222,058	美元 162,835	2021年10月21日	美国道富银行	2,418
澳元 199,205	美元 146,104	2021年10月21日	美国道富银行	2,196
澳元 371,996	美元 270,640	2021年10月21日	美国道富银行	1,907
澳元 756,639	美元 548,434	2021年10月21日	美国道富银行	1,831
澳元 322,314	美元 234,663	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	1,820
澳元 471,551	美元 342,268	2021年10月21日	多伦多道明银行	1,615
澳元 312,630	美元 226,792	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	945
澳元 119,663	美元 87,116	2021年10月21日	法国巴黎银行	670
澳元 36,791	美元 26,891	2021年10月21日	加拿大皇家银行	313
澳元 101,394	美元 73,404	2021年10月21日	法国巴黎银行	156
澳元 4,260	美元 3,141	2021年10月21日	美国道富银行	64
澳元 386,994	美元 279,624	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	56
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	美林国际, 伦敦	24
澳元 1,507	美元 1,105	2021年10月21日	美国道富银行	17

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 3,216	美元 2,339	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	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 1,516	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 2,623	美元 1,895	2021年10月21日	美国道富银行	0
加元 4,221,496	美元 3,340,336	2021年10月21日	加拿大皇家银行	8,158
加元 2,075,179	美元 1,640,375	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	2,361
加元 230,926	美元 183,808	2021年10月21日	美国道富银行	1,530
加元 286,090	美元 227,234	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,413
加元 102,530	美元 81,938	2021年10月21日	加拿大皇家银行	1,008
加元 664,955	美元 525,751	2021年10月21日	加拿大皇家银行	878
加元 325,885	美元 257,923	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	691
加元 344,228	美元 272,369	2021年10月21日	美国道富银行	657
加元 75,570	美元 60,239	2021年10月21日	加拿大皇家银行	589
加元 206,102	美元 163,079	2021年10月21日	法国巴黎银行	395
加元 161,558	美元 127,831	2021年10月21日	美国道富银行	308
加元 502,273	美元 396,686	2021年10月21日	多伦多道明银行	224
加元 203,614	美元 160,935	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	215
加元 280,592	美元 221,612	2021年10月21日	加拿大皇家银行	131
加元 95,623	美元 75,576	2021年10月21日	美国道富银行	97
加元 7,254	美元 5,745	2021年10月21日	美国道富银行	19
加元 1,390	美元 1,102	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	5
加元 1,385	美元 1,096	2021年10月21日	加拿大皇家银行	3
加元 1,400	美元 1,106	2021年10月21日	美国道富银行	1
离岸人民币 195,602,960	美元 30,307,769	2021年10月21日	美国道富银行	47,321
离岸人民币 14,070,315	美元 2,181,075	2021年10月21日	美国道富银行	4,349
离岸人民币 5,492,174	美元 852,031	2021年10月21日	美国道富银行	2,373
离岸人民币 2,996,306	美元 464,465	2021年10月21日	美国道富银行	926
离岸人民币 5,829,051	美元 902,696	2021年10月21日	美国道富银行	922
离岸人民币 3,652,940	美元 566,006	2021年10月21日	美国道富银行	884
离岸人民币 8,550,938	美元 1,323,397	2021年10月21日	美国道富银行	538
离岸人民币 538,927	美元 83,607	2021年10月21日	美国道富银行	233
离岸人民币 761,559	美元 118,000	2021年10月21日	美国道富银行	184
离岸人民币 2,365,371	美元 366,110	2021年10月21日	美国道富银行	179
离岸人民币 405,082	美元 62,843	2021年10月21日	美国道富银行	175
离岸人民币 767,248	美元 118,817	2021年10月21日	美国道富银行	121
离岸人民币 1,225,331	美元 189,655	2021年10月21日	美国道富银行	93
离岸人民币 201,955	美元 31,331	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	87
离岸人民币 471,871	美元 73,075	2021年10月21日	美国道富银行	75
离岸人民币 3,409,073	美元 527,417	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	21
离岸人民币 1,615,362	美元 249,912	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	10
离岸人民币 16,833	美元 2,609	2021年10月21日	美国道富银行	5
离岸人民币 654,606	美元 101,274	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	4
离岸人民币 41,220	美元 6,380	2021年10月21日	美国道富银行	3
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 7,094	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	美国道富银行	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
英镑 13,823	美元 19,107	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	468
英镑 21,289	美元 29,137	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	432
英镑 11,658	美元 16,089	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	369
英镑 9,299	美元 12,860	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	322
英镑 10,077	美元 13,843	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	255
英镑 12,811	美元 17,519	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	246
英镑 8,850	美元 12,129	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	196
英镑 8,601	美元 11,734	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	136
英镑 801	美元 1,109	2021年10月21日	美国道富银行	29
英镑 800	美元 1,102	2021年10月21日	加拿大皇家银行	24
纽元 2,676,488	美元 1,896,955	2021年10月21日	法国巴黎银行	50,768
纽元 934,653	美元 660,159	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	15,454
纽元 427,809	美元 304,018	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	8,924
纽元 344,319	美元 245,865	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	8,360
纽元 313,299	美元 219,976	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	3,869
纽元 172,845	美元 122,955	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	3,730

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
纽元 175,657	美元 124,221	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	3,056
纽元 114,793	美元 81,839	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	2,657
纽元 190,912	美元 134,273	2021年10月21日	美国道富银行	2,585
纽元 128,407	美元 90,329	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	1,756
纽元 129,451	美元 90,734	2021年10月21日	美国道富银行	1,441
纽元 62,072	美元 44,189	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	1,373
纽元 52,001	美元 37,113	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	1,244
纽元 85,901	美元 60,154	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	901
纽元 123,445	美元 85,915	2021年10月21日	美国道富银行	766
纽元 38,376	美元 27,231	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	760
纽元 52,529	美元 36,914	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	680
纽元 47,963	美元 33,758	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	674
纽元 78,322	美元 54,474	2021年10月21日	加拿大皇家银行	449
纽元 36,637	美元 25,679	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	407
纽元 20,855	美元 14,781	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	396
纽元 138,734	美元 95,887	2021年10月21日	多伦多道明银行	191
纽元 5,687	美元 4,049	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	126
纽元 5,574	美元 3,942	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	97
纽元 1,828	美元 1,302	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	41
纽元 3,194	美元 2,237	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	34
纽元 1,546	美元 1,099	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	32
纽元 1,570	美元 1,107	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	24
纽元 1,570	美元 1,107	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	24
美元 149,061	加元 189,717	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	689
美元 40,788	加元 52,000	2021年10月21日	法国巴黎银行	257
美元 49,373	加元 62,665	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	91
美元 2,224	加元 2,854	2021年10月21日	美国道富银行	29
美元 1,217	加元 1,545	2021年10月21日	美国道富银行	2
美元 656,701,720	离岸人民币 4,254,639,104	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	1,505,522
美元 161,035,842	离岸人民币 1,043,319,015	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	369,183
美元 91,021,668	离岸人民币 589,711,180	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	208,672
美元 2,591,828	离岸人民币 16,791,934	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	5,942
美元 2,418,182	离岸人民币 15,664,326	2021年10月21日	美国道富银行	5,143
美元 611,805	离岸人民币 3,975,285	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	3,185
美元 2,341,267	离岸人民币 15,149,221	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	2,370
美元 845,229	离岸人民币 5,478,743	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	2,351
美元 795,442	离岸人民币 5,156,885	2021年10月21日	美国道富银行	2,346
美元 448,791	离岸人民币 2,913,931	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	2,004
美元 583,933	离岸人民币 3,786,233	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,811
美元 572,555	离岸人民币 3,712,073	2021年10月21日	加拿大皇家银行	1,716
美元 994,566	离岸人民币 6,438,536	2021年10月21日	美国道富银行	1,498
美元 1,604,897	离岸人民币 10,383,159	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,414
美元 582,756	离岸人民币 3,775,535	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,332
美元 362,220	离岸人民币 2,348,532	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,106
美元 443,672	离岸人民币 2,875,000	2021年10月21日	美国道富银行	1,100
美元 292,362	离岸人民币 1,895,591	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	893
美元 417,315	离岸人民币 2,702,891	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	831
美元 377,680	离岸人民币 2,446,509	2021年10月21日	美国道富银行	803
美元 321,304	离岸人民币 2,081,624	2021年10月21日	法国巴黎银行	731
美元 439,761	离岸人民币 2,847,017	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	682
美元 245,386	离岸人民币 1,590,140	2021年10月21日	美国道富银行	614
美元 280,009	离岸人民币 1,813,820	2021年10月21日	美国道富银行	595
美元 262,606	离岸人民币 1,700,110	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	407
美元 138,905	离岸人民币 900,126	2021年10月21日	美国道富银行	248
美元 144,239	离岸人民币 934,213	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	387
美元 160,817	离岸人民币 1,041,051	2021年10月21日	美国道富银行	237
美元 71,603	离岸人民币 464,367	2021年10月21日	加拿大皇家银行	236
美元 72,909	离岸人民币 472,743	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	226
美元 213,911	离岸人民币 1,383,932	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	188
美元 220,071	离岸人民币 1,423,630	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	170
美元 105,833	离岸人民币 685,161	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	164
美元 51,071	离岸人民币 331,093	2021年10月21日	美国道富银行	151
美元 143,591	离岸人民币 929,110	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	145
美元 46,640	离岸人民币 302,371	2021年10月21日	美国道富银行	138

