

年度报告 — 2019年9月30日（经审核）

# 摩根亚洲股息基金

内地与香港互认基金系列



中国内地代理人:

**上投摩根**  
基金 管 理

基金管理人:

**摩根**  
资 产 管 理

此（等）报告并不构成购买组成本文件内容的任何基金单位之邀请，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 - 2
投资组合持有变动表 - 未经审计	2
财务状况表	3
综合收益表	3
可赎回份额持有人应占净资产变动表	4
现金流量表	4
财务报表之附注	5 - 41
独立核数师报告	42 - 43
管理人及受托人的责任声明	44
受托人对份额持有人的报告	44
业绩纪录 - 未经审计	45 - 46
经营与管理	47

投资组合

截至二零一九年九月三十日 (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
<b>上市投资 (98.6%)</b>				<b>印度 (4.7%)</b>			
<b>(I) 股票 (98.9%)</b>				Coal India	4,830,189	13,621,132	1.0
<b>澳大利亚 (15.3%)</b>				ITC Ltd	865,907	3,174,965	0.2
Australia & NZ Bkg Group-AU List	2,171,399	41,767,542	3.0	Power Grid Corp of India	17,107,372	48,049,669	3.5
Boral Ltd	5,670,317	18,471,588	1.3	<b>印度尼西亚 (5.4%)</b>			
Brambles Ltd	1,695,205	13,033,974	0.9	Astra Intl	15,234,900	7,083,504	0.5
Dexus Stapled Sec	1,898,556	15,276,139	1.1	Bank Mandiri (Persero)	46,644,300	22,919,620	1.7
Insurance Australia Group	3,829,738	20,405,438	1.5	Bank Rakyat Indonesia Persero	50,101,800	14,541,699	1.1
Macquarie Group	42,645	3,770,113	0.3	Telekomunikasi Indonesia	97,529,900	29,612,813	2.1
Oil Search	1,569,727	7,749,701	0.5	<b>韩国 (9.2%)</b>			
Qantas Airways	931,032	3,949,708	0.3	Kangwon Land	451,885	11,163,484	0.8
Scentre Group Stapled Secs	7,735,506	20,503,643	1.5	Korea Electric Power	1,120,290	24,257,418	1.8
Tabcorp Hldgs	7,074,144	23,140,109	1.7	Lotte Chemical	64,284	12,683,212	0.9
Transurban Group Stapled Sec	2,065,826	20,467,523	1.5	Orange Life Insurance	413,784	9,357,403	0.7
Viva Energy Group	8,490,682	11,166,754	0.8	Samsung Electronics	1,326,208	54,383,232	3.9
Westpac Banking	626,817	12,530,509	0.9	Samsung Electronics Pref	235,000	7,760,314	0.6
				Shinhan Financial Group	207,858	7,263,691	0.5
<b>中国 (27.9%)</b>				<b>新加坡 (6.9%)</b>			
宝山钢铁股份有限公司 A 股(C1)	24,762,878	20,493,560	1.5	AIMS APAC REIT	7,171,388	7,467,495	0.5
中国建设银行股份有限公司 H 股	47,422,000	36,174,141	2.6	Ascendas India Trust	26,322,300	29,693,245	2.2
中国人寿保险股份有限公司 H 股	13,577,000	31,451,172	2.3	DBS Group Hldgs	1,200,403	21,700,828	1.6
中国移动有限公司	2,488,000	20,581,524	1.5	Mapletree Logistics Trust	19,366,888	22,687,366	1.6
中国海外发展有限公司	8,722,000	27,425,224	2.0	United Overseas Bank	762,900	14,155,770	1.0
中国电信股份有限公司 H 股	34,286,000	15,613,570	1.1	<b>台湾 (10.3%)</b>			
中国永达汽车服务控股有限公司	12,178,500	10,051,138	0.7	宽联控股公司	1,939,000	13,406,034	1.0
中国海洋石油有限公司	9,040,000	13,791,668	1.0	台达电子工业股份有限公司	4,510,000	19,261,390	1.4
大唐国际发电股份有限公司 H 股	42,108,000	8,701,554	0.6	慧荣科技股份有限公司 ADR	326,684	11,548,279	0.8
杭州老板电器股份有限公司 A 股(C2)	4,886,768	17,997,255	1.3	台湾积体电路制造股份有限公司 ADR	108,179	5,028,160	0.4
恒安国际集团有限公司	2,107,500	13,818,086	1.0	世界先进积体电路股份有限公司	3,778,000	7,635,275	0.6
华能国际电力股份有限公司 H 股	20,208,000	9,718,111	0.7	启碁科技股份有限公司	2,811,247	7,394,084	0.5
江苏宁沪高速公路股份有限公司 H 股	14,060,000	17,863,306	1.3	<b>泰国 (5.7%)</b>			
美的集团股份有限公司 A 股 - C2	993,028	7,105,771	0.5	Bangkok Bank NVDR	5,707,000	32,374,187	2.3
中国石油天然气股份有限公司 H 股	52,180,000	26,824,170	1.9	Land & Houses (F)	19,847,100	6,229,595	0.5
中国平安保险 (集团) 股份有限公司 H 股	4,441,000	51,013,094	3.7	Siam Commercial Bank (F)	4,541,400	17,521,177	1.3
中国邮政储蓄银行股份有限公司 H 股	19,374,000	11,813,113	0.9	Thai Oil (F)	9,883,200	22,538,931	1.6
上海汽车集团股份有限公司 A 股(C1)	5,310,753	17,684,662	1.3			1,368,108,378	98.9
中石化炼化工程 (集团) 股份有限公司 H 股	15,468,000	9,707,702	0.7	<b>(II) 衍生性产品 (-0.3%)</b>			
越秀交通基建有限公司	21,546,000	18,606,835	1.3	<b>远期外汇合约 (-0.3%)</b>		(3,743,140)	(0.3)
<b>香港 (13.5%)</b>				<b>总上市投资</b>		1,364,365,238	98.6
中银香港 (控股) 有限公司	8,416,000	28,556,471	2.1	<b>其他净资产</b>		20,071,578	1.4
中电控股有限公司	3,784,000	39,749,522	2.9				
香港交易及结算所有限公司	591,183	17,344,706	1.2				
汇丰控股有限公司 - 香港上市	917,416	7,068,389	0.5				
领展房地产投资信托基金	1,056,500	11,650,691	0.8				
金沙中国有限公司	5,283,600	23,926,295	1.7				
新鸿基地产发展有限公司	2,360,000	33,957,701	2.4				
太古股份有限公司 A 股	702,500	6,537,155	0.5				
太古地产有限公司	2,011,200	6,311,136	0.5				
九龙仓置业地产投资有限公司	2,252,000	12,295,023	0.9				

投资组合 (续)

截至二零一九年九月三十日 (未经审计)

投资组合持有变动表

截至二零一九年九月三十日止年度 (未经审计)

单位数目	公平值 美元	占资 产净 值百 分比	持有占资产净值百 分比		
			2019	2018	
截至二零一九年九月三十日可赎回份额持 有人应占净资产	1,384,436,816	100.0			
总投资, 按成本	1,419,273,990				
			<b>上市投资</b>		
			<b>股票</b>		
			中国	27.9	27.2
			澳大利亚	15.3	12.5
			香港	13.5	12.4
			台湾	10.3	8.9
			韩国	9.2	13.1
			新加坡	6.9	13.6
			泰国	5.7	5.7
			印度尼西亚	5.4	3.5
			印度	4.7	0.8
			新西兰	-	0.4
			<b>衍生性产品</b>		
			远期外汇合约	(0.3)	(0.4)
			<b>总上市投资</b>	98.6	97.7
			<b>其他净资产</b>	1.4	2.3
			<b>截至九月三十日可赎回份额持有人应 占净资产</b>	100.0	100.0

财务状况表

截至二零一九年九月三十日

综合收益表

截至二零一九年九月三十日止年度

	2019 美元	2018 美元		2019 美元	2018 美元
<b>资产</b>			<b>收入</b>		
银行现金	15,713,579	29,897,332	投资及衍生性产品净亏损 [附注 5]	(85,061,943)	(20,775,395)
短期存款	-	17,285,223	股息收入	60,017,492	71,535,448
应收经纪款项	12,259,999	4,148,389	存款利息	283,114	333,996
分配应收款项	4,217,833	4,508,788	汇兑净亏损	(2,086,716)	(2,455,882)
衍生性产品 [附注 4(l)(a)]	368,688	2,208,647	其他收入 [附注 13]	-	644
投资 [附注 4(l)(a)]	1,368,108,378	1,528,940,360			
股息及其他应收款项	4,569,738	5,283,413			
				<u>(26,848,053)</u>	<u>48,638,811</u>
<b>总资产</b>	<u>1,405,238,215</u>	<u>1,592,272,152</u>			
			<b>支出</b>		
<b>负债</b>			管理费用 [附注 8(e)]	21,819,014	27,466,646
应付经纪款项	5,983,423	2,336,442	交易成本	3,570,638	5,252,558
赎回应付款项	3,540,541	14,217,088	托管费用及银行费用	522,135	545,645
应付收益分配 [附注 6]	5,106,024	6,294,812	受托人费用 [附注 9]	385,109	477,578
衍生性产品 [附注 4(l)(a)]	4,111,828	8,963,626	基金注册登记机构费用 [附注 8(h)]	254,493	342,763
应付税项 [附注 7]	149,308	32,481	法律及专业费用	101,470	8,102
其他应付款项	1,910,275	1,972,025	核数师酬金	17,304	16,700
			估值费用 [附注 8(e)]	17,220	17,150
<b>总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)</b>	<u>20,801,399</u>	<u>33,816,474</u>	印刷及出版支出	9,904	5,954
			其他经营费用	35,767	12,970
<b>可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]</b>	<u>1,384,436,816</u>	<u>1,558,455,678</u>		<u>26,733,054</u>	<u>34,146,066</u>
			<b>净经营 (亏损) / 利润</b>	<u>(53,581,107)</u>	<u>14,492,745</u>
			<b>财务成本</b>		
			收益分配 [附注 6]	(63,118,632)	(83,689,315)
			利息支出	(39,424)	(14,522)
				<u>(63,158,056)</u>	<u>(83,703,837)</u>
			<b>除税前亏损</b>	<u>(116,739,163)</u>	<u>(69,211,092)</u>
			税项 [附注 7]	(5,230,620)	(5,416,379)
			<b>可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之减少</b>	<u>(121,969,783)</u>	<u>(74,627,471)</u>

由受托人及管理人于二零二零年一月二十二日批准

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

可赎回份额持有人应占净资产变动表  
截至二零一九年九月三十日止年度

现金流量表  
截至二零一九年九月三十日止年度

	2019 美元	2018 美元
年初可赎回份额持有人应占净资产	1,558,455,678	1,736,071,182
分配可赎回份额 [附注 3]	933,590,300	1,882,890,086
赎回可赎回份额 [附注 3]	(985,639,379)	(1,985,878,119)
<b>净赎回</b>	<b>(52,049,079)</b>	<b>(102,988,033)</b>
	1,506,406,599	1,633,083,149
可赎回份额持有人应占净资产及 总综合收益之减少	(121,969,783)	(74,627,471)
年末可赎回份额持有人应占净资产	1,384,436,816	1,558,455,678

	2019 美元	2018 美元
<b>经营业务</b>		
购入投资及衍生性产品	(932,126,252)	(1,379,657,906)
出售投资及衍生性产品所得款项	1,000,402,176	1,514,113,437
已收股息	60,727,329	68,792,202
已收利息	288,260	327,288
已付基金注册登记机构费用	(256,585)	(379,979)
已付受托人费用	(385,440)	(482,372)
已付交易费用	(3,555,422)	(5,260,415)
已付税项	(5,113,793)	(5,416,379)
已付管理费用	(21,900,273)	(27,757,041)
其他	(2,214,536)	(2,586,374)

<b>经营业务所产生之现金净额</b>	<b>95,865,464</b>	<b>161,692,461</b>
---------------------	-------------------	--------------------

<b>融资活动</b>		
已付利息	(39,424)	(14,522)
分配可赎回份额所得款项	933,881,255	1,888,205,993
赎回可赎回份额付款	(996,315,926)	(1,980,219,723)
已付收益分配	(64,307,420)	(83,734,732)

<b>融资活动所运用之现金净额</b>	<b>(126,781,515)</b>	<b>(175,762,984)</b>
---------------------	----------------------	----------------------

<b>现金及现金等价物之减少</b>	<b>(30,916,051)</b>	<b>(14,070,523)</b>
年初现金及现金等价物	47,182,555	61,711,785
现金及现金等价物之汇兑亏损	(552,925)	(458,707)

<b>年末现金及现金等价物</b>	<b>15,713,579</b>	<b>47,182,555</b>
-------------------	-------------------	-------------------

**现金及现金等价物余额分析：**

银行现金	15,713,579	29,897,332
短期存款	-	17,285,223
	15,713,579	47,182,555

财务报表附注

1 本基金

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

投资管理人已通过特别决议将其名称由JF资产管理有限公司更改为「摩根资产管理（亚太）有限公司」，更名自二零一九年七月三十日生效。

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

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

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

2 主要会计政策

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。

*于二零一八年十月一日生效的新准则及对现有准则的修订*

没有于二零一八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。

*于二零一八年十月一日后生效且本基金并未提早采纳之新准则、对准则之修订和解释*

若干新准则、准则修订及解释在二零一八年十月一日开始的年度期间生效，但在编制本财务报表时并未提前采纳。此等新准则、准则修订及解释预期不会对本基金的财务报表产生重大影响。

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公允价值为负数的衍生性产品合约列示为按公允价值透过损益列账的负债。

当预期某一借入证券的市值将会下跌时，本基金出售该证券进行卖空，或通过卖空进行套汇交易。卖空被分类为按公允价值透过损益列账的金融负债。

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。



*确认、取消确认及计量*

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

*公允价值估计*

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

债务证券的公允价值按包括应计利息的报价计算。

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

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

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

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

*公允价值级次分层间的转拨*

在公允价值级次分层之间的转拨视为于报告期间开始时已发生。

**(c) 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帐。

**(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息法在综合收益表确认。

支出乃按应计基准在综合收益表确认。

**(e) 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。

**(f) 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。

**(g) 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。

**(h) 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用损失相当的金额，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。

**(i) 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。

**(j) 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）

2019

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	25,078,226.135	9,877,942.309	1,553,788.546	4,953,046.260	1,292,757.437
总分配	13,864,294.649	3,207,675.174	1,051,361.161	1,809,346.066	1,227,941.518
总赎回	(16,995,823.095)	(4,092,220.492)	(1,297,047.344)	(2,681,065.116)	(1,217,128.978)
年末	<u>21,946,697.689</u>	<u>8,993,396.991</u>	<u>1,308,102.363</u>	<u>4,081,327.210</u>	<u>1,303,569.977</u>
	澳元	加元	欧元	英镑	港元
可赎回份额持有人应占净资产	<u>193,608,672</u>	<u>80,850,394</u>	<u>12,102,153</u>	<u>37,565,455</u>	<u>16,439,998</u>
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	<u>8.82</u>	<u>8.99</u>	<u>9.25</u>	<u>9.20</u>	<u>12.61</u>
	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	新加坡元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	242,164,862.290	6,870,594.703	1,573,624.119	190,590,640.316	1,767,059.188
总分配	108,072,077.376	2,447,324.294	95,610.504	56,683,035.212	438,034.144
总赎回	(161,335,541.562)	(4,074,774.183)	(424,122.283)	(79,517,786.426)	(1,346,737.154)
年末	<u>188,901,398.104</u>	<u>5,243,144.814</u>	<u>1,245,112.340</u>	<u>167,755,889.102</u>	<u>858,356.178</u>
	港元	纽元	人民币	人民币	新加坡元
可赎回份额持有人应占净资产	<u>1,766,391,160</u>	<u>46,786,352</u>	<u>17,917,356</u>	<u>1,610,018,603</u>	<u>7,743,081</u>
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	<u>9.35</u>	<u>8.92</u>	<u>14.39</u>	<u>9.60</u>	<u>9.02</u>

