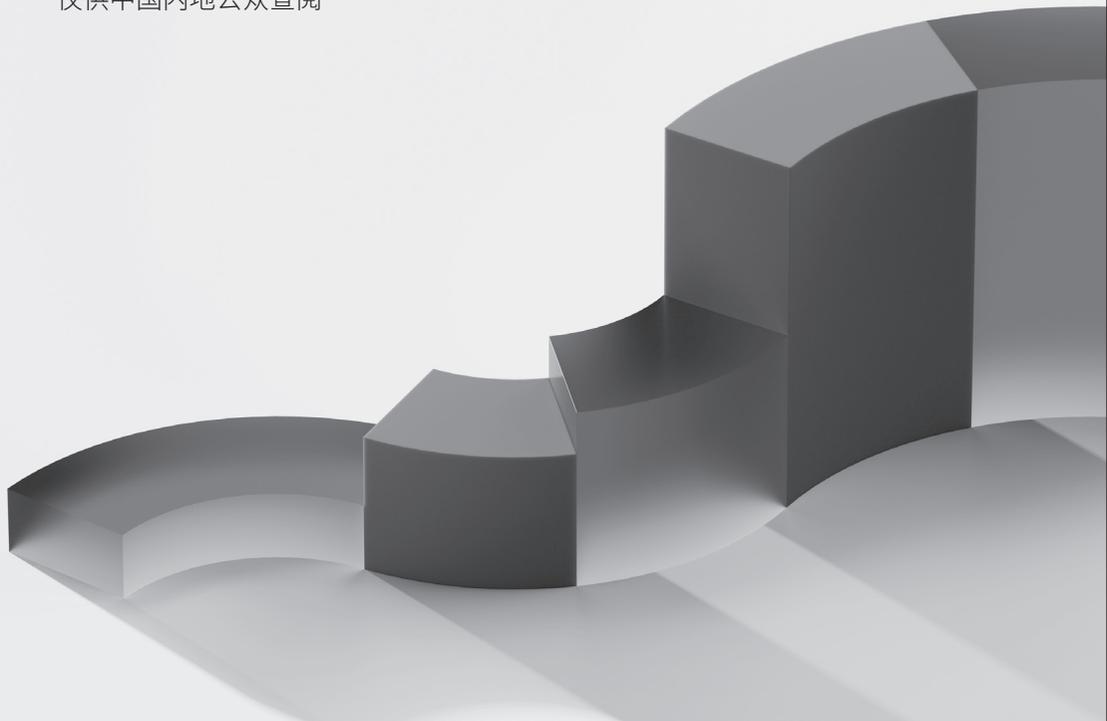


仅供中国内地公众查阅



半年度报告— 2022年3月31日（未经审核）

摩根亚洲总收益 债券基金



内地与香港互认基金系列

中国内地代理人：

上投摩根
基金 管 理

基金管理人：

摩根
资 产 管 理

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

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

内容	页
投资组合	1 - 8
投资组合持有变动表	8
金融衍生工具详情	9 - 20
抵押品持有情况	21
财务状况表	22
综合收益表	22 - 23
可赎回份额持有人应占净资产变动表	23
现金流量表	24
财务报表之附注	25 - 35

投资组合

(续)

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产净 值百分比		单位数目	公平值 美元	占资产净 值百分比
上市投资(97.5%)				开曼群岛(续)			
(I) 债务证券 (97.4%)				Country Garden 7.25%			
				08/04/26-RegS	美元 600,000	487,404	0.0
				Foxconn Far East Ltd 2.5%			
				28/10/30-RegS	美元 12,200,000	11,082,870	0.6
百慕大(0.7%)				FWD Ltd VRN 0% Perp-RegS	美元 18,300,000	17,750,085	0.9
China Oil & Gas 4.7%				Goodman HK Fin 4.375%			
30/06/26-RegS	美元 4,400,000	4,317,855	0.2	19/06/24-RegS	美元 1,300,000	1,343,734	0.1
China Oil & Gas 5.5%				Goodman HK Finance 3%			
25/01/23-RegS	美元 10,000,000	10,207,333	0.5	22/07/30-RegS	美元 2,300,000	2,204,306	0.1
开曼群岛(9.2%)				HPHT Finance 21.2%			
Agile Group Hldgs VRN				19/03/26-RegS	美元 1,000,000	949,667	0.1
6.875% 29/12/49-RegS	美元 2,000,000	411,720	0.0	KWG Group Holdings 6%			
Agile Group Hldgs VRN				15/09/22-RegS	美元 2,000,000	1,205,333	0.1
7.875%-RegS	美元 20,800,000	4,489,550	0.2	Longfor Grp 3.85%			
Azure Orbit IV 4% 25/01/28-RegS	美元 700,000	705,726	0.0	13/01/32-RegS	美元 2,000,000	1,735,145	0.1
Baidu Inc 3.425% 07/04/30-RegS	美元 1,000,000	978,799	0.1	Longfor Grp Hldg 4.5%			
CDBL Funding 2% 04/03/26-RegS	美元 5,800,000	5,449,999	0.3	16/01/28-RegS	美元 11,600,000	10,949,507	0.6
Champion Mtn Ltd 2.95%				Melco Resorts Fin 5.625%			
15/06/30-RegS	美元 11,600,000	11,157,682	0.6	07/27-RegS	美元 5,200,000	4,767,217	0.2
China Overseas 2.375%				Melco Resorts Finance			
2/3/25-RegS	美元 10,100,000	9,680,529	0.5	5.375% 04/12/29-RegS	美元 2,000,000	1,739,938	0.1
China Resources VRN 3.75%				Sands China 5.125%			
Perp-RegS	美元 12,400,000	12,459,107	0.6	08/08/25	美元 4,500,000	4,517,078	0.2
CIFI Hldgs Group VRN				Sands China 5.4% 08/08/28	美元 2,300,000	2,284,291	0.1
5.375% 29/12/49-RegS	美元 4,500,000	3,829,609	0.2	Shui On Develop 5.5%			
CK Hutchison Intl 2.5%				03/03/25-RegS	美元 12,500,000	11,615,972	0.6
8/5/30-RegS	美元 3,500,000	3,278,827	0.2	Shui on Develop Hldg VRN			
CK Hutchison Intl 2.75%				6.4% 20/12/65	美元 3,800,000	3,778,931	0.2
6/9/29-RegS	美元 300,000	286,774	0.0	Shui on Development Hldg			
CK Hutchison Intl 3.625%				5.75% 12/11/23-RegS	美元 6,900,000	6,777,190	0.3
04/29-RegS	美元 4,200,000	4,321,897	0.2	Sun Hung Kai Prop 3.75%			
Country Garden 2.7%				02/29-RegS	美元 6,000,000	6,147,378	0.3
12/07/26-RegS	美元 5,800,000	4,153,815	0.2	Tencent Holdings 3.84%			
Country Garden 5.625%				22/04/51-RegS	美元 15,000,000	13,304,378	0.7
15/12/26-RegS	美元 1,500,000	1,134,844	0.1	Times China Hldg Ltd 6.75%			
Country Garden 6.15%				08/07/25-RegS	美元 2,000,000	842,000	0.0
17/09/25-RegS	美元 7,800,000	6,102,655	0.3	Times China Hldgs 6.75%			
				07/23-RegS	美元 4,500,000	2,360,531	0.1
				Zhongsheng Group 3%			
				13/01/26-RegS	美元 6,900,000	6,636,834	0.3

投资组合(续)

(续)

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产净 值百分比		单位数目	公平值 美元	占资产净 值百分比
中国(7.7%)				香港(12.9%)			
Bank of China VRN 3.6% Perp-RegS	美元 6,800,000	6,835,360	0.4	AIA Group 3.2% 16/09/40- RegS	美元 6,000,000	5,338,001	0.3
Bank of Communication VRN 3.8% 31/12/49- RegS	美元 13,800,000	13,993,336	0.7	AIA Group VRN 29/12/49- RegS	美元 9,500,000	9,003,929	0.5
CCB Life Ins VRN 4.5% 21/4/77-RegS	美元 5,000,000	5,096,875	0.3	Airport Authority HK VRN 2.1% 31/12/49-RegS	美元 4,200,000	3,976,735	0.2
CDB Fin Leasing VRN 2.875% 9/30-RegS	美元 12,600,000	12,205,552	0.6	Airport Authority HK VRN 2.4% 31/12/49-RegS	美元 5,200,000	4,814,583	0.2
China CITIC Bk VRN 4.625% 2/29-RegS	美元 10,050,000	10,198,685	0.5	Anhui Transportation Hk 1.618% 26/08/26-RegS	美元 700,000	647,891	0.0
China Constr VRN 2.45% 24/6/30-RegS	美元 3,100,000	3,008,818	0.2	Bank Of Communication Hk VRN 2.304% 08/07/31- RegS	美元 14,250,000	13,439,061	0.7
China Constr VRN 2.85% 21/1/32-RegS	美元 17,500,000	16,845,634	0.9	Bank of East Asia VRN 5.625%Perp-RegS	美元 9,400,000	9,601,219	0.5
China Govt 3.53% 18/10/51-RegS	人民币 60,000,000	9,912,570	0.5	Bank of East Asia VRN 5.825% 31/12/49-RegS	美元 6,200,000	6,322,071	0.3
ENN Energy 2.625% 17/09/30-RegS	美元 6,800,000	6,108,133	0.3	Bank of East Asia VRN 5.875% Perp-RegS	美元 3,000,000	2,990,875	0.2
ICBC Ltd VRN 3.2% Perp- RegS	美元 6,500,000	6,341,135	0.3	China Clean Energy 4.282% 12/25-RegS	美元 3,500,000	3,581,873	0.2
ICBC Ltd VRN 3.58% Perp-RegS	美元 8,500,000	8,616,391	0.4	Chong Hing Bk VRN 3.876% 07/27-RegS	美元 15,300,000	15,387,949	0.8
ICBCIL Finance 1.75% 25/08/25-RegS	美元 14,800,000	13,998,832	0.7	Chong Hing Bk VRN 5.7% Perp-RegS	美元 6,300,000	6,355,965	0.3
Kunming Rail 3.5% 12/12/22-RegS	美元 9,600,000	9,737,484	0.5	CITIC Ltd 3.875% 28/02/27- RegS	美元 14,700,000	14,815,043	0.8
Kunming Traffic Inv 6.2% 6/22-RegS	美元 11,000,000	10,912,439	0.6	CMB International Leasin 2% 04/02/26-RegS	美元 2,200,000	2,059,897	0.1
Shougang Group 4% 23/05/24-RegS	美元 16,000,000	16,310,515	0.8	CMB International Leasin 2.75% 12/08/30-RegS	美元 7,600,000	6,772,588	0.3
哥伦比亚(0.0%)				CMB Wing Lung Bk VRN 3.75%11/27-RegS	美元 6,000,000	6,099,405	0.3
Rep of Colombia 4.375% 21/03/23	哥伦比亚比索 500,000,000	130,486	0.0	CNAC HK Finbrid VRN 3.35% Perp-RegS	美元 20,200,000	20,166,418	1.0