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 47,990	离岸人民币 311,066	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	133
美元 122,350	离岸人民币 791,666	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	124
美元 43,393	离岸人民币 281,274	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	121
美元 16,912	离岸人民币 110,000	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	105
美元 41,329	离岸人民币 267,814	2021年10月21日	美国道富银行	102
美元 31,955	离岸人民币 207,200	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	99
美元 70,048	离岸人民币 453,415	2021年10月21日	美国道富银行	97
美元 38,628	离岸人民币 250,243	2021年10月21日	加拿大皇家银行	86
美元 47,717	离岸人民币 308,895	2021年10月21日	美国道富银行	70
美元 32,721	离岸人民币 211,931	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	65
美元 19,377	离岸人民币 125,628	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	58
美元 21,960	离岸人民币 142,300	2021年10月21日	美国道富银行	54
美元 322,962	离岸人民币 2,087,912	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	45
美元 36,951	离岸人民币 239,077	2021年10月21日	美国道富银行	35
美元 13,769	离岸人民币 89,203	2021年10月21日	美国道富银行	31
美元 21,350	离岸人民币 138,198	2021年10月21日	美国道富银行	30
美元 31,145	离岸人民币 201,510	2021年10月21日	美国道富银行	29
美元 4,410	离岸人民币 28,683	2021年10月21日	多伦多道明银行	27
美元 26,463	离岸人民币 171,210	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	23
美元 5,921	离岸人民币 38,388	2021年10月21日	加拿大皇家银行	18
美元 3,115	离岸人民币 20,241	2021年10月21日	加拿大皇家银行	16
美元 6,195	离岸人民币 40,129	2021年10月21日	加拿大皇家银行	13
美元 3,538	离岸人民币 22,939	2021年10月21日	美国道富银行	10
美元 4,060	离岸人民币 26,281	2021年10月21日	美国道富银行	6
美元 1,153	离岸人民币 7,488	2021年10月21日	加拿大皇家银行	6
美元 2,459	离岸人民币 15,927	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	5
美元 1,389	离岸人民币 9,000	2021年10月21日	加拿大皇家银行	3
美元 1,218	离岸人民币 7,890	2021年10月21日	美国道富银行	3
美元 1,271	离岸人民币 8,226	2021年10月21日	美国道富银行	1
美元 121	离岸人民币 787	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	0
美元 68,780	纽元 100,094	2021年10月21日	法国巴黎银行	263
澳元 20,000,000	美元 14,624,380	2021年10月25日	高盛国际, 伦敦	175,920
巴西雷亚尔 50,643,498	美元 9,549,431	2021年10月25日	渣打银行, 伦敦	289,322
离岸人民币 90,000,000	美元 13,953,006	2021年10月25日	香港上海汇丰银行有限公司	34,332
离岸人民币 185,000,000	美元 28,626,622	2021年10月25日	香港上海汇丰银行有限公司	16,013
欧元 12,652,095	美元 15,000,000	2021年10月25日	香港上海汇丰银行有限公司	330,263
印尼盾 256,000,000,000	美元 17,850,917	2021年10月25日	高盛国际, 伦敦	6,046
韩元 17,200,000,000	美元 14,822,475	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	301,591
韩元 17,000,000,000	美元 14,622,775	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	270,739
韩元 17,500,000,000	美元 15,020,815	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	246,659
韩元 18,070,000,000	美元 15,302,536	2021年10月25日	高盛国际, 伦敦	47,165
墨西哥比索 408,362,395	美元 20,380,000	2021年10月25日	高盛国际, 伦敦	575,728
墨西哥比索 310,000,000	美元 15,316,567	2021年10月25日	高盛国际, 伦敦	282,558
墨西哥比索 300,000,000	美元 14,823,234	2021年10月25日	高盛国际, 伦敦	274,192
林吉特 94,000,000	美元 22,555,489	2021年10月25日	渣打银行, 伦敦	126,533
菲律宾比索 740,000,000	美元 14,846,321	2021年10月25日	高盛国际, 伦敦	351,382
新加坡元 40,000,000	美元 29,798,541	2021年10月25日	美国道富银行	336,170
新加坡元 39,500,000	美元 29,415,861	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	321,770
新加坡元 38,955,441	美元 28,994,238	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	301,247
新加坡元 19,000,000	美元 14,119,214	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	124,588
泰铢 500,000,000	美元 14,946,611	2021年10月25日	美林国际, 伦敦	171,597
台币 380,000,000	美元 13,683,979	2021年10月25日	渣打银行, 伦敦	45,087
台币 375,000,000	美元 13,475,297	2021年10月25日	渣打银行, 伦敦	15,864
美元 6,837,435	澳元 9,500,000	2021年10月25日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	25,583
美元 14,574,149	离岸人民币 95,000,000	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	117,785
美元 29,316,251	离岸人民币 190,000,000	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	67,617
美元 14,649,737	离岸人民币 95,000,000	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	42,197
美元 23,171,076	离岸人民币 150,000,000	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	26,715
美元 8,790,417	离岸人民币 57,000,000	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	24,743
美元 13,914,642	离岸人民币 90,000,000	2021年10月25日	高盛国际, 伦敦	4,033
美元 14,886,104	印尼盾 215,000,000,000	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	100,799
美元 53,868,723	印度卢比 4,030,000,000	2021年10月25日	渣打银行, 伦敦	279,037
美元 13,063,633	韩元 15,500,000,000	2021年10月25日	美林国际, 伦敦	22,048
美元 14,607,483	林吉特 62,000,000	2021年10月25日	香港上海汇丰银行有限公司	186,084

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 11,882,694	林吉特 50,000,000	2021年10月25日	渣打银行, 伦敦	47,602
纽元 21,000,000	美元 14,710,416	2021年10月26日	高盛国际, 伦敦	225,477
美元 6,878,678	纽元 10,000,000	2021年10月26日	Citibank N.A., 伦敦	18,912
离岸人民币 13,466,503	美元 2,080,301	2021年11月19日	多伦多道明银行	1,823
离岸人民币 1,062,871	美元 164,234	2021年11月19日	多伦多道明银行	186
离岸人民币 7,120	美元 1,100	2021年11月19日	法国巴黎银行	1
离岸人民币 7,120	美元 1,100	2021年11月19日	法国巴黎银行	1
纽元 1,601	美元 1,104	2021年11月19日	美国道富银行	0
美元 1,806	澳元 2,500	2021年11月19日	加拿大皇家银行	0
			未实现总收益	9,266,792
美元 127,835	加元 161,558	2021年10月4日	美国道富银行	(308)
美元 25,681	纽元 36,637	2021年10月4日	Citibank N.A., 伦敦	(408)
美元 73,399	澳元 101,394	2021年10月5日	法国巴黎银行	(156)
美元 2,143,881	澳元 2,944,197	2021年10月5日	美国道富银行	(17,114)
美元 54,479	纽元 78,322	2021年10月5日	加拿大皇家银行	(450)
纽元 100,094	美元 68,786	2021年10月6日	法国巴黎银行	(263)
美元 1,104	纽元 1,601	2021年10月6日	美国道富银行	(0)
加元 52,000	美元 40,789	2021年10月7日	法国巴黎银行	(257)
澳元 2,500	美元 1,806	2021年10月8日	加拿大皇家银行	(0)
离岸人民币 142,300	美元 21,981	2021年10月8日	美国道富银行	(57)
离岸人民币 267,814	美元 41,369	2021年10月8日	美国道富银行	(108)
离岸人民币 2,875,000	美元 444,094	2021年10月8日	美国道富银行	(1,158)
离岸人民币 97,844,493	美元 15,000,656	2021年10月8日	高盛国际, 伦敦	(152,541)
新加坡元 20,431,837	美元 15,012,724	2021年10月8日	Citibank N.A., 伦敦	(37,045)
美元 15,061,816	韩元 17,345,036,705	2021年10月8日	美林国际, 伦敦	(413,988)
美元 14,859,451	泰铢 489,537,184	2021年10月8日	渣打银行, 伦敦	(391,277)
离岸人民币 138,198	美元 21,364	2021年10月12日	美国道富银行	(32)
离岸人民币 308,895	美元 47,749	2021年10月12日	美国道富银行	(74)
离岸人民币 453,415	美元 70,093	2021年10月12日	美国道富银行	(104)
离岸人民币 1,041,051	美元 160,924	2021年10月12日	美国道富银行	(251)
离岸人民币 9,000	美元 1,390	2021年10月13日	加拿大皇家银行	(3)
离岸人民币 250,243	美元 38,649	2021年10月13日	加拿大皇家银行	(91)
美元 1,103	离岸人民币 7,120	2021年10月13日	法国巴黎银行	(1)
澳元 348,351	美元 251,095	2021年10月21日	法国巴黎银行	(557)
澳元 393,873	美元 283,112	2021年10月21日	法国巴黎银行	(1,426)
加元 2,270	美元 1,780	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(11)
加元 18,716	美元 14,742	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(31)
加元 83,277	美元 65,436	2021年10月21日	美国道富银行	(298)
加元 98,850	美元 77,536	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(491)
加元 849,133	美元 669,714	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(537)
加元 313,318	美元 246,760	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(554)
加元 227,008	美元 178,530	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(656)
加元 167,415	美元 131,293	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(853)
加元 301,357	美元 235,335	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(2,537)
加元 315,661	美元 245,940	2021年10月21日	美国道富银行	(3,222)
加元 812,179	美元 633,656	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(7,426)
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 13,062	美元 2,019	2021年10月21日	美国道富银行	(2)
离岸人民币 7,113	美元 1,099	2021年10月21日	美国道富银行	(2)
离岸人民币 7,113	美元 1,099	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 7,097	美元 1,096	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(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 7,069	美元 1,091	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(2)
离岸人民币 7,069	美元 1,091	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(2)
离岸人民币 7,109	美元 1,096	2021年10月21日	美国道富银行	(3)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 7,109	美元 1,096	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 7,109	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 7,098	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	加拿大皇家银行	(3)
离岸人民币 32,412	美元 5,010	2021年10月21日	美国道富银行	(4)
离岸人民币 10,312	美元 1,592	2021年10月21日	美国道富银行	(4)
离岸人民币 8,938	美元 1,379	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(4)
离岸人民币 25,266	美元 3,903	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(5)
离岸人民币 28,359	美元 4,381	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
离岸人民币 25,918	美元 4,004	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
离岸人民币 7,114	美元 1,095	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(6)
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 7,114	美元 1,095	2021年10月21日	多伦多道明银行	(6)
离岸人民币 24,571	美元 3,791	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(10)
离岸人民币 27,673	美元 4,268	2021年10月21日	美国道富银行	(13)
离岸人民币 72,540	美元 11,202	2021年10月21日	美国道富银行	(20)
离岸人民币 49,661	美元 7,662	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(21)
离岸人民币 40,015	美元 6,159	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(32)
离岸人民币 265,958	美元 41,106	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(38)
离岸人民币 174,315	美元 26,927	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(40)
离岸人民币 132,569	美元 20,462	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(47)
离岸人民币 202,015	美元 31,188	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(65)
离岸人民币 189,120	美元 29,193	2021年10月21日	美国道富银行	(65)
离岸人民币 353,960	美元 54,686	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(73)
离岸人民币 571,605	美元 88,347	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(86)
离岸人民币 1,261,867	美元 195,130	2021年10月21日	美国道富银行	(83)
离岸人民币 547,377	美元 84,594	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(88)
离岸人民币 249,546	美元 38,518	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(88)
离岸人民币 384,767	美元 59,436	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(89)
离岸人民币 596,572	美元 92,196	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(95)
离岸人民币 500,067	美元 77,255	2021年10月21日	美国道富银行	(107)
离岸人民币 314,746	美元 48,584	2021年10月21日	美国道富银行	(108)
离岸人民币 1,798,873	美元 278,170	2021年10月21日	美国道富银行	(122)
离岸人民币 337,591	美元 52,093	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(133)
离岸人民币 930,382	美元 143,768	2021年10月21日	美国道富银行	(165)
离岸人民币 380,587	美元 58,706	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(172)
离岸人民币 804,664	美元 124,299	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(185)
离岸人民币 810,233	美元 125,153	2021年10月21日	多伦多道明银行	(193)
离岸人民币 458,704	美元 70,751	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(212)
离岸人民币 1,021,103	美元 157,733	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(235)
离岸人民币 1,361,736	美元 210,424	2021年10月21日	美国道富银行	(241)
离岸人民币 1,219,777	美元 188,423	2021年10月21日	美国道富银行	(280)
离岸人民币 1,858,806	美元 287,266	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(298)
离岸人民币 2,386,470	美元 368,870	2021年10月21日	美国道富银行	(325)
离岸人民币 342,163	美元 52,609	2021年10月21日	多伦多道明银行	(325)
离岸人民币 1,027,665	美元 158,648	2021年10月21日	法国巴黎银行	(335)
离岸人民币 993,370	美元 153,339	2021年10月21日	美国道富银行	(339)
离岸人民币 1,480,323	美元 228,671	2021年10月21日	美国道富银行	(340)
离岸人民币 689,175	美元 106,265	2021年10月21日	多伦多道明银行	(353)
离岸人民币 950,565	美元 146,701	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(354)
离岸人民币 1,055,804	美元 162,920	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(417)
离岸人民币 932,206	美元 143,795	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(421)
离岸人民币 2,135,367	美元 329,909	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(439)
离岸人民币 1,419,784	美元 219,182	2021年10月21日	法国巴黎银行	(464)
离岸人民币 1,637,591	美元 252,847	2021年10月21日	美国道富银行	(493)
离岸人民币 1,347,506	美元 207,961	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(502)
离岸人民币 3,253,609	美元 502,824	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(521)
离岸人民币 2,324,093	美元 358,799	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(746)
离岸人民币 5,962,415	美元 921,594	2021年10月21日	美国道富银行	(812)
离岸人民币 2,398,447	美元 370,230	2021年10月21日	美国道富银行	(818)
离岸人民币 3,886,813	美元 600,410	2021年10月21日	美国道富银行	(893)
离岸人民币 2,276,334	美元 351,230	2021年10月21日	美国道富银行	(927)