2019

	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	357,512,440	58,738,129,006	-	-	-
总分配	208,045,055	27,402,227,327	9,267,609,430	6,311,042,040	4,060,277,420
总赎回	(283,474,960)	(43,685,096,377)	(277,437,833)	(1,414,616,320)	(343,859,630)
年末	282,082,535	42,455,259,956	8,990,171,597	4,896,425,720	3,716,417,790
	美元	美元	美元	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占净 资产	3,538,027	393,250,535	85,817,827	49,939,511	36,880,292
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	12.54	9.26	9.55	10.20	9.92
	PRC 人民币对冲份 额 (累计) 份额	PRC 人民币对冲份 额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额	
已发行份额数目:					
年初	-	-	-	-	-
总分配	32,200,828,580	35,389,211,800	4,329,581,030	3,348,562,860	
总赎回	(3,182,769,620)	(3,796,896,770)	(226,909,560)	(231,664,390)	
年末	29,018,058,960	31,592,315,030	4,102,671,470	3,116,898,470	
	人民币	人民币	美元	美元	
可赎回份额持有人应占净 资产	277,120,157	293,273,002	39,293,862	29,055,297	
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	9.55	9.28	9.58	9.32	

2018

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	27,108,234.972	10,051,457.473	1,825,364.582	6,387,566.040	877,376.220
总分配	33,983,210.531	9,213,394.313	1,245,713.674	3,892,715.651	988,022.479
总赎回	(36,013,219.368)	(9,386,909.477)	(1,517,289.710)	(5,327,235.431)	(572,641.262)
年末	25,078,226.135	9,877,942.309	1,553,788.546	4,953,046.260	1,292,757.437
	澳元	加元	欧元	英镑	港元
可赎回份额持有人应占净资产	236,489,568	94,664,021	15,276,700	48,524,037	16,478,379
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.43	9.58	9.83	9.80	12.75
	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	新加坡元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	280,011,130.965	8,621,369.463	2,752,627.244	193,808,307.217	1,279,397.621
总分配	301,982,781.257	6,133,639.999	328,501.932	105,243,757.367	1,459,585.523
总赎回	(339,829,049.932)	(7,884,414.759)	(1,507,505.057)	(108,461,424.268)	(971,923.956)
年末	242,164,862.290	6,870,594.703	1,573,624.119	190,590,640.316	1,767,059.188
	港元	纽元	人民币	人民币	新加坡元
可赎回份额持有人应占净资产	2,397,665,622	65,500,294	22,929,067	1,949,899,852	17,001,971
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.90	9.53	14.57	10.23	9.62

2018

	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:		
年初	3,655,626.170	57,111,634.129
总分配	2,066,589.623	78,202,356.292
总赎回	(5,364,703.353)	(76,575,861.415)
年末	<u>357,512.440</u>	<u>58,738,129.006</u>
	美元	美元
可赎回份额持有人应占净 资产	<u>4,541,186</u>	<u>577,217,695</u>
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	<u>12.70</u>	<u>9.83</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

本基金的投资及衍生性产品须面对在所有投资及衍生性产品中所固有的市场价格风险，即持有投资及衍生性产品的价值可升可跌。本基金的市场风险按照特定的投资限制及指南，通过以下方式管理：(i)审慎的股票选择，及(ii)分散的投资组合。

本基金的投资管理人主要通过本基金的 Beta 值定期监测本基金的市场价格敏感度。Beta 值计量基金回报与投资管理人选择的相关基准指数之间的统计关系。

截至九月三十日，投资及衍生性产品之公平值及其估计市场敏感度如下：

	2019		2018	
	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				
股票				
- 中国	386,435,656	27.9	424,196,487	27.2
- 澳大利亚	212,232,741	15.3	194,922,850	12.5
- 香港	187,397,089	13.5	193,008,152	12.4
- 台湾	141,802,142	10.3	138,910,435	8.9
- 韩国	126,868,754	9.2	203,780,231	13.1
- 新加坡	95,704,704	6.9	212,669,009	13.6
- 泰国	78,663,890	5.7	88,793,196	5.7
- 印度尼西亚	74,157,636	5.4	54,435,098	3.5
- 其他	64,845,766	4.7	18,224,902	1.2
	<u>1,368,108,378</u>	<u>98.9</u>	<u>1,528,940,360</u>	<u>98.1</u>
衍生性产品				
- 远期外汇合约	368,688	0.0	2,208,647	0.2
	<u>1,368,477,066</u>	<u>98.9</u>	<u>1,531,149,007</u>	<u>98.3</u>
负债				
衍生性产品				
- 远期外汇合约	(4,111,828)	(0.3)	(8,963,626)	(0.6)
总上市投资	<u>1,364,365,238</u>	<u>98.6</u>	<u>1,522,185,381</u>	<u>97.7</u>

有关衍生性产品合约的风险亦请参阅附注 12。

	资产净值 美元	本基金相关基准指数 (注*)	Beta 值 (注**)	占相关基准指数之 合理变动百分比 (注***)	估计对资产净值的影响 (注****) 美元
截至二零一九年九月三十日	<u>1,384,436,816</u>	MSCI AC Asia Pacific ex Japan Net	0.87	-1.8	<u>(21,680,281)</u>
截至二零一八年九月三十日	<u>1,558,455,678</u>	MSCI AC Asia Pacific ex Japan Net	0.80	+2.0	<u>24,935,291</u>

假定所有其他可能影响本基金资产净值的变量保持不变，若相关基准指数收益呈反方向波动，则将导致本基金的资产净值以相同金额呈反向变动。

注：

\* 本基金相关基准指数指投资管理人监测本基金市场价格风险时所使用的有关市场指数。

\*\* Beta 值计量了在过去最长三十六个月期间或自组合启动后的数月期间，本基金回报与各基准指数之间的统计关系。对于推出期间少于十二个月内推出的基金，将采用本基金的每周回报计算 Beta 值。

\*\*\* 合理变动百分比取决于过去十二个月的基准指数之实际历史变动，但不包括不大可能出现或“最恶劣”情况或“压力测试”下之变动，亦不代表投资管理人对本基金未来回报的预测。对于推出期间少于十二个月的基金，将采用自经营开始后基准指数之实际历史变动计算合理变动百分比。

\*\*\*\* 假定所有其他变量保持不变，对本基金资产净值的估计影响按照本基金资产净值乘以相关 Beta 值再乘以相关基准指数之合理变动百分比计算。

**(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。

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。

	2019 1 个月以内 美元	2018 1 个月以内 美元
银行现金	15,713,579	29,897,332
短期存款	-	17,285,223
	15,713,579	47,182,555
总利率敏感性缺口	15,713,579	47,182,555

任何现金及现金等价物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 12。



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 <sup>1</sup> ）	美元 等值	与美元比较之合理变动百分比 （注 <sup>2</sup> ）	估计对资产净值的 影响（美元）
<b>2019</b>			
澳元	347,043,021	-6.8	(23,598,925)
加元	61,534,619	-2.4	(1,476,831)
人民币（离岸）	376,676,328	-3.7	(13,937,024)
人民币（在岸）	510,843	-3.6	(18,390)
欧元	13,467,356	-6.1	(821,509)
港元	513,369,545	-0.2	(1,026,739)
印度卢比	61,539,415	+2.3	1,415,407
印尼盾	74,157,636	+5.0	3,707,882
韩元	126,868,754	-7.3	(9,261,419)
纽元	29,865,371	-5.4	(1,612,730)
新加坡元	103,021,203	-1.2	(1,236,254)
英镑	46,752,289	-5.5	(2,571,376)
台币	128,046,879	-1.6	(2,048,750)
泰铢	80,144,818	+5.7	4,568,255
	<u>1,962,998,077</u>		<u>(47,918,403)</u>
<b>2018</b>			
澳元	367,373,222	-7.8	(28,655,111)
加元	72,852,859	-3.2	(2,331,291)
人民币（离岸）	327,919,262	-3.3	(10,821,336)
人民币（在岸）	261,585	-3.5	(9,155)
欧元	17,612,706	-1.8	(317,029)
港元	595,529,558	-0.2	(1,191,059)
印度卢比	12,127,534	-9.9	(1,200,626)
印尼盾	54,435,098	-9.6	(5,225,769)
韩元	203,780,231	+3.3	6,724,748
纽元	49,480,584	-8.3	(4,106,888)
新加坡元	226,911,666	-0.6	(1,361,470)
英镑	62,847,512	-2.8	(1,759,730)
台币	142,199,178	-0.7	(995,394)
泰铢	89,435,990	+3.1	2,772,516
	<u>2,222,766,985</u>		<u>(48,477,594)</u>

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

注：

\* 资产及负债汇兑风险承担净值包括货币及非货币资产及负债。

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

(b) 信贷风险

信贷风险指交易对手无法于到期日支付全数金额的风险。

管理人会参考交易对手的违约历史及其信贷评级等因素进行信贷风险监控。由于过去 5 年内，本基金在分配应收款项、应收经纪款项或应收股息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 12 个月内的预期信贷损失确认损失准备金。

截至九月三十日，在信用增级前本基金的最高信贷风险承担列示如下：

	2019 美元	2018 美元
银行现金	15,713,579	29,897,332
短期存款	-	17,285,223
应收经纪款项	12,259,999	4,148,389
分配应收款项	4,217,833	4,508,788
经纪发行的衍生性产品	368,688	2,208,647
股息及其他应收款项	4,569,738	5,283,413
	<u>37,129,837</u>	<u>63,331,792</u>

所有上市投资交易均由经核准的经纪按照货银交付原则进行结算。由于本基金的托管银行只会在收取款项后始交付有关投资，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后即时付款。若任何一方不能履行其责任，交易将告失效。

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。

	2019 交易对手风险承担 美元	2018 交易对手风险承担 美元
银行结余及短期存款		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	14,474,897	32,657,551
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	1,238,682	14,525,004
经纪发行的衍生性产品		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	134,221	402,939
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	234,467	1,804,902
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	-	806
托管机构的投资余额		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	<u>1,368,108,378</u>	<u>1,528,940,360</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。

	2019		2018	
	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
应付经纪款项	5,983,423	-	2,336,442	-
赎回应付款项	3,540,541	-	14,217,088	-
应付收益分配	5,106,024	-	6,294,812	-
衍生性产品	4,111,734	94	7,861,942	1,101,684
其他应付款项	1,910,275	-	1,972,025	-
可赎回份额持有人应占净资产	1,384,436,816	-	1,558,455,678	-
<b>总金融负债</b>	<b>1,405,088,813</b>	<b>94</b>	<b>1,591,137,987</b>	<b>1,101,684</b>

投资管理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**

截至二零一九年及二零一八年九月三十日，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>2019</u>				
<u>资产</u>				
衍生性产品	280,794	(176,347)	-	104,447
按公允价值透过损益列账的金融资产	280,794	(176,347)	-	104,447
<u>负债</u>				
衍生性产品	3,379,097	(176,347)	-	3,202,750
按公允价值透过损益列账的金融负债	3,379,097	(176,347)	-	3,202,750

	财务状况表中列	受总抵销安排及类似协议规限的相		净额
	示的经确认金融	关金额		
	资产总额	金融工具	抵押品及保证金	
	美元	美元	美元	美元
<u>2018</u>				
<u>资产</u>				
衍生性产品	700,999	(687,796)	-	13,203
按公允价值透过损益列账的金融资产	700,999	(687,796)	-	13,203

	财务状况表中列	受总抵销安排及类似协议规限的相		净额
	示的经确认金融	关金额		
	负债总额	金融工具	抵押品及保证金	
	美元	美元	美元	美元
<u>负债</u>				
衍生性产品	4,558,879	(687,796)	-	3,871,083
按公允价值透过损益列账的金融负债	4,558,879	(687,796)	-	3,871,083

**(II) 资本风险管理**

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

为了维持资本结构，本基金的政策执行如下：

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

**(III) 公允价值估计**

截至二零一九年及二零一八年九月三十日，管理人认为资产及负债的账目价值与公允价值相若。

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

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

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

上市投资	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总额 美元
<u>2019</u>				
<u>资产</u>				
股票	1,368,108,378	-	-	1,368,108,378
衍生性产品	-	368,688	-	368,688
按公平值透过损益列账的总金融资产	<u>1,368,108,378</u>	<u>368,688</u>	<u>-</u>	<u>1,368,477,066</u>
<u>负债</u>				
衍生性产品	-	4,111,828	-	4,111,828
按公平值透过损益列账的总金融负债	<u>-</u>	<u>4,111,828</u>	<u>-</u>	<u>4,111,828</u>
<u>2018</u>				
<u>资产</u>				
股票	1,528,940,360	-	-	1,528,940,360
衍生性产品	-	2,208,647	-	2,208,647
按公平值透过损益列账的总金融资产	<u>1,528,940,360</u>	<u>2,208,647</u>	<u>-</u>	<u>1,531,149,007</u>
<u>负债</u>				
衍生性产品	-	8,963,626	-	8,963,626
按公平值透过损益列账的总金融负债	<u>-</u>	<u>8,963,626</u>	<u>-</u>	<u>8,963,626</u>

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。

截至二零一九年及二零一八年九月三十日止年度无各层级间的转换。

截至二零一九年及二零一八年九月三十日，以摊余成本计量的资产和负债，其账面价值与公平值相若。

5 投资及衍生性产品净亏损

	2019 美元	2018 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益／亏损之变动	(1,647,926)	(53,174,498)
投资及衍生性产品销售实现的（亏损）／收益	(83,414,017)	32,399,103
	<u>(85,061,943)</u>	<u>(20,775,395)</u>