投资组合(续)

(续)

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

	单位数目	公允价值 美元	占资产净 值百分比		单位数目	公允价值 美元	占资产净 值百分比
香港(续)				印度(续)			
CNAC HK Finbridge 3.875%				HDFC Bank VRN 3.7%			
06/29-RegS	美元 10,500,000	10,451,849	0.5	31/12/49-RegS	美元 14,400,000	13,427,280	0.7
Gemdale Ever 5.6%				Indian Railway Fin 3.249%			
14/06/22-RegS	美元 1,400,000	1,410,422	0.1	2/30-RegS	美元 5,000,000	4,709,310	0.2
GLP China Holdings Ltd				Indian Railway Fin 3.73%			
2.95% 29/03/26-RegS	美元 9,400,000	8,712,896	0.4	29/3/24-RegS	美元 1,000,000	1,005,597	0.0
HBIS Group HK 3.75%				Indian Railway Finance			
18/12/22-RegS	美元 7,000,000	7,088,208	0.4	3.835% 13/12/27-RegS	美元 800,000	802,521	0.0
HK Intl (Qingdao) 3.9%				JSW Infrastructure 4.95%			
11/22-RegS	美元 7,600,000	7,739,853	0.4	21/01/29-RegS	美元 5,700,000	5,492,996	0.3
HK Intl (Qingdao) 4.25%				JSW Steel 3.95% 05/04/27-RegS	美元 11,700,000	11,270,941	0.6
12/22-RegS	美元 9,900,000	10,071,166	0.5	JSW Steel 5.95% 18/04/24-RegS	美元 4,000,000	4,198,761	0.2
HK Red Star Macal 3.375%				Jubilant Pharma 6%			
21/09/22-RegS	美元 9,500,000	7,323,906	0.4	05/03/24-RegS	美元 5,800,000	5,832,151	0.3
ICBCIL Finance 3.625%				NTPC Ltd 3.75% 03/04/24-RegS	美元 2,700,000	2,744,453	0.1
19/05/26-RegS	美元 13,000,000	13,184,648	0.7	NTPC Ltd 4.5% 19/03/28-RegS	美元 5,000,000	5,003,740	0.3
Jinan Urb Const Intl Inv				Oil India 5.125% 04/02/29-RegS	美元 3,250,000	3,441,099	0.2
2.4% 23/09/26-RegS	美元 5,800,000	5,433,355	0.3	Renew Power Syn 6.67%			
Lenovo Group Ltd 3.421%				12/03/24-RegS	美元 9,600,000	9,849,795	0.5
02/11/30-RegS	美元 7,700,000	7,237,936	0.4				
MCC Holding Hk Corp VRN				印度尼西亚(11.0%)			
31/12/49-RegS	美元 10,600,000	10,636,496	0.5	Adaro Indonesia 4.25%			
MTR Corp 1.625% 19/08/30-RegS	美元 7,600,000	6,742,795	0.3	31/10/24-RegS	美元 10,000,000	10,050,314	0.5
Weichai Intl HK VRN 3.75%				Bank Negara Indonesia VRN			
Perp-RegS	美元 6,000,000	6,052,685	0.3	4.3% 31/12/49-RegS	美元 15,500,000	14,183,137	0.7
Xiaomi Best Time Intl				Bank Tabungan Negara			
3.375% 29/04/2030-RegS	美元 15,900,000	14,609,294	0.8	4.2% 1/25-RegS	美元 6,300,000	6,181,455	0.3
Xiaomi Best Time Intl 4.1%				Hutama Karya 3.75%			
14/07/51-RegS	美元 4,700,000	3,954,173	0.2	11/05/30-RegS	美元 12,500,000	12,741,904	0.7
印度(5.4%)				Hyundai Motor Manu Indo			
Adani Ports & Sp 3.375%				1.75% 06/05/26-RegS	美元 6,900,000	6,489,337	0.3
24/7/24-RegS	美元 7,900,000	7,834,483	0.4	Indonesia Asahan 6.757%			
Adani Ports & Sp 4.2%				11/48-RegS	美元 12,200,000	13,984,756	0.7
04/08/27-RegS	美元 10,000,000	9,824,410	0.5	Indonesia Asahan Alumini			
Adani Transmiss 4.25%				5.8% 15/05/50-RegS	美元 12,200,000	12,489,947	0.6
21/05/36-RegS	美元 1,700,000	1,439,833	0.1				
Adani Transmission 4%							
03/08/26-RegS	美元 9,400,000	9,216,784	0.5				
Bharat Petroleum 4%							
08/05/25-RegS	美元 10,440,000	10,578,580	0.5				

投资组合(续)

(续)

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产净 值百分比		单位数目	公平值 美元	占资产净 值百分比
印度尼西亚(续)				韩国(5.7%)			
Indonesia Gov 8.25%	印尼盾			Busan Bank 3.625%			
15/05/29-RegS	100,000,000,000	7,776,639	0.4	25/07/26-RegS	美元 16,200,000	16,147,574	0.8
Indonesia Govt 1.85%				Hana Bank VRN 3.5%			
12/03/31-RegS	美元 5,600,000	5,082,237	0.3	Perp-RegS	美元 4,700,000	4,563,070	0.2
Indonesia Govt 3.05%				Hanwha Life Ins VRN			
12/03/51-RegS	美元 11,300,000	10,261,866	0.5	3.379% 04/02/32-			
Indonesia Govt NoFR64	印尼盾			RegS	美元 5,800,000	5,594,240	0.3
6.125% 15/05/28	303,000,000,000	21,302,509	1.1	Heungkuk Life VRN			
Pelabuhan Indonesia				4.475% 11/47-RegS	美元 16,000,000	16,250,182	0.8
5.375% 5/45-RegS	美元 14,000,000	15,398,650	0.8	Hyundai Capital Services			
Pertamina Persero				1.25% 08/02/26-RegS	美元 900,000	828,395	0.0
5.625% 20/05/43	美元 5,600,000	6,088,005	0.3	Kookmin Bank 4.5%			
Pertamina Persero 6%				01/02/29-RegS	美元 9,900,000	10,385,674	0.5
03/05/42-RegS	美元 5,000,000	5,705,273	0.3	Korea Inv & Secs 2.125%			
Perusahaan Listrik 4%				19/07/26-RegS	美元 14,000,000	13,128,836	0.7
30/06/50-RegS	美元 10,000,000	9,008,061	0.5	Rep of Korea 1.125%	韩元		
Perusahaan Listrik Neg				10/06/30	15,000,000,000	12,571,387	0.7
4.375% 05/02/50-				Shinhan Fin Grp VRN			
RegS	美元 9,000,000	8,321,270	0.4	3.34% 2/30-RegS	美元 11,200,000	11,091,181	0.6
Perusahaan Listrik Neg				Shinhan Fin Grp VRN			
4.875% 17/07/49-				31/12/49-RegS	美元 8,000,000	7,404,406	0.4
RegS	美元 3,000,000	2,910,677	0.2	Woori Bank VRN 4.25%			
Perusahaan Listrik Neg				Perp-RegS	美元 12,900,000	12,981,861	0.7
6.25% 25/01/49-RegS	美元 2,000,000	2,287,327	0.1				
Perusahaan Listrik Negar				马来西亚(2.4%)			
5.25% 24/10/42-RegS	美元 2,000,000	2,070,472	0.1	Axiata SPV5 Labuan Ltd			
Perusahaan Listrik Negar				3.064% 19/08/50-RegS	美元 5,000,000	4,333,527	0.2
6.15% 21/05/48-RegS	美元 17,000,000	19,365,267	1.0	GOHL Capital 4.25%			
PT Pertamina 2.3%				24/01/27-RegS	美元 15,900,000	15,304,851	0.8
09/02/31-RegS	美元 15,600,000	13,883,520	0.7	Malaysia Government 3.9%			
PT Pertamina 4.175%				30/11/26-RegS	林吉特 23,000,000	5,654,802	0.3
21/01/50-RegS	美元 10,600,000	9,880,282	0.5	Malaysian Government			
				3.733% 15/06/28-RegS	林吉特 60,800,000	14,576,678	0.7
泽西市(0.3%)				TNB Global Vent 4.851%			
West China Cement				1/11/28-RegS	美元 7,100,000	7,663,459	0.4
4.95% 08/07/26-RegS	美元 7,000,000	6,353,637	0.3				

投资组合(续)

(续)

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产净 值百分比		单位数目	公平值 美元	占资产净 值百分比
毛里求斯(2.4%)				新西兰(0.3%)			
Azure Orbit IV 3.575%				New Zealand Govt 2%			
25/01/28-RegS	美元 4,100,000	3,784,335	0.2	15/05/32	纽元 8,000,000	5,019,906	0.3
Azure Power Solar 5.65%							
12/24-RegS	美元 8,750,000	9,123,832	0.5	菲律宾(3.2%)			
Greenko Mauritius 6.25%				Globe Telecom Inc VRN			
21/2/23-RegS	美元 8,700,000	8,848,397	0.4	4.2% Perp-RegS	美元 6,800,000	6,733,090	0.3
Greenko Power 4.3%				Megaworld Corp 4.125%			
13/12/28	美元 2,900,000	2,756,885	0.1	30/07/27-RegS	美元 14,400,000	14,551,770	0.7
Greenko Solar 5.55%				Metropolitan Bank 2.125%			
29/01/25-RegS	美元 3,300,000	3,364,542	0.2	01/26-RegS	美元 5,300,000	5,105,400	0.3
Greenko Wind 5.5%				PLDT Inc 2.5% 23/01/31-			
06/04/25-RegS	美元 4,200,000	4,197,900	0.2	RegS	美元 3,600,000	3,310,460	0.2
India Green Energy Hld				Rizal Comm Bank VRN			
5.375% 29/04/24-RegS	美元 5,000,000	5,150,722	0.3	6.5% Perp-RegS	美元 15,500,000	14,827,763	0.8
India Green Power Hol				SMC Global Power Hld			
4% 22/02/27	美元 10,150,000	9,412,433	0.5	VRN 5.95% 31/12/49-	美元 1,100,000	1,064,669	0.0
				RegS			
墨西哥(1.6%)				SMC Global Power Hld			
Mexican Bds Desarr	墨西哥比索			VRN 6.5% 31/12/49-			
NoM20 8.5% 05/29	2,800,000	14,520,610	0.8	RegS	美元 7,300,000	7,323,117	0.4
Mexico Utd States 7.75%	墨西哥比索			SMC Global Power Hld			
29/05/31	3,300,000	16,358,785	0.8	VRN 7% 31/12/49-RegS	美元 10,000,000	10,083,611	0.5
蒙古(0.8%)				新加坡(8.3%)			
Mongolia Intl Bond 3.5%				Abja Investment 5.45%			
07/07/27-RegS	美元 3,000,000	2,766,008	0.1	24/01/28-RegS	美元 9,200,000	9,612,013	0.5
Mongolia Intl Bond				BOC Aviation 3.25%			
4.45% 07/07/31-RegS	美元 8,200,000	7,489,293	0.4	29/04/25-RegS	美元 3,800,000	3,796,178	0.2
Mongolia Intl Bond				Continuum Energy 4.5%			
5.625% 01/05/23-RegS	美元 4,800,000	4,954,135	0.3	09/02/2027	美元 9,400,000	8,995,409	0.5
				DBS Grp Hldgs VRN 3.3%			
荷兰(1.4%)				Perp-RegS	美元 9,000,000	8,791,395	0.4
Greenko Dutch Bv 3.85%				GLP Pte 3.875% 04/06/25-			
29/03/2026	美元 10,700,000	9,890,293	0.5	RegS	美元 17,100,000	16,894,454	0.9
Minejesa Capital 4.625%				Indika Energy 5.875%			
08/30-RegS	美元 16,000,000	15,344,833	0.8	09/11/24-RegS	美元 15,600,000	15,773,918	0.8
Minejesa Capital 5.625%				Indika Energy Capital Iv			
10/08/37-RegS	美元 2,000,000	1,841,308	0.1	8.25% 22/10/25-RegS	美元 5,200,000	5,463,575	0.3
				LLPL Capital Pte 6.875%			
				4/2/39-RegS	美元 13,800,000	12,192,645	0.6