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 6,834,477	美元 1,056,386	2021年10月21日	美国道富银行	(931)
离岸人民币 2,411,991	美元 372,015	2021年10月21日	美国道富银行	(1,129)
离岸人民币 3,401,399	美元 525,042	2021年10月21日	美国道富银行	(1,167)
离岸人民币 9,125,529	美元 1,410,566	2021年10月21日	美国道富银行	(1,184)
离岸人民币 2,973,178	美元 458,750	2021年10月21日	美国道富银行	(1,211)
离岸人民币 1,383,374	美元 212,742	2021年10月21日	美国道富银行	(1,271)
离岸人民币 6,639,053	美元 1,025,675	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(1,410)
离岸人民币 6,749,544	美元 1,042,712	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,466)
离岸人民币 7,378,000	美元 1,139,788	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,614)
离岸人民币 4,455,810	美元 687,571	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(1,758)
离岸人民币 1,962,821	美元 301,852	2021年10月21日	美国道富银行	(1,804)
离岸人民币 16,912,572	美元 2,613,998	2021年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(2,434)
离岸人民币 8,080,652	美元 1,247,670	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(2,435)
离岸人民币 3,552,182	美元 547,092	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(2,442)
离岸人民币 5,814,892	美元 897,112	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(2,472)
离岸人民币 8,765,470	美元 1,352,985	2021年10月21日	美国道富银行	(3,064)
离岸人民币 8,905,470	美元 1,373,600	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(4,107)
离岸人民币 16,306,544	美元 2,518,210	2021年10月21日	美国道富银行	(4,469)
离岸人民币 10,056,903	美元 1,551,131	2021年10月21日	美国道富银行	(4,706)
离岸人民币 23,172,084	美元 3,580,034	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(4,767)
离岸人民币 11,572,362	美元 1,785,064	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(5,220)
离岸人民币 7,242,634	美元 1,113,587	2021年10月21日	多伦多道明银行	(6,874)
离岸人民币 22,937,209	美元 3,541,103	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(7,362)
离岸人民币 9,916,100	美元 1,526,160	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(7,895)
离岸人民币 20,264,754	美元 3,126,412	2021年10月21日	高盛国际, 伦敦	(8,615)
离岸人民币 12,593,004	美元 1,938,308	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(9,873)
英镑 9,715	美元 13,076	2021年10月21日	多伦多道明银行	(24)
美元 1,491	澳元 2,050	2021年10月21日	法国巴黎银行	(10)
美元 1,308	澳元 1,796	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(10)
美元 2,401	澳元 3,262	2021年10月21日	多伦多道明银行	(44)
美元 16,943	澳元 23,180	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(197)
美元 9,698	澳元 13,089	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(243)
美元 15,793	澳元 21,400	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(333)
美元 49,454	澳元 66,949	2021年10月21日	多伦多道明银行	(1,090)
美元 458,754	澳元 632,932	2021年10月21日	法国巴黎银行	(1,517)
美元 196,915	澳元 268,500	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(2,948)
美元 203,672	澳元 277,744	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(3,027)
美元 144,079	澳元 195,190	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(3,072)
美元 188,780	澳元 256,512	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(3,473)
美元 160,184	澳元 215,554	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(4,466)
美元 360,399	澳元 484,113	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(10,670)
美元 153,560,822	澳元 206,603,044	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(4,308,717)
美元 9,963	加元 12,605	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(13)
美元 9,487	加元 12,000	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(15)
美元 11,605	加元 14,637	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(51)
美元 31,650	加元 40,000	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(76)
美元 65,563	加元 82,702	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(284)
美元 276,217	加元 349,483	2021年10月21日	加拿大皇家银行	(358)
美元 158,842	加元 200,000	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(975)
美元 1,012,949	加元 1,280,000	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(2,599)
美元 1,187,876	加元 1,500,000	2021年10月21日	法国巴黎银行	(3,872)
美元 1,296,672	加元 1,626,825	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(12,561)
美元 106,298,817	加元 133,884,423	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(619,054)
美元 19,732	离岸人民币 127,545	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1)
美元 72,559	离岸人民币 469,004	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(2)
美元 1,485	离岸人民币 9,583	2021年10月21日	美国道富银行	(3)
美元 1,930	离岸人民币 12,438	2021年10月21日	美国道富银行	(5)
美元 3,875	离岸人民币 25,000	2021年10月21日	美国道富银行	(8)
美元 13,490	离岸人民币 87,114	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(13)
美元 56,597	离岸人民币 365,497	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(54)
美元 21,926	离岸人民币 141,335	2021年10月21日	美国道富银行	(61)
美元 36,759	离岸人民币 237,134	2021年10月21日	美国道富银行	(74)
美元 53,304	离岸人民币 344,024	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(82)