6 收益分配

基金管理人有意就每个会计期应占收入的至少 85%拨作收益分配类别，在分别收取每收益分配类别的费用后，分配予该等收益分配类别的份额持有人。

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

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2019 美元	2018 美元
澳元对冲类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	澳元 0.0334	24,551,192.585	(581,182)	
加元对冲类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	加元 0.0300	9,730,020.425	(222,273)	
欧元对冲类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	欧元 0.0140	1,478,876.925	(23,459)	
英镑对冲类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	英镑 0.0239	4,629,744.401	(141,384)	
港元类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	港元 0.0373	225,391,244.892	(1,072,415)	
纽元对冲类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	纽元 0.0338	6,686,206.644	(147,574)	
人民币对冲类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	人民币 0.0564	186,614,300.992	(1,509,032)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月9日	新加坡元 0.0305	1,463,803.011	(32,240)	
美元类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	美元 0.0370	56,330,916.220	(2,084,245)	
澳元对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	澳元 0.0322	24,217,069.015	(569,441)	
加元对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	加元 0.0313	9,571,749.729	(225,413)	
欧元对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	欧元 0.0153	1,468,673.886	(25,442)	
英镑对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	英镑 0.0249	4,556,991.697	(144,775)	
港元类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	港元 0.0373	221,992,751.135	(1,058,088)	
纽元对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	纽元 0.0327	6,468,702.591	(145,298)	
人民币对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	人民币 0.0480	182,690,352.230	(1,260,685)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	新加坡元 0.0303	1,360,393.754	(30,044)	
美元类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	美元 0.0370	55,366,396.874	(2,048,558)	
澳元对冲类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	澳元 0.0310	24,055,256.692	(524,982)	
加元对冲类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	加元 0.0288	9,644,159.542	(203,362)	
欧元对冲类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	欧元 0.0096	1,467,997.762	(16,110)	
英镑对冲类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	英镑 0.0203	4,540,989.065	(117,403)	
港元类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	港元 0.0372	215,973,759.409	(1,026,167)	
纽元对冲类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	纽元 0.0319	6,236,866.146	(133,410)	
人民币对冲类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	人民币 0.0442	181,256,663.433	(1,166,104)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	新加坡元 0.0305	1,360,884.875	(30,453)	
美元类别（每月派息）	2018年12月31日	2019年1月9日	美元 0.0370	54,444,331.780	(2,014,440)	
澳元对冲类别（每月派息）	2019年1月31日	2019年2月13日	澳元 0.0310	24,985,687.912	(564,768)	
加元对冲类别（每月派息）	2019年1月31日	2019年2月13日	加元 0.0285	9,843,324.929	(213,611)	
欧元对冲类别（每月派息）	2019年1月31日	2019年2月13日	欧元 0.0111	1,401,655.119	(17,852)	
英镑对冲类别（每月派息）	2019年1月31日	2019年2月13日	英镑 0.0216	4,543,925.858	(129,110)	
港元类别（每月派息）	2019年1月31日	2019年2月13日	港元 0.0374	218,685,568.516	(1,042,329)	
纽元对冲类别（每月派息）	2019年1月31日	2019年2月13日	纽元 0.0304	6,797,364.409	(143,325)	
人民币对冲类别（每月派息）	2019年1月31日	2019年2月13日	人民币 0.0406	185,275,660.724	(1,121,410)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2019年1月31日	2019年2月13日	新加坡元 0.0298	1,117,921.883	(24,775)	
美元类别（每月派息）	2019年1月31日	2019年2月13日	美元 0.0370	56,868,080.566	(2,104,119)	
澳元对冲类别（每月派息）	2019年2月28日	2019年3月8日	澳元 0.0312	26,093,571.829	(579,205)	
加元对冲类别（每月派息）	2019年2月28日	2019年3月8日	加元 0.0297	9,734,008.495	(219,514)	
欧元对冲类别（每月派息）	2019年2月28日	2019年3月8日	欧元 0.0138	1,364,075.476	(21,435)	
英镑对冲类别（每月派息）	2019年2月28日	2019年3月8日	英镑 0.0228	4,639,193.795	(140,689)	
港元类别（每月派息）	2019年2月28日	2019年3月8日	港元 0.0374	216,040,538.393	(1,029,315)	
纽元对冲类别（每月派息）	2019年2月28日	2019年3月8日	纽元 0.0303	6,207,285.394	(128,177)	
人民币对冲类别（每月派息）	2019年2月28日	2019年3月8日	人民币 0.0342	190,081,900.683	(970,966)	
新加坡元对冲类别（每月派息）	2019年2月28日	2019年3月8日	新加坡元 0.0308	1,065,669.074	(24,291)	
美元类别（每月派息）	2019年2月28日	2019年3月8日	美元 0.0370	57,675,825.633	(2,134,006)	
澳元对冲类别（每月派息）	2019年3月29日	2019年4月9日	澳元 0.0309	25,393,310.165	(557,378)	
加元对冲类别（每月派息）	2019年3月29日	2019年4月9日	加元 0.0288	9,619,742.735	(207,379)	
欧元对冲类别（每月派息）	2019年3月29日	2019年4月9日	欧元 0.0110	1,901,136.043	(23,482)	
英镑对冲类别（每月派息）	2019年3月29日	2019年4月9日	英镑 0.0213	4,344,365.840	(120,578)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2019 美元	2018 美元
港元类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	港元 0.0374	217,176,054.543	(1,034,705)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	纽元 0.0303	5,645,290.840	(116,658)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	人民币 0.0374	187,316,881.244	(1,042,407)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	新加坡元 0.0306	941,212.710	(21,263)	
美元类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	美元 0.0370	57,853,279.825	(2,140,572)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	人民币 0.0363	12,540,956.210	(67,737)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	人民币 0.0372	912,007.830	(5,048)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	美元 0.0373	576,831.520	(21,516)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	澳元 0.0292	23,427,492.220	(481,492)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	加元 0.0285	9,303,925.833	(197,117)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	欧元 0.0102	1,908,897.991	(21,821)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	英镑 0.0208	4,171,538.031	(113,115)	
港元类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	港元 0.0374	210,149,165.799	(1,001,807)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	纽元 0.0304	5,442,406.380	(110,338)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	人民币 0.0382	178,920,625.991	(1,013,872)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	新加坡元 0.0305	950,587.319	(21,300)	
美元类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	美元 0.0370	56,548,317.667	(2,092,287)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	人民币 0.0370	20,892,017.720	(114,668)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	人民币 0.0371	1,499,421.440	(8,252)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	美元 0.0373	1,401,758.560	(52,286)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	澳元 0.0287	22,811,036.647	(453,593)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	加元 0.0291	9,114,580.651	(196,194)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	欧元 0.0119	1,442,819.676	(19,133)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	英镑 0.0217	4,193,408.061	(114,693)	
港元类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	港元 0.0374	200,501,832.589	(956,408)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	纽元 0.0297	5,405,272.694	(104,646)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	人民币 0.0399	177,548,133.148	(1,021,782)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	新加坡元 0.0316	959,638.706	(22,033)	
美元类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	美元 0.0370	54,263,367.922	(2,007,745)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	人民币 0.0387	24,429,292.200	(136,361)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	人民币 0.0385	2,210,012.320	(12,272)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	美元 0.0373	2,094,266.360	(78,116)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	澳元 0.0273	23,723,811.241	(454,495)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	加元 0.0288	9,031,519.462	(199,049)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	欧元 0.0120	1,402,683.936	(19,169)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	英镑 0.0220	4,250,838.426	(119,021)	
港元类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	港元 0.0373	194,928,715.935	(930,668)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	纽元 0.0299	5,457,640.215	(109,602)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	人民币 0.0414	174,828,117.824	(1,053,089)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	新加坡元 0.0320	1,050,542.761	(24,847)	
美元类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	美元 0.0370	53,900,267.345	(1,994,310)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	人民币 0.0401	25,655,142.640	(149,683)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	人民币 0.0383	2,458,102.970	(13,698)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	美元 0.0372	2,299,582.920	(85,544)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	澳元 0.0252	22,404,435.504	(389,145)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	加元 0.0292	8,968,002.527	(199,418)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	欧元 0.0113	1,419,596.560	(17,861)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	英镑 0.0214	4,085,117.316	(107,043)	
港元类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	港元 0.0372	190,490,042.265	(905,253)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	纽元 0.0293	5,180,450.355	(100,180)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	人民币 0.0380	170,978,982.747	(942,798)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	新加坡元 0.0310	822,672.491	(18,635)	
美元类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	美元 0.0370	53,699,177.956	(1,986,870)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	人民币 0.0368	28,188,852.420	(150,528)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	人民币 0.0382	2,693,687.700	(14,931)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	美元 0.0373	2,603,180.590	(97,099)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	澳元 0.0259	21,910,735.282	(382,345)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	加元 0.0307	9,057,365.047	(209,257)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	欧元 0.0144	1,299,323.676	(20,605)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	英镑 0.0235	4,209,215.010	(120,466)	
港元类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	港元 0.0374	191,290,580.266	(913,076)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	纽元 0.0285	5,368,828.437	(96,504)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	人民币 0.0434	170,943,526.158	(1,036,600)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	新加坡元 0.0324	859,817.932	(20,082)	
美元类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	美元 0.0370	43,797,356.478	(1,620,502)	
美元 C 类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	美元 0.0381	8,840,919.689	(336,839)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	人民币 0.0421	30,472,245.790	(179,249)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	人民币 0.0392	3,200,436.600	(17,529)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	美元 0.0372	2,787,373.550	(103,690)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2019 美元	2018 美元
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	澳元 0.0265	21,952,658.954	(392,358)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	加元 0.0314	9,004,073.560	(213,541)	
欧元对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	欧元 0.0144	1,308,102.363	(20,536)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	英镑 0.0242	4,094,106.633	(122,093)	
港元类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	港元 0.0373	188,929,792.793	(898,931)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	纽元 0.0278	5,258,722.915	(91,670)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	人民币 0.0467	167,887,823.378	(1,097,905)	
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	新加坡元 0.0326	858,356.178	(20,235)	
美元类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元 0.0370	42,476,441.096	(1,571,628)	
美元 C 类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元 0.0381	8,968,915.052	(341,716)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	人民币 0.0451	31,537,763.700	(199,176)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	人民币 0.0394	3,816,275.490	(21,055)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元 0.0372	3,096,228.640	(115,180)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	澳元 0.0386	28,107,499.221		(831,885)
加元对冲类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	加元 0.0328	9,852,725.299		(250,694)
欧元对冲类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	欧元 0.0190	1,691,166.534		(37,432)
英镑对冲类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	英镑 0.0256	6,199,869.740		(210,768)
港元类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	港元 0.0362	262,001,521.523		(1,215,675)
纽元对冲类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	纽元 0.0143	8,654,681.813		(244,863)
人民币对冲类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	人民币 0.0569	189,256,757.525		(1,623,836)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	新加坡元 0.0320	1,215,271.347		(28,544)
美元类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	美元 0.0360	55,059,547.009		(1,982,145)
澳元对冲类别 (每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	澳元 0.0379	28,612,220.708		(823,225)
加元对冲类别 (每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	加元 0.0326	9,666,996.964		(244,620)
欧元对冲类别 (每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	欧元 0.0197	1,603,772.934		(37,671)
英镑对冲类别 (每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	英镑 0.0275	5,784,731.794		(215,339)
港元类别 (每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	港元 0.0362	253,496,806.045		(1,174,499)
纽元对冲类别 (每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	纽元 0.0413	8,816,259.059		(249,872)
人民币对冲类别 (每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	人民币 0.0572	185,721,225.146		(1,606,481)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	新加坡元 0.0329	1,270,147.357		(31,023)
美元类别 (每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	美元 0.0360	53,543,178.874		(1,927,555)
澳元对冲类别 (每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	澳元 0.0364	26,593,124.396		(757,113)
加元对冲类别 (每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	加元 0.0291	9,441,958.962		(219,291)
欧元对冲类别 (每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	欧元 0.0100	1,637,774.119		(19,666)
英镑对冲类别 (每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	英镑 0.0199	5,385,302.615		(144,971)
港元类别 (每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	港元 0.0362	246,462,990.223		(1,141,310)
纽元对冲类别 (每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	纽元 0.0400	8,242,324.824		(234,478)
人民币对冲类别 (每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	人民币 0.0576	182,805,258.002		(1,616,938)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	新加坡元 0.0320	1,315,947.788		(31,510)
美元类别 (每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	美元 0.0360	52,641,636.661		(1,895,100)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	澳元 0.0373	27,198,221.300		(821,486)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	加元 0.0313	10,891,280.184		(277,864)
欧元对冲类别 (每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	欧元 0.0138	1,749,114.500		(30,070)
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	英镑 0.0237	5,316,624.301		(179,184)
港元类别 (每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	港元 0.0382	297,051,646.623		(1,450,802)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	纽元 0.0414	8,000,938.535		(245,150)
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	人民币 0.0590	186,061,793.008		(1,744,061)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	新加坡元 0.0317	1,334,929.921		(32,323)
美元类别 (每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	美元 0.0380	59,627,598.092		(2,265,849)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	澳元 0.0378	27,681,692.458		(815,382)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	加元 0.0341	10,704,774.107		(284,881)
欧元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	欧元 0.0195	1,789,126.717		(42,551)
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	英镑 0.0272	5,372,957.465		(201,365)
港元类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	港元 0.0383	316,977,789.078		(1,551,410)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	纽元 0.0403	7,551,518.217		(219,800)
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	人民币 0.0594	184,981,775.537		(1,736,012)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	新加坡元 0.0317	1,755,797.932		(42,075)
美元类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	美元 0.0380	63,904,658.659		(2,428,377)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	澳元 0.0361	30,646,884.744		(848,628)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	加元 0.0307	12,455,327.062		(296,590)
欧元对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	欧元 0.0129	1,973,629.844		(31,312)
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	英镑 0.0224	5,536,281.228		(173,965)
港元类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	港元 0.0384	334,256,150.365		(1,635,442)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	纽元 0.0394	7,413,279.127		(210,709)
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	人民币 0.0588	188,117,016.137		(1,760,215)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	新加坡元 0.0324	1,607,811.921		(39,726)
美元类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	美元 0.0380	75,045,535.344		(2,851,730)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	澳元 0.0371	30,850,884.780		(863,977)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	加元 0.0320	12,273,609.087		(306,373)



收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2019 美元	2018 美元
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	纽元 0.0392	7,224,036.706		(199,530)
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	人民币 0.0532	191,692,289.294		(1,613,855)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	新加坡元 0.0306	1,531,072.618		(35,384)
美元类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	美元 0.0390	74,019,197.938		(2,886,749)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	澳元 0.0370	28,880,446.038		(808,538)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	加元 0.0322	11,692,954.189		(290,251)
欧元对冲类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	欧元 0.0164	1,912,549.398		(36,613)
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	英镑 0.0251	5,643,988.276		(188,505)
港元类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	港元 0.0394	311,153,885.112		(1,562,880)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	纽元 0.0394	7,362,948.377		(203,549)
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	人民币 0.0569	198,579,779.845		(1,763,996)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	新加坡元 0.0324	1,448,469.894		(35,089)
美元类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	美元 0.0390	72,939,393.396		(2,844,636)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	澳元 0.0364	28,935,199.925		(778,187)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	加元 0.0312	11,863,820.793		(281,388)
欧元对冲类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	欧元 0.0156	1,862,128.030		(33,916)
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	英镑 0.0240	5,527,913.936		(175,157)
港元类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	港元 0.0394	310,279,751.389		(1,558,231)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	纽元 0.0379	7,349,209.566		(188,582)
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	人民币 0.0559	199,946,617.588		(1,686,384)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	新加坡元 0.0329	1,477,478.378		(35,650)
美元类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	美元 0.0390	70,388,460.265		(2,745,150)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	澳元 0.0373	28,021,753.027		(777,010)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	加元 0.0326	11,302,355.151		(282,993)
欧元对冲类别 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	欧元 0.0168	1,747,149.298		(34,343)
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	英镑 0.0254	5,371,051.698		(178,955)
港元类别 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	港元 0.0394	293,010,815.761		(1,471,187)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	纽元 0.0383	7,027,180.620		(183,231)
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	人民币 0.0484	199,363,871.315		(1,415,837)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	新加坡元 0.0325	1,723,929.065		(41,157)
美元类别 (每月派息)	2018年7月31日	2018年8月8日	美元 0.0390	67,436,905.299		(2,630,039)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	澳元 0.0363	26,354,257.326		(691,856)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	加元 0.0331	10,621,555.753		(269,622)
欧元对冲类别 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	欧元 0.0168	1,622,362.813		(31,712)
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	英镑 0.0267	5,099,062.159		(176,954)
港元类别 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	港元 0.0394	267,234,759.208		(1,341,468)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	纽元 0.0387	6,956,755.312		(178,632)
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	人民币 0.0441	196,788,209.899		(1,270,233)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	新加坡元 0.0333	1,794,258.319		(43,611)
美元类别 (每月派息)	2018年8月31日	2018年9月10日	美元 0.0390	61,336,149.462		(2,392,110)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	澳元 0.0369	25,133,610.550		(671,042)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	加元 0.0322	9,910,530.727		(246,882)
欧元对冲类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	欧元 0.0172	1,553,788.546		(31,041)
英镑对冲类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	英镑 0.0269	5,000,959.942		(175,428)
港元类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	港元 0.0394	243,159,774.328		(1,224,360)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	纽元 0.0378	6,868,537.217		(172,122)
人民币对冲类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	人民币 0.0517	191,420,766.150		(1,439,401)
新加坡元对冲类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	新加坡元 0.0337	1,767,059.188		(43,583)
美元类别 (每月派息)	2018年9月28日	2018年10月9日	美元 0.0390	58,742,371.132		(2,290,953)
可赎回份额持有人的总收益分配					(63,118,632)	(83,689,315)

7 税项

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

于截至二零一九年及二零一八年九月三十日止年度，已就收到的若干股息收入预扣或缴付海外税项。

8 与受托人及其关联人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。基金的关联人士是根据香港证券及期货事务监察委员会所颁布的单位信托及互惠基金守则（“证监会守则”）中的定义。所有该等交易均于正常业务过程中按一般商业条款订立。

(a) 以下为与管理人及其关联人士之投资交易：

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>2019</u>					
J.P. Morgan India Private Limited	1,251,699	0.06	1,127	0.06	0.09
J.P. Morgan Securities Australia Limited	12,368,681	0.62	16,843	0.92	0.14
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	113,662,102	5.73	133,919	7.34	0.12
<u>2018</u>					
J.P. Morgan Securities Australia Limited	13,224,666	0.45	14,105	0.51	0.11
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	154,336,876	5.27	190,936	6.84	0.12

(b) 与管理人及其关联人士之年末结余：

	2019 美元	2018 美元
银行现金	5,930,917	7,821,580
应收款项	5,511	5,140
应付款项	(1,795,537)	(1,875,692)

于本年度内，存放于管理人关联人士的银行现金的利息收入为 83,228 美元（二零一八年：61,524 美元）。

(c) 本基金可能利用受托人及其关联人以及管理人及其关联人士的券商、托管人、代理人及银行服务。本基金可能收取存款利息，并为该等服务支付利息费用、交易成本、托管费用及银行费用。所有该等交易均于正常业务过程中按一般商业条款订立。

(d) 于本年度内，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 4,324 美元（二零一八年：10,078 美元）。

(e) 支付给摩根基金（亚洲）有限公司 C 类别（每月派息）之管理费和其他基金份额类别之管理费分别按各类别资产净值的年率百分之零七五和百分之一二五计算。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) 本基金允许管理人及其关联人士认购/申购及赎回本基金份额。所有交易均为按一般商业条款下进行的正常业务流程。

(g) 有关支付给受托人的费用，请参阅附注 9。

(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零二零一五至百分之零二零五不等。基金注册登记机构费用于每季季末支付。

9 受托人费用

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零零零六计算；资产净值介乎 4,000 万美元至 7,000 万美元，按年率百分之零零零四计算；超过 7,000 万美元时，按年率百分之零零零二五计算。受托人费用于每个交易日累计，并于每月月底支付。

