

年度报告 – 2019年9月30日（经审核）

摩根国际债券基金

内地与香港互认基金系列



中国内地代理人:

上投摩根
基金 管理

基金管理人:

摩根
资产 管理

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

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

内容	页
投资组合 - 未经审计	1 - 7
投资组合持有变动表 - 未经审计	7 - 8
财务状况表	9
综合收益表	9
可赎回份额持有人应占净资产变动表	10
现金流量表	10
财务报表之附注	11 - 45
独立核数师报告	46 - 47
管理人及受托人的责任声明	48
受托人对份额持有人的报告	48
业绩纪录 - 未经审计	48 - 49
经营与管理	49

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
上市投资 (98.3%)				Belgium Kingdom No71 3.75%/6/45- RegS	欧元 845,000	1,695,041	0.2
(I) 债务证券 (71.4%)				Belgium KingNo78 1.6%/47- RegS/144A	欧元 550,000	782,440	0.1
澳大利亚 (3.0%)				Belgium KingNo87 0.9%/6/29- RegS/144A	欧元 2,040,000	2,484,514	0.2
APT Pipelines 4.2%	美元 500,000	530,107	0.0	加拿大 (3.6%)			
23/03/25-RegS				British Columbia 4.3%			
Ausgrid Finance 4.35% 01/08/28- RegS	美元 500,000	550,150	0.1	18/06/42	加元 1,000,000	1,027,168	0.1
Ausnet Serv VRN 5.75% 03/76-RegS	美元 500,000	522,993	0.0	British Columbia CA 5.7% 18/06/29	加元 1,000,000	1,009,779	0.1
Australian Govt No124 5.75% 15/5/21	澳元 2,200,000	1,634,793	0.2	Canada Govt Of 1%			
Australian Govt No133 5.5% 21/04/23	澳元 4,750,000	3,816,412	0.4	01/09/22	加元 4,900,000	3,650,092	0.4
Australian Govt No138 3.25% 21/4/29	澳元 16,650,000	13,695,373	1.3	Canada Govt Of 10.5%			
Australian Govt No140 4.5%/4/33-RegS	澳元 1,300,000	1,266,692	0.1	15/03/21	加元 3,360,000	2,868,283	0.3
Australian Govt No150 3% 03/47-RegS	澳元 200,000	178,712	0.0	Canada Govt Of 2%			
Commonwealth Bk AU 0.5% 07/26-RegS	欧元 1,000,000	1,143,731	0.1	01/09/23	加元 3,270,000	2,525,209	0.2
Mirvac Group 3.625%				Canada Govt Of 2.5%			
18/03/27-RegS	美元 600,000	614,975	0.1	01/06/24	加元 3,700,000	2,954,987	0.3
Queensland No23 4.25%/23- RegS/144A	澳元 900,000	684,468	0.1	Canada Govt Of 2.75%			
Queensland Try 3.5%				01/12/48	加元 1,700,000	1,655,435	0.2
08/30-RegS/144A	澳元 2,300,000	1,849,645	0.2	Canada Govt Of 5%			
SGSP (Aust) Stp Cpn 3.3% 09/04/23	美元 1,950,000	2,034,507	0.2	01/06/37	加元 3,455,000	4,049,219	0.4
Sydney Airport Fin 3.625% 4/26-RegS	美元 500,000	528,203	0.0	Canada Govt Of 5.75%			
Transurban Queen 4.5% 19/04/28- RegS	美元 500,000	548,425	0.1	01/06/29	加元 6,250,000	6,659,126	0.6
Westpac Banking 0.375%/02/04/26- RegS	欧元 850,000	962,749	0.1	Canadian Imperial Bk 0.04%/7/27-RegS	欧元 284,000	315,621	0.0
奥地利 (0.5%)				Hydro-Quebec 4%			
Austria Rep 1.5%				15/02/55	加元 300,000	316,790	0.0
20/02/47- RegS/144A	欧元 500,000	731,832	0.1	Hydro-Quebec No19 6.5% 15/02/35	加元 1,700,000	1,985,071	0.2
Austria Rep Of 3.65%				Ontario Prov Of 2.6%			
20/04/22	欧元 200,000	246,146	0.0	02/06/25	加元 600,000	474,389	0.0
Austria Rep Of 4.15%				Ontario Prov Of 4%			
15/03/37-RegS	欧元 1,020,000	1,944,203	0.2	02/06/21	加元 1,500,000	1,189,815	0.1
Austria Rep Of 6.25%				Ontario Prov Of 6.5%			
15/07/27	欧元 1,250,000	2,108,951	0.2	08/03/29	加元 400,000	416,506	0.0
Suzano Austria 7%				Province of Alberta 2.2% 26/07/22	美元 1,000,000	1,015,672	0.1
16/03/47-RegS	美元 400,000	458,507	0.0	Quebec Prov Of 2.5%			
比利时 (0.7%)				20/04/26	美元 500,000	525,115	0.1
Belgium Kingdom No66 4%/32-RegS	欧元 1,305,000	2,195,580	0.2	Quebec Prov Of 2.6%			
				06/07/25	加元 2,700,000	2,133,831	0.2
				Quebec Prov f 4.2%			
				10/03/25-RegS	澳元 1,200,000	922,278	0.1
				Quebec Prov Of 5%			
				01/12/41	加元 1,650,000	1,829,347	0.2
				开曼群岛 (0.5%)			
				CDBL Funding 3%			
				24/04/23-RegS	美元 200,000	203,117	0.0
				CDBL Funding I 3.5%			
				24/10/27-RegS	美元 250,000	259,178	0.0
				Hutchison Wham Int12 3.25% 22-RegS	美元 1,000,000	1,034,060	0.1

投资组合 (续)

截至二零一九年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	占资产 公平值 美元 百分比		单位数目	占资产 公平值 美元 百分比
开曼群岛 (续)			Finnish Govt Of 4%		
Kuwait Projects 5%			7/25-RegS-144A	欧元 1,050,000	1,466,061 0.2
15/03/23	美元 1,000,000	1,057,272 0.1			
QNB Finance 2.125%			法国 (2.8%)		
07/09/21-RegS	美元 450,000	447,263 0.1	Dexia Credit 1%		
Saudi Elec Global 5.06%			18/10/27-RegS	欧元 1,000,000	1,205,090 0.1
8/4/43-RegS	美元 300,000	348,380 0.0	Dexia Credit 1.625%		
Three Gorges Fin 1.3%			08/12/23-RegS	英镑 600,000	773,371 0.1
21/06/24-RegS	欧元 405,000	464,964 0.1	Dexia Credit Local		
Three Gorges Fin 1.7%			1.25% 11/24-RegS	欧元 1,200,000	1,430,406 0.1
10/06/22-RegS	欧元 200,000	228,680 0.0	France OAT 2%		
Vale Overseas 4.375%			25/05/48-RegS-		
11/01/22	美元 600,000	625,441 0.1	144A	欧元 1,050,000	1,619,706 0.2
			France OAT 2.25%		
智利 (0.0%)			25/05/24	欧元 1,000,000	1,247,876 0.1
Rep of Chile 1.44%			France OAT 5.5%		
02/29	欧元 300,000	366,993 0.0	25/04/29	欧元 1,690,000	2,928,359 0.3
			France OAT 5.75%		
中国 (2.1%)			25/10/32	欧元 8,044,000	16,050,671 1.5
China Dev Bank No1910			France OAT 6%		
3.65% 21/5/29	人民币 40,000,000	5,699,611 0.6	25/10/25-RegS	欧元 2,400,000	3,819,550 0.4
China Govt Bond 3.25%			德国 (1.1%)		
22/11/28	人民币 60,000,000	8,542,516 0.8	Bundesrep Deut		
China Govt Bond			4.75% 04/07/34	欧元 2,186,956	4,309,597 0.4
No1823 3.29%10/23	人民币 10,000,000	1,465,355 0.2	Bundesrep Deut No97		
China Govt Bond			6.5% 04/07/27	欧元 1,330,000	2,305,527 0.2
No1904 3.19% 04/24	人民币 25,000,000	3,589,010 0.4	Kredit fuer Wied		
China Govt Bond			0.375% 09/03/26	欧元 500,000	576,585 0.1
No1910 3.86% 07/49	人民币 10,000,000	1,440,033 0.1	Kredit fuer Wied		
Export-Imp Bk CN			0.375% 23/04/25	欧元 400,000	458,974 0.0
0.75%28/05/23-RegS	欧元 200,000	224,294 0.0	Kredit fuer Wied 2%		
Ind & Comm Bk CN			02/05/25	美元 1,400,000	1,438,049 0.1
4.875%21/9/25-RegS	美元 300,000	329,596 0.0	Landwirtschaft Renten		
			0.05% 6/23-RegS	欧元 500,000	558,238 0.1
哥伦比亚 (0.1%)			Landwirtschaft Renten		
Ecopetrol SA 5.375%			0.5% 02/29-RegS	欧元 700,000	824,951 0.1
26/06/26	美元 600,000	682,250 0.1	Landwirtschaft Renten		
Rep of Colombia 5%			1.875% 4/23-RegS	美元 1,000,000	1,016,642 0.1
15/06/45	美元 300,000	355,732 0.0			
			希腊 (0.1%)		
塞浦路斯 (0.5%)			Hellenic Repub1.875%		
Cyprus Rep Of 0.625%			7/26-RegS/144A	欧元 1,100,000	1,266,779 0.1
03/12/24-RegS	欧元 620,000	698,085 0.1			
Cyprus Rep Of 2.375%			香港 (0.1%)		
25/09/28-RegS	欧元 3,312,000	4,235,182 0.4	CNAC (HK) Finbridge		
			1.75%06/22-RegS	欧元 550,000	623,961 0.1
丹麦 (0.0%)			CNAC (HK) Finbridge		
Denmark Kingdom Of			3%19/07/20-RegS	美元 200,000	201,550 0.0
4.5% 15/11/39	丹麦克朗 522,000	156,931 0.0			
			匈牙利 (0.1%)		
芬兰 (0.2%)			Hungary Govt No31/A	匈牙利福林	
Finnish Govt Of			3.25% 22/10/31	180,000,000	674,232 0.1
2%15/4/24-RegS-			Rep of Hungary		
144A	欧元 300,000	370,276 0.0	5.375% 25/03/24	美元 560,000	634,142 0.0
			冰岛 (0.2%)		
			Iceland Rep Of 0.5%		
			20/12/22-RegS	欧元 1,500,000	1,680,359 0.2