投资组合(续)

(续)

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产净 值百分比		单位数目	公平值 美元	占资产净值 百分比
新加坡(续)				维京群岛(20.4%)			
Medco Bell 6.375%				Amipeace Ltd 2.25%			
30/01/27-RegS	美元 4,000,000	3,908,988	0.2	22/10/30-RegS	美元 5,600,000	5,116,118	0.3
Medco Oak Tree 7.375%				Beijing Capital 2.8%			
14/05/26-RegS	美元 3,000,000	3,116,958	0.2	22/10/30-RegS	美元 11,900,000	11,850,652	0.6
Medco Platinum 6.75%				Bluestar Fin Hldgs VRN			
30/01/25-RegS	美元 15,600,000	15,819,297	0.8	3.875% 31/12/49-RegS	美元 8,300,000	8,407,410	0.4
OCBC VRN 1.832%				CAS Capital No1 VRN 4%			
10/09/30-RegS	美元 10,300,000	9,734,928	0.5	31/12/49-RegS	美元 17,200,000	16,354,238	0.8
Parkway Pantai VRN				Castle Peak PWR Fin			
4.25% Perp-RegS	美元 13,300,000	13,234,239	0.7	2.125% 03/03/31-RegS	美元 5,900,000	5,254,025	0.3
PSA Intl Pte 2.25%				Castle Peak Pwr Fin 2.2%			
30/04/30-RegS	美元 2,000,000	1,905,199	0.1	06/30-RegS	美元 6,200,000	5,646,290	0.3
Singapore Govt 2.25%	新加坡元			CCCI Treasure VRN 3.425%			
01/08/36	22,500,000	16,183,044	0.8	Perp-RegS	美元 6,000,000	5,989,833	0.3
United Overseas VRN				CCCI Treasure VRN 3.65%			
3.875%PERP-RegS	美元 16,000,000	16,184,600	0.8	Perp-RegS	美元 4,200,000	4,166,381	0.2
				Central Plaza Dev VRN			
国际(1.2%)				5.75% 31/12/49-RegS	美元 9,900,000	8,631,631	0.4
Corp Andina Fomento	哥伦比亚比索			Champion Path Holdings			
6.77% 5/28-RegS	23,000,000,000	5,614,818	0.3	4.5% 27/01/26-RegS	美元 1,400,000	1,215,200	0.1
Intl Bk Recon & Develop	巴西雷亚尔			Champion Path Holdings			
6.75% 04/02/24-RegS	49,755,000	9,872,118	0.5	4.85% 27/01/28-RegS	美元 2,800,000	2,247,762	0.1
Intl Finance Corp 6.2%	巴西雷亚尔			China Railway XunJie			
27/07/22-RegS	34,890,000	7,248,064	0.4	3.25%7/26-RegS	美元 4,500,000	4,462,571	0.2
				Chinalco Capital Hlgs			
泰国(2.5%)				2.125% 03/06/26-RegS	美元 5,700,000	5,374,418	0.3
Bangkok Bank VRN 5%				Chinalco Capital Hlgs			
31/12/49-RegS	美元 9,000,000	8,898,850	0.5	2.95% 24/02/27-RegS	美元 2,300,000	2,222,805	0.1
Kasikornbank VRN 3.343%				Chouzhou Intl Inv			
10/31-RegS	美元 13,100,000	12,543,802	0.6	3.15%11/8/23-RegS	美元 8,100,000	8,119,983	0.4
Krung Thai Bank/Caym				CLP Power HK Fin 2.125%			
VRN 4.4% 31/12/49-				06/30-RegS	美元 10,100,000	9,172,634	0.5
RegS	美元 13,200,000	12,341,780	0.6	CN Huaneng VRN 2.85%			
Muang Thai Life VRN				31/12/49-RegS	美元 5,900,000	5,904,818	0.3
27/01/37-RegS	美元 2,500,000	2,402,432	0.1	CN Huaneng VRN 3.08%			
Thai Oil Trsry Center 3.5%				29/12/49-RegS	美元 5,900,000	5,832,045	0.3
17/10/49-RegS	美元 9,000,000	6,882,565	0.4	CNPC Global Cap 2%			
Thai Oil Trsry Center				23/06/30-RegS	美元 19,600,000	17,648,417	0.9
3.75% 18/06/50-RegS	美元 7,700,000	6,106,671	0.3	Dianjian Haiyu VRN 3.45%			
				Perp-RegS	美元 6,400,000	6,339,147	0.3

投资组合(续)

(续)

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

	单位数目	公允价值 美元	占资产净 值百分比		单位数目	公允价值 美元	占资产净 值百分比
维京群岛(续)				维京群岛(续)			
ENN Clean Energy 3.375%				RKPF Overseas 2019 A 5.9%			
12/05/26-RegS	美元 7,300,000	6,931,472	0.4	05/03/25-RegS	美元 2,000,000	1,599,022	0.1
Fortune Star 5% 18/05/26-RegS	美元 14,200,000	12,379,166	0.6	RKPF Overseas 2020 A 5.2%			
Fortune Star 5.95%				12/01/26-RegS	美元 11,100,000	8,787,438	0.4
29/01/23-RegS	美元 2,200,000	2,184,044	0.1	01RKPF Overseas 6.7%			
Fortune Star 6.75%				30/09/24-RegS	美元 11,400,000	9,865,972	0.5
02/07/23-RegS	美元 14,400,000	14,324,580	0.7	SD Iron & Steel Xinheng			
Franshion Brillant VRN 4%				4.8% 28/07/24-RegS	美元 8,800,000	8,807,920	0.5
Perp-RegS	美元 12,700,000	12,316,178	0.6	SD Iron & Steel Xinheng			
Gemstones Intl 12%				6.85% 25/09/22-RegS	美元 9,300,000	9,429,658	0.5
10/03/23-RegS	美元 23,600,000	14,620,200	0.7	Sinopec Grp 2018 2.7%			
Greenland Global 5.9%				13/05/30-RegS	美元 11,900,000	11,307,904	0.6
12/02/23-RegS	美元 20,400,000	14,283,173	0.7	Studio City Finance 6%			
Haitian Bvi Int Invst 2.8%				15/7/25-RegS	美元 6,500,000	6,037,081	0.3
04/11/23-RegS	美元 12,400,000	12,435,505	0.6	Sunny Express 2.95%			
HKT Capital No43				01/03/27-RegS	美元 7,400,000	7,248,880	0.4
14/07/26-RegS	美元 1,700,000	1,680,512	0.1	Talent Yield 3.125%			
Huarong Fin 2017 VRN 4%				06/05/31-RegS	美元 5,400,000	5,197,990	0.3
Perp-RegS	美元 15,100,000	15,379,350	0.8	Wealth Driven 5.5%			
Huarong Fin 2019 3.375%				17/08/23-RegS	美元 3,200,000	3,149,991	0.2
02/30-RegS	美元 11,100,000	9,737,128	0.5			1,905,155,267	97.4
Huarong Fin 2019 4.5%						-----	-----
29/05/29-RegS	美元 7,500,000	7,217,475	0.4				
Huarong Finance 2019				(II) 衍生性产品(0.1%)			
3.875% 13/11/29-RegS	美元 6,169,000	5,697,714	0.3	远期外汇合约(0.1%)		1,804,296	0.1
Hysan (MTN) 2.875%							
02/06/27-RegS	美元 12,000,000	11,790,642	0.6	期货(0.0%)			
JIC Zhixin 3.5% 24/11/27-RegS	美元 2,000,000	2,019,553	0.1	Aust 10yr Bond Fut 06/22	132	(74,218)	(0.0)
Minmetals Boun VRN				US 2yr Note (CBT) Fut 06/22	(923)	118,617	0.0
3.375% Perp-RegS	美元 5,200,000	5,170,282	0.3	US Ultra Bond (CBT) Fut			
Minmetals Bounteous 4.2%				06/22	60	328,625	0.0
07/26-RegS	美元 10,000,000	10,291,167	0.5			-----	-----
New Metro Global 4.5%						2,177,320	0.1
02/05/26-RegS	美元 13,000,000	8,491,032	0.4			-----	-----
New Metro Global 4.8%							
15/12/24-RegS	美元 7,700,000	5,583,495	0.3				
NWD MTN Ltd 4.125%							
18/07/29-RegS	美元 16,400,000	15,200,989	0.8				

投资组合(续)

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

投资组合持有变动表

截至二零二二年三月三十一日止期间(未经审计)

	单位数目	占资产		持有占资产净值百分比		
		公平值 美元	净值 百分比	二零二二年 三月三十一日	二零二一年 九月三十日	
总上市投资		1,907,332,587	97.5			
其他净资产		48,201,636	2.5			
截至二零二二年三月三十一日可赎回份额持有人应占净资产		1,955,534,223	100.0			
总投资, 按成本		2,015,772,380				
				上市投资		
				债券证券		
				维京群岛	20.4	22.3
				香港	12.9	11.9
				印度尼西亚	11.0	9.7
				开曼群岛	9.2	14.1
				新加坡	8.3	6.2
				中国	7.7	7.2
				韩国	5.7	3.9
				印度	5.4	4.1
				菲律宾	3.2	2.7
				泰国	2.5	2.6
				马来西亚	2.4	2.4
				毛里求斯	2.4	1.8
				墨西哥	1.6	1.8
				荷兰	1.4	1.7
				国际	1.2	1.3
				蒙古	0.8	0.3
				百慕大	0.7	0.6
				泽西市	0.3	0.2
				新西兰	0.3	-
				哥伦比亚	0.0	0.0
				美国	-	1.6
				巴基斯坦	-	0.6
				斯里兰卡	-	0.5
				衍生性产品		
				远期外汇合约	0.1	(0.2)
				期货	0.0	0.1
				总上市投资	97.5	97.4
				其他净资产	2.5	2.6
				可赎回份额持有人应占净资产	100.0	100.0