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 57,733	离岸人民币 372,140	2021年10月21日	美国道富银行	(161)
美元 1,045,772	离岸人民币 6,753,452	2021年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(990)
美元 1,162,479	离岸人民币 7,502,510	2021年10月21日	美国道富银行	(1,815)
美元 3,271,745	离岸人民币 21,106,172	2021年10月21日	美国道富银行	(6,548)
美元 1,366	英镑 995	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(25)
美元 1,717	英镑 1,242	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(42)
美元 7,556,061	英镑 5,469,680	2021年10月21日	渣打银行, 伦敦	(180,831)
美元 1,555	纽元 2,211	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(30)
美元 18,245	纽元 25,748	2021年10月21日	美林国际, 伦敦	(485)
美元 27,786	纽元 39,209	2021年10月21日	多伦多道明银行	(741)
美元 141,984	纽元 200,811	2021年10月21日	美国道富银行	(3,469)
美元 281,764	纽元 400,382	2021年10月21日	美国道富银行	(5,589)
美元 58,640,099	纽元 82,412,702	2021年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(1,793,465)
离岸人民币 100,000,000	美元 15,449,308	2021年10月25日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	(5,886)
离岸人民币 176,000,000	美元 27,162,774	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	(56,976)
离岸人民币 175,000,000	美元 26,998,215	2021年10月25日	渣打银行, 伦敦	(65,874)
离岸人民币 95,689,843	美元 14,696,932	2021年10月25日	香港上海汇丰银行有限公司	(101,688)
离岸人民币 116,288,505	美元 17,855,501	2021年10月25日	美林国际, 伦敦	(128,741)
离岸人民币 330,000,000	美元 50,856,798	2021年10月25日	香港上海汇丰银行有限公司	(178,341)
印尼盾 484,814,193,969	美元 33,426,471	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	(368,243)
印度卢比 1,100,000,000	美元 14,719,264	2021年10月25日	美林国际, 伦敦	(60,522)
印度卢比 1,100,000,000	美元 14,717,235	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	(62,551)
印度卢比 1,370,000,000	美元 18,324,107	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	(83,445)
林吉特 57,464,650	美元 13,700,000	2021年10月25日	渣打银行, 伦敦	(11,405)
林吉特 50,000,000	美元 11,757,513	2021年10月25日	香港上海汇丰银行有限公司	(17,783)
林吉特 154,729,101	美元 36,524,223	2021年10月25日	渣打银行, 伦敦	(395,055)
菲律宾比索 730,000,000	美元 14,272,866	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	(26,195)
新加坡元 40,684,668	美元 29,891,218	2021年10月25日	渣打银行, 伦敦	(75,451)
美元 14,527,220	澳元 20,000,000	2021年10月25日	渣打银行, 伦敦	(78,760)
美元 6,791,996	欧元 5,850,000	2021年10月25日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	(9,091)
美元 14,948,712	欧元 12,652,095	2021年10月25日	香港上海汇丰银行有限公司	(278,975)
美元 24,542,114	印尼盾 350,000,000,000	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	(144,829)
美元 14,752,630	印度卢比 1,090,538,000	2021年10月25日	渣打银行, 伦敦	(99,977)
美元 20,316,724	印度卢比 1,500,000,000	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	(162,471)
美元 12,747,189	韩元 15,000,000,000	2021年10月25日	高盛国际, 伦敦	(83,627)
美元 14,464,638	韩元 17,000,000,000	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	(112,601)
美元 14,699,016	韩元 17,000,000,000	2021年10月25日	美林国际, 伦敦	(346,979)
美元 14,835,371	韩元 17,000,000,000	2021年10月25日	高盛国际, 伦敦	(483,334)
美元 46,209,945	韩元 53,164,541,751	2021年10月25日	渣打银行, 伦敦	(1,326,448)
美元 14,626,525	墨西哥比索 300,000,000	2021年10月25日	美林国际, 伦敦	(77,483)
美元 7,362,545	墨西哥比索 150,000,000	2021年10月25日	香港上海汇丰银行有限公司	(88,024)
美元 7,863,421	墨西哥比索 160,000,000	2021年10月25日	高盛国际, 伦敦	(103,932)
美元 22,176,568	林吉特 92,729,101	2021年10月25日	香港上海汇丰银行有限公司	(50,856)
美元 22,647,874	林吉特 94,000,000	2021年10月25日	香港上海汇丰银行有限公司	(218,918)
美元 14,464,898	菲律宾比索 730,000,000	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	(166,837)
美元 14,751,321	菲律宾比索 740,000,000	2021年10月25日	高盛国际, 伦敦	(256,382)
美元 14,732,574	新加坡元 20,000,000	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	(1,389)
美元 27,255,082	新加坡元 37,000,000	2021年10月25日	Citibank N.A., 伦敦	(2,389)
美元 15,239,907	新加坡元 20,684,668	2021年10月25日	渣打银行, 伦敦	(4,423)
美元 13,736,964	新加坡元 18,600,000	2021年10月25日	香港上海汇丰银行有限公司	(36,961)
美元 14,185,959	新加坡元 19,200,000	2021年10月25日	香港上海汇丰银行有限公司	(44,021)
美元 7,639,209	泰铢 250,000,000	2021年10月25日	美林国际, 伦敦	(251,703)
美元 7,643,390	泰铢 250,000,000	2021年10月25日	美林国际, 伦敦	(255,883)
美元 14,531,738	纽元 21,000,000	2021年10月26日	渣打银行, 伦敦	(46,798)
澳元 298,430	美元 215,585	2021年11月19日	美国道富银行	(30)
澳元 429,399	美元 309,274	2021年11月19日	高盛国际, 伦敦	(966)
加元 1,402	美元 1,107	2021年11月19日	法国巴黎银行	(0)
加元 278,412	美元 218,758	2021年11月19日	加拿大皇家银行	(993)
离岸人民币 34,243	美元 5,278	2021年11月19日	Citibank N.A., 伦敦	(7)
离岸人民币 1,275,902	美元 196,593	2021年11月19日	美国道富银行	(335)
离岸人民币 1,757,297	美元 270,768	2021年11月19日	美国道富银行	(461)
离岸人民币 9,091,387	美元 1,401,251	2021年11月19日	Citibank N.A., 伦敦	(1,953)
英镑 29,485	美元 39,756	2021年11月19日	加拿大皇家银行	(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
英镑 11,945	美元 16,061	2021年11月19日	美国道富银行	(45)
美元 172,168	美元 118,251	2021年11月19日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(479)
美元 37,910	离岸人民币 245,349	2021年11月19日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(42)
			未实现总亏损	(14,653,676)
			未实现净亏损	(5,386,884)

2020

未平仓合约:

美元 638,133	澳元 909,225	2020年10月2日	美国道富银行	13,599
美元 3,343	澳元 4,697	2020年10月2日	Barclays Bank PLC, 伦敦	23
美元 1,107	纽元 1,681	2020年10月5日	加拿大皇家银行	5
美元 1,099	加元 1,473	2020年10月5日	高盛国际, 伦敦	4
美元 644,358	澳元 918,243	2020年10月6日	加拿大皇家银行	13,838
美元 54,111	澳元 76,730	2020年10月6日	高盛国际, 伦敦	890
美元 58,463	加元 78,303	2020年10月6日	加拿大皇家银行	160
美元 1,108	澳元 1,545	2020年10月6日	法国巴黎银行	0
加元 167,424	美元 125,361	2020年10月7日	加拿大皇家银行	16
纽元 8,067	美元 5,333	2020年10月7日	高盛国际, 伦敦	1
美元 117,073	澳元 164,534	2020年10月7日	HSBC Bank PLC, 伦敦	865
美元 12,810	纽元 19,466	2020年10月7日	高盛国际, 伦敦	56
美元 7,242	加元 9,710	2020年10月7日	HSBC Bank PLC, 伦敦	28
美元 14,846	澳元 20,717	2020年10月8日	法国巴黎银行	4
美元 2,942,163	离岸人民币 20,078,957	2020年10月9日	HSBC Bank PLC, 伦敦	16,585
美元 823,272	离岸人民币 5,632,912	2020年10月9日	法国巴黎银行	6,769
美元 53,108	离岸人民币 363,370	2020年10月9日	法国巴黎银行	437
美元 15,310	离岸人民币 104,754	2020年10月9日	法国巴黎银行	126
美元 1,715,961	离岸人民币 11,711,649	2020年10月13日	HSBC Bank PLC, 伦敦	9,817
美元 45,806	离岸人民币 312,633	2020年10月13日	HSBC Bank PLC, 伦敦	262
美元 306,737	离岸人民币 2,082,609	2020年10月14日	HSBC Bank PLC, 伦敦	125
美元 143,354	离岸人民币 973,310	2020年10月14日	HSBC Bank PLC, 伦敦	58
澳元 2,233,440	美元 1,648,443	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	47,513
澳元 2,105,150	美元 1,531,979	2020年10月21日	加拿大皇家银行	23,008
澳元 747,552	美元 543,605	2020年10月21日	法国巴黎银行	7,760
澳元 296,236	美元 219,077	2020年10月21日	美国道富银行	6,735
澳元 346,790	美元 254,288	2020年10月21日	加拿大皇家银行	5,709
澳元 428,854	美元 312,940	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	5,538
澳元 334,755	美元 243,869	2020年10月21日	法国巴黎银行	3,916
澳元 306,183	美元 223,327	2020年10月21日	法国巴黎银行	3,855
澳元 318,457	美元 231,857	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	3,587
澳元 263,587	美元 192,239	2020年10月21日	法国巴黎银行	3,300
澳元 210,156	美元 153,915	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	3,275
澳元 785,243	美元 565,794	2020年10月21日	美国道富银行	2,932
澳元 3,299,266	美元 2,367,837	2020年10月21日	美国道富银行	2,923
澳元 204,821	美元 149,670	2020年10月21日	法国巴黎银行	2,854
澳元 279,556	美元 202,582	2020年10月21日	加拿大皇家银行	2,196
澳元 310,992	美元 225,049	2020年10月21日	法国巴黎银行	2,130
澳元 74,159	美元 54,167	2020年10月21日	法国巴黎银行	1,009
澳元 75,557	美元 55,112	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	953
澳元 25,045	美元 18,252	2020年10月21日	美国道富银行	299
澳元 2,674	美元 1,958	2020年10月21日	美国道富银行	40
澳元 1,487	美元 1,101	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	35
澳元 1,506	美元 1,105	2020年10月21日	加拿大皇家银行	25
澳元 1,502	美元 1,096	2020年10月21日	法国巴黎银行	19

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 1,500	美元 1,093	2020年10月21日	美国道富银行	18
澳元 1,508	美元 1,093	2020年10月21日	加拿大皇家银行	12
澳元 1,506	美元 1,085	2020年10月21日	法国巴黎银行	6
澳元 1,526	美元 1,095	2020年10月21日	美国道富银行	1
加元 939,085	美元 719,038	2020年10月21日	加拿大皇家银行	15,972
加元 761,118	美元 579,872	2020年10月21日	加拿大皇家银行	10,045
加元 433,519	美元 331,447	2020年10月21日	加拿大皇家银行	6,884
加元 567,910	美元 430,735	2020年10月21日	加拿大皇家银行	5,557
加元 288,691	美元 221,082	2020年10月21日	加拿大皇家银行	4,947
加元 368,379	美元 278,826	2020年10月21日	加拿大皇家银行	3,031
加元 134,315	美元 103,091	2020年10月21日	加拿大皇家银行	2,533
加元 221,200	美元 168,002	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	2,396
加元 170,281	美元 129,355	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,870
加元 98,614	美元 75,585	2020年10月21日	加拿大皇家银行	1,755
加元 681,055	美元 510,854	2020年10月21日	加拿大皇家银行	968
加元 51,155	美元 38,838	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	540
加元 18,543	美元 14,078	2020年10月21日	加拿大皇家银行	195
加元 5,108	美元 3,878	2020年10月21日	加拿大皇家银行	53
加元 3,960	美元 3,006	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	41
加元 4,044	美元 3,068	2020年10月21日	加拿大皇家银行	41
加元 2,904	美元 2,215	2020年10月21日	加拿大皇家银行	40
加元 2,269	美元 1,728	2020年10月21日	加拿大皇家银行	30
加元 1,435	美元 1,099	2020年10月21日	加拿大皇家银行	24
加元 1,444	美元 1,101	2020年10月21日	加拿大皇家银行	20
加元 1,844	美元 1,397	2020年10月21日	加拿大皇家银行	17
加元 1,451	美元 1,101	2020年10月21日	加拿大皇家银行	15
加元 1,453	美元 1,103	2020年10月21日	加拿大皇家银行	15
加元 1,444	美元 1,095	2020年10月21日	法国巴黎银行	13
加元 1,449	美元 1,097	2020年10月21日	加拿大皇家银行	12
加元 3,768	美元 2,833	2020年10月21日	加拿大皇家银行	12
离岸人民币 5,569,335	美元 821,763	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	1,573
离岸人民币 1,681,979	美元 248,414	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	711
离岸人民币 2,134,608	美元 314,964	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	603
离岸人民币 3,353,693	美元 494,463	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	569
离岸人民币 1,235,647	美元 182,495	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	521
离岸人民币 1,142,139	美元 168,395	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	194
离岸人民币 543,619	美元 80,212	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	154
离岸人民币 288,374	美元 42,591	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	122
离岸人民币 297,298	美元 43,833	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	50
离岸人民币 11,310	美元 1,670	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	5
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 7,458	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 7,440	美元 1,097	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1
英镑 48,802	美元 64,927	2020年10月21日	美国道富银行	1,831
英镑 7,160	美元 9,633	2020年10月21日	美国道富银行	375
英镑 8,660	美元 11,522	2020年10月21日	美国道富银行	326
英镑 10,548	美元 13,739	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	102
英镑 818	美元 1,088	2020年10月21日	美国道富银行	31
英镑 827	美元 1,098	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	29
英镑 833	美元 1,098	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	21
英镑 856	美元 1,113	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	7
英镑 845	美元 1,098	2020年10月21日	法国巴黎银行	6
英镑 922	美元 1,194	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	2
纽元 451,340	美元 305,131	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	6,796
纽元 651,342	美元 437,146	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	6,610