10 借款

截至二零一九年及二零一八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（受托人的关联人）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。

11 非金钱收益／佣金共享安排

投资管理人与经纪签署了非金钱收益／佣金共享安排，从而收取若干产品和服务以协助作出投资决策。由基金支付的部分交易佣金会由经纪保留，作为产品和服务的补偿。

该等产品和服务必须对本基金具有明显的利益，并仅限于研究和咨询服务。

12 衍生性产品

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	未实现收益／ (亏损) 美元
<b>2019</b>			
未平仓合约：			
澳元 874,053	美元 593,927	2019 年 10 月 2 日	4,376
澳元 295,850	美元 199,815	2019 年 10 月 2 日	264
英镑 5,297	美元 6,559	2019 年 10 月 2 日	31
纽元 165,542	美元 103,989	2019 年 10 月 2 日	178
纽元 2,569	美元 1,625	2019 年 10 月 2 日	14
美元 1,913	加元 2,537	2019 年 10 月 2 日	3
美元 9,699	英镑 7,877	2019 年 10 月 3 日	7
美元 145,343	英镑 117,945	2019 年 10 月 4 日	12
美元 72,686	加元 96,244	2019 年 10 月 4 日	6
美元 87,335	纽元 139,277	2019 年 10 月 4 日	6
离岸人民币 873,190	美元 122,725	2019 年 10 月 8 日	450
离岸人民币 699,894	美元 98,368	2019 年 10 月 8 日	360
离岸人民币 672,135	美元 94,284	2019 年 10 月 8 日	163
离岸人民币 11,150	美元 1,567	2019 年 10 月 8 日	6
离岸人民币 11,254	美元 1,578	2019 年 10 月 8 日	2
离岸人民币 200,310	美元 28,097	2019 年 10 月 9 日	47
离岸人民币 27,807	美元 3,900	2019 年 10 月 9 日	7
离岸人民币 763,313	美元 107,019	2019 年 10 月 10 日	133
离岸人民币 350,150	美元 49,092	2019 年 10 月 10 日	61
离岸人民币 531,300	美元 74,664	2019 年 10 月 11 日	269
离岸人民币 120,898	美元 16,990	2019 年 10 月 11 日	61
澳元 1,909,505	美元 1,310,723	2019 年 10 月 21 日	21,998
澳元 2,097,861	美元 1,437,695	2019 年 10 月 21 日	21,849
澳元 1,489,206	美元 1,012,240	2019 年 10 月 21 日	7,175
澳元 565,490	美元 388,443	2019 年 10 月 21 日	6,793
澳元 381,117	美元 262,311	2019 年 10 月 21 日	5,096
澳元 791,838	美元 538,367	2019 年 10 月 21 日	3,955
澳元 1,125,939	美元 763,352	2019 年 10 月 21 日	3,456
澳元 279,454	美元 191,874	2019 年 10 月 21 日	3,271
澳元 453,443	美元 309,269	2019 年 10 月 21 日	3,240
澳元 246,271	美元 169,061	2019 年 10 月 21 日	2,853
澳元 115,412	美元 79,542	2019 年 10 月 21 日	1,651
澳元 236,054	美元 160,522	2019 年 10 月 21 日	1,209

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
澳元 95,031	美元 65,265	2019年10月21日	1,129
澳元 74,344	美元 51,154	2019年10月21日	980
澳元 299,112	美元 202,798	2019年10月21日	927
澳元 259,549	美元 175,924	2019年10月21日	755
澳元 75,071	美元 51,415	2019年10月21日	750
澳元 373,215	美元 252,475	2019年10月21日	593
澳元 83,466	美元 56,813	2019年10月21日	482
澳元 120,627	美元 81,791	2019年10月21日	379
澳元 19,270	美元 13,263	2019年10月21日	258
澳元 13,781	美元 9,460	2019年10月21日	159
澳元 130,547	美元 88,233	2019年10月21日	127
澳元 15,652	美元 10,676	2019年10月21日	112
澳元 7,454	美元 5,117	2019年10月21日	86
澳元 6,984	美元 4,797	2019年10月21日	83
澳元 6,725	美元 4,619	2019年10月21日	81
澳元 5,570	美元 3,839	2019年10月21日	80
澳元 9,840	美元 6,691	2019年10月21日	50
澳元 4,149	美元 2,848	2019年10月21日	49
澳元 3,277	美元 2,255	2019年10月21日	43
澳元 4,112	美元 2,804	2019年10月21日	29
澳元 1,600	美元 1,103	2019年10月21日	23
澳元 1,604	美元 1,104	2019年10月21日	21
澳元 1,604	美元 1,104	2019年10月21日	21
澳元 1,614	美元 1,108	2019年10月21日	19
澳元 1,601	美元 1,099	2019年10月21日	19
澳元 1,598	美元 1,097	2019年10月21日	19
澳元 1,603	美元 1,101	2019年10月21日	18
澳元 8,733	美元 5,908	2019年10月21日	14
澳元 1,608	美元 1,094	2019年10月21日	9
澳元 1,628	美元 1,107	2019年10月21日	8
澳元 1,618	美元 1,097	2019年10月21日	5
澳元 1,629	美元 1,101	2019年10月21日	2
加元 48,046	美元 36,552	2019年10月21日	255
加元 47,800	美元 36,299	2019年10月21日	188
加元 37,351	美元 28,405	2019年10月21日	188
加元 53,358	美元 40,332	2019年10月21日	22
加元 3,207	美元 2,437	2019年10月21日	14
加元 47,107	美元 35,598	2019年10月21日	11
加元 1,447	美元 1,101	2019年10月21日	8
加元 1,450	美元 1,102	2019年10月21日	7
加元 1,456	美元 1,106	2019年10月21日	6
加元 1,447	美元 1,099	2019年10月21日	6
加元 1,449	美元 1,098	2019年10月21日	4
加元 1,449	美元 1,098	2019年10月21日	4
加元 1,449	美元 1,098	2019年10月21日	4
加元 66,245	美元 50,046	2019年10月21日	1
离岸人民币 17,993,861	美元 2,538,429	2019年10月21日	19,550
离岸人民币 12,463,062	美元 1,753,256	2019年10月21日	8,609
离岸人民币 2,144,159	美元 304,624	2019年10月21日	4,473
离岸人民币 7,848,398	美元 1,102,666	2019年10月21日	4,004
离岸人民币 9,335,207	美元 1,310,323	2019年10月21日	3,530
离岸人民币 2,436,255	美元 343,830	2019年10月21日	2,789
离岸人民币 1,750,350	美元 247,707	2019年10月21日	2,683
离岸人民币 2,098,912	美元 296,347	2019年10月21日	2,530
离岸人民币 2,064,700	美元 291,206	2019年10月21日	2,178
离岸人民币 1,953,093	美元 275,465	2019年10月21日	2,060
离岸人民币 1,922,439	美元 271,089	2019年10月21日	1,975
离岸人民币 2,273,110	美元 319,899	2019年10月21日	1,697
离岸人民币 3,079,953	美元 432,779	2019年10月21日	1,630
离岸人民币 2,121,716	美元 298,593	2019年10月21日	1,584
离岸人民币 1,784,656	美元 251,329	2019年10月21日	1,504
离岸人民币 1,151,696	美元 162,529	2019年10月21日	1,308
离岸人民币 987,165	美元 139,202	2019年10月21日	1,014
离岸人民币 4,873,399	美元 683,126	2019年10月21日	921

交付合约	折算额		未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 2,186,162	美元 306,913	2019年10月21日	882
离岸人民币 1,886,886	美元 264,935	2019年10月21日	798
离岸人民币 754,472	美元 106,397	2019年10月21日	782
离岸人民币 1,390,139	美元 195,332	2019年10月21日	733
离岸人民币 653,473	美元 92,148	2019年10月21日	671
离岸人民币 1,787,865	美元 250,917	2019年10月21日	642
离岸人民币 555,688	美元 78,416	2019年10月21日	628
离岸人民币 1,676,127	美元 235,235	2019年10月21日	602
离岸人民币 1,811,575	美元 254,020	2019年10月21日	426
离岸人民币 288,183	美元 40,640	2019年10月21日	299
离岸人民币 178,327	美元 25,236	2019年10月21日	273
离岸人民币 613,767	美元 86,178	2019年10月21日	260
离岸人民币 574,111	美元 80,610	2019年10月21日	243
离岸人民币 961,428	美元 134,812	2019年10月21日	226
离岸人民币 200,771	美元 28,323	2019年10月21日	218
离岸人民币 202,328	美元 28,533	2019年10月21日	210
离岸人民币 463,539	美元 65,085	2019年10月21日	198
离岸人民币 290,723	美元 40,837	2019年10月21日	140
离岸人民币 672,536	美元 94,271	2019年10月21日	125
离岸人民币 226,360	美元 31,807	2019年10月21日	120
离岸人民币 228,003	美元 32,035	2019年10月21日	118
离岸人民币 220,888	美元 31,034	2019年10月21日	113
离岸人民币 198,421	美元 27,872	2019年10月21日	96
离岸人民币 132,595	美元 18,653	2019年10月21日	92
离岸人民币 185,946	美元 26,119	2019年10月21日	90
离岸人民币 166,142	美元 23,343	2019年10月21日	85
离岸人民币 44,619	美元 6,314	2019年10月21日	68
离岸人民币 30,013	美元 4,264	2019年10月21日	62
离岸人民币 113,445	美元 15,939	2019年10月21日	58
离岸人民币 47,762	美元 6,743	2019年10月21日	57
离岸人民币 97,745	美元 13,733	2019年10月21日	50
离岸人民币 93,052	美元 13,075	2019年10月21日	49
离岸人民币 43,619	美元 6,155	2019年10月21日	49
离岸人民币 102,880	美元 14,441	2019年10月21日	39
离岸人民币 18,866	美元 2,680	2019年10月21日	39
离岸人民币 36,754	美元 5,183	2019年10月21日	38
离岸人民币 86,844	美元 12,192	2019年10月21日	35
离岸人民币 28,400	美元 4,008	2019年10月21日	32
离岸人民币 29,408	美元 4,147	2019年10月21日	30
离岸人民币 108,989	美元 15,282	2019年10月21日	26
离岸人民币 45,661	美元 6,416	2019年10月21日	24
离岸人民币 43,081	美元 6,053	2019年10月21日	23
离岸人民币 14,264	美元 2,019	2019年10月21日	22
离岸人民币 44,437	美元 6,242	2019年10月21日	21
离岸人民币 13,094	美元 1,853	2019年10月21日	20
离岸人民币 16,761	美元 2,366	2019年10月21日	20
离岸人民币 17,557	美元 2,476	2019年10月21日	18
离岸人民币 7,784	美元 1,106	2019年10月21日	16
离岸人民币 26,576	美元 3,734	2019年10月21日	14
离岸人民币 16,351	美元 2,303	2019年10月21日	14
离岸人民币 32,629	美元 4,581	2019年10月21日	13
离岸人民币 25,615	美元 3,599	2019年10月21日	13
离岸人民币 7,736	美元 1,095	2019年10月21日	12
离岸人民币 29,089	美元 4,084	2019年10月21日	12
离岸人民币 22,244	美元 3,125	2019年10月21日	12
离岸人民币 21,051	美元 2,958	2019年10月21日	11
离岸人民币 9,984	美元 1,408	2019年10月21日	10
离岸人民币 7,822	美元 1,104	2019年10月21日	9
离岸人民币 7,795	美元 1,100	2019年10月21日	9
离岸人民币 7,805	美元 1,101	2019年10月21日	8

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 17,806	美元 2,500	2019年10月21日	8
离岸人民币 7,768	美元 1,095	2019年10月21日	8
离岸人民币 7,768	美元 1,095	2019年10月21日	8
离岸人民币 7,789	美元 1,097	2019年10月21日	7
离岸人民币 7,789	美元 1,097	2019年10月21日	7
离岸人民币 7,789	美元 1,097	2019年10月21日	7
离岸人民币 18,152	美元 2,548	2019年10月21日	7
离岸人民币 7,789	美元 1,097	2019年10月21日	7
离岸人民币 17,083	美元 2,399	2019年10月21日	7
离岸人民币 7,789	美元 1,097	2019年10月21日	7
离岸人民币 11,122	美元 1,563	2019年10月21日	6
离岸人民币 19,792	美元 2,775	2019年10月21日	5
离岸人民币 7,828	美元 1,100	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,826	美元 1,100	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,828	美元 1,100	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,794	美元 1,095	2019年10月21日	4
离岸人民币 8,537	美元 1,199	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,858	美元 1,104	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,828	美元 1,100	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,826	美元 1,100	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,824	美元 1,098	2019年10月21日	3
离岸人民币 7,828	美元 1,099	2019年10月21日	3
离岸人民币 7,824	美元 1,098	2019年10月21日	3
离岸人民币 7,826	美元 1,097	2019年10月21日	2
离岸人民币 7,826	美元 1,097	2019年10月21日	2
离岸人民币 8,045	美元 1,128	2019年10月21日	2
离岸人民币 7,826	美元 1,097	2019年10月21日	2
离岸人民币 7,840	美元 1,099	2019年10月21日	1
欧元 136,000	美元 150,735	2019年10月21日	2,250
欧元 93,180	美元 102,598	2019年10月21日	864
欧元 70,098	美元 76,872	2019年10月21日	338
欧元 21,274	美元 23,400	2019年10月21日	173
欧元 2,118	美元 2,335	2019年10月21日	23
欧元 994	美元 1,099	2019年10月21日	13
英镑 798,824	美元 998,596	2019年10月21日	13,487
英镑 418,258	美元 522,120	2019年10月21日	6,325
英镑 283,813	美元 353,799	2019年10月21日	3,801
英镑 205,573	美元 255,801	2019年10月21日	2,289
英镑 45,293	美元 56,626	2019年10月21日	771
英镑 214,639	美元 265,318	2019年10月21日	625
英镑 164,144	美元 203,015	2019年10月21日	592
英镑 7,749	美元 9,669	2019年10月21日	112
英镑 16,469	美元 20,409	2019年10月21日	99
英镑 4,956	美元 6,204	2019年10月21日	92
英镑 1,488	美元 1,857	2019年10月21日	22
英镑 881	美元 1,102	2019年10月21日	15
英镑 4,559	美元 5,635	2019年10月21日	13
英镑 883	美元 1,098	2019年10月21日	9
英镑 891	美元 1,103	2019年10月21日	4
英镑 1,774	美元 2,192	2019年10月21日	4
英镑 889	美元 1,098	2019年10月21日	2
纽元 1,524,361	美元 969,219	2019年10月21日	12,988
纽元 520,184	美元 330,132	2019年10月21日	3,820
纽元 300,354	美元 191,036	2019年10月21日	2,624
纽元 276,071	美元 174,620	2019年10月21日	1,440
纽元 279,623	美元 176,819	2019年10月21日	1,412
纽元 100,563	美元 64,287	2019年10月21日	1,204
纽元 375,890	美元 236,907	2019年10月21日	1,111
纽元 43,385	美元 27,921	2019年10月21日	705
纽元 282,368	美元 177,664	2019年10月21日	535
纽元 131,429	美元 82,953	2019年10月21日	508