投资组合 (续)

截至二零一九年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	占资产		单位数目	占资产	
		公平值 美元	净值 百分比		公平值 美元	净值 百分比
印度 (0.0%)						
Indian Railway Fin3.73%29/3/24- RegS	美元 200,000	207,631	0.0			
NTPC Ltd 4.25% 26/02/26-RegS	美元 200,000	212,886	0.0			
印度尼西亚 (0.7%)						
Indonesia Govt NoFR35 12.9% 15/6/22	印尼盾 10,000,000,000	841,187	0.1			
Indonesia Govt NoFR53 8.25% 15/7/21	印尼盾 5,000,000,000	369,844	0.0			
Indonesia Govt NoFR59 7% 15/05/27	印尼盾 34,000,000,000	2,430,516	0.2			
Pertamina Persero 5.25% 05/21-RegS	美元 300,000	318,815	0.0			
Pertamina Persero 6.5% 27/5/41-RegS	美元 300,000	390,732	0.0			
Perusahaan Listrik 2.875%10/25-RegS	欧元 400,000	498,465	0.1			
Rep of Indonesia 1.45% 18/09/26	欧元 397,000	456,510	0.1			
Rep of Indonesia 3.375% 07/25-RegS	欧元 400,000	507,296	0.1			
Rep of Indonesia 3.75% 25/4/22- RegS	美元 1,000,000	1,048,650	0.1			
跨国性 (0.3%)						
Euro Stability 0.5% 02/03/26-RegS	欧元 1,300,000	1,509,892	0.1			
European Fin Stab 1.8% 10/7/48-RegS	欧元 400,000	615,803	0.1			
European Inv Bank 2.5% 15/03/23	美元 600,000	618,097	0.1			
Inter-American Dev 3.2% 07/08/42	美元 500,000	581,989	0.0			
爱尔兰 (0.2%)						
Ireland Treasury 1.3% 15/05/33-RegS	欧元 667,322	834,595	0.1			
Ireland Treasury 2% 18/02/45-RegS	欧元 500,000	731,676	0.1			
Ireland Treasury 2.4% 15/05/30-RegS	欧元 465,000	639,212	0.0			
以色列 (0.2%)						
Israel Electric5%12/11/24- 144A/RegS	美元 400,000	447,942	0.1			
Israel Govt 3.75% 31/03/24	以色列新锡克尔 2,500,000	840,094	0.1			
State of Israel 2.375% 18/01/37	欧元 200,000	277,043	0.0			
意大利 (2.9%)						
Italy Rep (BTP) 3.45%3/48- RegS&144A	欧元 2,180,000	3,242,310	0.3			
Italy Rep (BTP) 3.75% 21-RegS&144A	欧元 4,000,000	4,707,554	0.5			
Italy Rep (BTP) 5% 09/40-RegS&144A	欧元 1,800,000	3,104,298	0.3			
Italy Rep Of (BTP) 0.95% 01/03/23	欧元 2,950,000	3,322,166	0.3			
Italy Rep Of (BTP) 2.8% 01/03/67	欧元 192,000	250,012	0.0			
Italy Rep Of (BTP) 4.5% 01/03/24	欧元 3,500,000	4,557,124	0.4			
Italy Rep Of (BTP) 4.75% 01/08/23	欧元 720,000	931,708	0.1			
Italy Rep Of (BTP) 4.75% 01/09/28	欧元 5,340,000	7,897,470	0.8			
Italy Rep Of (BTP) 6.5% 01/11/27	欧元 1,000,000	1,625,896	0.2			
日本 (19.3%)						
Asahi Group Hldgs 0.321% 09/21-RegS	欧元 500,000	548,564	0.1			
Central Nippon Exp 2.091% 9/21-RegS	美元 500,000	498,219	0.0			
Central Nippon Exp 2.362% 5/21-RegS	美元 700,000	706,034	0.1			
Dev Bank of Japan 0.875% 10/25-RegS	欧元 400,000	467,144	0.0			
Dev Bank Of Japan 2% 19/10/21-RegS	美元 1,000,000	1,009,350	0.1			
Japan Fin Org 0.875% 22/09/21-RegS	欧元 800,000	894,544	0.1			
Japan Fin Org 3.375% 27/09/23-RegS	美元 1,000,000	1,053,425	0.1			
JGB Nol (30Yr) 2.8% 20/09/29	日元 1,257,200,000	15,162,522	1.5			
JGB Nol (40Yr) 2.4% 20/03/48	日元 285,000,000	4,107,542	0.4			
JGB Nol10 (40Yr) 0.9% 20/03/57	日元 466,700,000	5,039,329	0.5			
JGB Nol100 (20Yr) 2.2% 20/03/28	日元 1,387,350,000	15,633,609	1.5			
JGB Nol132 (20Yr) 1.7% 20/12/31	日元 657,150,000	7,454,676	0.7			
JGB Nol134 (5 Yr) 0.1% 20/12/22	日元 1,943,000,000	18,251,205	1.8			
JGB Nol151 (20Yr) 1.2% 20/12/34	日元 519,800,000	5,678,175	0.6			
JGB Nol160 (20Yr) 0.7% 20/03/37	日元 669,650,000	6,817,703	0.7			
JGB No20 (30Yr) 2.5% 20/09/35	日元 1,585,400,000	20,375,173	2.0			
JGB No315 (10Yr) 1.2% 20/06/21	日元 200,000,000	1,905,133	0.2			
JGB No333 (10Yr) 0.6% 20/03/24	日元 1,070,000,000	10,331,015	1.0			
JGB No353 (10Yr) 0.1% 20/12/28	日元 299,700,000	2,869,528	0.3			

投资组合 (续)

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
日本 (续)				科威特 (0.1%)			
JGB No36 (30Yr) 2% 20/03/42	日元 50,000,000	640,159	0.1	Kuwait Intl Bank 2.75% 20/03/22-RegS	美元 490,000	497,492	0.1
JGB No37 (30Yr) 1.9% 20/09/42	日元 483,900,000	6,124,576	0.6	卢森堡 (0.4%)			
JGB No4 (40Yr) 2.2% 20/03/51	日元 813,350,000	11,618,792	1.1	European Fin Stab 2.05% 10/29-RegS	欧元 700,000	786,915	0.1
JGB No50 (20Yr) 1.9% 22/03/21	日元 355,000,000	3,394,048	0.3	European Fin Stab 0.75% 05/27-RegS	欧元 1,550,000	1,841,968	0.2
JGB No51 (20Yr) 2% 21/06/21	日元 2,020,000,000	19,543,840	1.9	European Fin Stab 2.35% 07/44-RegS	欧元 470,000	775,744	0.0
JGB No54 (20Yr) 2.2% 20/12/21	日元 970,000,000	9,538,071	0.9	European Inv Bank 4.875% 15/02/36	美元 800,000	1,114,423	0.1
JGB No67 (20Yr) 1.9% 20/03/24	日元 820,000,000	8,364,058	0.8	墨西哥 (0.4%)			
JGB No78 (20Yr) 1.9% 20/06/25	日元 1,240,650,000	13,044,895	1.3	Mexican Bds Desarr 10% 05/12/24	墨西哥比索 286,900	1,707,531	0.2
JGB No91 (20Yr) 2.3% 20/09/26	日元 200,000,000	2,200,681	0.2	Mexican Bds Desarr NoM20 8.5% 05/29	墨西哥比索 100,000	576,946	0.0
JPN Bank For Int'l 1.5% 21/07/21	美元 500,000	498,308	0.0	Petroleos Mexic 8.25% 02/06/22- RegS	英镑 300,000	421,086	0.0
JPN Bank for Intl 2.5% 01/06/22	美元 1,000,000	1,024,833	0.1	Petroleos Mexicanos 2.5% 11/22-RegS	欧元 700,000	796,528	0.1
JPN Bank for Intl 3.25% 20/07/28	美元 1,000,000	1,108,160	0.1	Petroleos Mexicanos 4.25% 15/01/25	美元 700,000	691,035	0.1
Kansai Elec Power 2.55% 09/24-RegS	美元 800,000	798,673	0.1	United Mexican States 4.15% 28/3/27	美元 300,000	317,954	0.0
Mitsui Fudosan 2.95% 23/01/23-RegS	美元 200,000	204,114	0.0	摩洛哥 (0.0%)			
Sumitomo Mitsui 0.267% 18/6/26- RegS	欧元 420,000	469,018	0.0	OCP SA 6.875% 25/04/44-RegS	美元 300,000	381,988	0.0
Sumitomo Mitsui Bk 0.55% 11/23-RegS	欧元 281,000	318,036	0.0	荷兰 (1.3%)			
Toyota Tsusho 2.596% 19/09/24- RegS	美元 800,000	804,372	0.1	ABN Amro Bank 1.125% 23/04/39- RegS	欧元 900,000	1,160,440	0.1
哈萨克斯坦 (0.1%)				BNG Bank 0.05% 13/07/24-RegS	欧元 800,000	896,458	0.1
Kazakhstan Rep Of 1.5% 30/9/34-RegS	欧元 1,080,000	1,176,522	0.1	BNG Bank 0.875% 24/10/36-RegS	欧元 600,000	741,379	0.1
韩国 (0.5%)				BNG Bank 5.2% 07/12/28-RegS	英镑 400,000	700,521	0.1
Export-imp Bk Kor 4.375% 15/09/21	美元 300,000	313,348	0.0	Neder Waterscha 1.25% 27/05/36- RegS	欧元 600,000	775,778	0.1
Korea Dev Bank 0% 10/07/24-RegS	欧元 429,000	470,853	0.1	Neder Waterscha 3.4% 22/07/25- RegS	澳元 1,800,000	1,354,641	0.1
Korea Dev Bank 0.625% 17/07/23- RegS	欧元 450,000	507,048	0.1	Netherlands Govt 2.5% 15/01/33- RegS	欧元 550,000	841,247	0.1
Korea Housing 0.1% 18/06/24-RegS	欧元 1,199,000	1,326,217	0.1	Netherlands Govt 2.75% 15/01/47	欧元 260,000	511,399	0.0
Korea Housing 0.75 30/10/23-RegS	欧元 799,000	910,925	0.1	Netherlands Govt 3.75% 15/01/42	欧元 734,900	1,535,004	0.1
Korea Midland Power 3.375%1/22-RegS	美元 200,000	206,174	0.0	Netherlands Govt 5.5% 15/01/28	欧元 1,009,000	1,705,928	0.2
NongHyup Bank 1.875% 12/09/21- RegS	美元 1,000,000	992,040	0.1	NIB Capital Bank 0.5% 19/03/27-RegS	欧元 1,700,000	1,945,965	0.2