金融衍生工具详情

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

截至二零二二年三月三十一日，本基金持有之金融衍生工具汇总如下：

(a) 远期外汇合约

以下为截至二零二二年三月三十一日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/(亏损) 美元
<u>截至二零二二年三月三十一日</u>				
未平仓合约：				
美元 481,217	离岸人民币 3,074,572	2022 年 4 月 1 日	法国巴黎银行	3,113
美元 200,119	离岸人民币 1,278,572	2022 年 4 月 1 日	法国巴黎银行	1,291
美元 264,455	离岸人民币 1,685,710	2022 年 4 月 1 日	汇丰银行，伦敦	1,090
美元 64,404	离岸人民币 410,557	2022 年 4 月 1 日	汇丰银行，伦敦	270
美元 50,592	离岸人民币 322,494	2022 年 4 月 1 日	汇丰银行，伦敦	210
美元 21,002	纽元 30,455	2022 年 4 月 1 日	美林国际，伦敦	181
美元 11,763	离岸人民币 75,156	2022 年 4 月 1 日	法国巴黎银行	76
美元 5,979	澳元 7,996	2022 年 4 月 1 日	法国巴黎银行	26
美元 1,104	纽元 1,595	2022 年 4 月 1 日	美林国际，伦敦	5
美元 1,102	离岸人民币 7,026	2022 年 4 月 1 日	汇丰银行，伦敦	5
美元 1,104	澳元 1,471	2022 年 4 月 1 日	加拿大皇家银行	1
美元 60,457	加元 75,692	2022 年 4 月 4 日	汇丰银行，伦敦	143
美元 10,157	纽元 14,675	2022 年 4 月 4 日	汇丰银行，伦敦	50
美元 26,837	澳元 35,770	2022 年 4 月 4 日	加拿大皇家银行	25
英镑 24,728	美元 32,575	2022 年 4 月 6 日	加拿大皇家银行	18
美元 213,268	离岸人民币 1,356,021	2022 年 4 月 6 日	法国巴黎银行	290
美元 65,716	离岸人民币 417,909	2022 年 4 月 6 日	加拿大皇家银行	100
美元 24,527	离岸人民币 155,977	2022 年 4 月 6 日	加拿大皇家银行	37
美元 1,102	离岸人民币 7,026	2022 年 4 月 6 日	汇丰银行，伦敦	5
美元 1,102	离岸人民币 7,026	2022 年 4 月 6 日	汇丰银行，伦敦	5
离岸人民币 7,195	美元 1,133	2022 年 4 月 7 日	汇丰银行，伦敦	0
美元 76,218	纽元 109,592	2022 年 4 月 7 日	美林国际，伦敦	4
美元 1,102	离岸人民币 7,011	2022 年 4 月 7 日	加拿大皇家银行	2
美元 1,102	离岸人民币 7,011	2022 年 4 月 7 日	加拿大皇家银行	2
离岸人民币 346,296	美元 54,536	2022 年 4 月 8 日	美林国际，伦敦	5
离岸人民币 386,519	美元 60,860	2022 年 4 月 11 日	美林国际，伦敦	7
离岸人民币 35,044	美元 5,518	2022 年 4 月 11 日	美林国际，伦敦	1
澳元 402,519	美元 302,495	2022 年 4 月 21 日	花旗银行，伦敦	157
澳元 1,466	美元 1,103	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	2
加元 1,377	美元 1,106	2022 年 4 月 21 日	法国巴黎银行	4
加元 1,377	美元 1,106	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	4

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 28,703,536	美元 4,530,743	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	14,708
离岸人民币 28,234,953	美元 4,452,492	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	10,181
离岸人民币 26,101,978	美元 4,114,208	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	7,487
离岸人民币 21,120,578	美元 3,329,796	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	6,817
离岸人民币 14,065,839	美元 2,217,862	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	4,831
离岸人民币 7,070,491	美元 1,115,671	2022年4月21日	多伦多道明银行	3,245
离岸人民币 9,274,909	美元 1,461,842	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,586
离岸人民币 12,497,482	美元 1,968,292	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	2,016
离岸人民币 4,952,237	美元 781,155	2022年4月21日	美国道富银行	2,001
离岸人民币 4,175,400	美元 658,743	2022年4月21日	加拿大皇家银行	1,812
离岸人民币 6,553,069	美元 1,032,708	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,689
离岸人民币 4,134,564	美元 652,177	2022年4月21日	美国道富银行	1,671
离岸人民币 2,927,313	美元 462,004	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,439
离岸人民币 4,719,303	美元 743,934	2022年4月21日	美国道富银行	1,428
离岸人民币 4,216,104	美元 664,728	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,393
离岸人民币 4,556,107	美元 718,070	2022年4月21日	美国道富银行	1,241
离岸人民币 1,941,975	美元 306,718	2022年4月21日	加拿大皇家银行	1,180
离岸人民币 1,872,417	美元 295,732	2022年4月21日	加拿大皇家银行	1,138
离岸人民币 2,468,277	美元 389,455	2022年4月21日	美国道富银行	1,112
离岸人民币 5,325,776	美元 839,030	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	1,106
离岸人民币 3,266,075	美元 514,943	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,079
离岸人民币 3,819,809	美元 602,025	2022年4月21日	美国道富银行	1,040
离岸人民币 3,626,910	美元 571,649	2022年4月21日	美国道富银行	1,014
离岸人民币 2,055,375	美元 324,305	2022年4月21日	美国道富银行	926
离岸人民币 2,960,881	美元 466,742	2022年4月21日	美国道富银行	896
离岸人民币 3,071,389	美元 484,092	2022年4月21日	美国道富银行	859
离岸人民币 3,278,905	美元 516,734	2022年4月21日	美国道富银行	852
离岸人民币 1,732,422	美元 273,420	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	852
离岸人民币 4,022,848	美元 633,718	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	788
离岸人民币 2,917,873	美元 459,838	2022年4月21日	美国道富银行	758
离岸人民币 2,209,345	美元 348,302	2022年4月21日	美国道富银行	697
离岸人民币 2,297,678	美元 362,143	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	641
离岸人民币 1,824,203	美元 287,584	2022年4月21日	美国道富银行	575
离岸人民币 1,178,342	美元 185,904	2022年4月21日	加拿大皇家银行	511
离岸人民币 1,777,283	美元 280,121	2022年4月21日	加拿大皇家银行	494
离岸人民币 1,974,541	美元 311,072	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	410
离岸人民币 1,152,047	美元 181,631	2022年4月21日	美国道富银行	375
离岸人民币 1,304,547	美元 205,612	2022年4月21日	加拿大皇家银行	363
离岸人民币 956,245	美元 150,761	2022年4月21日	美国道富银行	311
离岸人民币 579,109	美元 91,398	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	285
离岸人民币 1,173,073	美元 184,794	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	230
离岸人民币 299,224	美元 47,260	2022年4月21日	加拿大皇家银行	182
离岸人民币 581,127	美元 91,592	2022年4月21日	加拿大皇家银行	162
离岸人民币 595,146	美元 93,791	2022年4月21日	美国道富银行	155
离岸人民币 469,160	美元 73,970	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	155

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 520,011	美元 81,960	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	145
离岸人民币 681,376	美元 107,345	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	141
离岸人民币 166,624	美元 26,266	2022年4月21日	美国道富银行	50
离岸人民币 119,166	美元 18,792	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	43
离岸人民币 110,235	美元 17,375	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	32
离岸人民币 88,083	美元 13,887	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	28
离岸人民币 66,487	美元 10,483	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	23
离岸人民币 27,880	美元 4,401	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	14
离岸人民币 29,392	美元 4,638	2022年4月21日	多伦多道明银行	13
离岸人民币 59,307	美元 9,341	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	10
离岸人民币 20,586	美元 3,244	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	5
离岸人民币 6,946	美元 1,097	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	4
离岸人民币 6,956	美元 1,096	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	1
离岸人民币 6,946	美元 1,094	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	1
离岸人民币 6,946	美元 1,094	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	1
英镑 31,136	美元 41,719	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	729
英镑 28,996	美元 38,656	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	483
英镑 9,475	美元 12,719	2022年4月21日	加拿大皇家银行	245
英镑 17,109	美元 22,599	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	76
英镑 2,932	美元 3,936	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	76
英镑 38,508	美元 50,704	2022年4月21日	加拿大皇家银行	9
纽元 4,085	美元 2,847	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	6
纽元 1,589	美元 1,110	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	6
纽元 9,512	美元 6,619	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	5
纽元 1,578	美元 1,098	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	1
美元 107,586,998	澳元 145,267,302	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,525,742
美元 83,205,259	加元 105,808,209	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	1,498,568
美元 43,096,040	纽元 62,602,013	2022年4月21日	多伦多道明银行	434,896
美元 4,046,707	离岸人民币 25,843,410	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	19,333
美元 3,393,885	离岸人民币 21,688,409	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	18,434
美元 3,138,328	离岸人民币 20,043,596	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	15,205
美元 842,326	澳元 1,140,941	2022年4月21日	美国道富银行	14,654
美元 3,138,653	离岸人民币 20,000,000	2022年4月21日	加拿大皇家银行	8,022
美元 662,715	加元 836,506	2022年4月21日	加拿大皇家银行	6,943
美元 657,538	澳元 883,758	2022年4月21日	加拿大皇家银行	6,268
美元 1,334,819	离岸人民币 8,522,560	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	6,067
美元 163,475	澳元 224,910	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	5,458
美元 511,916	加元 645,587	2022年4月21日	加拿大皇家银行	4,903
美元 846,801	离岸人民币 5,411,400	2022年4月21日	美国道富银行	4,595
美元 694,572	离岸人民币 4,439,727	2022年4月21日	美国道富银行	3,947
美元 342,028	纽元 496,979	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	3,551
美元 589,990	离岸人民币 3,771,237	2022年4月21日	美国道富银行	3,353
美元 577,859	离岸人民币 3,693,805	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	3,302
美元 117,396	纽元 173,563	2022年4月21日	美国道富银行	3,293
美元 2,740,902	离岸人民币 17,441,123	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	3,175