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
纽元 27,861	美元 17,898	2019年10月21日	421
纽元 27,330	美元 17,427	2019年10月21日	283
纽元 47,691	美元 30,176	2019年10月21日	259
纽元 37,223	美元 23,550	2019年10月21日	200
纽元 107,756	美元 67,720	2019年10月21日	124
纽元 19,810	美元 12,494	2019年10月21日	67
纽元 6,246	美元 3,983	2019年10月21日	65
纽元 15,590	美元 9,839	2019年10月21日	60
纽元 1,727	美元 1,113	2019年10月21日	30
纽元 1,715	美元 1,102	2019年10月21日	27
纽元 1,711	美元 1,099	2019年10月21日	26
纽元 1,714	美元 1,100	2019年10月21日	25
纽元 1,712	美元 1,095	2019年10月21日	20
纽元 1,722	美元 1,095	2019年10月21日	15
纽元 1,731	美元 1,100	2019年10月21日	13
纽元 1,750	美元 1,107	2019年10月21日	10
纽元 1,742	美元 1,102	2019年10月21日	9
新加坡元 85,398	美元 62,206	2019年10月21日	440
新加坡元 59,172	美元 42,992	2019年10月21日	195
新加坡元 18,520	美元 13,474	2019年10月21日	79
新加坡元 43,093	美元 31,216	2019年10月21日	47
新加坡元 1,515	美元 1,101	2019年10月21日	5
美元 46,685,082	英镑 37,904,411	2019年10月21日	58,595
美元 3,724,542	离岸人民币 26,789,874	2019年10月21日	25,659
美元 2,634,582	离岸人民币 18,936,558	2019年10月21日	16,266
美元 531,344	英镑 440,003	2019年10月21日	11,260
美元 1,476,615	澳元 2,196,446	2019年10月21日	5,762
美元 696,448	加元 928,091	2019年10月21日	4,685
美元 450,440	离岸人民币 3,237,383	2019年10月21日	2,747
美元 419,337	离岸人民币 3,013,839	2019年10月21日	2,557
美元 194,806	离岸人民币 1,399,886	2019年10月21日	1,158
美元 594,231	澳元 882,078	2019年10月21日	1,083
美元 767,372	离岸人民币 5,488,758	2019年10月21日	975
美元 718,911	离岸人民币 5,142,132	2019年10月21日	913
美元 555,245	加元 736,118	2019年10月21日	861
美元 141,421	离岸人民币 1,016,255	2019年10月21日	841
美元 98,733	离岸人民币 709,500	2019年10月21日	587
美元 113,599	离岸人民币 814,210	2019年10月21日	379
美元 197,615	离岸人民币 1,414,123	2019年10月21日	342
美元 63,760	新加坡元 88,624	2019年10月21日	339
美元 112,267	加元 148,934	2019年10月21日	247
美元 143,967	离岸人民币 1,030,127	2019年10月21日	236
美元 64,463	离岸人民币 462,034	2019年10月21日	215
美元 28,246	离岸人民币 203,023	2019年10月21日	175
美元 146,891	离岸人民币 1,050,200	2019年10月21日	121
美元 16,843	离岸人民币 121,150	2019年10月21日	116
美元 54,702	加元 72,553	2019年10月21日	109
美元 120,757	离岸人民币 863,350	2019年10月21日	100
美元 25,442	离岸人民币 182,350	2019年10月21日	85
美元 3,469	英镑 2,863	2019年10月21日	62
美元 30,006	加元 39,787	2019年10月21日	51
美元 2,417	英镑 2,000	2019年10月21日	49
美元 15,843	加元 21,026	2019年10月21日	41
美元 5,589	离岸人民币 40,200	2019年10月21日	39
美元 45,590	英镑 37,000	2019年10月21日	38
美元 30,723	离岸人民币 219,656	2019年10月21日	25
美元 14,435	离岸人民币 103,213	2019年10月21日	13
美元 1,531	加元 2,041	2019年10月21日	11
美元 1,105	离岸人民币 7,947	2019年10月21日	8
美元 4,968	离岸人民币 35,548	2019年10月21日	8
美元 1,867	加元 2,479	2019年10月21日	6
美元 1,624	离岸人民币 11,618	2019年10月21日	2
澳元 52,488	美元 35,462	2019年11月21日	2
离岸人民币 706,647	美元 98,841	2019年11月21日	4

未实现总收益 368,688

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
加元 148,934	美元 112,232	2019年10月2日	(256)
美元 1,101	澳元 1,629	2019年10月2日	(2)
美元 1,097	英镑 889	2019年10月2日	(2)
美元 12,489	纽元 19,810	2019年10月2日	(66)
美元 40,320	加元 53,358	2019年10月3日	(20)
美元 82,919	纽元 131,429	2019年10月3日	(500)
美元 175,815	澳元 259,549	2019年10月3日	(750)
英镑 37,000	美元 45,561	2019年10月4日	(38)
美元 35,406	澳元 52,488	2019年10月4日	(3)
美元 1,098	离岸人民币 7,826	2019年10月8日	(2)
美元 2,776	离岸人民币 19,792	2019年10月8日	(5)
美元 94,290	离岸人民币 672,536	2019年10月8日	(113)
美元 1,128	离岸人民币 8,045	2019年10月9日	(1)
美元 1,099	离岸人民币 7,840	2019年10月9日	(1)
美元 32,044	离岸人民币 228,003	2019年10月9日	(116)
美元 1,546	离岸人民币 11,039	2019年10月10日	(0)
美元 1,200	离岸人民币 8,537	2019年10月10日	(4)
美元 3,126	离岸人民币 22,244	2019年10月10日	(11)
美元 1,096	离岸人民币 7,827	2019年10月11日	(0)
美元 1,547	离岸人民币 11,046	2019年10月11日	(0)
离岸人民币 530,400	美元 74,259	2019年10月15日	(2)
离岸人民币 2,928,205	美元 409,965	2019年10月15日	(10)
澳元 1,634	美元 1,103	2019年10月21日	0
澳元 1,633	美元 1,100	2019年10月21日	(2)
澳元 204,598	美元 138,057	2019年10月21日	(26)
澳元 50,814	美元 34,234	2019年10月21日	(60)
加元 1,461	美元 1,104	2019年10月21日	(0)
加元 1,631	美元 1,232	2019年10月21日	(0)
加元 1,457	美元 1,100	2019年10月21日	(1)
加元 1,461	美元 1,102	2019年10月21日	(1)
加元 1,460	美元 1,101	2019年10月21日	(2)
加元 1,460	美元 1,100	2019年10月21日	(3)
加元 2,537	美元 1,914	2019年10月21日	(3)
加元 169,478	美元 127,924	2019年10月21日	(109)
加元 61,642	美元 46,446	2019年10月21日	(122)
加元 55,404	美元 41,730	2019年10月21日	(125)
加元 467,275	美元 352,846	2019年10月21日	(161)
加元 891,767	美元 673,367	2019年10月21日	(326)
加元 622,096	美元 469,512	2019年10月21日	(455)
加元 301,877	美元 226,868	2019年10月21日	(1,187)
离岸人民币 7,865	美元 1,100	2019年10月21日	(1)
离岸人民币 18,665	美元 2,611	2019年10月21日	(2)
离岸人民币 7,903	美元 1,105	2019年10月21日	(2)
离岸人民币 7,903	美元 1,104	2019年10月21日	(2)
离岸人民币 21,036	美元 2,942	2019年10月21日	(2)
离岸人民币 25,462	美元 3,562	2019年10月21日	(3)
离岸人民币 9,701	美元 1,354	2019年10月21日	(4)
离岸人民币 7,858	美元 1,096	2019年10月21日	(4)
离岸人民币 41,245	美元 5,769	2019年10月21日	(4)
离岸人民币 11,624	美元 1,622	2019年10月21日	(5)
离岸人民币 7,873	美元 1,096	2019年10月21日	(7)
离岸人民币 7,873	美元 1,096	2019年10月21日	(7)
离岸人民币 7,873	美元 1,096	2019年10月21日	(7)
离岸人民币 9,388	美元 1,305	2019年10月21日	(9)
离岸人民币 20,820	美元 2,905	2019年10月21日	(10)
离岸人民币 96,464	美元 13,493	2019年10月21日	(10)
离岸人民币 19,859	美元 2,763	2019年10月21日	(16)
离岸人民币 17,305	美元 2,406	2019年10月21日	(17)
离岸人民币 23,185	美元 3,223	2019年10月21日	(22)
离岸人民币 59,298	美元 8,274	2019年10月21日	(27)
离岸人民币 268,954	美元 37,592	2019年10月21日	(58)
离岸人民币 192,043	美元 26,700	2019年10月21日	(184)



交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
离岸人民币 918,530	美元 128,383	2019年10月21日	(198)
离岸人民币 266,499	美元 37,085	2019年10月21日	(220)
离岸人民币 1,490,675	美元 208,253	2019年10月21日	(420)
离岸人民币 1,928,328	美元 269,395	2019年10月21日	(543)
离岸人民币 1,439,756	美元 200,887	2019年10月21日	(658)
离岸人民币 1,071,839	美元 149,155	2019年10月21日	(887)
离岸人民币 4,843,576	美元 676,891	2019年10月21日	(1,139)
离岸人民币 2,091,038	美元 290,869	2019年10月21日	(1,846)
离岸人民币 2,182,918	美元 303,489	2019年10月21日	(2,087)
离岸人民币 23,414,129	美元 3,275,082	2019年10月21日	(2,555)
离岸人民币 3,191,324	美元 443,922	2019年10月21日	(2,817)
英镑 7,877	美元 9,706	2019年10月21日	(8)
英镑 901	美元 1,100	2019年10月21日	(11)
英镑 912	美元 1,105	2019年10月21日	(20)
英镑 3,584	美元 4,331	2019年10月21日	(88)
英镑 34,466	美元 41,758	2019年10月21日	(745)
美元 1,578	离岸人民币 11,254	2019年10月21日	(2)
美元 1,007	离岸人民币 7,174	2019年10月21日	(3)
美元 1,100	离岸人民币 7,828	2019年10月21日	(4)
美元 1,567	离岸人民币 11,150	2019年10月21日	(6)
美元 1,677	新加坡元 2,310	2019年10月21日	(7)
美元 3,899	离岸人民币 27,807	2019年10月21日	(7)
美元 1,140	澳元 1,677	2019年10月21日	(8)
美元 3,070	新加坡元 4,231	2019年10月21日	(9)
美元 1,096	英镑 881	2019年10月21日	(10)
美元 1,182	纽元 1,868	2019年10月21日	(10)
美元 1,468	澳元 2,159	2019年10月21日	(11)
美元 1,414	纽元 2,235	2019年10月21日	(12)
美元 1,625	纽元 2,569	2019年10月21日	(14)
美元 1,774	澳元 2,606	2019年10月21日	(15)
美元 659	纽元 1,027	2019年10月21日	(15)
美元 1,120	澳元 1,636	2019年10月21日	(16)
美元 6,904	英镑 5,585	2019年10月21日	(16)
美元 1,937	离岸人民币 13,729	2019年10月21日	(16)
美元 1,645	英镑 1,317	2019年10月21日	(21)
美元 1,437	欧元 1,296	2019年10月21日	(22)
美元 12,838	离岸人民币 91,498	2019年10月21日	(29)
美元 6,565	英镑 5,297	2019年10月21日	(32)
美元 14,808	纽元 23,537	2019年10月21日	(43)
美元 28,088	离岸人民币 200,310	2019年10月21日	(48)
美元 3,736	英镑 2,988	2019年10月21日	(51)
美元 4,214	纽元 6,636	2019年10月21日	(51)
美元 7,831	加元 10,297	2019年10月21日	(52)
美元 16,986	离岸人民币 120,898	2019年10月21日	(62)
美元 49,082	离岸人民币 350,150	2019年10月21日	(66)
美元 30,767	澳元 45,483	2019年10月21日	(70)
美元 24,089	离岸人民币 171,483	2019年10月21日	(84)
美元 6,676	纽元 10,500	2019年10月21日	(89)
美元 34,573	新加坡元 47,667	2019年10月21日	(96)
美元 29,006	离岸人民币 206,500	2019年10月21日	(100)
美元 14,414	离岸人民币 102,150	2019年10月21日	(115)
美元 20,074	离岸人民币 142,541	2019年10月21日	(120)
美元 5,594	纽元 8,692	2019年10月21日	(141)
美元 106,996	离岸人民币 763,313	2019年10月21日	(144)
美元 104,033	纽元 165,542	2019年10月21日	(189)
美元 59,784	加元 78,859	2019年10月21日	(210)
美元 20,708	澳元 30,364	2019年10月21日	(215)
美元 26,968	离岸人民币 191,099	2019年10月21日	(217)
美元 21,843	离岸人民币 154,350	2019年10月21日	(236)
美元 22,545	离岸人民币 159,331	2019年10月21日	(241)
美元 30,759	离岸人民币 217,958	2019年10月21日	(248)
美元 31,915	纽元 50,475	2019年10月21日	(252)
美元 74,647	离岸人民币 531,300	2019年10月21日	(273)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 50,022	加元 65,850	2019年10月21日	(275)
美元 199,955	澳元 295,850	2019年10月21日	(285)
美元 98,336	离岸人民币 700,400	2019年10月21日	(290)
美元 102,534	离岸人民币 730,300	2019年10月21日	(302)
美元 83,199	离岸人民币 592,173	2019年10月21日	(304)
美元 83,689	离岸人民币 595,600	2019年10月21日	(314)
美元 36,634	离岸人民币 259,423	2019年10月21日	(319)
美元 51,166	新加坡元 70,276	2019年10月21日	(337)
美元 98,814	离岸人民币 703,470	2019年10月21日	(339)
美元 57,648	离岸人民币 409,342	2019年10月21日	(346)
美元 96,553	离岸人民币 687,210	2019年10月21日	(354)
美元 205,795	离岸人民币 166,581	2019年10月21日	(367)
美元 98,342	离岸人民币 699,894	2019年10月21日	(367)
美元 104,580	离岸人民币 744,350	2019年10月21日	(382)
美元 605,982	英镑 491,053	2019年10月21日	(414)
美元 122,691	离岸人民币 873,190	2019年10月21日	(458)
美元 69,452	新加坡元 95,382	2019年10月21日	(465)
美元 64,175	离岸人民币 455,088	2019年10月21日	(469)
美元 192,843	离岸人民币 1,374,237	2019年10月21日	(470)
美元 203,265	离岸人民币 1,448,505	2019年10月21日	(496)
美元 84,931	离岸人民币 603,073	2019年10月21日	(509)
美元 194,621	离岸人民币 1,386,150	2019年10月21日	(580)
美元 167,567	离岸人民币 1,192,662	2019年10月21日	(612)
美元 76,479	欧元 69,280	2019年10月21日	(838)
美元 59,372	离岸人民币 417,930	2019年10月21日	(868)
美元 302,219	离岸人民币 2,152,500	2019年10月21日	(901)
美元 582,468	英镑 471,590	2019年10月21日	(902)
美元 109,222	离岸人民币 773,650	2019年10月21日	(922)
美元 283,085	离岸人民币 2,015,312	2019年10月21日	(971)
美元 363,366	离岸人民币 2,588,671	2019年10月21日	(990)
美元 275,188	离岸人民币 1,958,637	2019年10月21日	(1,008)
美元 355,213	离岸人民币 2,530,189	2019年10月21日	(1,023)
美元 141,619	离岸人民币 1,004,357	2019年10月21日	(1,024)
美元 381,743	离岸人民币 2,719,597	2019年10月21日	(1,040)
美元 132,801	离岸人民币 941,189	2019年10月21日	(1,048)
美元 48,176	纽元 75,037	2019年10月21日	(1,105)
美元 153,447	欧元 139,454	2019年10月21日	(1,189)
美元 252,209	英镑 203,489	2019年10月21日	(1,266)
美元 197,885	离岸人民币 1,404,520	2019年10月21日	(1,273)
美元 208,210	离岸人民币 1,477,803	2019年10月21日	(1,340)
美元 81,008	澳元 118,011	2019年10月21日	(1,361)
美元 85,223	澳元 124,168	2019年10月21日	(1,421)
美元 173,726	离岸人民币 1,230,550	2019年10月21日	(1,467)
美元 121,239	欧元 109,524	2019年10月21日	(1,658)
美元 164,449	离岸人民币 1,162,059	2019年10月21日	(1,778)
美元 252,173	离岸人民币 1,788,400	2019年10月21日	(1,824)
美元 5,498,134	新加坡元 7,599,163	2019年10月21日	(1,849)
美元 256,921	离岸人民币 1,821,920	2019年10月21日	(1,879)
美元 265,077	澳元 389,916	2019年10月21日	(1,921)
美元 87,511	纽元 136,230	2019年10月21日	(2,053)
美元 148,242	欧元 133,892	2019年10月21日	(2,055)
美元 119,985	欧元 108,000	2019年10月21日	(2,067)
美元 351,314	纽元 556,687	2019年10月21日	(2,104)
美元 512,878	澳元 756,538	2019年10月21日	(2,289)
美元 213,249	离岸人民币 1,506,900	2019年10月21日	(2,306)
美元 380,236	加元 500,257	2019年10月21日	(2,313)
美元 137,592	澳元 200,407	2019年10月21日	(2,336)
美元 752,708	加元 992,988	2019年10月21日	(2,546)
美元 1,189,215	离岸人民币 8,475,972	2019年10月21日	(2,703)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 184,560	欧元 166,505	2019年10月21日	(2,766)
美元 115,932	纽元 180,370	2019年10月21日	(2,785)
美元 723,001	加元 952,941	2019年10月21日	(3,094)
美元 175,554	纽元 273,035	2019年10月21日	(4,277)
美元 555,535	离岸人民币 3,937,040	2019年10月21日	(4,408)
美元 594,317	澳元 874,053	2019年10月21日	(4,416)
美元 585,834	离岸人民币 4,151,771	2019年10月21日	(4,648)
美元 428,449	英镑 343,650	2019年10月21日	(4,656)
美元 277,952	纽元 435,427	2019年10月21日	(4,807)
美元 272,224	澳元 395,000	2019年10月21日	(5,635)
美元 371,759	澳元 541,341	2019年10月21日	(6,404)
美元 2,426,102	离岸人民币 17,282,345	2019年10月21日	(6,828)
美元 360,175	澳元 523,310	2019年10月21日	(6,988)
美元 834,225	纽元 1,316,764	2019年10月21日	(8,216)
美元 376,957	纽元 586,363	2019年10月21日	(9,128)
美元 2,638,361	离岸人民币 18,782,095	2019年10月21日	(9,144)
美元 372,996	纽元 579,456	2019年10月21日	(9,500)
美元 539,036	澳元 783,487	2019年10月21日	(10,253)
美元 742,151	澳元 1,080,581	2019年10月21日	(12,858)
美元 873,236	澳元 1,271,276	2019年10月21日	(15,242)
美元 2,075,651	离岸人民币 14,669,393	2019年10月21日	(22,157)
美元 1,173,427	澳元 1,705,371	2019年10月21日	(22,457)
美元 1,621,762	澳元 2,366,687	2019年10月21日	(24,468)
美元 3,365,965	离岸人民币 23,835,883	2019年10月21日	(29,298)
美元 1,622,047	澳元 2,357,164	2019年10月21日	(31,176)
美元 36,279,614	离岸人民币 258,190,874	2019年10月21日	(136,696)
美元 60,411,325	加元 79,777,082	2019年10月21日	(143,044)
美元 39,011,637	离岸人民币 277,633,847	2019年10月21日	(146,990)
美元 12,989,460	欧元 11,732,239	2019年10月21日	(179,937)
美元 225,970,780	离岸人民币 1,609,703,532	2019年10月21日	(635,934)
美元 30,124,477	纽元 46,909,125	2019年10月21日	(698,105)
美元 129,566,840	澳元 189,284,652	2019年10月21日	(1,817,415)
加元 96,244	美元 72,736	2019年11月21日	(10)
离岸人民币 7,827	美元 1,095	2019年11月21日	(0)
离岸人民币 11,039	美元 1,544	2019年11月21日	(0)
离岸人民币 11,046	美元 1,545	2019年11月21日	(0)
离岸人民币 812,180	美元 113,566	2019年11月21日	(32)
英镑 117,945	美元 145,614	2019年11月21日	(24)
纽元 139,277	美元 87,431	2019年11月21日	(7)
美元 34,964	离岸人民币 249,962	2019年11月21日	(2)
美元 74,189	离岸人民币 530,400	2019年11月21日	(3)
美元 409,578	离岸人民币 2,928,205	2019年11月21日	(16)
		未实现总亏损	(4,111,828)
		未实现净亏损	(3,743,140)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
<b>2018</b>			
未平仓合约:			
美元 745,063	加元 966,149	2018年10月2日	2,383
美元 1,549	加元 2,023	2018年10月2日	17
美元 1,870	澳元 2,590	2018年10月2日	4
美元 1,096	纽元 1,654	2018年10月2日	0
英镑 102,128	美元 134,682	2018年10月3日	1,497
美元 260,774	加元 340,689	2018年10月3日	2,795
美元 212,981	澳元 295,004	2018年10月3日	483
美元 60,501	纽元 91,281	2018年10月3日	18
澳元 143,609	美元 104,241	2018年10月4日	325
纽元 3,175	美元 2,105	2018年10月4日	0
美元 377,113	澳元 521,219	2018年10月4日	41
美元 611,849	英镑 469,162	2018年10月4日	32
美元 241,817	加元 312,553	2018年10月4日	3
纽元 19,608	美元 13,001	2018年10月5日	1
离岸人民币 157,268	美元 22,965	2018年10月9日	94
澳元 235,223,177	美元 170,387,672	2018年10月10日	180,181
澳元 1,038,951	美元 761,582	2018年10月10日	9,797
澳元 2,009,859	美元 1,464,109	2018年10月10日	9,775
澳元 818,967	美元 597,169	2018年10月10日	4,564
澳元 345,861	美元 254,104	2018年10月10日	3,839
澳元 267,783	美元 196,793	2018年10月10日	3,025
澳元 241,230	美元 177,385	2018年10月10日	2,831
澳元 433,709	美元 315,069	2018年10月10日	1,237
澳元 157,582	美元 114,690	2018年10月10日	664
澳元 5,184	美元 3,810	2018年10月10日	59
澳元 4,895	美元 3,596	2018年10月10日	53
澳元 3,129	美元 2,301	2018年10月10日	37
澳元 3,324	美元 2,437	2018年10月10日	31
澳元 2,086	美元 1,534	2018年10月10日	24
澳元 3,427	美元 2,497	2018年10月10日	17
澳元 1,498	美元 1,092	2018年10月10日	8
澳元 1,496	美元 1,089	2018年10月10日	6
澳元 1,496	美元 1,089	2018年10月10日	6
澳元 1,911	美元 1,389	2018年10月10日	5
澳元 1,526	美元 1,109	2018年10月10日	4
加元 281,498	美元 218,204	2018年10月10日	394
加元 2,475	美元 1,919	2018年10月10日	3
加元 2,076	美元 1,609	2018年10月10日	3
离岸人民币 13,646,805	美元 2,010,184	2018年10月10日	25,454
离岸人民币 28,909,850	美元 4,220,188	2018年10月10日	15,669
离岸人民币 16,383,270	美元 2,393,148	2018年10月10日	10,439
离岸人民币 5,334,407	美元 785,109	2018年10月10日	9,297
离岸人民币 3,406,920	美元 500,666	2018年10月10日	5,179
离岸人民币 13,307,269	美元 1,940,194	2018年10月10日	4,845
离岸人民币 9,821,247	美元 1,432,458	2018年10月10日	4,100
离岸人民币 5,263,530	美元 769,361	2018年10月10日	3,857
离岸人民币 12,669,601	美元 1,845,538	2018年10月10日	2,929
离岸人民币 4,557,540	美元 665,634	2018年10月10日	2,806
离岸人民币 4,206,149	美元 613,921	2018年10月10日	2,197
离岸人民币 2,073,056	美元 303,239	2018年10月10日	1,743
离岸人民币 2,137,570	美元 312,265	2018年10月10日	1,386
离岸人民币 4,541,462	美元 661,524	2018年10月10日	1,034
离岸人民币 650,030	美元 95,268	2018年10月10日	731
离岸人民币 5,119,252	美元 745,184	2018年10月10日	663
离岸人民币 1,020,556	美元 148,940	2018年10月10日	515
离岸人民币 901,422	美元 131,451	2018年10月10日	353
离岸人民币 184,247	美元 27,010	2018年10月10日	214
离岸人民币 3,400,160	美元 494,696	2018年10月10日	192
离岸人民币 310,418	美元 45,314	2018年10月10日	168
离岸人民币 78,601	美元 11,578	2018年10月10日	147