投资组合 (续)

截至二零一九年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比			
荷兰 (续)				SP Powerassets 3% 26/09/27-RegS 美元 400,000 417,407 0.0						
NN Bank Netherlands 0.125%9/29-RegS	欧元 600,000	659,761	0.0	Temasek Fin I 0.5% 01/03/22-RegS	欧元 700,000	780,634	0.1			
NXP BV/NXP Fdg 3.875% 01/09/22- RegS	美元 670,000	694,441	0.1	Temasek Fin I 1.5% 01/03/28-RegS	欧元 400,000	490,097	0.0			
新西兰 (0.4%)				斯洛伐克 (0.1%)						
ASB Fin London 0.625% 18/10/24-RegS	欧元 973,000	1,114,714	0.1	Slovakia (Govt of) 0.75%9/4/30-RegS	欧元 980,000	1,162,988	0.1			
Auckland Council 0.125% 09/29-RegS	欧元 1,500,000	1,642,196	0.2	斯洛文尼亚 (0.2%)						
New Zealand Govt 3% 20/04/29	纽元 500,000	371,311	0.0	Rep of Slovenia 1.1875% 03/29- RegS	欧元 1,501,000	1,841,488	0.2			
New Zealand Govt 5.5% 15/04/23	纽元 1,150,000	857,538	0.1	西班牙 (3.7%)						
波兰 (0.2%)				Banco Santander 0.25% 10/07/29- RegS 欧元 500,000 563,588 0.1						
Poland Govt No0725 3.25% 25/07/25	波兰兹罗提 5,200,000	1,405,969	0.1	Liberbank SA 0.25% 25/09/29-RegS	欧元 1,000,000	1,103,055	0.1			
Rep of Poland 1.5% 09/09/25-RegS	欧元 600,000	723,098	0.1	Spain Kingdom 0.6% 10/29-RegS&144A	欧元 8,040,000	9,179,886	0.9			
葡萄牙 (1.2%)				Spain Kingdom 1.85% 07/35-RegS&144A				欧元 5,449,000	7,111,280	0.7
Banco BPI 0.25% 22/03/24-RegS	欧元 1,000,000	1,115,840	0.1	Spain Kingdom 5.4% 01/23-RegS&144A	欧元 4,000,000	5,369,238	0.5			
Obrigacoes Tes2.875%10/25- RegS&144A	欧元 6,000,000	7,913,199	0.8	Spain Kingdom Of 1.4% 30/4/28	欧元 5,510,000	6,745,207	0.6			
Obrigacoes Tesouro 2.25% 04/34-RegS	欧元 1,650,000	2,246,658	0.2	Spain Kingdom Of 2.9% 31/10/46	欧元 1,750,000	2,817,353	0.3			
Portugal Rep Of 5.125%15/10/24- 144A	美元 500,000	582,216	0.1	Spain Kingdom Of 4.65% 30/07/25	欧元 1,460,000	2,057,268	0.2			
卡塔尔 (0.1%)				Spain Kingdom Of 5.5% 30/04/21				欧元 2,400,000	2,926,643	0.3
State of Qatar 2.375% 02/06/21-RegS	美元 200,000	202,240	0.0	国际 (0.6%)						
State of Qatar 3.875% 23/04/23-RegS	美元 300,000	322,937	0.1	African Dev Bk 0.5% 21/03/29 欧元 500,000 584,620 0.0						
沙特阿拉伯 (0.2%)				Asian Dev Bank 1.375% 07/03/25 英镑 500,000 645,210 0.1						
Saudi Arabian Oil 4.25%16/4/39-RegS	美元 400,000	439,968	0.1	European Inv Bank 4% 15/10/37 欧元 350,000 668,085 0.1						
Saudi Intl Bond 0.75% 09/07/27-RegS	欧元 1,070,000	1,207,017	0.1	European Inv Bank 4.125% 15/04/24 欧元 1,200,000 1,620,579 0.2						
Saudi Intl Bond 4.5% 26/10/46-RegS	美元 300,000	341,768	0.0	European Inv Bk 0.5% 15/01/27 欧元 400,000 468,742 0.0						
Saudi Intl Bond 5.25% 16/01/50-RegS	美元 300,000	378,146	0.0	European Inv Bk 1.25% 12/05/25- RegS 瑞典克朗 7,750,000 847,053 0.1						
新加坡 (0.2%)				European Inv Bk 1.75% 11/11/26- RegS 瑞典克朗 1,100,000 126,551 0.0						
Abja Investment 4.85% 31/01/20-RegS	美元 300,000	303,220	0.0	European Union 3.75% 04/04/42 欧元 710,000 1,397,860 0.1						
CMT MTN Pte 3.609% 04/04/29-RegS	美元 500,000	538,672	0.1	泰国 (0.3%)						
				Thailand Govt 2.4% 17/12/23 泰铢 25,000,000 856,667 0.1						

投资组合 (续)
截至二零一九年九月三十日 (未经审计)

(续)

	单位数目	占资产			单位数目	占资产		
		公平值 美元	净值 百分比			公平值 美元	净值 百分比	
泰国 (续)								
Thailand Govt 2.875% 17/12/28	泰铢 23,000,000	848,925	0.1	Intl Bk Rec & Dev 2.5% 29/07/25	美元 1,010,000	1,061,566	0.1	
Thailand Govt 3.775% 25/06/32	泰铢 23,000,000	956,661	0.1	US Treasury 2.25% 31/07/21	美元 1,000,000	1,014,181	0.1	
Thailand Govt of 3.3% 17/06/38	泰铢 16,000,000	679,245	0.0	US Treasury 2.75% 15/02/28	美元 4,710,000	5,133,148	0.5	
阿拉伯联合酋长国 (0.2%)								
ABU Dhabi (Govt Of) 3.125% 10/27- RegS	美元 1,150,000	1,224,896	0.1	US Treasury 3% 15/02/47	美元 5,700,000	6,790,590	0.7	
ABU Dhabi Natl 4.375% 22/06/26- RegS	美元 300,000	326,964	0.0	US Treasury 3% 15/02/49	美元 7,220,000	8,651,615	0.8	
ABU Dhabi Natl 4.875% 23/04/30- RegS	美元 300,000	346,214	0.0	US Treasury 3.125% 15/05/48	美元 3,050,000	3,749,614	0.4	
DP World 2.375% 25/09/26-RegS	欧元 400,000	471,878	0.1	US Treasury 3.375% 15/05/44	美元 7,160,000	9,025,613	0.9	
英国 (4.1%)								
Asbbnk 2025-RegS (New)	欧元 481,000	558,228	0.0	US Treasury 3.625% 15/02/21	美元 1,000,000	1,030,059	0.1	
Lloyds Bank 0.125% 23/09/29-RegS	欧元 1,089,000	1,187,379	0.1	US Treasury 4.5% 15/02/36	美元 2,348,000	3,253,735	0.3	
Lloyds Bank 0.25% 25/03/24-RegS	欧元 520,000	580,253	0.1	US Treasury 4.625% 15/02/40	美元 7,771,000	11,312,639	1.1	
Nationwide Bldg 0.75% 26/10/22- RegS	欧元 1,000,000	1,134,829	0.1	US Treasury 6.125% 15/08/29	美元 3,000,000	4,238,234	0.4	
UK Treasury 2.75% 07/09/24-RegS	英镑 850,000	1,176,620	0.1	US Treasury 6.25% 15/05/30	美元 38,840,000	57,001,263	5.5	
UK Treasury 3.5% 22/07/68-RegS	英镑 1,520,000	3,840,976	0.4	US Treasury 6.25% 15/08/23	美元 9,900,000	11,720,806	1.1	
UK Treasury 3.75% 22/07/52-RegS	英镑 2,430,000	5,396,923	0.5	US Treasury 7.5% 15/11/24	美元 10,150,000	13,400,862	1.3	
UK Treasury 4.25% 07/12/27	英镑 1,100,000	1,805,932	0.2	US Treasury 7.625% 15/02/25	美元 19,830,000	26,184,357	2.5	
UK Treasury 4.75% 07/12/30	英镑 4,400,000	8,019,341	0.8	US Treasury 8.125% 15/08/21	美元 15,000,000	16,928,117	1.7	
UK Treasury 4.75% 07/12/38	英镑 5,050,000	10,612,929	1.0	维京群岛 (0.3%)				
UK Treasury 5% 07/03/25-RegS	英镑 2,500,000	3,879,270	0.4	Cheung Kong Infra Fin 1% 12/24-RegS	欧元 450,000	507,161	0.0	
UK Treasury 8% 07/06/21	英镑 1,650,000	2,345,315	0.2	JIC Zhixin 0.5% 24/11/20-RegS	欧元 500,000	549,003	0.1	
Uni of Oxford 2.544% 08/12/17-RegS	英镑 126,000	201,276	0.0	JIC Zhixin 3% 24/11/22- RegS	美元 500,000	507,942	0.1	
Virgin Money 0.01% 22/09/26	欧元 1,500,000	1,640,700	0.2	State Grid Osea 2016 2.875% 5/26-RegS	美元 300,000	308,181	0.0	
美国 (17.6%)								
Apple Inc 3.45% 09/02/45	美元 400,000	426,005	0.0	State Grid Overseas 1.25% 5/22-RegS	欧元 300,000	338,723	0.0	
Brambles USA 4.125% 23/10/25-RegS	美元 500,000	541,272	0.1	Xingsheng BVI 4.5% 20/09/21-RegS	美元 600,000	616,245	0.1	
General Motors Fin 3.7% 09/05/23	美元 300,000	310,918	0.0	(II) 集体投资计划 (26.5%)				
欧洲 (1.8%)								
JPMF-Europe High Yield 'X' (acc)-EUR**								
						125,802	18,077,172	1.8
跨国性 (1.5%)								
JPMIF-JPM GI High Yield 'X'(acc)-USD**								
						90,298	15,913,191	1.5