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
纽元 203,529	美元 137,442	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	2,910
纽元 312,601	美元 208,560	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	1,930
纽元 115,372	美元 78,054	2020年10月21日	美国道富银行	1,793
纽元 243,206	美元 162,327	2020年10月21日	法国巴黎银行	1,568
纽元 81,995	美元 55,495	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	1,296
纽元 136,805	美元 91,469	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	1,041
纽元 108,498	美元 72,074	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	357
纽元 16,307	美元 11,048	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	269
纽元 4,056	美元 2,729	2020年10月21日	美国道富银行	48
纽元 3,200	美元 2,143	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	28
纽元 2,398	美元 1,610	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	24
纽元 1,626	美元 1,098	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	23
纽元 1,639	美元 1,106	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	23
纽元 1,629	美元 1,095	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	18
纽元 1,639	美元 1,100	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	17
纽元 1,649	美元 1,106	2020年10月21日	法国巴黎银行	17
纽元 5,440	美元 3,612	2020年10月21日	加拿大皇家银行	16
纽元 1,765	美元 1,178	2020年10月21日	美国道富银行	11
纽元 1,624	美元 1,081	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	7
纽元 1,652	美元 1,098	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	5
美元 515,189,067	离岸人民币 3,528,735,994	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	4,486,639
美元 424,776,111	离岸人民币 2,909,461,496	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	3,699,257
美元 111,798,463	离岸人民币 765,752,389	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	973,623
美元 2,150,757	离岸人民币 14,731,394	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	18,731
美元 1,474,106	离岸人民币 10,115,227	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	15,562
美元 1,746,161	离岸人民币 11,961,911	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	15,467
美元 1,627,523	离岸人民币 11,155,788	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	15,386
美元 1,583,202	离岸人民币 10,849,299	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	14,571
美元 644,971	澳元 918,243	2020年10月21日	加拿大皇家银行	13,225
美元 1,023,663	离岸人民币 7,030,403	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	11,703
美元 1,023,091	离岸人民币 7,023,174	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	11,211
美元 894,535	离岸人民币 6,130,897	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	8,360
美元 881,167	离岸人民币 6,039,918	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	8,330
美元 871,851	离岸人民币 5,973,811	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	7,909
美元 1,300,914	纽元 1,979,250	2020年10月21日	美国道富银行	7,371
美元 699,257	离岸人民币 4,790,231	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	6,199
美元 538,097	离岸人民币 3,695,593	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	6,152
美元 713,267	离岸人民币 4,884,690	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	6,100
美元 563,196	离岸人民币 3,864,616	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	5,945
美元 643,053	离岸人民币 4,404,604	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	5,612
美元 1,368,884	离岸人民币 9,332,123	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	5,450
美元 615,145	离岸人民币 4,213,226	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	5,336
美元 454,926	离岸人民币 3,117,500	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	4,187
美元 732,408	离岸人民币 5,001,482	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	4,157
美元 830,892	离岸人民币 5,669,719	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	4,084
美元 457,275	离岸人民币 3,132,541	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	4,054
美元 245,278	澳元 347,799	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	4,024
美元 413,575	离岸人民币 2,834,127	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	3,806
美元 281,038	离岸人民币 1,931,201	2020年10月21日	美国道富银行	3,370
美元 367,854	澳元 517,618	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	3,174
美元 362,385	离岸人民币 2,482,033	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	3,143
美元 244,352	离岸人民币 1,679,108	2020年10月21日	美国道富银行	2,930
美元 373,800	澳元 525,336	2020年10月21日	法国巴黎银行	2,761
美元 214,886	离岸人民币 1,475,233	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	2,371
美元 260,204	离岸人民币 1,782,689	2020年10月21日	美国道富银行	2,332
美元 249,804	离岸人民币 1,711,257	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	2,213
美元 232,734	离岸人民币 1,594,486	2020年10月21日	美国道富银行	2,086

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 570,472	英镑 442,747	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	1,955
美元 204,438	离岸人民币 1,400,781	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	1,855
美元 193,782	离岸人民币 1,327,312	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	1,691
美元 237,377	离岸人民币 1,621,589	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	1,433
美元 114,965	离岸人民币 790,000	2020年10月21日	美国道富银行	1,379
美元 310,607	纽元 471,980	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	1,372
美元 235,766	离岸人民币 1,610,000	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	1,338
美元 271,949	离岸人民币 1,855,685	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	1,337
美元 2,646,508	离岸人民币 17,979,246	2020年10月21日	美国道富银行	1,277
美元 166,154	离岸人民币 1,134,997	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	996
美元 165,616	离岸人民币 1,130,959	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	940
美元 84,691	纽元 129,548	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	940
美元 238,708	加元 320,050	2020年10月21日	法国巴黎银行	904
美元 82,444	英镑 64,442	2020年10月21日	美国道富银行	873
美元 100,493	离岸人民币 688,296	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	872
美元 75,278	离岸人民币 517,000	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	861
美元 75,818	离岸人民币 520,260	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	800
美元 200,297	离岸人民币 1,365,488	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	797
美元 1,440,400	离岸人民币 9,785,964	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	769
美元 80,946	离岸人民币 554,510	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	717
美元 35,627	英镑 28,033	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	617
美元 50,990	离岸人民币 350,035	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	560
美元 63,368	离岸人民币 434,007	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	548
美元 48,491	英镑 37,923	2020年10月21日	加拿大皇家银行	539
美元 57,902	离岸人民币 396,734	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	525
美元 83,491	离岸人民币 570,350	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	504
美元 57,109	离岸人民币 391,140	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	494
美元 50,284	离岸人民币 344,539	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	456
美元 61,591	离岸人民币 420,616	2020年10月21日	法国巴黎银行	353
美元 89,259	加元 119,664	2020年10月21日	加拿大皇家银行	330
美元 582,489	离岸人民币 3,957,387	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	311
美元 34,552	离岸人民币 236,700	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	306
美元 29,224	离岸人民币 200,160	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	253
美元 58,421	加元 78,309	2020年10月21日	加拿大皇家银行	206
美元 15,756	离岸人民币 108,000	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	149
美元 6,473	纽元 9,921	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	84
美元 7,001	纽元 10,701	2020年10月21日	法国巴黎银行	73
美元 144,505	离岸人民币 981,703	2020年10月21日	美国道富银行	70
美元 10,005	英镑 7,791	2020年10月21日	加拿大皇家银行	67
美元 16,721	离岸人民币 113,989	2020年10月21日	加拿大皇家银行	67
美元 9,369	英镑 7,286	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	52
美元 4,236	离岸人民币 29,107	2020年10月21日	美国道富银行	51
美元 7,322	离岸人民币 50,000	2020年10月21日	法国巴黎银行	42
美元 4,142	离岸人民币 28,388	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	39
美元 7,403	离岸人民币 50,515	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	36
美元 3,256	离岸人民币 22,318	2020年10月21日	法国巴黎银行	30
美元 158,805	加元 212,150	2020年10月21日	法国巴黎银行	26
美元 1,068	澳元 1,521	2020年10月21日	加拿大皇家银行	22
美元 8,073	加元 10,812	2020年10月21日	加拿大皇家银行	22
美元 2,566	离岸人民币 17,524	2020年10月21日	H58C Bank PLC, 伦敦	14
美元 1,060	英镑 829	2020年10月21日	美国道富银行	11
美元 1,098	离岸人民币 7,520	2020年10月21日	美国道富银行	10
美元 1,138	离岸人民币 7,793	2020年10月21日	美国道富银行	10
美元 905	离岸人民币 6,215	2020年10月21日	美国道富银行	10
美元 17,663	离岸人民币 120,000	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	9
美元 857	离岸人民币 5,883	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	9
美元 1,464	离岸人民币 10,000	2020年10月21日	美国道富银行	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 689	离岸人民币 4,732	2020年10月21日	美国道富银行	8
美元 780	离岸人民币 5,344	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	7
美元 819	澳元 1,152	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	7
美元 864	离岸人民币 5,920	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	7
美元 12,159	离岸人民币 82,600	2020年10月21日	美国道富银行	6
美元 704	离岸人民币 4,826	2020年10月21日	美国道富银行	6
美元 598	离岸人民币 4,098	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	5
美元 800	离岸人民币 5,462	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	5
美元 1,102	离岸人民币 7,517	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	4
美元 772	离岸人民币 5,271	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	4
美元 1,107	离岸人民币 7,519	2020年10月21日	法国巴黎银行	1
美元 970	离岸人民币 6,592	2020年10月21日	美国道富银行	1
美元 721	离岸人民币 4,899	2020年10月21日	美国道富银行	0
澳元 20,648,074	美元 15,000,000	2020年11月20日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	197,396
加元 1,116,632	美元 836,201	2020年11月20日	加拿大皇家银行	86
加元 5,428	美元 4,064	2020年11月20日	加拿大皇家银行	0
离岸人民币 101,944,650	美元 15,000,000	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	18,935
哥伦比亚比索 54,550,650,000	美元 14,619,156	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	501,775
欧元 12,644,325	美元 15,000,000	2020年11月20日	美国道富银行	155,562
欧元 12,731,937	美元 15,000,000	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	52,706
欧元 12,771,474	美元 15,000,000	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	6,290
印尼盾 294,100,000,000	美元 20,000,000	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	354,043
韩元 23,500,000,000	美元 20,224,274	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	61,254
墨西哥比索 326,000,000	美元 15,338,367	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	654,476
纽元 22,951,520	美元 15,202,054	2020年11月20日	美国道富银行	31,099
纽元 6,221	美元 4,113	2020年11月20日	高盛国际, 伦敦	0
秘鲁索尔 55,000,000	美元 15,408,320	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	120,776
新加坡元 61,313,265	美元 45,000,000	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	81,857
新加坡元 44,001,674	美元 32,250,000	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	14,341
美元 47,321,666	韩元 56,322,720,000	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	999,845
美元 14,941,122	韩元 17,700,000,000	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	244,654
美元 15,193,155	离岸人民币 105,000,000	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	237,552
美元 14,958,041	韩元 17,700,000,000	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	227,792
美元 14,445,049	墨西哥比索 325,000,000	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	194,901
美元 17,492,570	新加坡元 24,046,039	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	123,567
美元 14,580,033	离岸人民币 100,000,000	2020年11月20日	美国道富银行	115,576
美元 14,705,115	欧元 12,600,000	2020年11月20日	美国道富银行	87,185
美元 14,736,383	欧元 12,600,000	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	55,953
美元 14,654,462	离岸人民币 100,000,000	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	40,943
美元 15,192,505	印度卢比 1,124,648,000	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	20,303
美元 892,226	离岸人民币 6,074,004	2020年11月20日	HSBC Bank PLC, 伦敦	367
美元 313,652	澳元 437,628	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	34
美元 145,069	离岸人民币 987,591	2020年11月20日	法国巴黎银行	60
美元 1,763	离岸人民币 12,000	2020年11月20日	高盛国际, 伦敦	1
美元 1,014	加元 1,354	2020年11月20日	法国巴黎银行	0
美元 1,033	纽元 1,564	2020年11月20日	美林国际, 伦敦	0
			未实现总收益	14,308,682