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
离岸人民币 212,164	美元 30,991	2018年10月10日	134
离岸人民币 66,054	美元 9,681	2018年10月10日	74
离岸人民币 33,203	美元 4,879	2018年10月10日	50
离岸人民币 24,989	美元 3,678	2018年10月10日	44
离岸人民币 170,636	美元 24,856	2018年10月10日	39
离岸人民币 18,321	美元 2,676	2018年10月10日	11
离岸人民币 30,034	美元 4,379	2018年10月10日	11
离岸人民币 13,307	美元 1,943	2018年10月10日	8
离岸人民币 12,331	美元 1,800	2018年10月10日	6
离岸人民币 7,515	美元 1,099	2018年10月10日	6
离岸人民币 24,574	美元 3,579	2018年10月10日	6
离岸人民币 11,532	美元 1,682	2018年10月10日	5
离岸人民币 7,556	美元 1,104	2018年10月10日	5
离岸人民币 7,500	美元 1,095	2018年10月10日	4
离岸人民币 23,847	美元 3,471	2018年10月10日	3
离岸人民币 51,383	美元 7,476	2018年10月10日	3
离岸人民币 7,526	美元 1,095	2018年10月10日	1
离岸人民币 7,552	美元 1,099	2018年10月10日	0
欧元 15,272,883	美元 17,981,581	2018年10月10日	231,436
欧元 201,069	美元 236,253	2018年10月10日	2,570
欧元 197,149	美元 230,445	2018年10月10日	1,319
欧元 106,894	美元 125,372	2018年10月10日	1,140
欧元 218,626	美元 254,908	2018年10月10日	821
欧元 49,601	美元 58,079	2018年10月10日	432
欧元 88,549	美元 103,044	2018年10月10日	132
欧元 26,302	美元 30,680	2018年10月10日	111
欧元 14,103	美元 16,494	2018年10月10日	104
欧元 107,392	美元 124,884	2018年10月10日	72
欧元 18,968	美元 22,113	2018年10月10日	68
欧元 5,177	美元 6,035	2018年10月10日	18
欧元 1,017	美元 1,192	2018年10月10日	11
欧元 941	美元 1,103	2018年10月10日	9
欧元 1,525	美元 1,779	2018年10月10日	7
欧元 942	美元 1,101	2018年10月10日	6
欧元 955	美元 1,111	2018年10月10日	2
英镑 48,102,640	美元 63,273,106	2018年10月10日	523,212
英镑 325,831	美元 429,111	2018年10月10日	4,065
英镑 109,735	美元 144,478	2018年10月10日	1,329
英镑 175,940	美元 230,279	2018年10月10日	765
英镑 48,692	美元 64,096	2018年10月10日	577
英镑 41,728	美元 54,941	2018年10月10日	506
英镑 23,903	美元 31,330	2018年10月10日	148
英镑 1,320	美元 1,738	2018年10月10日	16
英镑 1,188	美元 1,564	2018年10月10日	14
英镑 836	美元 1,101	2018年10月10日	10
英镑 840	美元 1,099	2018年10月10日	4
纽元 64,978,028	美元 43,174,683	2018年10月10日	94,251
纽元 702,687	美元 471,357	2018年10月10日	5,475
纽元 366,392	美元 245,507	2018年10月10日	2,589
纽元 190,861	美元 128,123	2018年10月10日	1,583
纽元 225,150	美元 150,785	2018年10月10日	1,511
纽元 108,049	美元 72,267	2018年10月10日	631
纽元 113,318	美元 75,415	2018年10月10日	285
纽元 10,377	美元 6,966	2018年10月10日	86
纽元 6,014	美元 4,030	2018年10月10日	42
纽元 4,970	美元 3,324	2018年10月10日	29
纽元 1,648	美元 1,104	2018年10月10日	11
纽元 1,648	美元 1,104	2018年10月10日	11
纽元 3,482	美元 2,318	2018年10月10日	10
纽元 30,233	美元 20,053	2018年10月10日	9
纽元 1,642	美元 1,094	2018年10月10日	5
纽元 1,642	美元 1,093	2018年10月10日	4
新加坡元 16,851,967	美元 12,339,246	2018年10月10日	3,423
新加坡元 91,283	美元 66,919	2018年10月10日	99

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 64,356,641	英镑 49,797,007	2018年10月10日	603,346
美元 79,043,884	加元 102,224,214	2018年10月10日	52,529
美元 1,431,506	纽元 2,187,078	2018年10月10日	18,525
美元 1,881,565	澳元 2,616,843	2018年10月10日	11,982
美元 1,048,971	澳元 1,461,557	2018年10月10日	8,611
美元 583,822	加元 762,900	2018年10月10日	6,475
美元 833,086	英镑 643,327	2018年10月10日	6,132
美元 370,136	澳元 519,868	2018年10月10日	6,040
美元 803,653	加元 1,045,895	2018年10月10日	5,612
美元 419,352	英镑 324,985	2018年10月10日	4,589
美元 485,752	澳元 676,460	2018年10月10日	3,733
美元 472,075	纽元 716,887	2018年10月10日	3,221
美元 457,756	加元 595,715	2018年10月10日	3,180
美元 467,344	澳元 650,164	2018年10月10日	3,114
美元 389,638	加元 507,286	2018年10月10日	2,877
美元 266,148	纽元 405,324	2018年10月10日	2,582
美元 321,659	英镑 248,455	2018年10月10日	2,450
美元 162,418	澳元 227,567	2018年10月10日	2,250
美元 241,224	澳元 335,944	2018年10月10日	1,865
美元 615,845	离岸人民币 4,245,754	2018年10月10日	1,639
美元 171,003	加元 222,797	2018年10月10日	1,386
美元 393,182	纽元 594,874	2018年10月10日	1,220
美元 68,220	加元 89,738	2018年10月10日	1,216
美元 147,977	澳元 206,066	2018年10月10日	1,133
美元 168,813	澳元 234,769	2018年10月10日	1,066
美元 525,107	澳元 726,871	2018年10月10日	856
美元 52,105	纽元 79,424	2018年10月10日	553
美元 139,107	澳元 193,004	2018年10月10日	551
美元 133,335	新加坡元 182,819	2018年10月10日	491
美元 55,809	加元 72,750	2018年10月10日	482
美元 1,510,353	离岸人民币 10,388,216	2018年10月10日	462
美元 42,241	纽元 64,395	2018年10月10日	453
美元 144,994	离岸人民币 1,000,000	2018年10月10日	441
美元 30,150	纽元 46,000	2018年10月10日	348
美元 46,075	纽元 70,000	2018年10月10日	335
美元 309,361	英镑 237,390	2018年10月10日	314
美元 75,410	新加坡元 103,394	2018年10月10日	275
美元 49,371	英镑 38,052	2018年10月10日	268
美元 117,671	加元 152,399	2018年10月10日	248
美元 88,677	澳元 122,843	2018年10月10日	212
美元 49,141	纽元 74,436	2018年10月10日	210
美元 12,849	英镑 10,000	2018年10月10日	196
美元 18,341	加元 23,898	2018年10月10日	150
美元 333,626	英镑 255,859	2018年10月10日	142
美元 7,096	澳元 10,000	2018年10月10日	140
美元 9,287	纽元 14,205	2018年10月10日	131
美元 5,550	加元 7,310	2018年10月10日	106
美元 125,752	欧元 108,294	2018年10月10日	106
美元 4,836	澳元 6,814	2018年10月10日	95
美元 19,149	澳元 26,570	2018年10月10日	77
美元 6,520	英镑 5,053	2018年10月10日	71
美元 4,297	加元 5,645	2018年10月10日	70
美元 5,241	纽元 8,007	2018年10月10日	68
美元 7,683	加元 10,000	2018年10月10日	55
美元 33,711	英镑 25,882	2018年10月10日	52
美元 2,307	加元 3,043	2018年10月10日	47
美元 3,395	澳元 4,752	2018年10月10日	44
美元 5,437	澳元 7,570	2018年10月10日	41
美元 69,508	离岸人民币 478,187	2018年10月10日	38
美元 3,876	新加坡元 5,343	2018年10月10日	35
美元 12,932	澳元 17,915	2018年10月10日	31
美元 7,135	澳元 9,900	2018年10月10日	29
美元 193,412	加元 250,000	2018年10月10日	27