投资组合 (续)

截至二零一九年九月三十日 (未经审计)

单位数目	占资产	
	公平值 美元	净值 百分比
卢森堡 (23.2%) JPMF-JPM Global Corp Bd 'X'-dist- USD**	2,261,312	239,292,076 23.2
		273,282,439 26.5
	-----	-----
(III) 衍生性产品 (0.4%)		
远期外汇合约 (0.4%)		4,249,575 0.4
期货 (0.0%)		
Euro BUXL 30Yr Bd (EUX) Fut 12/19	6	(28,912) (0.0)
Euro-BTP (EUX) Fut 12/19	65	112,748 0.0
Euro-Bund (EUX) Fut 12/19	(122)	179,719 0.0
Euro-OAT (EUX) Fut 12/19	55	(108,529) (0.0)
		4,404,601 0.4
	-----	-----
总上市投资		1,013,530,262 98.3
其他净资产		17,268,131 1.7

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		1,030,798,393 100.0
		=====
总投资, 按成本		986,723,596

* 由管理人的关联人士发行和管理 (关联人士的定义, 参见附注 8)

未有在香港获得认可, 且不可向香港居民提供

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)

	持有占资产净值百分比	
	2019	2018
上市投资		
债务证券		
日本	19.3	19.9
美国	17.6	14.2
英国	4.1	4.1
西班牙	3.7	2.7
加拿大	3.6	2.9
澳大利亚	3.0	2.3
意大利	2.9	3.7
法国	2.8	2.8
中国	2.1	0.7
荷兰	1.3	0.8
葡萄牙	1.2	1.4
德国	1.1	1.8
比利时	0.7	0.7
印度尼西亚	0.7	0.2
国际	0.6	1.1
奥地利	0.5	0.8
塞浦路斯	0.5	0.3
韩国	0.5	0.2
开曼群岛	0.5	1.0
卢森堡	0.4	0.4
墨西哥	0.4	1.2
新西兰	0.4	1.0
泰国	0.3	-
跨国性	0.3	0.3
维京群岛	0.3	0.9
新加坡	0.2	0.4
阿拉伯联合酋长国	0.2	0.5
沙特阿拉伯	0.2	0.1
爱尔兰	0.2	0.2
波兰	0.2	0.3
斯洛文尼亚	0.2	0.1
芬兰	0.2	0.3
冰岛	0.2	0.5
以色列	0.2	0.2
匈牙利	0.1	1.3
希腊	0.1	-
哈萨克斯坦	0.1	-
斯洛伐克	0.1	0.1
哥伦比亚	0.1	0.2
香港	0.1	0.2
卡塔尔	0.1	0.4
科威特	0.1	0.2
印度	0.0	0.1
摩洛哥	0.0	-
智利	0.0	0.1
丹麦	0.0	0.0
瑞典	-	0.2
菲律宾	-	0.1
瑞士	-	0.0
集体投资计划		
卢森堡	23.2	23.2
欧洲	1.8	3.5

投资组合持有变动表 (续)

截至二零一九年九月三十日止年度 (未经审计)

	持有占资产净值百分比	
	2019	2018
跨国性	1.5	2.0
衍生性产品		
远期外汇合约	0.4	0.1
期货	0.0	0.1
总上市投资	<u>98.3</u>	<u>99.8</u>
其他净资产	<u>1.7</u>	<u>0.2</u>
截至九月三十日可赎回份额持有人应占净资产	<u><u>100.0</u></u>	<u><u>100.0</u></u>

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
资产		
银行现金	22,744,035	6,526,585
应收经纪款项	3,964,578	1,745,010
分配应收款项	22,449,089	2,092,666
保证金	322,843	146,765
衍生性产品 [附注 4(l)(a)]	8,026,730	2,326,837
投资 [附注 4(l)(a)]	1,009,125,661	354,635,265
利息及其他应收款项	13,138	5,210
总资产	<u>1,066,646,074</u>	<u>367,478,338</u>
负债		
应付经纪款项	22,995,931	2,798,250
赎回应付款项	5,548,291	5,549,991
应付收益分配 [附注 6]	2,860,807	1,230,002
衍生性产品 [附注 4(l)(a)]	3,622,129	1,756,522
其他应付款项	820,523	298,750
总负债 (不含可赎回份额持有人 应占净资产)	<u>35,847,681</u>	<u>11,633,515</u>
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	<u>1,030,798,393</u>	<u>355,844,823</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:

东亚银行 (信托) 有限公司, 受托人

摩根基金 (亚洲) 有限公司, 管理人

	2019 美元	2018 美元
收入		
投资及衍生性产品净收益 [附注 5]	47,729,841	534,520
股息收入	4,915,646	1,633,687
存款利息	86,663	27,520
汇兑净收益	19,859	525,149
其他收入 [附注 13]	47,196	157
	<u>52,799,205</u>	<u>2,721,033</u>
支出		
管理费用 [附注 8(e)]	4,569,521	3,142,923
托管费用及银行费用	275,026	159,873
基金注册登记机构费用 [附注 8(h)]	146,680	86,079
法律及专业费用	129,351	19,916
受托人费用 [附注 9]	103,008	70,839
核数师酬金	21,104	20,400
交易成本	19,939	8,368
印刷及出版支出	3,655	9,720
其他经营费用	5,378	3,580
	<u>5,273,662</u>	<u>3,521,698</u>
净经营利润 / (亏损)	<u>47,525,543</u>	<u>(800,665)</u>
财务成本		
收益分配 [附注 6]	(19,984,963)	(13,620,372)
利息支出	(2,157)	(2,692)
	<u>(19,987,120)</u>	<u>(13,623,064)</u>
除税前利润 / (亏损)	<u>27,538,423</u>	<u>(14,423,729)</u>
税项 [附注 7]	(36,457)	(105,515)
可赎回份额持有人应占净资产 及总综合收益之增加 / (减少)	<u>27,501,966</u>	<u>(14,529,244)</u>

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	355,844,823	523,390,762
分配可赎回份额 [附注 3]	1,341,351,566	233,414,736
赎回可赎回份额 [附注 3]	(693,899,962)	(386,431,431)
净分配 / (赎回)	647,451,604	(153,016,695)
	1,003,296,427	370,374,067
可赎回份额持有人应占净资产及 总综合收益之增加 / (减少)	27,501,966	(14,529,244)
年末可赎回份额持有人应占净资产	1,030,798,393	355,844,823

	2019 美元	2018 美元
经营业务		
购入投资及衍生性产品	(1,119,268,052)	(469,286,382)
出售投资及衍生性产品所得款项	526,651,324	638,481,233
已收股息	4,915,646	1,633,687
已收利息	78,663	28,104
已付交易费用	(17,465)	(7,248)
已付税项	(28,516)	(117,203)
已付受托人费用	(93,470)	(73,589)
已付基金注册登记机构费用	(110,844)	(91,786)
保证金之 (增加) / 减少	(176,078)	263,417
已付管理费用	(4,146,847)	(3,265,488)
其他	(105,973)	375,157
经营业务所 (运用) / 产生之 现金净额	(592,301,612)	167,939,902
融资活动		
已付利息	(2,157)	(2,692)
分配可赎回份额所得款项	1,320,995,143	232,137,456
赎回可赎回份额付款	(693,901,662)	(382,286,192)
已付收益分配	(18,354,158)	(14,087,355)
融资活动产生 / (运用) 之现 金净额	608,737,166	(164,238,783)
现金及现金等价物之增加	16,435,554	3,701,119
年初现金及现金等价物	6,526,585	2,893,018
现金及现金等价物之汇兑亏损	(218,104)	(67,552)
年末现金及现金等价物	22,744,035	6,526,585
现金及现金等价物余额分析:		
银行现金	22,744,035	6,526,585

财务报表附注

1 本基金

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

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。

本基金的投资目标旨在通过主要投资于环球投资级别债务证券，取得比环球债券市场更高的回报。

由于将资源从伦敦调拨至香港，本基金的投资管理事项由基金现任投资管理人-摩根资产管理（亚太）有限公司负责。因此，本基金对 JPMorgan Asset Management (UK) Limited 担任助理投资管理人之授权已于二零一七年十一月三日终止。

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

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

2 主要会计政策

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

(a) 财务报表之编制基础

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

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

于二零一八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，但在编制此等财务报表时并未提前采纳。此等新准则、准则修订及解释预期不会对本基金的财务报表产生重大影响。

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公允价值为负数的衍生性产品合约列示为按公允价值透过损益列账的负债。

当预期某一借入证券将会下跌时，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。

公平值估计

公平值指在计量日期，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平值，按最后交易价计算。当被投资公司的证券被暂停交易时，该投资的价值按基金管理人估计的公平值计算。