澳元 347,799	美元 245,269	2020年10月2日	高盛国际, 伦敦	(4,033)
加元 1,354	美元 1,014	2020年10月5日	法国巴黎银行	(0)
加元 10,812	美元 8,072	2020年10月5日	加拿大皇家银行	(22)
加元 78,309	美元 58,419	2020年10月5日	加拿大皇家银行	(209)
加元 119,664	美元 89,255	2020年10月5日	加拿大皇家银行	(334)
英镑 7,791	美元 10,005	2020年10月5日	加拿大皇家银行	(68)
英镑 28,033	美元 35,624	2020年10月5日	渣打银行, 伦敦	(617)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
纽元 1,564	美元 1,033	2020年10月5日	美林国际, 伦敦	(0)
纽元 10,701	美元 7,001	2020年10月5日	法国巴黎银行	(73)
纽元 9,921	美元 6,474	2020年10月5日	渣打银行, 伦敦	(84)
纽元 129,548	美元 84,692	2020年10月5日	渣打银行, 伦敦	(939)
澳元 525,336	美元 373,790	2020年10月6日	法国巴黎银行	(2,771)
澳元 918,243	美元 644,947	2020年10月6日	加拿大皇家银行	(13,249)
加元 320,050	美元 238,697	2020年10月6日	法国巴黎银行	(916)
纽元 471,980	美元 310,611	2020年10月6日	渣打银行, 伦敦	(1,368)
美元 4,064	加元 5,428	2020年10月6日	加拿大皇家银行	(0)
美元 4,113	纽元 6,221	2020年10月6日	高盛国际, 伦敦	(0)
澳元 437,628	美元 313,618	2020年10月7日	美林国际, 伦敦	(73)
美元 836,097	加元 1,116,632	2020年10月8日	加拿大皇家银行	(107)
离岸人民币 10,000	美元 1,465	2020年10月9日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(8)
离岸人民币 554,510	美元 81,015	2020年10月9日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(696)
离岸人民币 1,134,997	美元 166,311	2020年10月9日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(938)
离岸人民币 1,711,257	美元 250,017	2020年10月9日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(2,146)
离岸人民币 11,961,911	美元 1,747,652	2020年10月9日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(15,003)
离岸人民币 391,140	美元 57,146	2020年10月13日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(491)
离岸人民币 570,350	美元 83,541	2020年10月13日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(503)
离岸人民币 434,007	美元 63,409	2020年10月13日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(545)
离岸人民币 1,621,589	美元 237,520	2020年10月13日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(1,430)
离岸人民币 50,000	美元 7,325	2020年10月14日	法国巴黎银行	(42)
离岸人民币 420,616	美元 61,622	2020年10月14日	法国巴黎银行	(354)
离岸人民币 12,000	美元 1,767	2020年10月15日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 987,591	美元 145,443	2020年10月15日	法国巴黎银行	(63)
澳元 1,533	美元 1,089	2020年10月21日	法国巴黎银行	(9)
澳元 4,697	美元 3,344	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(23)
澳元 164,534	美元 117,077	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(861)
澳元 76,730	美元 54,112	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(888)
澳元 342,371	美元 241,392	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(4,019)
澳元 340,011	美元 238,384	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(5,336)
澳元 638,480	美元 451,228	2020年10月21日	美国道富银行	(6,435)
澳元 1,328,886	美元 944,372	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(8,174)
澳元 574,955	美元 403,881	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(8,247)
澳元 909,225	美元 638,167	2020年10月21日	美国道富银行	(13,565)
澳元 918,243	美元 644,385	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(13,812)
加元 1,467	美元 1,098	2020年10月21日	法国巴黎银行	(0)
加元 1,473	美元 1,099	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(4)
加元 9,710	美元 7,242	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(28)
加元 78,303	美元 58,466	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(157)
加元 233,003	美元 174,035	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(407)
加元 428,444	美元 320,310	2020年10月21日	多伦多道明银行	(453)
加元 240,905	美元 179,711	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(647)
加元 227,885	美元 169,922	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(689)
离岸人民币 7,483	美元 1,101	2020年10月21日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 7,483	美元 1,101	2020年10月21日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 7,483	美元 1,101	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	(1)
离岸人民币 7,519	美元 1,107	2020年10月21日	法国巴黎银行	(1)
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 7,446	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 7,765	美元 1,138	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(6)
离岸人民币 7,534	美元 1,101	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(8)
离岸人民币 7,520	美元 1,098	2020年10月21日	美国道富银行	(9)
离岸人民币 7,534	美元 1,101	2020年10月21日	美国道富银行	(9)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 7,517	美元 1,097	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(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 7,517	美元 1,097	2020年10月21日	美林国际, 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 7,516	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 7,515	美元 1,094	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(13)
离岸人民币 9,735	美元 1,421	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(13)
离岸人民币 9,604	美元 1,399	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(15)
离岸人民币 13,938	美元 2,034	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(19)
离岸人民币 258,034	美元 37,976	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(25)
离岸人民币 447,306	美元 65,835	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(39)
离岸人民币 47,119	美元 6,894	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(46)
离岸人民币 55,480	美元 8,123	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(47)
离岸人民币 42,074	美元 6,143	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(53)
离岸人民币 66,509	美元 9,735	2020年10月21日	美国道富银行	(61)
离岸人民币 54,306	美元 7,927	2020年10月21日	法国巴黎银行	(71)
离岸人民币 104,754	美元 15,295	2020年10月21日	法国巴黎银行	(132)
离岸人民币 137,071	美元 20,010	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(176)
离岸人民币 370,333	美元 54,324	2020年10月21日	美国道富银行	(214)
离岸人民币 192,767	美元 28,142	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(247)
离岸人民币 312,633	美元 45,781	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(260)
离岸人民币 199,041	美元 28,982	2020年10月21日	美国道富银行	(331)
离岸人民币 4,271,341	美元 628,664	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(372)
离岸人民币 269,002	美元 39,198	2020年10月21日	美国道富银行	(417)
离岸人民币 737,141	美元 108,132	2020年10月21日	美国道富银行	(426)
离岸人民币 363,370	美元 53,056	2020年10月21日	法国巴黎银行	(458)
离岸人民币 338,347	美元 49,364	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(464)
离岸人民币 697,763	美元 102,178	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(581)
离岸人民币 400,415	美元 58,331	2020年10月21日	法国巴黎银行	(638)
离岸人民币 6,943,584	美元 1,021,904	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(670)
离岸人民币 390,891	美元 56,882	2020年10月21日	美国道富银行	(684)
离岸人民币 1,331,475	美元 195,367	2020年10月21日	美国道富银行	(718)
离岸人民币 1,085,726	美元 159,115	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(779)
离岸人民币 934,099	美元 136,770	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(794)
离岸人民币 9,379,761	美元 1,380,442	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(905)
离岸人民币 608,013	美元 88,608	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(934)
离岸人民币 14,877,873	美元 2,189,753	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(1,295)
离岸人民币 1,079,205	美元 157,546	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(1,388)
离岸人民币 1,655,530	美元 242,401	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,407)
离岸人民币 1,474,265	美元 215,228	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,886)
离岸人民币 1,480,040	美元 215,993	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(1,970)
离岸人民币 1,616,755	美元 235,930	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(2,168)
离岸人民币 2,081,713	美元 304,348	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(2,224)
离岸人民币 1,701,206	美元 248,253	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(2,281)
离岸人民币 1,391,577	美元 202,623	2020年10月21日	美国道富银行	(2,313)
离岸人民币 4,574,398	美元 671,021	2020年10月21日	美国道富银行	(2,645)
离岸人民币 2,309,143	美元 337,389	2020年10月21日	法国巴黎银行	(2,676)
离岸人民币 2,310,349	美元 337,167	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(3,076)
离岸人民币 3,766,247	美元 551,451	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(3,200)
离岸人民币 2,665,271	美元 389,025	2020年10月21日	美国道富银行	(3,486)
离岸人民币 4,967,810	美元 728,039	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(3,565)
离岸人民币 2,825,545	美元 412,238	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(3,877)
离岸人民币 2,990,264	美元 436,392	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(3,981)
离岸人民币 3,259,223	美元 475,915	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(4,068)
离岸人民币 2,947,091	美元 429,300	2020年10月21日	法国巴黎银行	(4,715)