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 491,787	离岸人民币 3,143,613	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	2,810
美元 109,457	澳元 149,452	2022年4月21日	法国巴黎银行	2,799
美元 537,995	离岸人民币 3,434,248	2022年4月21日	美国道富银行	2,329
美元 558,595	加元 700,496	2022年4月21日	加拿大皇家银行	2,180
美元 457,666	离岸人民币 2,921,477	2022年4月21日	美国道富银行	1,981
美元 393,529	离岸人民币 2,510,718	2022年4月21日	美国道富银行	1,492
美元 169,807	离岸人民币 1,087,610	2022年4月21日	加拿大皇家银行	1,310
美元 230,160	离岸人民币 1,471,035	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	1,284
美元 286,966	澳元 383,658	2022年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,207
美元 194,663	离岸人民币 1,244,163	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	1,086
美元 113,262	纽元 164,353	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	1,023
美元 471,409	离岸人民币 3,001,905	2022年4月21日	美国道富银行	892
美元 122,130	离岸人民币 781,673	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	854
美元 400,656	离岸人民币 2,551,354	2022年4月21日	美国道富银行	758
美元 137,958	离岸人民币 881,010	2022年4月21日	美国道富银行	654
美元 266,498	纽元 384,141	2022年4月21日	加拿大皇家银行	618
美元 49,044	加元 61,823	2022年4月21日	加拿大皇家银行	448
美元 89,308	离岸人民币 570,325	2022年4月21日	美国道富银行	424
美元 222,985	加元 279,071	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	423
美元 53,630	离岸人民币 343,108	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	352
美元 44,657	离岸人民币 286,027	2022年4月21日	加拿大皇家银行	345
美元 74,719	离岸人民币 477,069	2022年4月21日	加拿大皇家银行	340
美元 78,734	离岸人民币 502,500	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	326
美元 55,744	加元 70,000	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	294
美元 32,240	离岸人民币 206,574	2022年4月21日	加拿大皇家银行	261
美元 42,727	离岸人民币 273,130	2022年4月21日	美国道富银行	245
美元 11,853	纽元 17,395	2022年4月21日	美国道富银行	243
美元 34,013	离岸人民币 217,692	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	238
美元 102,150	加元 127,897	2022年4月21日	加拿大皇家银行	237
美元 42,747	离岸人民币 273,172	2022年4月21日	美国道富银行	232
美元 47,291	离岸人民币 302,001	2022年4月21日	美国道富银行	224
美元 284,214	纽元 409,004	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	191
美元 39,844	离岸人民币 254,432	2022年4月21日	美国道富银行	187
美元 15,832	加元 20,000	2022年4月21日	加拿大皇家银行	179
美元 5,072	加元 6,527	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	152
美元 14,880	澳元 20,000	2022年4月21日	法国巴黎银行	142
美元 85,367	离岸人民币 543,330	2022年4月21日	美国道富银行	117
美元 17,194	离岸人民币 110,000	2022年4月21日	美国道富银行	113
美元 43,546	英镑 33,163	2022年4月21日	加拿大皇家银行	112
美元 23,611	离岸人民币 150,690	2022年4月21日	加拿大皇家银行	98
美元 34,767	离岸人民币 221,539	2022年4月21日	加拿大皇家银行	89
美元 18,087	离岸人民币 115,500	2022年4月21日	美国道富银行	85
美元 17,156	离岸人民币 109,563	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	82
美元 14,441	离岸人民币 92,281	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	78
美元 2,179	澳元 3,000	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	74

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 13,396	离岸人民币 85,557	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	65
美元 9,820	离岸人民币 62,827	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	64
美元 15,834	离岸人民币 101,020	2022年4月21日	美国道富银行	60
美元 47,143	离岸人民币 300,000	2022年4月21日	美国道富银行	57
美元 31,814	离岸人民币 202,566	2022年4月21日	加拿大皇家银行	56
美元 1,250	澳元 1,737	2022年4月21日	加拿大皇家银行	54
美元 1,969	纽元 2,895	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	44
美元 8,446	离岸人民币 53,925	2022年4月21日	加拿大皇家银行	38
美元 14,337	英镑 10,917	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	35
美元 3,672	离岸人民币 23,500	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	26
美元 1,187	纽元 1,745	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	26
美元 3,195	离岸人民币 20,465	2022年4月21日	美国道富银行	25
美元 1,271	澳元 1,726	2022年4月21日	美国道富银行	25
美元 4,743	离岸人民币 30,282	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	22
美元 2,312	离岸人民币 14,810	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	19
美元 3,736	离岸人民币 23,851	2022年4月21日	美国道富银行	17
美元 3,460	纽元 5,000	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	17
美元 2,092	离岸人民币 13,401	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	17
美元 12,661	离岸人民币 80,563	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	15
美元 3,350	离岸人民币 21,387	2022年4月21日	美国道富银行	15
美元 1,944	离岸人民币 12,438	2022年4月21日	法国巴黎银行	13
美元 1,746	离岸人民币 11,160	2022年4月21日	美国道富银行	10
美元 3,379	英镑 2,574	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	9
美元 1,459	离岸人民币 9,315	2022年4月21日	美国道富银行	7
美元 1,744	离岸人民币 11,110	2022年4月21日	加拿大皇家银行	4
美元 1,649	离岸人民币 10,506	2022年4月21日	美国道富银行	4
美元 1,038	离岸人民币 6,624	2022年4月21日	加拿大皇家银行	4
离岸人民币 1,278,038	美元 200,749	2022年5月20日	汇丰银行, 伦敦	24
离岸人民币 133,782	美元 21,014	2022年5月20日	汇丰银行, 伦敦	3
离岸人民币 10,612	美元 1,667	2022年5月20日	美林国际, 伦敦	0
离岸人民币 6,992	美元 1,098	2022年5月20日	美林国际, 伦敦	0
离岸人民币 6,992	美元 1,098	2022年5月20日	美林国际, 伦敦	0
离岸人民币 6,992	美元 1,098	2022年5月20日	美林国际, 伦敦	0
纽元 109,592	美元 76,167	2022年5月20日	美林国际, 伦敦	2
美元 759,991	澳元 1,014,921	2022年5月20日	美国道富银行	2,731
美元 595,777	加元 746,622	2022年5月20日	加拿大皇家银行	1,887
美元 298,639	纽元 431,185	2022年5月20日	加拿大皇家银行	1,031
美元 613,807	离岸人民币 3,909,884	2022年5月20日	高盛国际, 伦敦	268
美元 522,216	离岸人民币 3,326,458	2022年5月20日	高盛国际, 伦敦	228
美元 39,117	英镑 29,829	2022年5月20日	加拿大皇家银行	148
美元 3,569,319	离岸人民币 22,726,626	2022年5月20日	花旗银行, 伦敦	60
美元 15,093	离岸人民币 96,103	2022年5月20日	花旗银行, 伦敦	0
哥伦比亚比索				
23,000,000,000	美元 6,062,044	2022年6月30日	高盛国际, 伦敦	15,419
墨西哥比索				
190,000,000	美元 9,393,237	2022年6月30日	花旗银行, 伦敦	18,823

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/(亏损) 美元
台币 329,000,000	美元 11,607,682	2022年6月30日	花旗银行, 伦敦	111,916
台币 277,000,000	美元 9,768,208	2022年6月30日	花旗银行, 伦敦	89,402
美元 4,370,710	墨西哥比索 90,000,000	2022年6月30日	美国道富银行	69,802
美元 12,041,221	澳元 16,100,000	2022年6月30日	美林国际, 伦敦	69,022
美元 9,558,216	新加坡元 13,000,000	2022年6月30日	美国道富银行	48,074
美元 9,719,047	日元 1,180,000,000	2022年6月30日	美林国际, 伦敦	28,090
美元 5,332,065	韩元 6,500,000,000	2022年6月30日	高盛国际, 伦敦	27,611
美元 4,778,614	新加坡元 6,500,000	2022年6月30日	花旗银行, 伦敦	24,531
美元 4,873,089	澳元 6,500,000	2022年6月30日	花旗银行, 伦敦	16,139
美元 7,752,482	新加坡元 10,500,000	2022年6月30日	花旗银行, 伦敦	6,445
美元 19,846,145	菲律宾比索 1,050,000,000	2022年7月1日	渣打银行, 伦敦	347,133
美元 27,938,357	印度卢比 2,151,560,806	2022年7月1日	渣打银行, 伦敦	182,945
			未实现总收益	4,774,766
离岸人民币 11,160	美元 1,748	2022年4月1日	美国道富银行	(10)
离岸人民币 273,130	美元 42,778	2022年4月1日	美国道富银行	(247)
美元 1,103	澳元 1,466	2022年4月4日	美国道富银行	(2)
美元 1,106	加元 1,377	2022年4月4日	法国巴黎银行	(4)
美元 1,111	纽元 1,589	2022年4月4日	汇丰银行, 伦敦	(6)
加元 127,897	美元 102,157	2022年4月6日	加拿大皇家银行	(238)
离岸人民币 62,827	美元 9,830	2022年4月6日	汇丰银行, 伦敦	(65)
离岸人民币 110,000	美元 17,210	2022年4月6日	美国道富银行	(114)
离岸人民币 502,500	美元 78,802	2022年4月6日	花旗银行, 伦敦	(337)
离岸人民币 343,108	美元 53,681	2022年4月6日	汇丰银行, 伦敦	(355)
纽元 5,000	美元 3,460	2022年4月6日	美林国际, 伦敦	(17)
美元 1,106	加元 1,377	2022年4月6日	加拿大皇家银行	(4)
离岸人民币 6,624	美元 1,039	2022年4月7日	加拿大皇家银行	(4)
离岸人民币 300,000	美元 47,178	2022年4月7日	美国道富银行	(65)
离岸人民币 150,690	美元 23,630	2022年4月7日	加拿大皇家银行	(100)
美元 21,070	离岸人民币 133,782	2022年4月7日	汇丰银行, 伦敦	(2)
美元 201,284	离岸人民币 1,278,038	2022年4月7日	汇丰银行, 伦敦	(19)
离岸人民币 543,330	美元 85,426	2022年4月8日	美国道富银行	(132)
美元 1,101	离岸人民币 6,992	2022年4月8日	美林国际, 伦敦	(0)
澳元 1,471	美元 1,104	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(1)
澳元 1,479	美元 1,109	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(2)
澳元 7,502	美元 5,631	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(5)
澳元 1,489	美元 1,102	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(16)
澳元 35,770	美元 26,842	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(26)
澳元 7,996	美元 5,980	2022年4月21日	法国巴黎银行	(26)
澳元 1,522	美元 1,096	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(48)
澳元 188,927	美元 141,854	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(52)
澳元 8,133	美元 5,977	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(133)
澳元 28,642	美元 21,311	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(203)
澳元 8,338	美元 6,055	2022年4月21日	法国巴黎银行	(208)