债务证券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。

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。

公平值级次分层间的转拨

在公平值级次分层之间的转拨视为于报告期间开始时已发生。

(c) 证券借贷

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

(d) 金融工具抵销

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

(e) 收入及支出

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

投资利息收入乃作为投资及衍生性产品净收益/亏损的一部分，在综合收益表确认。

银行现金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。

(f) 外币交易

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

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

(g) 现金及现金等价物

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

(h) 保证金

为衍生性产品交易而存放在经纪处的保证金采用实际利率法以摊销成本列账。

(i) 应收/应付经纪款项

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

该等金额按公允价值进行初始确认，并以摊余成本进行后续计量。于每一报告日期，若信贷风险自初始确认后显著增加，本基金应按与存续期预期信用损失相当的金额，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。

(j) 销售份额所得款项及赎回份额支付款项

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

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

(k) 应付可赎回份额持有人的收益分配

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

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

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	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	4,713,021.725	1,946,638.084	55,817,474.280	1,209,710.812	192,096.205
总分配	11,612,602.078	6,403,155.478	197,409,523.778	6,351,130.598	301,968.406
总赎回	(8,881,612.016)	(4,105,543.159)	(132,730,158.260)	(3,015,042.656)	(17,542.015)
年末	<u>7,444,011.787</u>	<u>4,244,250.403</u>	<u>120,496,839.798</u>	<u>4,545,798.754</u>	<u>476,522.596</u>
	澳元	加元	港元	纽元	人民币
可赎回份额持有人应占净资产	<u>75,379,036</u>	<u>42,996,672</u>	<u>1,235,343,698</u>	<u>46,035,618</u>	<u>6,094,496</u>
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	<u>10.13</u>	<u>10.13</u>	<u>10.25</u>	<u>10.13</u>	<u>12.79</u>
	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元类别 (每半年派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	51,921,399.172	15,842,915.848	508,802.803	-	-
总分配	63,810,918.547	53,028,254.260	412,010.795	48,704,692.830	12,904,625.370
总赎回	(44,067,836.853)	(34,279,749.199)	(335,753.648)	(748,451.140)	(444,948.890)
年末	<u>71,664,480.866</u>	<u>34,591,420.909</u>	<u>585,059.950</u>	<u>47,956,241.690</u>	<u>12,459,676.480</u>
	人民币	美元	美元	人民币	人民币
可赎回份额持有人应占净资产	<u>717,124,629</u>	<u>350,740,212</u>	<u>13,405,615</u>	<u>538,799,669</u>	<u>137,346,857</u>
可赎回份额持有人应占净资产（每份额）	<u>10.01</u>	<u>10.14</u>	<u>22.91</u>	<u>11.24</u>	<u>11.02</u>

2019

	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	36,597,083.570	24,304,119.220	6,966,897.780	4,450,020.470
总赎回	(2,784,684.660)	(943,672.350)	(130,429.740)	(167,382.030)
年末	<u>33,812,398.910</u>	<u>23,360,446.870</u>	<u>6,836,468.040</u>	<u>4,282,638.440</u>
	人民币	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应 占净资产	<u>358,901,326</u>	<u>242,583,238</u>	<u>72,249,710</u>	<u>44,456,561</u>
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	<u>10.61</u>	<u>10.38</u>	<u>10.57</u>	<u>10.38</u>

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	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	6,415,031.558	2,441,258.750	70,531,533.777	1,911,587.412	268,366.792
总分配	2,669,625.021	1,092,765.392	48,762,663.464	1,103,824.102	16,529.102
总赎回	(4,371,634.854)	(1,587,386.058)	(63,476,722.961)	(1,805,700.702)	(92,799.689)
年末	<u>4,713,021.725</u>	<u>1,946,638.084</u>	<u>55,817,474.280</u>	<u>1,209,710.812</u>	<u>192,096.205</u>
	澳元	加元	港元	纽元	人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	<u>44,711,934</u>	<u>18,500,087</u>	<u>536,431,426</u>	<u>11,491,342</u>	<u>2,211,940</u>
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	<u>9.49</u>	<u>9.50</u>	<u>9.61</u>	<u>9.50</u>	<u>11.51</u>

2018

	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元类别 (每半年派息) 份额
已发行份额数目:			
年初	76,399,459.094	23,140,341.777	640,599.130
总分配	20,784,691.297	10,880,615.341	150,781.488
总赎回	(45,262,751.219)	(18,178,041.270)	(282,577.815)
年末	51,921,399.172	15,842,915.848	508,802.803
	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应占净 资产	487,434,570	150,841,303	10,950,129
可赎回份额持有人应占净 资产 (每份额)	9.39	9.52	21.52

4 财务风险管理

(i) 财务风险因素

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

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

(a) 市场风险

(i) 市场价格风险

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

(ii) 利率风险

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

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

	1 年以内 美元	1 至 5 年 美元	5 年以上 美元	非计息类 美元	合计 美元
2019					
银行现金	22,744,035	-	-	-	22,744,035
保证金	322,843	-	-	-	322,843
衍生性产品	155,026	-	-	-	155,026
投资 (注*)	504,770	196,651,354	538,687,098	273,282,439	1,009,125,661
总利率敏感性缺口	23,726,674	196,651,354	538,687,098	273,282,439	1,032,347,565

	1年以内 美元	1至5年 美元	5年以上 美元	非计息类 美元	合计 美元
<u>2018</u>					
银行现金	6,526,585	-	-	-	6,526,585
保证金	146,765	-	-	-	146,765
衍生性产品	231,095	-	-	-	231,095
投资(注*)	4,377,321	91,808,978	156,456,546	101,992,420	354,635,265
总利率敏感性缺口	11,281,766	91,808,978	156,456,546	101,992,420	361,539,710

注：

* 投资的票面息率范围介乎年率 0.00% - 12.90% (二零一八年：年率 0.10% - 10.00%)。

截至九月三十日，本基金投资及衍生性产品之公平值如下：

	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				
<u>资产</u>				
债务证券				
- 日本	198,497,524	19.3	70,754,448	19.9
- 美国	181,774,594	17.6	50,712,110	14.2
- 其他	355,571,104	34.5	131,176,287	36.8
	735,843,222	71.4	252,642,845	70.9
集体投资计划				
- 卢森堡	239,292,076	23.2	82,307,567	23.2
- 其他	33,990,363	3.3	19,684,853	5.5
	273,282,439	26.5	101,992,420	28.7
衍生性产品				
- 远期外汇合约	7,734,263	0.8	1,952,678	0.6
- 期货	292,467	0.0	374,159	0.1
	8,026,730	0.8	2,326,837	0.7
	1,017,152,391	98.7	356,962,102	100.3
<u>负债</u>				
衍生性产品				
- 期货	(137,441)	(0.0)	(143,064)	(0.0)
- 远期外汇合约	(3,484,688)	(0.4)	(1,613,458)	(0.5)
	(3,622,129)	(0.4)	(1,756,522)	(0.5)
总上市投资	1,013,530,262	98.3	355,205,580	99.8

有关衍生性产品合约的风险亦请参阅附注 12。

投资管理主要通过本基金的修正久定期监控本基金的利率风险敏感度。修正久期计量某项债券的价格相对于利率变动的敏感度。于二零一九年九月三十日，投资管理人估计本基金的修正久期为 8.06（二零一八年：7.04）。为了披露相关敏感度，采用的利率合理变动百分比为二十五个基点，不包括不大可能出现或“最恶劣”情况或“压力测试”下之变动，也不代表投资管理人对本基金未来回报的预测。若利率上升二十五个基点，其他变量保持稳定，则将致使本基金的资产净值减少约 20,770,588 美元（二零一八年：6,262,869 美元）。若利率下降二十五个基点，则将致使本基金的资产净值增加相同金额。

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

(iii) 汇兑风险

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

本基金订立了若干远期外汇合约，以对冲若干外汇承担以维持有限的非美元风险承担。年末未平仓远期外汇合约请参阅附注 12(a)。

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

汇兑风险承担净值（注 ¹ ）	美元 等值	与美元比较之合 理变动百分比 （注 ² ）	估计对资产 净值的影响 美元
2019			
澳元	51,529,995	-6.8	(3,504,040)
加元	33,459,983	-2.4	(803,040)
人民币（在岸）	20,736,525	-3.6	(746,515)
人民币（离岸）	168,061,207	-3.7	(6,218,265)
丹麦克朗	156,931	-6.3	(9,887)
欧元	(7,212)	-6.1	440
港元	1,465,039	-0.2	(2,930)
匈牙利福林	674,232	-9.4	(63,378)
印尼盾	3,641,547	+5.0	182,077
以色列新锡克尔	840,532	+4.6	38,664
日元	435,980	+5.1	22,235
韩元	3	-7.3	(0)
墨西哥比索	281,239	-5.3	(14,906)
纽元	29,591,650	-5.4	(1,597,949)
挪威克朗	1,106	-10.4	(115)
波兰兹罗提	198,749	-8.1	(16,099)
英镑	783,684	-5.5	(43,103)
瑞典克朗	220,426	-9.5	(20,940)
泰铢	714,576	+5.7	40,731
土耳其里拉	191	+6.4	12
	<u>312,786,383</u>		<u>(12,757,008)</u>

汇兑风险承担净值（注 ¹ ）	美元 等值	与美元比较之合 理变动百分比 （注 ² ）	估计对资产 净值的影响 美元
2018			
澳元	32,466,238	-7.8	(2,532,367)
加元	14,614,886	-3.2	(467,676)
人民币（离岸）	71,421,067	-3.3	(2,356,895)
丹麦克朗	143,113	-2.0	(2,862)
欧元	(42,618)	-1.8	767
港元	2,222,050	-0.2	(4,444)
匈牙利福林	111,433	-5.6	(6,240)
印尼盾	275,566	-9.6	(26,454)
日元	213,246	-0.9	(1,919)
韩元	3	+3.3	0
墨西哥比索	132,510	-2.9	(3,843)
纽元	7,643,898	-8.3	(634,444)
挪威克朗	1,234	-2.2	(27)
波兰兹罗提	186,305	-1.1	(2,049)
英镑	324,226	-2.8	(9,078)
瑞典克朗	188,424	-8.2	(15,451)
土耳其里拉	176	-40.8	(72)
	<u>129,901,757</u>		<u>(6,063,054)</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或应收经纪款项等应收款项未发生历史违约，故管理人认为该等应收款项不存在重大信贷风险。总体而言，由于该等工具违约风险较低，且本基金交易对手均有足够能力在短期内履行其合同义务，故管理人认为违约概率近乎零。因此，未对十二个月内的预期信贷损失确认损失准备金。