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 3,704,382	美元 540,777	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(4,764)
离岸人民币 3,768,400	美元 550,127	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(4,841)
离岸人民币 3,896,056	美元 568,762	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(5,005)
离岸人民币 7,352,499	美元 1,074,588	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(5,261)
离岸人民币 3,553,664	美元 517,888	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(5,456)
离岸人民币 4,021,586	美元 585,569	2020年10月21日	美国道富银行	(6,686)
离岸人民币 5,632,912	美元 822,463	2020年10月21日	法国巴黎银行	(7,089)
离岸人民币 6,948,207	美元 1,015,831	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(7,423)
离岸人民币 6,229,169	美元 909,352	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(8,010)
离岸人民币 7,611,575	美元 1,112,129	2020年10月21日	法国巴黎银行	(8,820)
离岸人民币 7,044,619	美元 1,028,443	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(9,010)
离岸人民币 5,740,911	美元 836,322	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(9,136)
离岸人民币 7,221,760	美元 1,054,095	2020年10月21日	美国道富银行	(9,446)
离岸人民币 11,711,649	美元 1,715,004	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(9,758)
离岸人民币 11,076,134	美元 1,620,524	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(10,646)
离岸人民币 9,657,417	美元 1,410,121	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(12,116)
离岸人民币 8,783,292	美元 1,280,020	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(13,486)
离岸人民币 7,838,684	美元 1,140,681	2020年10月21日	美国道富银行	(13,713)
离岸人民币 10,255,040	美元 1,496,178	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(14,070)
离岸人民币 20,078,957	美元 2,939,394	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(17,612)
离岸人民币 15,173,422	美元 2,214,009	2020年10月21日	法国巴黎银行	(20,563)
离岸人民币 14,039,646	美元 2,043,041	2020年10月21日	美国道富银行	(24,561)
离岸人民币 353,746,484	美元 51,621,475	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(474,380)
英镑 861	美元 1,109	2020年10月21日	美国道富银行	(4)
英镑 855	美元 1,094	2020年10月21日	法国巴黎银行	(12)
英镑 3,699	美元 4,756	2020年10月21日	美国道富银行	(27)
英镑 14,766	美元 19,003	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(88)
英镑 8,617	美元 11,022	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(118)
英镑 7,908	美元 10,096	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(128)
英镑 8,552	美元 10,861	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(197)
英镑 168,448	美元 214,184	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(3,602)
英镑 440,683	美元 560,874	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(8,885)
纽元 1,681	美元 1,107	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(5)
纽元 19,466	美元 12,810	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(56)
纽元 23,614	美元 15,524	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(85)
纽元 101,303	美元 66,112	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(849)
纽元 154,649	美元 101,155	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(1,068)
纽元 151,327	美元 98,776	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(1,251)
纽元 288,600	美元 189,214	2020年10月21日	法国巴黎银行	(1,551)
美元 908	离岸人民币 6,156	2020年10月21日	法国巴黎银行	(1)
美元 913	澳元 1,272	2020年10月21日	法国巴黎银行	(1)
美元 1,033	离岸人民币 7,000	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(2)
美元 1,066	英镑 823	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(2)
美元 1,068	纽元 1,608	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(5)
美元 1,070	纽元 1,608	2020年10月21日	法国巴黎银行	(7)
美元 1,078	英镑 827	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(8)
美元 559	纽元 830	2020年10月21日	美国道富银行	(10)
美元 921	澳元 1,271	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(10)
美元 1,063	加元 1,401	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(14)
美元 1,095	加元 1,444	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(14)
美元 838	纽元 1,247	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(14)
美元 922	加元 1,210	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(16)
美元 1,037	澳元 1,423	2020年10月21日	美国道富银行	(17)
美元 1,106	纽元 1,649	2020年10月21日	美国道富银行	(17)
美元 1,064	澳元 1,442	2020年10月21日	法国巴黎银行	(31)
美元 1,101	澳元 1,487	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(35)
美元 4,810	英镑 3,691	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(38)

交付合约	折净额	交割日期	交易对手	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 35,537	离岸人民币 241,040	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(39)
美元 12,140	英镑 9,359	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(40)
美元 6,334	纽元 9,493	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(59)
美元 2,769	英镑 2,095	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(60)
美元 23,631	离岸人民币 160,000	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(68)
美元 17,258	加元 22,956	2020年10月21日	法国巴黎银行	(71)
美元 14,079	英镑 10,823	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(87)
美元 3,454	英镑 2,602	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(90)
美元 13,681	纽元 20,385	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(206)
美元 39,840	英镑 30,654	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(208)
美元 178,674	澳元 248,966	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(215)
美元 150,667	加元 200,872	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(280)
美元 138,760	离岸人民币 940,310	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(281)
美元 68,688	纽元 103,469	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(295)
美元 49,175	纽元 73,892	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(333)
美元 17,043	纽元 25,247	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(355)
美元 17,469	澳元 23,865	2020年10月21日	美国道富银行	(363)
美元 365,133	离岸人民币 2,476,614	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(405)
美元 288,442	离岸人民币 1,954,637	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(585)
美元 51,391	澳元 70,525	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(839)
美元 79,440	纽元 118,379	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(1,191)
美元 136,001	纽元 203,857	2020年10月21日	法国巴黎银行	(1,252)
美元 92,700	澳元 127,088	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(1,603)
美元 152,001	纽元 227,503	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(1,621)
美元 81,303	加元 106,338	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(1,691)
美元 78,996	纽元 116,946	2020年10月21日	法国巴黎银行	(1,694)
美元 1,689,501	离岸人民币 11,459,515	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(1,872)
美元 113,090	纽元 168,187	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(1,918)
美元 436,186	纽元 656,854	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(2,006)
美元 192,997	加元 254,855	2020年10月21日	法国巴黎银行	(2,195)
美元 131,571	纽元 195,717	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(2,202)
美元 74,659	澳元 100,849	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(2,372)
美元 497,973	澳元 691,185	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(2,532)
美元 906,916	离岸人民币 6,140,585	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(2,601)
美元 279,234	澳元 385,866	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(2,646)
美元 158,560	澳元 217,002	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(3,013)
美元 110,698	英镑 83,183	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(3,150)
美元 1,194,628	离岸人民币 8,088,633	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(3,426)
美元 198,790	英镑 150,827	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(3,785)
美元 227,206	加元 298,222	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(3,936)
美元 372,521	加元 492,191	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(4,031)
美元 330,668	加元 436,096	2020年10月21日	法国巴黎银行	(4,175)
美元 335,532	加元 442,592	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(4,175)
美元 341,050	加元 449,261	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(4,701)
美元 210,710	澳元 287,376	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(4,718)
美元 279,174	澳元 382,549	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(4,963)
美元 396,999	纽元 592,934	2020年10月21日	Citibank N.A., 伦敦	(5,070)
美元 297,564	澳元 407,968	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(5,133)
美元 432,099	加元 569,532	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(5,707)
美元 382,537	澳元 525,393	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(5,935)
美元 473,490	澳元 650,731	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(7,046)
美元 318,548	加元 416,030	2020年10月21日	高盛国际, 伦敦	(7,078)
美元 519,550	加元 683,945	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(7,499)
美元 782,093	澳元 1,079,285	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(8,462)
美元 612,225	澳元 841,324	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(9,163)
美元 500,091	澳元 684,727	2020年10月21日	美国道富银行	(9,278)
美元 692,524	加元 912,400	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(9,437)

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 453,703	纽元 671,857	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(9,606)
美元 439,662	加元 573,679	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(10,164)
美元 266,238	英镑 197,944	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(10,316)
美元 759,237	加元 1,000,000	2020年10月21日	加拿大皇家银行	(10,565)
美元 977,706	加元 1,288,000	2020年10月21日	法国巴黎银行	(13,417)
美元 958,475	澳元 1,314,854	2020年10月21日	美国道富银行	(15,986)
美元 557,582	澳元 755,425	2020年10月21日	美林国际, 伦敦	(16,092)
美元 10,819,342	离岸人民币 73,317,713	2020年10月21日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(21,935)
美元 1,695,957	加元 2,224,252	2020年10月21日	渣打银行, 伦敦	(30,722)
美元 5,721,064	英镑 4,335,966	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(115,085)
美元 60,583,742	纽元 90,338,995	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(869,666)
美元 101,496,846	加元 133,037,772	2020年10月21日	Barclays Bank PLC, 伦敦	(1,892,237)
美元 151,058,515	澳元 207,275,310	2020年10月21日	多伦多道明银行	(2,483,399)
澳元 1,545	美元 1,108	2020年11月20日	法国巴黎银行	(0)
澳元 20,717	美元 14,848	2020年11月20日	美国道富银行	(4)
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 17,889	美元 2,628	2020年11月20日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(1)
离岸人民币 7,505	美元 1,102	2020年11月20日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(1)
离岸人民币 973,310	美元 142,976	2020年11月20日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(55)
离岸人民币 2,082,609	美元 305,927	2020年11月20日	HSBC Bank PLC, 伦敦	(118)
离岸人民币 205,421,460	美元 30,000,000	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	(187,286)
离岸人民币 748,802,093	美元 108,726,338	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	(1,312,325)
印尼盾 300,820,000,000	美元 20,000,000	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	(94,855)
印度卢比 1,124,648,000	美元 15,100,000	2020年11月20日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	(112,768)
印度卢比 2,379,360,000	美元 32,000,000	2020年11月20日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	(184,872)
韩元 17,200,000,000	美元 14,754,830	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	(2,785)
林吉特 62,623,500	美元 15,000,000	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	(47,577)
菲律宾比索 729,495,000	美元 15,000,000	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	(21,652)
菲律宾比索 729,870,000	美元 15,000,000	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	(29,374)
新加坡元 20,231,100	美元 14,750,000	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	(71,319)
台币 446,074,400	美元 15,356,987	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	(144,248)
美元 5,333	纽元 8,067	2020年11月20日	高盛国际, 伦敦	(0)
美元 125,377	加元 167,424	2020年11月20日	加拿大皇家银行	(13)
美元 15,020,560	新加坡元 20,500,000	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	(2,245)
美元 15,184,863	纽元 22,951,520	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	(13,909)
美元 14,693,188	新加坡元 20,000,000	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	(41,170)
美元 15,110,390	林吉特 62,623,500	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	(62,907)
美元 14,764,277	墨西哥比索 326,000,000	2020年11月20日	香港上海汇丰银行有限公司	(80,843)
美元 14,746,381	新加坡元 20,000,000	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	(94,359)
美元 15,030,518	日元 1,570,000,000	2020年11月20日	Citibank N.A., 伦敦	(143,063)
美元 14,879,946	印尼盾 220,000,000,000	2020年11月20日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	(185,000)
美元 30,221,947	新加坡元 41,000,000	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	(185,303)
美元 15,588,685	秘鲁索尔 55,000,000	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	(301,199)
美元 15,103,901	澳元 20,648,074 哥伦比亚比索 54,550,650,000	2020年11月20日	澳大利亚和新西兰银行集团有限公司	(301,234)
美元 14,787,381	巴西雷亚尔 83,200,000	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	(671,691)
美元 15,590,159	巴西雷亚尔 79,798,350	2020年11月20日	渣打银行, 伦敦	(847,212)
美元 15,000,000	台币 859,560,000	2020年11月30日	渣打银行, 伦敦	(859,876)
美元 30,000,000	台币 859,560,000	2020年11月30日	渣打银行, 伦敦	(85,768)
			未实现总亏损	(12,639,189)
			未实现净收益	1,669,493