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 28,129	美元 20,868	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(260)
澳元 24,889	美元 18,095	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(600)
澳元 33,781	美元 24,432	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(942)
澳元 52,297	美元 38,303	2022年4月21日	美国道富银行	(978)
澳元 80,172	美元 58,791	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(1,427)
澳元 59,664	美元 43,346	2022年4月21日	美国道富银行	(1,469)
澳元 127,380	美元 94,142	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(1,535)
澳元 69,875	美元 50,297	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(2,187)
澳元 285,457	美元 211,528	2022年4月21日	美国道富银行	(2,884)
澳元 154,326	美元 113,013	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(2,904)
澳元 211,802	美元 155,089	2022年4月21日	美国道富银行	(3,999)
澳元 159,374	美元 115,662	2022年4月21日	美国道富银行	(4,046)
澳元 370,222	美元 272,287	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(5,793)
澳元 297,231	美元 215,402	2022年4月21日	美国道富银行	(7,854)
澳元 540,289	美元 397,044	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(8,776)
澳元 350,215	美元 254,056	2022年4月21日	美国道富银行	(8,996)
澳元 632,628	美元 458,974	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(16,204)
澳元 1,146,352	美元 844,014	2022年4月21日	美国道富银行	(17,031)
澳元 930,026	美元 680,521	2022年4月21日	美国道富银行	(18,037)
澳元 1,012,334	美元 738,737	2022年4月21日	美国道富银行	(21,644)
澳元 953,206	美元 693,788	2022年4月21日	美国道富银行	(22,182)
澳元 1,274,929	美元 933,869	2022年4月21日	美国道富银行	(23,752)
澳元 1,243,337	美元 903,599	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(30,293)
澳元 1,196,468	美元 860,792	2022年4月21日	多伦多道明银行	(37,895)
加元 1,390	美元 1,105	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(8)
加元 1,390	美元 1,101	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(12)
加元 38,559	美元 30,818	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(50)
加元 26,493	美元 21,142	2022年4月21日	法国巴黎银行	(67)
加元 290,810	美元 232,737	2022年4月21日	美国道富银行	(68)
加元 7,024	美元 5,545	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(78)
加元 75,692	美元 60,453	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(142)
加元 12,159	美元 9,590	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(144)
加元 15,645	美元 12,320	2022年4月21日	美国道富银行	(205)
加元 21,030	美元 16,507	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(328)
加元 38,318	美元 30,009	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(666)
加元 38,531	美元 30,070	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(776)
加元 116,767	美元 92,392	2022年4月21日	美国道富银行	(1,085)
加元 141,119	美元 111,711	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,261)
加元 80,111	美元 62,707	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,425)
加元 127,497	美元 100,434	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(1,632)
加元 94,315	美元 73,652	2022年4月21日	美国道富银行	(1,851)
加元 91,404	美元 71,043	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(2,129)
加元 211,095	美元 166,020	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(2,970)
加元 277,343	美元 218,974	2022年4月21日	多伦多道明银行	(3,050)
加元 226,583	美元 178,183	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(3,206)
加元 405,772	美元 317,673	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(7,164)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/(亏损) 美元
加元 711,470	美元 561,942	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(7,619)
加元 462,456	美元 362,469	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(7,746)
加元 678,843	美元 535,506	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(7,936)
加元 891,665	美元 702,380	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(11,435)
加元 841,280	美元 658,906	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(14,573)
加元 693,032	美元 539,919	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(14,882)
加元 863,454	美元 674,573	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(16,657)
加元 921,325	美元 718,965	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(18,593)
离岸人民币 11,824	美元 1,858	2022年4月21日	法国巴黎银行	(2)
离岸人民币 7,011	美元 1,102	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(2)
离岸人民币 7,011	美元 1,102	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(2)
离岸人民币 7,011	美元 1,102	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(2)
离岸人民币 7,011	美元 1,102	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(2)
离岸人民币 7,067	美元 1,108	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(4)
离岸人民币 7,026	美元 1,101	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(4)
离岸人民币 7,026	美元 1,101	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(4)
离岸人民币 9,017	美元 1,414	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 7,026	美元 1,101	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 7,003	美元 1,097	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 7,003	美元 1,097	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 6,994	美元 1,095	2022年4月21日	美国道富银行	(5)
离岸人民币 7,027	美元 1,100	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(6)
离岸人民币 7,027	美元 1,100	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(6)
离岸人民币 9,186	美元 1,438	2022年4月21日	美国道富银行	(7)
离岸人民币 7,013	美元 1,096	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(8)
离岸人民币 7,013	美元 1,096	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(8)
离岸人民币 12,429	美元 1,946	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(9)
离岸人民币 19,008	美元 2,974	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(16)
离岸人民币 36,134	美元 5,668	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(17)
离岸人民币 16,502	美元 2,576	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(20)
离岸人民币 43,219	美元 6,768	2022年4月21日	美国道富银行	(32)
离岸人民币 155,977	美元 24,507	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(33)
离岸人民币 37,991	美元 5,939	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(38)
离岸人民币 60,705	美元 9,489	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(62)
离岸人民币 111,784	美元 17,519	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(68)
离岸人民币 75,156	美元 11,748	2022年4月21日	法国巴黎银行	(77)
离岸人民币 199,327	美元 31,281	2022年4月21日	美国道富银行	(80)
离岸人民币 417,909	美元 65,662	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(89)
离岸人民币 324,299	美元 50,932	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(91)
离岸人民币 144,031	美元 22,539	2022年4月21日	美国道富银行	(122)
离岸人民币 167,550	美元 26,219	2022年4月21日	美国道富银行	(142)
离岸人民币 112,359	美元 17,528	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(150)
离岸人民币 189,807	美元 29,693	2022年4月21日	美国道富银行	(170)
离岸人民币 174,644	美元 27,287	2022年4月21日	美国道富银行	(190)
离岸人民币 322,494	美元 50,533	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(206)
离岸人民币 893,813	美元 140,375	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(252)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/(亏损) 美元
离岸人民币 1,356,021	美元 213,092	2022年4月21日	法国巴黎银行	(256)
离岸人民币 410,557	美元 64,330	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(265)
离岸人民币 213,863	美元 33,378	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(270)
离岸人民币 454,269	美元 71,135	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(337)
离岸人民币 377,732	美元 59,091	2022年4月21日	美国道富银行	(339)
离岸人民币 343,124	美元 53,611	2022年4月21日	美国道富银行	(374)
离岸人民币 662,339	美元 103,826	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(382)
离岸人民币 1,002,002	美元 157,247	2022年4月21日	美国道富银行	(402)
离岸人民币 676,925	美元 106,024	2022年4月21日	美国道富银行	(479)
离岸人民币 775,248	美元 121,397	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(575)
离岸人民币 1,244,018	美元 195,118	2022年4月21日	美国道富银行	(608)
离岸人民币 549,203	美元 85,745	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(663)
离岸人民币 1,239,798	美元 194,347	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(715)
离岸人民币 1,470,551	美元 230,648	2022年4月21日	美国道富银行	(719)
离岸人民币 1,433,661	美元 224,507	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(1,056)
离岸人民币 1,685,710	美元 264,148	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(1,071)
离岸人民币 3,874,020	美元 608,423	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(1,091)
离岸人民币 1,278,572	美元 199,860	2022年4月21日	法国巴黎银行	(1,303)
离岸人民币 1,877,388	美元 293,994	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(1,383)
离岸人民币 1,306,326	美元 204,134	2022年4月21日	美国道富银行	(1,395)
离岸人民币 2,152,358	美元 337,115	2022年4月21日	美国道富银行	(1,524)
离岸人民币 1,541,787	美元 240,929	2022年4月21日	美国道富银行	(1,646)
离岸人民币 4,557,569	美元 715,233	2022年4月21日	美国道富银行	(1,826)
离岸人民币 1,654,013	美元 258,235	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(1,997)
离岸人民币 1,681,837	美元 262,580	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(2,030)
离岸人民币 2,100,698	美元 328,418	2022年4月21日	法国巴黎银行	(2,093)
离岸人民币 4,044,140	美元 634,186	2022年4月21日	美国道富银行	(2,094)
离岸人民币 2,552,662	美元 399,456	2022年4月21日	美国道富银行	(2,164)
离岸人民币 4,781,620	美元 749,835	2022年4月21日	美国道富银行	(2,475)
离岸人民币 2,490,917	美元 389,424	2022年4月21日	法国巴黎银行	(2,482)
离岸人民币 3,883,150	美元 608,201	2022年4月21日	美国道富银行	(2,749)
离岸人民币 2,372,290	美元 370,244	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(2,998)
离岸人民币 2,857,773	美元 446,509	2022年4月21日	美国道富银行	(3,115)
离岸人民币 3,074,572	美元 480,593	2022年4月21日	法国巴黎银行	(3,141)
离岸人民币 4,237,404	美元 663,542	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(3,145)
离岸人民币 2,555,408	美元 398,823	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(3,229)
离岸人民币 8,530,014	美元 1,338,092	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(3,967)
离岸人民币 4,748,828	美元 742,886	2022年4月21日	美国道富银行	(4,264)
离岸人民币 9,311,429	美元 1,459,632	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(5,370)
离岸人民币 3,877,223	美元 604,112	2022年4月21日	法国巴黎银行	(5,906)
离岸人民币 4,594,112	美元 715,811	2022年4月21日	法国巴黎银行	(6,998)
离岸人民币 8,863,212	美元 1,385,588	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(8,894)
离岸人民币 14,354,324	美元 2,243,744	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(14,675)
离岸人民币 27,590,204	美元 4,324,113	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(16,757)
离岸人民币 26,498,283	美元 4,133,662	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(35,412)
英镑 9,214	美元 12,116	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(13)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/(亏损) 美元
英镑 3,970	美元 5,203	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(23)
英镑 10,966	美元 14,387	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(49)
英镑 11,691	美元 15,320	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(71)
英镑 29,550	美元 38,802	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(101)
英镑 36,673	美元 48,068	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(212)
英镑 18,421	美元 24,016	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(234)
英镑 34,688	美元 45,418	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(247)
英镑 33,866	美元 44,204	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(379)
英镑 332,923	美元 437,873	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(415)
纽元 1,595	美元 1,104	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(5)
纽元 15,049	美元 10,457	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(8)
纽元 1,616	美元 1,113	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(10)
纽元 1,625	美元 1,096	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(34)
纽元 14,675	美元 10,154	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(50)
纽元 30,455	美元 20,997	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(181)
纽元 14,634	美元 9,992	2022年4月21日	法国巴黎银行	(184)
纽元 170,543	美元 118,036	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(553)
纽元 542,609	美元 376,662	2022年4月21日	美国道富银行	(647)
纽元 59,943	美元 40,848	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(834)
纽元 123,144	美元 84,679	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(951)
纽元 103,126	美元 70,389	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(1,321)
纽元 161,667	美元 110,997	2022年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(1,420)
纽元 128,799	美元 86,990	2022年4月21日	美国道富银行	(2,571)
纽元 236,012	美元 161,045	2022年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(3,068)
纽元 208,366	美元 140,966	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(3,923)
纽元 274,879	美元 186,758	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(4,382)
纽元 378,249	美元 258,396	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(4,623)
纽元 498,267	美元 341,771	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(4,704)
纽元 546,599	美元 374,096	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(5,987)
纽元 403,282	美元 273,421	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(7,006)
纽元 536,425	美元 365,386	2022年4月21日	美国道富银行	(7,622)
纽元 447,044	美元 302,670	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(8,187)
纽元 514,391	美元 347,676	2022年4月21日	多伦多道明银行	(10,011)
美元 1,265	离岸人民币 8,033	2022年4月21日	美国道富银行	(1)
美元 1,832	离岸人民币 11,629	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(2)
美元 1,154	离岸人民币 7,324	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(2)
美元 1,107	离岸人民币 7,027	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(2)
美元 1,844	离岸人民币 11,704	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(3)
美元 1,477	离岸人民币 9,373	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(3)
美元 2,863	离岸人民币 18,174	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(4)
美元 2,577	离岸人民币 16,355	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(4)
美元 1,223	离岸人民币 7,750	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(4)
美元 2,028	离岸人民币 12,849	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(6)
美元 1,561	离岸人民币 9,880	2022年4月21日	美国道富银行	(6)
美元 4,131	离岸人民币 26,211	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(7)
美元 4,041	离岸人民币 25,635	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(8)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/(亏损) 美元
美元 2,617	离岸人民币 16,582	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(8)
美元 5,223	离岸人民币 33,140	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(9)
美元 4,523	离岸人民币 28,689	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(9)
美元 4,118	离岸人民币 26,120	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(9)
美元 36,864	英镑 27,993	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(11)
美元 6,643	离岸人民币 42,135	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(14)
美元 9,437	离岸人民币 59,882	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(15)
美元 9,614	离岸人民币 61,000	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(17)
美元 9,610	离岸人民币 60,974	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(17)
美元 32,571	英镑 24,728	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(18)
美元 5,300	离岸人民币 33,555	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(21)
美元 1,281	英镑 954	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(25)
美元 26,465	离岸人民币 168,027	2022年4月21日	美国道富银行	(29)
美元 31,763	英镑 24,102	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(33)
美元 24,713	离岸人民币 156,857	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(34)
美元 719,419	澳元 957,747	2022年4月21日	美国道富银行	(39)
美元 25,952	离岸人民币 164,676	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(42)
美元 24,829	离岸人民币 157,536	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(43)
美元 25,072	离岸人民币 159,018	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(53)
美元 36,586	离岸人民币 232,122	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(65)
美元 33,378	离岸人民币 211,515	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(100)
美元 63,375	离岸人民币 402,147	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(104)
美元 88,529	离岸人民币 561,724	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(151)
美元 55,620	离岸人民币 352,461	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(166)
美元 44,227	离岸人民币 280,000	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(174)
美元 33,785	英镑 25,520	2022年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(188)
美元 75,905	离岸人民币 480,553	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(298)
美元 232,213	离岸人民币 1,473,409	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(396)
美元 118,193	英镑 89,154	2022年4月21日	法国巴黎银行	(823)
美元 233,541	纽元 333,939	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,333)
美元 586,789	澳元 778,721	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,879)
美元 453,148	加元 563,609	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(1,955)
美元 2,149,890	离岸人民币 13,634,916	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(4,658)
美元 5,937,549	英镑 4,504,625	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(7,291)
美元 75,470,553	离岸人民币 478,645,189	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(163,518)
美元 90,478,612	离岸人民币 573,828,475	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(196,035)
美元 517,060,623	离岸人民币 3,279,273,443	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(1,120,286)
美元 1,130	离岸人民币 7,195	2022年5月20日	汇丰银行, 伦敦	(0)
美元 5,504	离岸人民币 35,044	2022年5月20日	美林国际, 伦敦	(1)
美元 54,394	离岸人民币 346,296	2022年5月20日	美林国际, 伦敦	(5)
美元 60,712	离岸人民币 386,519	2022年5月20日	美林国际, 伦敦	(6)
澳元 6,500,000	美元 4,876,892	2022年6月30日	花旗银行, 伦敦	(12,337)
巴西雷亚尔 76,490,338	美元 15,162,815	2022年6月30日	高盛国际, 伦敦	(516,292)
离岸人民币 73,247,853	美元 11,419,412	2022年6月30日	美林国际, 伦敦	(60,477)
韩元 10,475,458,249	美元 8,632,220	2022年6月30日	高盛国际, 伦敦	(5,481)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/(亏损) 美元
墨西哥比索				
155,000,000	美元 7,637,658	2022年6月30日	高盛国际, 伦敦	(9,890)
墨西哥比索 97,000,000	美元 4,749,578	2022年6月30日	渣打银行, 伦敦	(36,307)
墨西哥比索 90,000,000	美元 4,373,241	2022年6月30日	花旗银行, 伦敦	(67,272)
林吉特 21,000,000	美元 4,966,300	2022年6月30日	渣打银行, 伦敦	(19,760)
美元 9,732,842	韩元 11,800,000,000	2022年6月30日	渣打银行, 伦敦	(2,969)
美元 4,974,541	纽元 7,150,000	2022年6月30日	高盛国际, 伦敦	(9,238)
美元 3,851,716	印尼盾 55,400,000,000	2022年6月30日	花旗银行, 伦敦	(9,390)
美元 15,296,899	印尼盾 220,000,000,000	2022年6月30日	高盛国际, 伦敦	(38,565)
美元 11,559,881	台币 329,000,000	2022年6月30日	渣打银行, 伦敦	(64,115)
印度卢比 370,000,000	美元 4,816,015	2022年7月1日	高盛国际, 伦敦	(19,954)
			未实现总亏损	(2,970,470)
			未实现净收益	1,804,296