截至九月三十日，在信用增级前本基金的最高信贷风险承担列示如下：

	2019 美元	2018 美元
银行现金	22,744,035	6,526,585
应收经纪款项	3,964,578	1,745,010
分配应收款项	22,449,089	2,092,666
保证金	322,843	146,765
经纪发行的衍生性产品	7,734,263	1,952,678
投资 - 债务证券	735,843,222	252,642,845
利息及其他应收款项	13,138	5,210
	<u>793,071,168</u>	<u>265,111,759</u>

所有上市交易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收取款项后始交付有关投资，所以违约风险极低。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。

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

下表概述截至九月三十日按照信贷评级的债务证券。

	2019 占资产净值百分比	2018 占资产净值百分比
标准普尔(AAA)/穆迪(Aaa)/惠誉(AAA)	26.4	23.4
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	10.9	11.3
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	22.8	25.7
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	7.3	8.9
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	0.1	0.3
未评级	3.9	1.3
	<u>71.4</u>	<u>70.9</u>

截至九月三十日，按照发行机构的信贷评级，下表概述上述未评级债务证券。

	2019 占资产净值百分比	2018 占资产净值百分比
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	3.7	1.3
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	0.2	-
	<u>3.9</u>	<u>1.3</u>

下表概述本基金截至九月三十日存放金融资产的银行／经纪／托管的信贷评级。

	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		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	22,742,487	6,525,027
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	1,548	1,558
存放经纪之保证金及经纪持有／发行的衍生性产品		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	1,289,188	1,272,465
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	7,060,385	1,169,294
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	-	31,843
托管机构的投资余额		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	<u>1,009,125,661</u>	<u>354,635,265</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，按九月三十日距离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	22,995,931	-	2,798,250	-
赎回应付款项	5,548,291	-	5,549,991	-
应付收益分配	2,860,807	-	1,230,002	-
衍生性产品	3,400,749	221,380	1,545,469	211,053
其他应付款项	820,523	-	298,750	-
可赎回份额持有人应占净资产	1,030,798,393	-	355,844,823	-
总金融负债	1,066,424,694	221,380	367,267,285	211,053

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 金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	净额 美元
<u>2019</u>				
<u>资产</u>				
保证金	322,843	-	-	322,843
衍生性产品	4,895,077	(1,621,325)	-	3,273,752
按公允价值透过损益 列账的金融资产	<u>5,217,920</u>	<u>(1,621,325)</u>	<u>-</u>	<u>3,596,595</u>
	财务状况表中列示的经确认 金融负债总额 美元	受总抵销安排及类似协议规限的相关金额 金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	净额 美元
<u>2019</u>				
<u>负债</u>				
衍生性产品	2,409,102	(1,621,325)	-	787,777
投资 - 短仓	-	-	-	-
按公允价值透过损益 列账的金融负债	<u>2,409,102</u>	<u>(1,621,325)</u>	<u>-</u>	<u>787,777</u>
	财务状况表中列示的经确认 金融资产总额 美元	受总抵销安排及类似协议规限的相关金额 金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	净额 美元
<u>2018</u>				
<u>资产</u>				
保证金	146,765	-	(143,064)	3,701
衍生性产品	521,511	(75,896)	-	445,615
按公允价值透过损益 列账的金融资产	<u>668,276</u>	<u>(75,896)</u>	<u>(143,064)</u>	<u>449,316</u>
	财务状况表中列示的经确认 金融负债总额 美元	受总抵销安排及类似协议规限的相关金额 金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	净额 美元
<u>2018</u>				
<u>负债</u>				
衍生性产品	814,649	(218,960)	-	595,689
按公允价值透过损益 列账的金融负债	<u>814,649</u>	<u>(218,960)</u>	<u>-</u>	<u>595,689</u>

(II) 资本风险管理

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

为了维持资本结构，本基金的政策执行如下：

- 监测相对于流动性资产的分配和赎回活动。
- 为了保护份额持有人在特殊情况下的利益，管理人亦可将任何一个交易日之赎回份额总数限制为本基金已发行份额的百分之十或更高。
- 按照宪制性文件，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允价值：

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>				
债务证券	-	735,843,222	-	735,843,222
集体投资计划	273,282,439	-	-	273,282,439
衍生性产品	292,467	7,734,263	-	8,026,730
按公允价值透过损益列账的总金融资产	<u>273,574,906</u>	<u>743,577,485</u>	-	<u>1,017,152,391</u>
<u>负债</u>				
衍生性产品	137,441	3,484,688	-	3,622,129
按公允价值透过损益列账的总金融负债	<u>137,441</u>	<u>3,484,688</u>	-	<u>3,622,129</u>

2018

资产

债务证券	-	252,642,845	-	252,642,845
集体投资计划	101,992,420	-	-	101,992,420
衍生性产品	374,159	1,952,678	-	2,326,837
按公允价值透过损益列账的总金融资产	102,366,579	254,595,523	-	356,962,102

负债

衍生性产品	143,064	1,613,458	-	1,756,522
按公允价值透过损益列账的总金融负债	143,064	1,613,458	-	1,756,522

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

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

被分类为第三层次的投资，由于其交易次数疏落，故此有显著的不可观察输入值。

截至二零一九年及二零一八年九月三十日止年度，公允价值层次之间并无转移。

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，其账面价值为其公允值的合理约数。

5 投资及衍生性产品净收益

	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	35,138,246	(8,590,665)
投资及衍生性产品销售之实现收益	12,591,595	9,125,185
	47,729,841	534,520

6 收益分配

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 0.0248	5,208,945.740	(91,558)	
加元对冲类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	加元 0.0206	2,488,376.432	(39,033)	
港元类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	港元 0.0273	68,950,814.918	(240,115)	
纽元对冲类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	纽元 0.0248	1,842,668.161	(29,841)	
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 0.0438	52,283,574.462	(328,332)	
美元类别（每月派息）	2018年10月31日	2018年11月8日	美元 0.0270	16,521,787.463	(446,088)	
澳元对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	澳元 0.0235	5,639,885.899	(96,785)	
加元对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	加元 0.0218	3,214,328.850	(52,722)	
港元类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	港元 0.0273	86,067,503.051	(300,245)	
纽元对冲类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	纽元 0.0236	2,916,571.008	(47,280)	
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 0.0359	56,955,717.745	(293,955)	
美元类别（每月派息）	2018年11月30日	2018年12月10日	美元 0.0270	19,031,159.156	(513,841)	
澳元对冲类别（每月派息）	2018年12月28日	2019年1月9日	澳元 0.0221	5,801,567.522	(90,218)	
加元对冲类别（每月派息）	2018年12月28日	2019年1月9日	加元 0.0192	3,327,247.662	(46,852)	
港元类别（每月派息）	2018年12月28日	2019年1月9日	港元 0.0272	86,548,770.886	(300,649)	
纽元对冲类别（每月派息）	2018年12月28日	2019年1月9日	纽元 0.0227	2,980,206.115	(45,285)	
人民币对冲类别（每月派息）	2018年12月28日	2019年1月9日	人民币 0.0323	57,434,400.921	(269,469)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2019 美元	2018 美元
美元类别 (每月派息)	2018年12月28日	2019年1月9日	美元 0.0270	18,978,940.743	(512,431)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	澳元 0.0222	7,226,645.355	(116,979)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	加元 0.0190	3,121,952.763	(45,166)	
港元类别 (每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	港元 0.0273	108,332,356.428	(376,907)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	纽元 0.0213	2,404,956.709	(35,530)	
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 0.0286	61,461,515.998	(262,053)	
美元类别 (每月派息)	2019年1月31日	2019年2月13日	美元 0.0270	23,593,366.998	(637,022)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	澳元 0.0226	7,717,364.772	(124,086)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	加元 0.0205	2,778,218.197	(43,245)	
港元类别 (每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	港元 0.0273	108,920,739.209	(378,804)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	纽元 0.0213	2,360,575.362	(34,266)	
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 0.0226	65,298,490.918	(220,418)	
美元类别 (每月派息)	2019年2月28日	2019年3月8日	美元 0.0270	22,376,917.599	(604,177)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	澳元 0.0223	6,861,820.520	(108,697)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	加元 0.0197	2,692,992.704	(39,711)	
港元类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	港元 0.0273	99,104,588.340	(344,659)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	纽元 0.0214	2,401,232.659	(35,046)	
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 0.0257	56,910,980.993	(217,630)	
美元类别 (每月派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	美元 0.0270	21,852,211.540	(590,010)	
美元类别 (每半年派息)	2019年3月29日	2019年4月9日	美元 0.3770	438,406.016	(165,279)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	澳元 0.0258	7,156,306.904	(129,954)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	加元 0.0246	2,922,136.123	(53,438)	
港元类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	港元 0.0324	91,525,008.476	(377,981)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	纽元 0.0266	2,506,408.975	(44,463)	
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 0.0315	55,801,563.134	(260,745)	
美元类别 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	美元 0.0320	20,962,165.411	(670,789)	
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 0.0326	49,362.170	(239)	
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 0.0327	961,247.720	(4,663)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年4月30日	2019年5月9日	美元 0.0328	138,604.190	(4,546)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	澳元 0.0248	7,132,692.996	(122,559)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	加元 0.0245	3,116,110.674	(56,472)	
港元类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	港元 0.0324	96,419,996.762	(398,442)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	纽元 0.0255	2,754,083.571	(45,779)	
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 0.0331	58,983,152.641	(281,595)	
美元类别 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	美元 0.0320	22,762,985.672	(728,416)	
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 0.0338	1,733,966.990	(8,453)	
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 0.0344	4,474,310.790	(22,200)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年5月31日	2019年6月11日	美元 0.0328	1,056,895.680	(34,666)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	澳元 0.0234	7,154,710.958	(117,487)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	加元 0.0244	3,585,630.756	(66,952)	
港元类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	港元 0.0323	89,609,461.572	(370,481)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	纽元 0.0258	3,099,702.483	(53,713)	
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 0.0345	60,393,143.187	(303,152)	
美元类别 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	美元 0.0320	23,458,573.036	(750,675)	
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 0.0336	2,834,270.360	(13,856)	
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 0.0358	9,169,455.770	(47,762)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年6月28日	2019年7月9日	美元 0.0328	1,678,298.740	(55,048)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	澳元 0.0213	6,834,597.410	(100,339)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	加元 0.0248	3,350,826.867	(63,283)	
港元类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	港元 0.0323	92,353,717.034	(381,076)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	纽元 0.0252	2,775,754.066	(46,166)	
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 0.0312	61,925,942.408	(280,362)	
美元类别 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	美元 0.0320	22,780,346.677	(728,971)	
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 0.0335	3,147,697.480	(15,301)	
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 0.0324	15,328,950.550	(72,069)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年7月31日	2019年8月8日	美元 0.0328	2,633,257.340	(86,371)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	澳元 0.0212	7,257,353.058	(103,660)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	加元 0.0261	3,330,416.771	(65,415)	
港元类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	港元 0.0324	105,241,287.830	(435,184)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	纽元 0.0238	4,291,222.316	(64,414)	
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 0.0370	67,689,853.147	(349,941)	
美元类别 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	美元 0.0320	28,710,313.479	(918,731)	
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 0.0344	8,468,442.800	(40,703)	
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 0.0384	19,375,002.240	(103,954)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年8月30日	2019年9月9日	美元 0.0328	3,637,344.070	(119,305)	