(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>						
US 10yr Note (CBT) Fut 12/21	(371)	(48,827,078)	2021 年 12 月	10-year U.S. Treasury notes	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	515,922
US 5yr Note (CBT) Fut 12/21	(1,416)	(173,802,938)	2021 年 12 月	5-year U.S. Treasury notes	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	829,686
					未实现总收益	1,345,608

US Long Bond (CBT) Fut 12/21	72	11,463,750	2021 年 12 月	20-year U.S. Treasury bonds	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	(92,250)
					未实现总亏损	(92,250)

					未实现净收益	1,253,358
						=====
<u>2020</u>						
US Ultra Bond (CBT) Futures	71	15,825,375	2020 年 12 月	30-year U.S. Treasury bonds	Citigroup Global Markets Ltd 伦敦	(76,688)
					未实现净亏损	(76,688)
						=====

独立核数师报告

致摩根亚洲总收益债券基金（“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

摩根亚洲总收益债券基金列载于第九页至第四十九页的财务报表，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，包括主要會計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二零零四年十一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责或承担任何责任。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）

致摩根亚洲总收益债券基金（“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；
- （在合理可行的情况下）保护本基金的财产及附带权利；及
- 就每一个会计年度，若管理人未按照信托契约管理本基金，则须向份额持有人报告。

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二零零四年十一月三十日所订立之信托契约（经修订）之条款管理本基金。

汇丰机构信托服务（亚洲）有限公司，受托人
二零二一年一月二十五日

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	每份资产净值
30/9/21		
- 澳元对冲类别（每月派息）	澳元 191,366,724	澳元 8.32
- 加元对冲类别（每月派息）	加元 125,506,796	加元 8.42
- 英镑对冲类别（每月派息）	英镑 5,300,020	英镑 8.80
- 港元类别（每月派息）	港元 4,079,907,047	港元 8.98
- 纽元对冲类别（每月派息）	纽元 76,304,693	纽元 8.29
- 人民币对冲类别（累计）	人民币 15,519,544	人民币 14.34
- 人民币对冲类别（每月派息）	人民币 4,067,566,571	人民币 8.62
- 美元类别（累计）	美元 12,949,102	美元 13.57
- 美元类别（每月派息）	美元 652,534,891	美元 10.29
- PRC 人民币对冲份额（累计）	人民币 791,153,106	人民币 13.62
- PRC 人民币对冲份额（每月派息）	人民币 571,858,247	人民币 9.32
- PRC 美元份额（累计）	美元 374,577,855	美元 12.12
- PRC 美元份额（每月派息）	美元 30,423,683	美元 9.37
30/9/20		
- 澳元对冲类别（每月派息）	澳元 200,080,050	澳元 8.65
- 加元对冲类别（每月派息）	加元 136,678,850	加元 8.74
- 英镑对冲类别（每月派息）	英镑 4,665,897	英镑 9.14
- 港元类别（每月派息）	港元 3,917,117,050	港元 9.28
- 纽元对冲类别（每月派息）	纽元 92,667,985	纽元 8.61
- 人民币对冲类别（累计）	人民币 15,430,879	人民币 13.82
- 人民币对冲类别（每月派息）	人民币 3,618,794,584	人民币 8.97
- 美元类别（累计）	美元 2,621,058	美元 13.39
- 美元类别（每月派息）	美元 736,162,668	美元 10.68
- PRC 人民币对冲份额（累计）	人民币 2,461,936,140	人民币 13.11
- PRC 人民币对冲份额（每月派息）	人民币 754,021,450	人民币 9.68
- PRC 美元份额（累计）	美元 495,983,658	美元 11.97
- PRC 美元份额（每月派息）	美元 35,772,394	美元 9.73
30/9/19		
- 澳元对冲类别（每月派息）	澳元 205,855,872	澳元 8.90
- 加元对冲类别（每月派息）	加元 136,297,063	加元 8.94
- 英镑对冲类别（每月派息）	英镑 3,723,282	英镑 9.36
- 港元类别（每月派息）	港元 3,941,035,656	港元 9.54
- 纽元对冲类别（每月派息）	纽元 88,379,459	纽元 8.83
- 人民币对冲类别（累计）	人民币 98,885,725	人民币 13.19
- 人民币对冲类别（每月派息）	人民币 3,811,348,133	人民币 9.13
- 美元类别（累计）	美元 2,707,081	美元 12.96
- 美元类别（每月派息）	美元 557,035,318	美元 10.86
- PRC 人民币对冲份额（累计）	人民币 5,711,865,861	人民币 12.53
- PRC 人民币对冲份额（每月派息）	人民币 883,011,937	人民币 9.86
- PRC 美元份额（累计）	美元 440,896,043	美元 11.58
- PRC 美元份额（每月派息）	美元 38,278,097	美元 9.89

业绩记录 - 未经审计 (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
30/9/21		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.85	澳元 8.32
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 8.95	加元 8.42
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.34	英镑 8.80
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.50	港元 8.97
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.81	纽元 8.29
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 14.57	人民币 13.84
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.19	人民币 8.62
- 美元类别 (累计)	美元 13.86	美元 13.41
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.93	美元 10.29
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 13.84	人民币 13.19
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.94	人民币 9.32
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12.39	美元 12.03
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 9.97	美元 9.37
30/9/20		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.01	澳元 7.92
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.06	加元 8.00
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.47	英镑 8.36
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.61	港元 8.51
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.94	纽元 7.88
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.89	人民币 12.16
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.24	人民币 8.23
- 美元类别 (累计)	美元 13.49	美元 11.93
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.99	美元 9.79
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 13.17	人民币 11.57
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.98	人民币 8.89
- PRC 美元份额 (累计)	美元 12.05	美元 10.66
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.02	美元 8.92
30/9/19		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 8.98	澳元 8.48
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.02	加元 8.53
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.43	英镑 8.92
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.64	港元 9.07
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 8.91	纽元 8.42
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.21	人民币 12.01
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.22	人民币 8.71
- 美元类别 (累计)	美元 12.98	美元 11.84
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.96	美元 10.35
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 12.55	人民币 11.41
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 9.96	人民币 9.40
- PRC 美元份额 (累计)	美元 11.60	美元 10.58
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 9.99	美元 9.43
30/9/18		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.14	澳元 8.54
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.18	加元 8.58
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 9.59	英镑 8.97
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.76	港元 9.17
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.07	纽元 8.47
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.32	人民币 11.88
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.38	人民币 8.78
- 美元类别 (累计)	美元 12.30	美元 11.75
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.13	美元 10.42
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.72	人民币 11.30
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.14	人民币 9.48
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.99	美元 10.49
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.15	美元 9.49

(续)

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
30/9/17		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.56	澳元 8.99
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.60	加元 9.03
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.04	英镑 9.43
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.12	港元 9.51
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.50	纽元 8.93
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.11	人民币 11.20
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.86	人民币 9.20
- 美元类别 (累计)	美元 12.24	美元 11.60
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.63	美元 10.95
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.51	人民币 10.63
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.42	人民币 9.92
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.88	美元 10.36
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.38	美元 9.98
30/9/16		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.65	澳元 9.01
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.68	加元 9.03
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.11	英镑 9.43
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.20	港元 9.51
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.58	纽元 8.94
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 11.82	人民币 10.36
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.95	人民币 9.26
- 美元类别 (累计)	美元 12.29	美元 11.09
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.73	美元 10.93
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.00	人民币 10.02
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.53	人民币 10.00
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.77	美元 9.96
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.49	美元 9.96
30/9/15		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.97	澳元 9.05
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.95	加元 9.07
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.35	英镑 9.45
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.46	港元 9.53
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.90	纽元 8.98
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 10.92	人民币 10.12
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.32	人民币 9.32
- 美元类别 (累计)	美元 11.83	美元 11.06
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.04	美元 10.97
30/9/14		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.05	澳元 9.41
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.06	加元 9.42
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.54	港元 9.89
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.00	纽元 9.36
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 10.49	人民币 10.01
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.41	人民币 9.91
- 美元类别 (累计)	美元 11.61	美元 10.53
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.13	美元 11.36
30/9/13		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.46	澳元 9.29
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.46	加元 9.29
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.94	港元 9.73
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.42	纽元 9.24
- 美元类别 (累计)	美元 11.40	美元 10.28
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.58	美元 11.19

业绩记录 - 未经审计 (续)

最高卖出价/最低买入价

<u>财务期结算日</u>	<u>最高卖出价</u>	<u>最低买入价</u>
30/9/12		
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.68	港元 9.91
- 美元类别 (累计)	美元 10.87	美元 9.97
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.29	美元 10.48

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

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

助理管理人

JPMorgan Asset Management
(UK) Limited
60 Victoria Embankment
London
EC4Y 0JP
United Kingdom

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

汇丰机构信托服务
(亚洲)有限公司
香港
中环皇后大道中1号

基金注册登记机构

HSBC Trustee (Cayman) Limited
P.O. Box 309
Ugland House
Grand Cayman KY1-1104
Cayman 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