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 2,314	加元 3,009	2018年10月10日	14
美元 2,204	英镑 1,700	2018年10月10日	14
美元 4,293	离岸人民币 29,605	2018年10月10日	13
美元 1,536	加元 2,000	2018年10月10日	12
美元 6,066	澳元 8,397	2018年10月10日	10
美元 2,043	纽元 3,095	2018年10月10日	9
美元 958	英镑 741	2018年10月10日	8
美元 29,272	新加坡元 40,000	2018年10月10日	8
美元 1,682	澳元 2,334	2018年10月10日	7
美元 6,518	英镑 5,000	2018年10月10日	4
美元 3,029	离岸人民币 20,837	2018年10月10日	2
美元 3,877	离岸人民币 26,668	2018年10月10日	1
澳元 1,599,776	美元 1,162,688	2018年11月13日	4,770
澳元 879,415	美元 639,791	2018年11月13日	3,271
澳元 460,102	美元 335,396	2018年11月13日	2,373
澳元 811,652	美元 589,315	2018年11月13日	1,842
澳元 1,580,513	美元 1,145,632	2018年11月13日	1,657
澳元 6,388	美元 4,643	2018年11月13日	19
澳元 3,755	美元 2,732	2018年11月13日	14
澳元 1,514	美元 1,104	2018年11月13日	8
加元 487,696	美元 377,945	2018年11月13日	296
加元 1,426	美元 1,106	2018年11月13日	2
加元 1,426	美元 1,106	2018年11月13日	2
离岸人民币 6,400,707	美元 932,906	2018年11月13日	4,002
离岸人民币 2,773,090	美元 404,262	2018年11月13日	1,816
离岸人民币 2,925,965	美元 425,883	2018年11月13日	1,251
离岸人民币 10,719,382	美元 1,556,092	2018年11月13日	439
离岸人民币 2,220,471	美元 322,641	2018年11月13日	394
离岸人民币 2,107,378	美元 306,093	2018年11月13日	260
离岸人民币 65,958	美元 9,584	2018年11月13日	12
离岸人民币 128,966	美元 18,721	2018年11月13日	5
离岸人民币 7,538	美元 1,099	2018年11月13日	5
离岸人民币 7,538	美元 1,099	2018年11月13日	5
离岸人民币 7,538	美元 1,099	2018年11月13日	5
欧元 300,217	美元 353,980	2018年11月13日	4,078
欧元 139,378	美元 164,078	2018年11月13日	1,632
欧元 45,787	美元 54,066	2018年11月13日	701
欧元 49,673	美元 58,199	2018年11月13日	305
欧元 1,852	美元 2,185	2018年11月13日	26
欧元 935	美元 1,107	2018年11月13日	17
欧元 933	美元 1,094	2018年11月13日	6
英镑 381,502	美元 502,879	2018年11月13日	4,408
英镑 67,381	美元 89,497	2018年11月13日	1,457
英镑 183,513	美元 240,905	2018年11月13日	1,128
英镑 86,127	美元 113,188	2018年11月13日	655
英镑 27,094	美元 35,797	2018年11月13日	396
英镑 10,907	美元 14,363	2018年11月13日	113
英镑 2,467	美元 3,249	2018年11月13日	25
英镑 836	美元 1,111	2018年11月13日	18
英镑 836	美元 1,098	2018年11月13日	6
英镑 836	美元 1,098	2018年11月13日	5
纽元 656,008	美元 436,873	2018年11月13日	1,874
纽元 203,969	美元 136,376	2018年11月13日	1,124
纽元 429,465	美元 285,348	2018年11月13日	570
纽元 54,458	美元 36,325	2018年11月13日	214
纽元 62,990	美元 41,899	2018年11月13日	130
纽元 1,663	美元 1,112	2018年11月13日	9
纽元 2,828	美元 1,883	2018年11月13日	8
纽元 1,663	美元 1,109	2018年11月13日	7
纽元 1,660	美元 1,101	2018年11月13日	0
新加坡元 244,836	美元 179,502	2018年11月13日	148
新加坡元 118,529	美元 86,864	2018年11月13日	36
新加坡元 3,343	美元 2,453	2018年11月13日	4
美元 73,650,974	加元 95,355,327	2018年11月13日	187,575

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 280,607,429	离岸人民币 1,933,654,572	2018 年 11 月 13 日	14,693
美元 2,614,152	离岸人民币 18,019,601	2018 年 11 月 13 日	949
美元 2,313,122	离岸人民币 15,942,732	2018 年 11 月 13 日	572
美元 1,134,048	加元 1,465,009	2018 年 11 月 13 日	387
美元 3,203,584	离岸人民币 22,075,771	2018 年 11 月 13 日	168
美元 155,761	离岸人民币 1,073,683	2018 年 11 月 13 日	58
美元 4,212	加元 5,458	2018 年 11 月 13 日	14
美元 36,129	离岸人民币 249,044	2018 年 11 月 13 日	13
美元 7,919	离岸人民币 54,589	2018 年 11 月 13 日	3
		未实现总收益	2,208,647
美元 1,090	欧元 933	2018 年 10 月 2 日	(6)
美元 1,096	英镑 836	2018 年 10 月 2 日	(6)
美元 41,892	欧元 62,990	2018 年 10 月 2 日	(130)
美元 35,730	英镑 27,094	2018 年 10 月 2 日	(400)
美元 589,176	澳元 811,652	2018 年 10 月 2 日	(1,865)
美元 352,822	欧元 300,217	2018 年 10 月 2 日	(4,122)
美元 58,012	欧元 49,673	2018 年 10 月 3 日	(312)
美元 112,983	英镑 86,127	2018 年 10 月 3 日	(665)
美元 1,101	欧元 1,660	2018 年 10 月 3 日	(0)
离岸人民币 15,942,732	美元 2,316,658	2018 年 10 月 9 日	(2,150)
澳元 1,524	美元 1,094	2018 年 10 月 10 日	(8)
澳元 1,531	美元 1,099	2018 年 10 月 10 日	(8)
澳元 1,532	美元 1,100	2018 年 10 月 10 日	(8)
澳元 3,012	美元 2,171	2018 年 10 月 10 日	(9)
澳元 2,549	美元 1,833	2018 年 10 月 10 日	(11)
澳元 4,410	美元 3,179	2018 年 10 月 10 日	(12)
澳元 1,526	美元 1,090	2018 年 10 月 10 日	(14)
澳元 2,891	美元 2,078	2018 年 10 月 10 日	(14)
澳元 9,162	美元 6,614	2018 年 10 月 10 日	(15)
澳元 1,550	美元 1,107	2018 年 10 月 10 日	(15)
澳元 11,974	美元 8,599	2018 年 10 月 10 日	(65)
澳元 15,783	美元 11,334	2018 年 10 月 10 日	(87)
澳元 7,729	美元 5,486	2018 年 10 月 10 日	(107)
澳元 33,860	美元 24,338	2018 年 10 月 10 日	(164)
澳元 30,584	美元 21,964	2018 年 10 月 10 日	(167)
澳元 463,605	美元 334,163	2018 年 10 月 10 日	(1,302)
澳元 1,721,975	美元 1,244,053	2018 年 10 月 10 日	(1,968)
澳元 360,633	美元 258,959	2018 年 10 月 10 日	(1,995)
澳元 1,192,745	美元 861,056	2018 年 10 月 10 日	(2,014)
澳元 662,020	美元 476,056	2018 年 10 月 10 日	(2,983)
澳元 1,097,627	美元 791,104	2018 年 10 月 10 日	(3,139)
澳元 1,645,359	美元 1,185,184	2018 年 10 月 10 日	(5,398)
澳元 466,057	美元 330,739	2018 年 10 月 10 日	(6,500)
澳元 1,446,154	美元 1,038,544	2018 年 10 月 10 日	(7,893)
澳元 2,472,100	美元 1,780,795	2018 年 10 月 10 日	(8,017)
澳元 3,479,267	美元 2,507,995	2018 年 10 月 10 日	(9,602)
澳元 1,162,532	美元 830,633	2018 年 10 月 10 日	(10,574)
澳元 1,038,942	美元 739,740	2018 年 10 月 10 日	(12,038)
澳元 1,448,313	美元 1,033,780	2018 年 10 月 10 日	(14,219)
澳元 2,861,552	美元 2,055,060	2018 年 10 月 10 日	(15,558)
澳元 1,703,532	美元 1,213,238	2018 年 10 月 10 日	(19,438)
澳元 1,521,367	美元 1,080,341	2018 年 10 月 10 日	(20,520)
加元 1,420	美元 1,098	2018 年 10 月 10 日	(1)
加元 1,425	美元 1,099	2018 年 10 月 10 日	(3)
加元 1,429	美元 1,103	2018 年 10 月 10 日	(3)
加元 1,433	美元 1,100	2018 年 10 月 10 日	(9)
加元 1,433	美元 1,100	2018 年 10 月 10 日	(9)
加元 1,434	美元 1,101	2018 年 10 月 10 日	(9)



交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
加元 10,776	美元 8,329	2018年10月10日	(9)
加元 141,051	美元 109,129	2018年10月10日	(10)
加元 2,478	美元 1,903	2018年10月10日	(14)
加元 3,692	美元 2,834	2018年10月10日	(23)
加元 23,238	美元 17,942	2018年10月10日	(38)
加元 9,669	美元 7,425	2018年10月10日	(56)
加元 7,549	美元 5,731	2018年10月10日	(110)
加元 36,176	美元 27,773	2018年10月10日	(218)
加元 99,806	美元 76,642	2018年10月10日	(583)
加元 59,194	美元 45,018	2018年10月10日	(784)
加元 375,327	美元 289,621	2018年10月10日	(790)
加元 51,364	美元 38,949	2018年10月10日	(795)
加元 208,027	美元 159,979	2018年10月10日	(983)
加元 390,284	美元 300,582	2018年10月10日	(1,402)
加元 302,084	美元 232,104	2018年10月10日	(1,635)
加元 378,666	美元 291,207	2018年10月10日	(1,788)
加元 457,715	美元 351,316	2018年10月10日	(2,842)
加元 653,690	美元 502,901	2018年10月10日	(2,895)
加元 207,137	美元 157,192	2018年10月10日	(3,081)
加元 513,867	美元 393,349	2018年10月10日	(4,257)
加元 363,155	美元 276,492	2018年10月10日	(4,501)
加元 751,229	美元 576,324	2018年10月10日	(4,942)
加元 819,256	美元 628,823	2018年10月10日	(5,079)
加元 605,925	美元 460,741	2018年10月10日	(8,096)
加元 684,172	美元 520,133	2018年10月10日	(9,248)
加元 1,162,177	美元 889,448	2018年10月10日	(9,791)
加元 877,690	美元 667,267	2018年10月10日	(11,850)
加元 1,123,857	美元 853,143	2018年10月10日	(16,446)
加元 1,394,492	美元 1,057,434	2018年10月10日	(21,560)
加元 95,355,327	美元 73,603,618	2018年10月10日	(177,972)
离岸人民币 7,532	美元 1,095	2018年10月10日	(0)
离岸人民币 7,942	美元 1,155	2018年10月10日	(0)
离岸人民币 9,901	美元 1,439	2018年10月10日	(1)
离岸人民币 8,936	美元 1,296	2018年10月10日	(3)
离岸人民币 160,787	美元 23,377	2018年10月10日	(8)
离岸人民币 26,620	美元 3,861	2018年10月10日	(10)
离岸人民币 249,044	美元 36,187	2018年10月10日	(32)
离岸人民币 102,419	美元 14,851	2018年10月10日	(45)
离岸人民币 129,149	美元 18,734	2018年10月10日	(49)
离岸人民币 2,075,562	美元 301,692	2018年10月10日	(169)
离岸人民币 4,914,450	美元 714,470	2018年10月10日	(265)
离岸人民币 13,637,841	美元 1,982,780	2018年10月10日	(647)
离岸人民币 5,157,088	美元 747,800	2018年10月10日	(2,224)
离岸人民币 18,019,601	美元 2,618,344	2018年10月10日	(2,346)
离岸人民币 22,075,771	美元 3,207,960	2018年10月10日	(2,641)
离岸人民币 12,008,418	美元 1,741,904	2018年10月10日	(4,546)
离岸人民币 14,954,433	美元 2,169,313	2018年10月10日	(5,593)
离岸人民币 1,933,654,572	美元 280,990,731	2018年10月10日	(231,302)
欧元 948	美元 1,100	2018年10月10日	(1)
欧元 4,438	美元 5,152	2018年10月10日	(6)
欧元 18,399	美元 21,365	2018年10月10日	(17)
欧元 95,220	美元 110,526	2018年10月10日	(140)
欧元 146,993	美元 170,284	2018年10月10日	(552)
英镑 849	美元 1,107	2018年10月10日	(1)
英镑 847	美元 1,103	2018年10月10日	(2)
英镑 857	美元 1,112	2018年10月10日	(6)
英镑 849	美元 1,101	2018年10月10日	(7)
英镑 2,427	美元 3,158	2018年10月10日	(7)
英镑 973	美元 1,259	2018年10月10日	(11)
英镑 1,346	美元 1,741	2018年10月10日	(15)
英镑 2,800	美元 3,632	2018年10月10日	(20)
英镑 32,148	美元 41,912	2018年10月10日	(25)
英镑 11,211	美元 14,591	2018年10月10日	(33)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
英镑 2,514	美元 3,231	2018年10月10日	(49)
英镑 28,122	美元 36,602	2018年10月10日	(84)
英镑 256,623	美元 334,482	2018年10月10日	(283)
英镑 339,429	美元 442,466	2018年10月10日	(319)
英镑 183,069	美元 238,459	2018年10月10日	(354)
英镑 30,731	美元 39,661	2018年10月10日	(428)
英镑 297,780	美元 387,799	2018年10月10日	(655)
英镑 84,108	美元 109,028	2018年10月10日	(691)
英镑 75,017	美元 96,802	2018年10月10日	(1,058)
英镑 70,789	美元 91,019	2018年10月10日	(1,326)
英镑 519,935	美元 676,426	2018年10月10日	(1,829)
英镑 690,914	美元 895,835	2018年10月10日	(5,463)
英镑 489,966	美元 630,952	2018年10月10日	(8,208)
英镑 521,050	美元 669,409	2018年10月10日	(10,301)
纽元 1,671	美元 1,103	2018年10月10日	(5)
纽元 3,178	美元 2,101	2018年10月10日	(6)
纽元 1,754	美元 1,155	2018年10月10日	(8)
纽元 1,676	美元 1,104	2018年10月10日	(8)
纽元 1,677	美元 1,100	2018年10月10日	(11)
纽元 1,678	美元 1,097	2018年10月10日	(15)
纽元 2,477	美元 1,624	2018年10月10日	(19)
纽元 4,950	美元 3,240	2018年10月10日	(42)
纽元 8,376	美元 5,496	2018年10月10日	(57)
纽元 15,547	美元 10,117	2018年10月10日	(191)
纽元 167,981	美元 111,125	2018年10月10日	(247)
纽元 101,674	美元 67,122	2018年10月10日	(287)
纽元 105,001	美元 68,729	2018年10月10日	(887)
纽元 120,059	美元 78,691	2018年10月10日	(908)
纽元 209,936	美元 138,186	2018年10月10日	(1,001)
纽元 109,915	美元 71,868	2018年10月10日	(1,006)
纽元 546,439	美元 360,994	2018年10月10日	(1,295)
纽元 453,138	美元 298,607	2018年10月10日	(1,823)
纽元 233,316	美元 152,589	2018年10月10日	(2,099)
纽元 963,186	美元 636,121	2018年10月10日	(2,472)
纽元 1,272,735	美元 841,257	2018年10月10日	(2,566)
纽元 468,385	美元 306,411	2018年10月10日	(4,128)
纽元 420,012	美元 273,649	2018年10月10日	(4,819)
纽元 768,885	美元 504,453	2018年10月10日	(5,318)
纽元 780,728	美元 511,154	2018年10月10日	(6,469)
新加坡元 1,502	美元 1,096	2018年10月10日	(3)
新加坡元 28,757	美元 20,978	2018年10月10日	(72)
新加坡元 18,385	美元 13,385	2018年10月10日	(73)
新加坡元 115,061	美元 83,995	2018年10月10日	(231)
新加坡元 167,800	美元 122,371	2018年10月10日	(461)
新加坡元 104,542	美元 75,938	2018年10月10日	(588)
新加坡元 118,739	美元 86,153	2018年10月10日	(765)
新加坡元 238,539	美元 173,627	2018年10月10日	(986)
新加坡元 189,986	美元 138,055	2018年10月10日	(1,017)
美元 1,094	离岸人民币 7,523	2018年10月10日	(0)
美元 2,339	欧元 2,012	2018年10月10日	(1)
美元 197	英镑 150	2018年10月10日	(1)
美元 1,420	离岸人民币 9,737	2018年10月10日	(4)
美元 35,130	离岸人民币 241,521	2018年10月10日	(4)
美元 1,810	离岸人民币 12,397	2018年10月10日	(7)
美元 39,112	离岸人民币 268,887	2018年10月10日	(7)
美元 1,748	纽元 2,626	2018年10月10日	(8)
美元 5,229	离岸人民币 35,901	2018年10月10日	(8)
美元 3,665	离岸人民币 25,136	2018年10月10日	(9)
美元 4,019	离岸人民币 27,495	2018年10月10日	(20)
美元 2,162	离岸人民币 14,692	2018年10月10日	(26)
美元 33,565	离岸人民币 230,609	2018年10月10日	(26)
美元 19,986	离岸人民币 137,142	2018年10月10日	(41)
美元 73,295	新加坡元 100,064	2018年10月10日	(46)
美元 139,265	纽元 209,962	2018年10月10日	(60)
美元 62,535	新加坡元 85,342	2018年10月10日	(64)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／ (亏损) 美元
美元 16,320	离岸人民币 111,683	2018年10月10日	(77)
美元 8,601	离岸人民币 58,530	2018年10月10日	(89)
美元 19,942	离岸人民币 136,504	2018年10月10日	(90)
美元 22,440	离岸人民币 153,617	2018年10月10日	(99)
美元 107,293	离岸人民币 736,606	2018年10月10日	(164)
美元 50,266	纽元 75,532	2018年10月10日	(188)
美元 80,524	离岸人民币 552,320	2018年10月10日	(197)
美元 91,223	欧元 78,285	2018年10月10日	(241)
美元 46,837	欧元 40,000	2018年10月10日	(349)
美元 3,085,031	离岸人民币 21,209,809	2018年10月10日	(372)
美元 41,990	离岸人民币 285,207	2018年10月10日	(511)
美元 111,418	欧元 95,351	2018年10月10日	(600)
美元 159,663	新加坡元 217,265	2018年10月10日	(623)
美元 70,051	纽元 104,543	2018年10月10日	(739)
美元 49,246	澳元 66,978	2018年10月10日	(781)
美元 122,755	澳元 168,530	2018年10月10日	(807)
美元 244,266	离岸人民币 1,673,352	2018年10月10日	(902)
美元 105,040	英镑 79,802	2018年10月10日	(938)
美元 96,382	纽元 143,932	2018年10月10日	(955)
美元 188,567	澳元 259,131	2018年10月10日	(1,060)
美元 148,926	离岸人民币 1,016,125	2018年10月10日	(1,146)
美元 234,678	离岸人民币 1,605,513	2018年10月10日	(1,180)
美元 334,203	纽元 502,000	2018年10月10日	(1,377)
美元 197,320	欧元 168,517	2018年10月10日	(1,469)
美元 376,322	英镑 287,232	2018年10月10日	(1,626)
美元 400,384	离岸人民币 2,741,543	2018年10月10日	(1,666)
美元 223,668	澳元 306,765	2018年10月10日	(1,692)
美元 559,388	离岸人民币 3,833,008	2018年10月10日	(1,933)
美元 387,903	离岸人民币 2,651,896	2018年10月10日	(2,223)
美元 219,723	纽元 327,634	2018年10月10日	(2,502)
美元 206,887	澳元 282,246	2018年10月10日	(2,654)
美元 237,742	欧元 202,235	2018年10月10日	(2,703)
美元 1,074,581	加元 1,385,092	2018年10月10日	(2,860)
美元 231,016	离岸人民币 1,568,390	2018年10月10日	(2,916)
美元 329,851	离岸人民币 2,244,540	2018年10月10日	(3,416)
美元 283,645	纽元 422,548	2018年10月10日	(3,496)
美元 1,752,339	离岸人民币 12,024,119	2018年10月10日	(3,605)
美元 679,559	英镑 516,373	2018年10月10日	(5,948)
美元 1,462,927	离岸人民币 10,011,238	2018年10月10日	(6,938)
美元 782,270	纽元 1,168,147	2018年10月10日	(7,788)
美元 1,528,121	离岸人民币 10,446,996	2018年10月10日	(8,758)
美元 760,216	离岸人民币 5,165,696	2018年10月10日	(8,941)
美元 1,128,684	澳元 1,546,622	2018年10月10日	(9,548)
美元 809,795	澳元 1,102,135	2018年10月10日	(12,289)
美元 894,113	澳元 1,215,403	2018年10月10日	(14,646)
美元 1,393,031	澳元 1,896,020	2018年10月10日	(21,069)
美元 12,620,320	新加坡元 17,192,333	2018年10月10日	(35,339)
美元 3,318,182	离岸人民币 22,563,240	2018年10月10日	(36,689)
美元 2,340,182	澳元 3,180,472	2018年10月10日	(38,790)
美元 3,706,094	离岸人民币 25,172,740	2018年10月10日	(45,087)
美元 18,637,596	欧元 15,883,399	2018年10月10日	(177,803)
美元 44,462,105	纽元 66,289,867	2018年10月10日	(511,885)
美元 181,798,526	澳元 247,349,981	2018年10月10日	(2,815,885)
美元 297,459,730	离岸人民币 2,022,690,471	2018年10月10日	(3,288,956)
澳元 2,590	美元 1,871	2018年11月13日	(4)
澳元 521,219	美元 377,219	2018年11月13日	(39)
澳元 295,004	美元 213,039	2018年11月13日	(485)
加元 6.678	美元 5,170	2018年11月13日	(1)
加元 312,553	美元 242,017	2018年11月13日	(10)
加元 2,023	美元 1,550	2018年11月13日	(17)
加元 874,332	美元 676,850	2018年11月13日	(192)
加元 679,082	美元 524,292	2018年11月13日	(1,557)
加元 966,149	美元 745,702	2018年11月13日	(2,438)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
加元 340,689	美元 260,988	2018 年 11 月 13 日	(2,826)
离岸人民币 7,570	美元 1,098	2018 年 11 月 13 日	(0)
离岸人民币 146,909	美元 21,316	2018 年 11 月 13 日	(4)
离岸人民币 8,524,706	美元 1,237,021	2018 年 11 月 13 日	(129)
离岸人民币 12,166,982	美元 1,765,432	2018 年 11 月 13 日	(304)
离岸人民币 12,701,769	美元 1,842,989	2018 年 11 月 13 日	(358)
离岸人民币 10,955,153	美元 1,589,286	2018 年 11 月 13 日	(583)
英镑 469,162	美元 612,929	2018 年 11 月 13 日	(78)
纽元 1,654	美元 1,096	2018 年 11 月 13 日	(0)
纽元 91,281	美元 60,514	2018 年 11 月 13 日	(15)
美元 2,106	纽元 3,175	2018 年 11 月 13 日	(0)
美元 13,004	纽元 19,608	2018 年 11 月 13 日	(2)
美元 3,434	离岸人民币 23,640	2018 年 11 月 13 日	(3)
美元 12,600	加元 16,260	2018 年 11 月 13 日	(9)
美元 3,189	纽元 4,794	2018 年 11 月 13 日	(10)
美元 7,367	澳元 10,147	2018 年 11 月 13 日	(23)
美元 51,222	离岸人民币 352,759	2018 年 11 月 13 日	(28)
美元 24,012	加元 30,963	2018 年 11 月 13 日	(36)
美元 7,520	纽元 11,274	2018 年 11 月 13 日	(44)
美元 19,607	离岸人民币 134,709	2018 年 11 月 13 日	(59)
美元 7,001	欧元 5,936	2018 年 11 月 13 日	(83)
美元 22,920	离岸人民币 157,268	2018 年 11 月 13 日	(97)
美元 147,467	新加坡元 201,145	2018 年 11 月 13 日	(119)
美元 190,047	新加坡元 259,168	2018 年 11 月 13 日	(194)
美元 38,837	离岸人民币 266,155	2018 年 11 月 13 日	(211)
美元 102,643	离岸人民币 705,193	2018 年 11 月 13 日	(302)
美元 104,265	澳元 143,609	2018 年 11 月 13 日	(320)
美元 42,640	纽元 63,786	2018 年 11 月 13 日	(343)
美元 22,719	英镑 17,106	2018 年 11 月 13 日	(368)
美元 153,710	离岸人民币 1,054,396	2018 年 11 月 13 日	(692)
美元 154,344	澳元 212,165	2018 年 11 月 13 日	(778)
美元 134,925	英镑 102,128	2018 年 11 月 13 日	(1,482)
美元 12,346,831	新加坡元 16,851,967	2018 年 11 月 13 日	(1,970)
美元 879,611	加元 1,133,260	2018 年 11 月 13 日	(2,065)
美元 4,362,588	离岸人民币 30,044,596	2018 年 11 月 13 日	(2,364)
美元 219,877	欧元 186,122	2018 年 11 月 13 日	(2,942)
美元 662,142	纽元 993,606	2018 年 11 月 13 日	(3,281)
美元 273,793	欧元 232,046	2018 年 11 月 13 日	(3,332)
美元 526,009	纽元 787,894	2018 年 11 月 13 日	(3,556)
美元 950,371	英镑 721,458	2018 年 11 月 13 日	(7,699)
美元 2,637,299	澳元 3,630,893	2018 年 11 月 13 日	(9,256)
美元 2,078,245	澳元 2,852,718	2018 年 11 月 13 日	(13,443)
美元 751,935	英镑 564,748	2018 年 11 月 13 日	(14,008)
美元 3,398,367	离岸人民币 23,289,681	2018 年 11 月 13 日	(18,487)
美元 43,179,966	纽元 64,978,028	2018 年 11 月 13 日	(93,014)
美元 170,422,955	澳元 235,223,177	2018 年 11 月 13 日	(168,362)
美元 18,029,050	欧元 15,272,883	2018 年 11 月 13 日	(227,721)
美元 63,367,859	英镑 48,102,640	2018 年 11 月 13 日	(515,941)
		未实现总亏损	(8,963,626)
		未实现净亏损	(6,754,979)