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 0.0221	7,440,929.935	(110,910)	
加元对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	加元 0.0271	4,229,846.688	(86,578)	
港元类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	港元 0.0323	120,137,630.856	(494,993)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	纽元 0.0232	4,569,936.376	(66,481)	
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 0.0400	71,760,161.447	(401,950)	
美元类别 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元 0.0320	34,559,701.361	(1,105,910)	
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 0.0346	12,004,221.160	(58,162)	
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 0.0416	23,060,566.640	(134,336)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元 0.0328	4,251,185.920	(139,439)	
美元类别 (每半年派息)	2019年9月30日	2019年10月10日	美元 0.4479	585,059.950	(262,048)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	澳元 0.0286	6,091,802.435		(133,587)
加元对冲类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	加元 0.0224	2,337,995.901		(40,626)
港元类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	港元 0.0252	66,811,020.942		(215,801)
纽元对冲类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	纽元 0.0310	1,845,324.625		(39,188)
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 0.0423	72,221,573.601		(460,666)
美元类别 (每月派息)	2017年10月31日	2017年11月8日	美元 0.0250	21,371,309.352		(534,283)
澳元对冲类别 (每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	澳元 0.0280	6,018,672.371		(127,934)
加元对冲类别 (每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	加元 0.0223	2,205,124.936		(38,170)
港元类别 (每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	港元 0.0252	62,841,524.933		(202,761)
纽元对冲类别 (每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	纽元 0.0309	1,905,123.832		(40,398)
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 0.0424	69,389,736.792		(444,917)
美元类别 (每月派息)	2017年11月30日	2017年12月8日	美元 0.0250	20,395,625.196		(509,891)
澳元对冲类别 (每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	澳元 0.0265	5,895,607.146		(122,198)
加元对冲类别 (每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	加元 0.0188	2,086,264.733		(31,304)
港元类别 (每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	港元 0.0252	59,866,457.070		(192,987)
纽元对冲类别 (每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	纽元 0.0297	1,897,050.569		(40,071)
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 0.0430	68,651,014.026		(453,312)
美元类别 (每月派息)	2017年12月29日	2018年1月9日	美元 0.0250	19,273,492.391		(481,837)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	澳元 0.0255	5,089,637.743		(105,094)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	加元 0.0195	1,931,687.858		(30,703)
港元类别 (每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	港元 0.0252	51,146,108.143		(164,788)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	纽元 0.0289	1,625,880.647		(34,776)
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 0.0412	63,615,707.736		(416,403)
美元类别 (每月派息)	2018年1月31日	2018年2月8日	美元 0.0250	17,420,237.037		(435,506)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	澳元 0.0261	5,016,351.782		(102,025)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	加元 0.0219	1,775,582.353		(30,347)
港元类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	港元 0.0252	50,293,992.413		(161,963)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	纽元 0.0282	1,630,687.042		(33,213)
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 0.0419	58,549,495.978		(387,592)
美元类别 (每月派息)	2018年2月28日	2018年3月8日	美元 0.0250	18,544,163.444		(463,604)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	澳元 0.0245	4,851,226.880		(91,168)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	加元 0.0188	1,874,239.336		(27,330)
港元类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	港元 0.0253	44,618,165.315		(143,832)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	纽元 0.0273	833,732.157		(16,420)
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 0.0415	55,446,416.454		(366,169)
美元类别 (每月派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	美元 0.0250	18,494,971.794		(462,374)
美元类别 (每半年派息)	2018年3月29日	2018年4月11日	美元 0.3409	554,542.414		(189,044)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	澳元 0.0245	4,605,016.070		(85,164)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	加元 0.0190	1,971,682.585		(29,223)
港元类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	港元 0.0253	49,743,791.922		(160,357)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	纽元 0.0262	754,190.420		(13,923)
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 0.0359	52,368,310.493		(297,517)
美元类别 (每月派息)	2018年4月30日	2018年5月9日	美元 0.0250	17,226,473.317		(430,662)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	澳元 0.0244	4,378,679.428		(80,840)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	加元 0.0193	1,971,310.708		(29,330)
港元类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	港元 0.0253	44,161,403.740		(142,435)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	纽元 0.0262	737,599.191		(13,559)
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 0.0387	47,459,735.398		(286,739)
美元类别 (每月派息)	2018年5月31日	2018年6月8日	美元 0.0250	14,483,331.320		(362,083)
澳元对冲类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	澳元 0.0238	4,154,430.606		(73,054)
加元对冲类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	加元 0.0181	1,761,444.281		(24,237)
港元类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	港元 0.0253	41,101,687.377		(132,545)
纽元对冲类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	纽元 0.0249	700,811.786		(11,815)
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 0.0385	45,974,829.457		(267,062)
美元类别 (每月派息)	2018年6月29日	2018年7月10日	美元 0.0250	14,110,369.142		(352,759)

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7月31日	2018年8月8日	澳元 0.0268	4,433,525.374		(88,330)
加元对冲类别（每月派息）	2018年7月31日	2018年8月8日	加元 0.0215	1,989,182.422		(32,847)
港元类别（每月派息）	2018年7月31日	2018年8月8日	港元 0.0274	39,906,462.390		(139,342)
纽元对冲类别（每月派息）	2018年7月31日	2018年8月8日	纽元 0.0274	799,715.843		(14,918)
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 0.0339	45,537,638.618		(226,512)
美元类别（每月派息）	2018年7月31日	2018年8月8日	美元 0.0270	13,899,610.507		(375,289)
澳元对冲类别（每月派息）	2018年8月31日	2018年9月10日	澳元 0.0258	4,493,240.972		(83,837)
加元对冲类别（每月派息）	2018年8月31日	2018年9月10日	加元 0.0220	1,968,790.343		(33,217)
港元类别（每月派息）	2018年8月31日	2018年9月10日	港元 0.0273	52,161,140.253		(181,427)
纽元对冲类别（每月派息）	2018年8月31日	2018年9月10日	纽元 0.0278	1,303,705.242		(24,047)
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 0.0299	53,088,597.403		(232,337)
美元类别（每月派息）	2018年8月31日	2018年9月10日	美元 0.0270	14,543,725.677		(392,681)
澳元对冲类别（每月派息）	2018年9月28日	2018年10月9日	澳元 0.0264	4,709,980.158		(89,969)
加元对冲类别（每月派息）	2018年9月28日	2018年10月9日	加元 0.0210	1,946,638.084		(31,625)
港元类别（每月派息）	2018年9月28日	2018年10月9日	港元 0.0273	56,629,682.098		(197,573)
纽元对冲类别（每月派息）	2018年9月28日	2018年10月9日	纽元 0.0269	1,209,710.812		(21,573)
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 0.0370	51,912,156.326		(279,366)
美元类别（每月派息）	2018年9月28日	2018年10月9日	美元 0.0270	15,904,555.624		(429,423)
美元类别（每半年派息）	2018年9月28日	2018年10月9日	美元 0.3547	508,804.647		(180,473)
可赎回份额持有人的总收益分配					(19,984,963)	(13,620,372)

7 税项

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

截至二零一九年及二零一八年九月三十日止年度，已就若干收取的利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：

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

截至二零一九年及二零一八年九月三十日止年度，综合收益表中的股息收入为 4,915,646 美元（二零一八年：1,633,687 美元），为管理人或其关联人士发行和管理的集体投资计划的投资分配。

公司名称	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>					
JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l.	231,766,659	13.99	-	-	-
J.P. Morgan Securities plc London	15,072,546*	0.91	100	1.46	0.00
<u>2018</u>					
JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l.	112,143,596	10.79	-	-	-
J.P. Morgan Securities plc London	58,691,248*	5.65	949	10.98	-

* 上述金额包含总计 12,497,464 美元的期货交易（二零一八年：56,218,406 美元）。

(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	22,742,487	6,525,028
保证金	-	146,765
应收款项	8,000	-
应付款项	(11,984,023)	(244,605)