(b) 期货

以下为截至二零二二年三月三十一日之未平仓期货合约:

	标的资产	交易对手	未实现收益/(亏损) 美元
<u>截至二零二二年三月三十一日</u>			
US 2yr Note (CBT) Fut 06/22	2年期美国国债	花旗集团全球市场公司伦敦分行	118,617
US Ultra Bond (CBT) Fut 06/22	30年期美国国债	花旗集团全球市场公司伦敦分行	328,625
		未实现总收益	447,242
Aust 10yr Bond Fut 06/22	澳大利亚10年期债券	花旗集团全球市场公司伦敦分行	(74,218)
		未实现总亏损	(74,218)
		未实现净收益	373,024

抵押品持有情况

截至二零二二年三月三十一日 (未经审计)

抵押品提供方	抵押品的性质	到期期限	抵押品所涵盖资产		抵押品价值
			计价货币	产净值百分比	美元
美林国际, 伦敦	现金	不适用	美元	0.0	537,265
渣打银行, 伦敦	现金	不适用	美元	0.0	270,000
				0.0	807,265
				0.0	807,265

现金抵押品再投资详情

截至二零二二年三月三十一日止期间, 未进行现金抵押品再投资。

托管/保管安排

	收到/持有的抵押品金额	计划下提供的抵押品所占比例
	二零二二年三月三十一日	二零二二年三月三十一日
	美元	%
现金抵押证券的托管人		
隔离账户		
香港上海汇丰银行有限公司	807,265	100.0
	807,265	100.0

财务状况表

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

	二零二二年 三月三十一日 美元	二零二一年 九月三十日 美元
资产		
银行现金	94,217,218	101,180,556
现金抵押	807,265	-
应收经纪款项	7,257,989	180,000
分配应收款项	1,124,337	10,504,265
保证金	5,356,149	1,329,609
衍生性产品	5,222,008	10,612,400
投资	1,905,155,267	2,668,285,291
利息及其他应收款项	21,594	3,516
总资产	2,019,161,827	2,792,095,637

负债

应付经纪款项	44,087,962	-
赎回应付款项	4,927,580	27,404,073
应付收益分配[附注 6]	9,475,123	11,544,210
衍生性产品	3,044,688	14,745,926
其他应付款项	2,092,251	2,897,805
总负债(不含可赎回份额持有人 应占净资产)	63,627,604	56,592,014

可赎回份额持有人应占净资产

[附注 3]	1,955,534,223	2,735,503,623
--------	---------------	---------------

综合收益表

截至二零二二年三月三十一日止期间(未经审计)

	二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元
收入		
投资及衍生性产品净(亏损)/收 益[附注 4]	(177,180,820)	148,985,958
存款利息	40,317	136,281
汇兑净亏损	(830,473)	(1,412,556)
其他收益	19	1,163,534
	(177,970,957)	148,873,217
支出		
管理费用[附注 5(a)]	11,374,508	17,119,302
受托人费用[附注 5(b)]	293,192	435,482
托管费用及银行费用[附注 5(a), 5(b)]	224,715	290,918
基金注册登记机构费用[附注 5(a)]	82,080	130,792
交易成本[附注 5(b)]	36,168	43,310
核数师酬金	28,853	13,013
估值费用[附注 5(a)]	8,610	8,470
法律及专业费用	8,213	45,905
印刷及出版支出	1,934	21,807
其他经营费用	14,211	10,002
	12,072,484	18,119,001

综合收益表(续)

截至二零二二年三月三十一日止期间(未经审计)

可赎回份额持有人应占净资产变动表

截至二零二二年三月三十一日止期间(未经审计)

	二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元		二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元
净经营(亏损)/利润	(190,043,441)	130,754,216	期初可赎回份额持 有人应占净资产	2,735,503,623	3,098,404,429
财务成本					
收益分配[附注 6]	(60,360,904)	(71,066,349)	分配可赎回份额 [附注 3]	172,554,285	1,510,901,452
利息费用[附注 5(b)]	(28)	(324)	赎回可赎回份额 [附注 3]	(702,006,193)	(1,379,083,639)
除税前(亏损)/利润	(250,404,373)	59,687,543	净(赎回)/分配	(529,451,908)	131,817,813
税项[附注 7]	(113,119)	(986,023)		2,206,051,715	3,230,222,242
可赎回份额持有人应占净资产及 总综合收益之(减少)/增加	(250,517,492)	58,701,520	可赎回份额持有人 应占净资产及总 综合收益之(减少) /增加	(250,517,492)	58,701,520
			期末可赎回份额持 有人应占净资产	1,955,534,223	3,288,923,762

第二十五至三十五页之附注乃属本财务报表之一部分。

现金流量表

(续)

截至二零二二年三月三十一日止期间(未经审计)

	二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元	二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元
经营业务				
购入投资及衍生 性产品	(298,579,145)	(1,475,262,065)		
出售投资及衍生 性产品所得款 项	915,227,476	1,402,544,345		
已收利息	40,252	138,746		
透支经纪款项之 减少	-	(391,036)		
现金抵押之增加	(807,265)	(90,000)		
已付交易成本	(36,168)	(44,596)		
已付基金注册登 记机构费用	(82,080)	(248,342)		
已付税项	(113,119)	(1,527,037)		
已付受托人费用	(311,104)	(424,175)		
保证金之(增加) /减少	(4,026,540)	650,671		
已付管理费用	(12,083,462)	(16,696,611)		
其他	(1,291,766)	(937,858)		
经营业务所产生 /(运用)之现金 净额	597,937,079	(92,287,958)		
融资活动				
已付利息			(28)	(324)
分配可赎回份额 所得款项			181,934,213	1,511,666,257
赎回可赎回份额 付款			(724,482,686)	(1,398,713,108)
已付收益分配			(62,429,991)	(69,021,332)
融资活动所(运用) /产生之现金 净额			(604,978,492)	43,931,493
现金及现金等价 物之减少			(7,041,413)	(48,356,465)
期初现金及现金 等价物			101,180,556	167,618,765
现金及现金等价 物之汇兑收益			78,075	495,604
期末现金及现金 等价物			94,217,218	119,757,904
现金及现金等价物余额分析:				
银行现金			94,217,218	119,757,904

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。

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使的权利。

2 主要会计政策概览

(a) 中期财务报表之会计政策

编制本未经审计简明中期财务报表所使用的会计政策和计算方法与截至二零二一年九月三十日止年度财务报表所采纳的会计政策和计算方法一致。

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公平值为负数的衍生性产品合约列示为按公允价值透过损益列账的负债。