### 13 其他收入

本年度本基金未收到管理人因估值和/或其他操作错误而支付的赔偿（二零一八年：644 美元）。

# 摩根亚洲股息基金

## 独立核数师报告

致摩根亚洲股息基金（“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

摩根亚洲股息基金列载于第三页至第四十一页的财务报表，包括：

- 于二零一九年九月三十日的财务状况表；
- 截至该日止年度的综合收益表；
- 截至该日止年度的可赎回份额持有人应占净资产变动表；
- 截至该日止年度的现金流量表；及
- 财务报表附注，包括主要会计政策概要。

#### 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二零一九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“核数师就审计报告承担的责任”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二零一一年五月六日订立的信托契约（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。

### 核数师就审计报告承担的责任

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导致的重大错误陈述获取合理保证，并出具包含我们意见的核数师报告。我们仅向阁下（作为整体）报告我们的意见，除此之外本报告别无其他目的。我们不会就本报告的内容向任何其他人士负上或承担任何责任。合理保证是高水平的保证，但不能保证按照《香港审计准则》进行的审计，在某一重大错误陈述存在时总能发现。错误陈述可以由欺诈或错误引起，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，以及获取充足及适当的审计凭证，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）

致摩根亚洲股息基金（“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。
- 评价财务报表的总体列报、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  
 二零二零年一月二十二日

**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
- 按持续运营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二零一九年九月三十日止财政年度在各个重要方面均依照二零一一年五月六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  
二零二零年一月二十二日

业绩记录 - 未经审计

资产净值

财务期结算日	本基金资产净值	每份额资产净值
30/9/19		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 193,608,672	澳元 8.82
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 80,850,394	加元 8.99
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 12,102,153	欧元 9.25
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 37,565,455	英镑 9.20
- 港元类别 (累计)	港元 16,439,998	港元 12.61
- 港元类别 (每月派息)	港元 1,766,391,160	港元 9.35
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 46,786,352	纽元 8.92
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 17,917,356	人民币 14.39
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 1,610,018,603	人民币 9.60
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 7,743,081	新加坡元 9.02
- 美元类别 (累计)	美元 3,538,027	美元 12.54
- 美元类别 (每月派息)	美元 393,250,535	美元 9.26
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 85,817,827	美元 9.55
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 49,939,511	人民币 10.20
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 36,880,292	人民币 9.92
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 277,120,157	人民币 9.55
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 293,273,002	人民币 9.28
- PRC 美元份额 (累计)	美元 39,293,862	美元 9.58
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 29,055,297	美元 9.32
30/9/18		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 236,489,568	澳元 9.43
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 94,664,021	加元 9.58
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 15,276,700	欧元 9.83
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 48,524,037	英镑 9.80
- 港元类别 (累计)	港元 16,478,379	港元 12.75
- 港元类别 (每月派息)	港元 2,397,665,622	港元 9.90
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 65,500,294	纽元 9.53
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 22,929,067	人民币 14.57
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 1,949,899,852	人民币 10.23
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 17,001,971	新加坡元 9.62
- 美元类别 (累计)	美元 4,541,186	美元 12.70
- 美元类别 (每月派息)	美元 577,217,695	美元 9.83
30/9/17		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 259,499,760	澳元 9.57
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 97,613,361	加元 9.71
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 18,159,564	欧元 9.95
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 63,339,050	英镑 9.92
- 港元类别 (累计)	港元 10,787,381	港元 12.30
- 港元类别 (每月派息)	港元 2,795,839,385	港元 9.98
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 83,401,013	纽元 9.67
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 38,144,622	人民币 13.86
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 2,005,664,263	人民币 10.35
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 12,477,623	新加坡元 9.75
- 美元类别 (累计)	美元 44,675,415	美元 12.22
- 美元类别 (每月派息)	美元 566,995,843	美元 9.93



业绩记录 - 未经审计 (续)

(续)

最高卖出价/最低买入价

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价	财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
30/9/19			30/9/15		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.77	澳元 8.53	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 11.36	澳元 8.56
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.95	加元 8.69	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 11.45	加元 8.63
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.20	欧元 8.88	- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.48	欧元 8.72
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.17	英镑 8.88	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 11.48	英镑 8.70
- 港元类别 (累计)	港元 13.61	港元 11.60	- 港元类别 (累计)	港元 12.54	港元 9.68
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.33	港元 9.00	- 港元类别 (每月派息)	港元 11.45	港元 8.67
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.88	纽元 8.63	- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 11.43	纽元 8.60
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 15.53	人民币 13.24	- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 13.35	人民币 10.00
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.62	人民币 9.29	- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 12.29	人民币 9.23
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.98	新加坡元 8.72	- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 11.41	新加坡元 8.61
- 美元类别 (累计)	美元 13.52	美元 11.53	- 美元类别 (累计)	美元 12.56	美元 9.69
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.22	美元 8.92	- 美元类别 (每月派息)	美元 11.47	美元 8.69
- 美元 C 类别 (每月派息)	美元 10.00	美元 9.29			
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 10.55	人民币 9.75	30/9/14		
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 10.39	人民币 9.57	- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 11.02	澳元 9.02
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 10.32	人民币 9.21	- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 11.08	加元 9.05
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.28	人民币 9.04	- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.10	欧元 9.05
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.33	美元 9.26	- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 11.10	英镑 9.06
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.29	美元 9.08	- 港元类别 (累计)	港元 11.79	港元 9.35
			- 港元类别 (每月派息)	港元 11.08	港元 9.06
			- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 11.07	纽元 9.06
			- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.29	人民币 9.92
			- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 11.91	人民币 9.92
			- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 11.08	新加坡元 9.06
			- 美元类别 (累计)	美元 11.81	美元 9.35
			- 美元类别 (每月派息)	美元 11.10	美元 9.06
30/9/18					
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.73	澳元 9.08			
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.90	加元 9.23			
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 11.15	欧元 9.46			
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 11.11	英镑 9.44			
- 港元类别 (累计)	港元 13.96	港元 12.27			
- 港元类别 (每月派息)	港元 11.22	港元 9.57			
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.84	纽元 9.18			
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 15.82	人民币 13.95			
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 11.62	人民币 9.86			
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.94	新加坡元 9.26			
- 美元类别 (累计)	美元 13.87	美元 12.19			
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.15	美元 9.47			
30/9/17					
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.86	澳元 8.64			
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.99	加元 8.76			
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.23	欧元 8.96			
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.20	英镑 8.93			
- 港元类别 (累计)	港元 12.53	港元 10.56			
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.28	港元 8.93			
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.97	纽元 8.74			
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 14.09	人民币 11.61			
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.68	人民币 9.32			
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 10.04	新加坡元 8.78			
- 美元类别 (累计)	美元 12.46	美元 10.57			
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.23	美元 8.94			
30/9/16					
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.79	澳元 7.71			
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.93	加元 7.77			
- 欧元对冲类别 (每月派息)	欧元 10.15	欧元 7.91			
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.14	英镑 7.85			
- 港元类别 (累计)	港元 11.81	港元 9.01			
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.10	港元 7.94			
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.90	纽元 7.75			
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.94	人民币 9.65			
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.62	人民币 8.32			
- 新加坡元对冲类别 (每月派息)	新加坡元 9.96	新加坡元 7.79			
- 美元类别 (累计)	美元 11.82	美元 8.94			
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.12	美元 7.88			
			30/9/12 (自成立起)		
			- 港元类别	港元 11.10	港元 8.83
			- 美元类别	美元 11.12	美元 8.82

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  
（前称 JF 资产管理有限公司）  
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**

于二零二零年一月二十二日  
Daniel James WATKINS  
Desiree Qionghui WANG  
Edwin Tsun Kay CHAN  
Ioan William ROBERTS  
Kheng Leong CHEAH

**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 484  
HSBC House  
68 West Bay Road  
Grand Cayman KY1-1106  
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