因此,本基金将所有的投资组合归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。

确认、终止确认及计量

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

公平值估计

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

债务证券及货币市场的公平值按包括应计利息的报价计算。

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

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

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

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

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

(c) 外币折算

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按期/年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

与现金及现金等价物有关的汇兑盈亏在综合收益表内的“汇兑净收益/亏损”中呈列。与按公平值透过损益列账的金融资产及金融负债有关的汇兑盈亏在综合收益表内的“投资及衍生性产品净收益/亏损”中呈列。

(d) 销售份额所得款项及赎回份额支付款项

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

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

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产(每份额)

二零二一年十月一日至二零二二年三月三十一日

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
期初	22,995,059.343	14,901,951.254	602,138.264	454,579,708.028	9,207,083.277
总分配	1,239,289.183	798,778.123	66,824.870	31,070,689.491	618,828.840
总赎回	(5,402,794.800)	(2,109,913.943)	(140,240.909)	(119,522,209.565)	(1,733,229.082)
期末	18,831,553.726	13,590,815.434	528,722.225	366,128,187.954	8,092,683.035

	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲 份额(累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	1,082,326.570	471,890,960.288	954,442.901	63,438,929.394	58,099,327.490
总分配	9,740.644	35,210,817.247	56,282.405	6,276,191.532	3,665,304.060
总赎回	(93,889.868)	(101,361,963.731)	(91,213.661)	(14,096,043.300)	(18,984,878.780)
期末	998,177.346	405,739,813.804	919,511.645	55,619,077.626	42,779,752.770

	PRC 人民币对冲 份额(每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额
已发行份额数目:			
期初	61,388,435.190	30,905,933.500	3,245,234.020
总分配	1,040,423.860	345,752.100	84,120.620
总赎回	(7,563,839.500)	(16,285,426.590)	(629,182.160)
期末	54,865,019.550	14,966,259.010	2,700,172.480

二零二零年十月一日至二零二一年三月三十一日

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

	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币对冲 份额(累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	1,116,424.680	403,471,907.385	195,694.858	68,929,752.615	187,806,607.220
总分配	1,345,320.201	161,976,536.796	5,273,592.718	38,998,973.447	20,705,155.450
总赎回	(1,131,207.625)	(70,329,688.376)	(39,186.369)	(31,063,491.305)	(116,062,418.620)
期末	1,330,537.256	495,118,755.805	5,430,101.207	76,865,234.757	92,449,344.050

	PRC 人民币对冲 份额(每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额
已发行份额数目:			
期初	77,860,626.410	41,449,894.640	3,677,328.270
总分配	9,543,866.960	24,918,384.050	581,198.190
总赎回	(15,186,974.600)	(32,995,701.030)	(605,629.000)
期末	72,217,518.770	33,372,577.660	3,652,897.460

二零二二年三月三十一日

	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	英镑对冲类别 (每月派息) 英镑	港元类别 (每月派息) 港元	纽元对冲类别 (每月派息) 纽元
可赎回份额持有人应占净资产	138,722,936	101,264,338	4,114,985	2,925,479,973	59,330,909
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	7.37	7.45	7.78	7.99	7.33
	人民币对冲类别 (累计) 人民币	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	美元类别 (累计) 美元	美元类别 (每月派息) 美元	PRC 人民币对冲 份额(累计) 人民币
可赎回份额持有人应占净资产	13,183,786	3,093,274,553	11,345,385	506,265,907	536,548,273
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	13.21	7.62	12.34	9.10	12.54
	PRC 人民币对冲 份额(每月派息) 人民币	PRC 美元份额 (累计) 美元	PRC 美元份额 (每月派息) 美元		
可赎回份额持有人应占净资产	451,985,755	164,959,974	22,398,845		
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	8.24	11.02	8.30		

二零二一年九月三十日

	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	英镑对冲类别 (每月派息) 英镑	港元类别 (每月派息) 港元	纽元对冲类别 (每月派息) 纽元
可赎回份额持有人应占净资产	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
	人民币对冲类别 (累计) 人民币	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	美元类别 (累计) 美元	美元类别 (每月派息) 美元	PRC 人民币对冲 份额(累计) 人民币
可赎回份额持有人应占净资产	15,519,544	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
	PRC 人民币对冲 份额(每月派息) 人民币	PRC 美元份额 (累计) 美元	PRC 美元份额 (每月派息) 美元		
可赎回份额持有人应占净资产	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		

4 投资及衍生性产品净(亏损)/收益

	二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益/亏损之变动	(110,865,703)	(18,409,098)
投资及衍生性产品销售之实现(亏损)/收益	(66,315,117)	167,395,056
	<u>(177,180,820)</u>	<u>148,985,958</u>

5 与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之交易

(a) 截至二零二二年三月三十一日及二零二一年三月三十一日止期间，支付给管理人，摩根基金(亚洲)有限公司，及其关联人士的金額如下：

	二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元
管理费用	11,374,508	17,119,302
基金注册登记机构费用	82,080	130,792
托管费用及银行费用	14,790	10,580
估值费用	8,610	8,470
	<u>11,479,988</u>	<u>17,269,144</u>

(b) 截至二零二二年三月三十一日及二零二一年三月三十一日止期间，支付给受托人，汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司，及其关联人士的金额如下：

	二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日
	美元	美元
受托人费用	293,192	435,482
托管费用及银行费用	170,300	245,573
交易成本	5,684	5,830
利息费用	28	324

6 收益分配

一旦该金额不足够支付本基金宣布之收益分配时，管理人可酌情决定从资本中拨款支付该等收益分配。

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元
澳元对冲类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	澳元 0.0345	22,444,233.000	(584,577)	
加元对冲类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	加元 0.0363	14,577,681.865	(429,016)	
英镑对冲类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	英镑 0.0373	563,583.628	(29,008)	
港元类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	港元 0.0383	431,457,900.786	(2,124,753)	
纽元对冲类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	纽元 0.0374	8,622,302.810	(232,584)	
人民币对冲类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	人民币 0.0594	453,675,880.473	(4,217,962)	
美元类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	美元 0.0440	60,714,753.551	(2,671,449)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	人民币 0.0642	60,692,996.160	(609,880)	
PRC 美元份额(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	美元 0.0401	3,173,472.370	(127,256)	
澳元对冲类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	澳元 0.0346	21,596,951.029	(531,746)	
加元对冲类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	加元 0.0363	14,553,196.984	(412,962)	
英镑对冲类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	英镑 0.0374	548,980.277	(27,299)	
港元类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	港元 0.0384	415,732,782.275	(2,046,789)	
纽元对冲类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	纽元 0.0387	8,522,899.413	(224,074)	
人民币对冲类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	人民币 0.0553	441,457,240.707	(3,819,480)	
美元类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	美元 0.0440	59,544,962.022	(2,619,978)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	人民币 0.0598	59,654,964.700	(558,134)	
PRC 美元份额(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	美元 0.0401	3,106,208.720	(124,559)	
澳元对冲类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	澳元 0.0329	21,364,966.590	(509,854)	
加元对冲类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	加元 0.0341	14,545,308.039	(387,875)	
英镑对冲类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	英镑 0.0341	553,190.646	(25,460)	
港元类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	港元 0.0385	404,177,462.896	(1,994,876)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零二一年	二零二一年
					十月一日至	十月一日至
					二零二二年	二零二一年
三月三十一日	三月三十一日	美元	美元			
纽元对冲类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	纽元 0.0385	8,452,210.383	(222,499)	
人民币对冲类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	人民币 0.0558	436,923,881.073	(3,823,979)	
美元类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	美元 0.0440	59,668,848.464	(2,625,429)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	人民币 0.0603	58,768,476.490	(555,824)	
PRC 美元份额(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	美元 0.0401	3,018,473.070	(121,041)	
澳元对冲类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	澳元 0.0349	19,416,614.220	(473,975)	
加元对冲类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	加元 0.0362	13,809,138.185	(391,381)	
英镑对冲类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	英镑 0.0379	566,562.649	(28,803)	
港元类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	港元 0.0384	390,843,133.008	(1,925,718)	
纽元对冲类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	纽元 0.0387	8,280,191.144	(210,115)	
人民币对冲类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	人民币 0.0516	420,787,408.000	(3,410,852)	
美元类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	美元 0.0440	57,714,699.365	(2,539,447)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2022年1月28日	2022年2月11日	人民币 0.0557	57,048,155.580	(498,851)	
PRC 美元份额(每月派息)	2022年1月28日	2022年2月11日	美元 0.0401	2,860,901.890	(114,722)	
澳元对冲类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	澳元 0.0348	19,002,025.971	(477,867)	
加元对冲类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	加元 0.0365	13,677,995.973	(391,889)	
英镑对冲类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	英镑 0.0392	557,442.670	(29,320)	
港元类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	港元 0.0385	384,008,454.766	(1,893,254)	
纽元对冲类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	纽元 0.0391	8,220,852.861	(216,599)	
人民币对冲类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	人民币 0.0533	412,963,391.796	(3,485,723)	
美元类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	美元 0.0440	57,148,612.792	(2,514,539)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	人民币 0.0577	55,898,919.670	(511,152)	
PRC 美元份额(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	美元 0.0401	2,823,707.350	(113,231)	
澳元对冲类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	澳元 0.0329	18,831,553.726	(465,257)	
加元对冲类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	加元 0.0358	13,590,815.434	(389,537)	
英镑对冲类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	英镑 0.0383	528,722.225	(26,662)	
港元类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	港元 0.0386	366,323,033.178	(1,805,561)	
纽元对冲类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	纽元 0.0386	8,107,797.479	(217,680)	
人民币对冲类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	人民币 0.0547	405,861,577.120	(3,497,208)	
美元类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	美元 0.0440	55,757,399.395	(2,453,326)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	人民币 0.0592	54,861,225.740	(511,615)	
PRC 美元份额(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	美元 0.0401	2,700,172.480	(108,277)	
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)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零二一年	二零二零年
					十月一日至	十月一日至
					二零二二年 三月三十一日	二零二一年 三月三十一日
					美元	美元
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		(279,030)
人民币对冲类别(每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	人民币 0.0573	495,182,226.693		(4,324,505)
美元类别(每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0440	76,797,893.233		(3,379,107)
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	人民币 0.0620	72,211,245.890		(682,360)
PRC 美元份额(每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0401	3,652,846.370		(146,479)
可赎回份额持有人之总收益分配					(60,360,904)	(71,066,349)

7 税项

截至二零二二年及二零二一年三月三十一日止期间取得的部分利息收入和产生的资本收益的境外税已经预扣或支付。

中国税项

本基金持有若干中国证券之投资。根据中华人民共和国税法，外国投资者从中国取得的股利和利息应按百分之十缴纳企业所得税，但不包括已明确地获得免税的政府债券利息以及外国机构投资者于二零一八年十一月七日至二零二五年十二月三十一日期间从中国内地债券市场买卖的债券中产生的已获暂时豁免的利息收入。中国企业如作为付款方须在付款时扣缴此类税款。对于源自中国但不适用于明确免税规定的股利和利息，若付款方未预先扣税，则按百分之十全额计提税项准备。

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

香港税项

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