于二零一九年九月三十日，本基金的投资结余 273,282,439 美元（二零一八年：101,992,420 美元），为管理人之关联人士发行和管理的集体投资计划的投资。

于二零一九年九月三十日，本基金的投资结余 1,009,125,661 美元（二零一八年：354,635,265 美元），为托管人摩根大通银行（管理人的关联人士）持有的投资。

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 78,404 美元（二零一八年：20,615 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 2,527 美元（二零一八年：2,027 美元）。
- (e) 支付给摩根基金（亚洲）有限公司之管理费按本基金资产净值的年率百分之零点八计算。此管理费于每个交易日累计，并于每月月底支付。如果本基金投资管理人或其关联人管理的集体投资计划，在考虑针对该集体投资计划中归属于本基金的利益已征收的管理费以后，相应减少支付给管理人的管理费用。
- (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率为本基金资产净值的年率介乎百分之零点零一至百分之零点五不等。基金注册登记机构费用于每季季末支付。

9 受托人费用

受托人费用按本基金资产净值百分之零点零一八的年率支付。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，本基金的无抵押短期银行借款之长期均在 7 天内。

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

(a) 以下为截至九月三十日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／ (亏损) 美元
<u>2019</u>			
未平仓合约：			
澳元 483,069	美元 328,250	2019 年 10 月 2 日	2,420
澳元 178,224	美元 120,371	2019 年 10 月 2 日	159
纽元 296,891	美元 187,760	2019 年 10 月 2 日	1,580
纽元 584,190	美元 366,974	2019 年 10 月 2 日	628
美元 8,527	加元 11,308	2019 年 10 月 2 日	13
澳元 1,539,337	美元 1,059,132	2019 年 10 月 3 日	20,849
澳元 26,786,002	美元 18,083,953	2019 年 10 月 3 日	16,795
澳元 581,528	美元 396,921	2019 年 10 月 3 日	4,681
澳元 1,867,300	美元 1,263,949	2019 年 10 月 3 日	4,455
澳元 70,000	美元 47,305	2019 年 10 月 3 日	90
加元 2,778,291	美元 2,108,021	2019 年 10 月 3 日	9,615
加元 2,290,666	美元 1,730,225	2019 年 10 月 3 日	115
欧元 61,774,813	美元 68,570,950	2019 年 10 月 3 日	1,217,872
欧元 61,774,000	美元 68,570,048	2019 年 10 月 3 日	1,217,856
欧元 24,658,788	美元 27,376,830	2019 年 10 月 3 日	491,353
欧元 6,167,781	美元 6,844,663	2019 年 10 月 3 日	119,931
欧元 5,323,261	美元 5,888,864	2019 年 10 月 3 日	84,912
欧元 3,075,172	美元 3,425,200	2019 年 10 月 3 日	72,340
欧元 4,546,836	美元 5,020,884	2019 年 10 月 3 日	63,469
欧元 3,634,067	美元 4,010,509	2019 年 10 月 3 日	48,286
欧元 2,755,573	美元 3,045,458	2019 年 10 月 3 日	41,057
欧元 1,288,408	美元 1,432,654	2019 年 10 月 3 日	27,902
欧元 651,313	美元 722,958	2019 年 10 月 3 日	12,831
欧元 516,134	美元 574,882	2019 年 10 月 3 日	12,142
欧元 520,000	美元 574,581	2019 年 10 月 3 日	7,625
日元 14,959,364,266	美元 141,136,810	2019 年 10 月 3 日	2,711,206
日元 417,213,344	美元 3,955,260	2019 年 10 月 3 日	94,602
日元 437,905,940	美元 4,132,386	2019 年 10 月 3 日	80,249

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
日元 611,773,455	美元 5,737,316	2019年10月3日	76,306
日元 284,168,358	美元 2,679,528	2019年10月3日	49,993
日元 276,516,248	美元 2,603,718	2019年10月3日	44,992
日元 410,511,902	美元 3,832,095	2019年10月3日	33,447
日元 152,164,793	美元 1,441,320	2019年10月3日	33,272
日元 88,939,177	美元 842,735	2019年10月3日	19,741
日元 700,513,890	美元 6,496,719	2019年10月3日	14,554
日元 292,587,644	美元 2,716,187	2019年10月3日	8,744
日元 502,819,940	美元 4,653,305	2019年10月3日	490
纽元 848,148	美元 538,572	2019年10月3日	6,698
纽元 80,000	美元 50,429	2019年10月3日	261
英镑 583,283	美元 726,809	2019年10月3日	8,029
英镑 790,725	美元 981,699	2019年10月3日	7,288
英镑 926,467	美元 1,144,313	2019年10月3日	2,629
波兰兹罗提 4,837,696	美元 1,222,488	2019年10月3日	15,810
瑞典克朗 7,388,836	美元 760,987	2019年10月3日	9,440
美元 34,210,926	英镑 27,800,561	2019年10月3日	47,706
美元 31,636,757	加元 41,898,551	2019年10月3日	8,674
美元 1,204,949	波兰兹罗提 4,837,696	2019年10月3日	1,730
美元 531,376	纽元 848,148	2019年10月3日	498
美元 2,624,775	泰铢 80,292,116	2019年10月3日	489
澳元 74,723	美元 50,618	2019年10月4日	217
加元 1,023,469	美元 773,415	2019年10月4日	402
美元 229,641	纽元 366,220	2019年10月4日	15
美元 7,670	加元 10,155	2019年10月4日	1
离岸人民币 18,312,341	美元 2,573,516	2019年10月8日	9,193
离岸人民币 6,414,393	日元 97,761,023	2019年10月8日	6,694
离岸人民币 6,639,165	美元 935,783	2019年10月8日	6,084
离岸人民币 4,678,718	美元 660,205	2019年10月8日	5,033
离岸人民币 8,737,452	美元 1,227,087	2019年10月8日	3,560
离岸人民币 2,329,159	美元 327,357	2019年10月8日	1,200
离岸人民币 758,000	美元 106,535	2019年10月8日	390
离岸人民币 1,596,001	美元 223,879	2019年10月8日	387
离岸人民币 1,538,881	美元 215,752	2019年10月8日	259
离岸人民币 251,600	美元 35,362	2019年10月8日	130
离岸人民币 71,233	美元 9,992	2019年10月8日	17
欧元 1,088,353	美元 1,190,157	2019年10月8日	3,091
日元 97,761,023	美元 906,088	2019年10月8日	1,166
美元 1,623,191	离岸人民币 11,636,686	2019年10月8日	6,323
美元 909,955	离岸人民币 6,529,500	2019年10月8日	4,386
美元 776,229	离岸人民币 5,563,567	2019年10月8日	2,851
离岸人民币 1,804,010	美元 252,972	2019年10月9日	352
离岸人民币 122,704	美元 17,211	2019年10月9日	29
离岸人民币 1,474,204	美元 206,760	2019年10月10日	329
离岸人民币 150,750	美元 21,143	2019年10月10日	34
离岸人民币 849,615	美元 119,397	2019年10月11日	430
离岸人民币 309,296	美元 43,465	2019年10月11日	156
澳元 1,092,150	美元 744,897	2019年10月21日	7,804
澳元 1,092,141	美元 743,393	2019年10月21日	6,307
澳元 379,931	美元 261,422	2019年10月21日	5,006
澳元 377,793	美元 258,881	2019年10月21日	3,908
澳元 267,917	美元 184,007	2019年10月21日	3,190
澳元 245,054	美元 168,210	2019年10月21日	2,823

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
澳元 179,875	美元 123,803	2019年10月21日	2,405
澳元 189,303	美元 130,138	2019年10月21日	2,377
澳元 196,674	美元 135,098	2019年10月21日	2,363
澳元 1,350,521	美元 913,175	2019年10月21日	1,708
澳元 122,145	美元 84,052	2019年10月21日	1,617
澳元 1,254,815	美元 848,098	2019年10月21日	1,223
澳元 89,708	美元 61,440	2019年10月21日	896
澳元 52,725	美元 36,338	2019年10月21日	755
澳元 60,606	美元 41,605	2019年10月21日	702
澳元 52,262	美元 35,900	2019年10月21日	628
澳元 46,100	美元 31,720	2019年10月21日	608
澳元 116,188	美元 79,011	2019年10月21日	595
澳元 104,789	美元 71,246	2019年10月21日	523
澳元 166,251	美元 112,726	2019年10月21日	523
澳元 22,833	美元 15,673	2019年10月21日	263
澳元 153,856	美元 104,082	2019年10月21日	244
澳元 14,697	美元 10,091	2019年10月21日	172
澳元 12,397	美元 8,530	2019年10月21日	163
澳元 9,723	美元 6,677	2019年10月21日	115
澳元 34,204	美元 23,139	2019年10月21日	54
澳元 8,759	美元 5,955	2019年10月21日	44
澳元 2,132	美元 1,469	2019年10月21日	30
澳元 2,634	美元 1,804	2019年10月21日	26
澳元 3,154	美元 2,151	2019年10月21日	23
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 1,772	美元 1,216	2019年10月21日	21
澳元 3,704	美元 2,521	2019年10月21日	21
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	19
澳元 1,604	美元 1,099	2019年10月21日	16
澳元 3,384	美元 2,294	2019年10月21日	10
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 1,624	美元 1,104	2019年10月21日	8
澳元 1,618	美元 1,097	2019年10月21日	5
澳元 1,618	美元 1,097	2019年10月21日	5
澳元 1,624	美元 1,101	2019年10月21日	5
澳元 1,627	美元 1,103	2019年10月21日	5
澳元 1,635	美元 1,106	2019年10月21日	3
澳元 1,619	美元 1,094	2019年10月21日	2
加元 173,348	美元 131,520	2019年10月21日	563
加元 110,885	美元 84,282	2019年10月21日	513
加元 86,362	美元 65,745	2019年10月21日	502
加元 37,512	美元 28,486	2019年10月21日	148
加元 56,461	美元 42,799	2019年10月21日	145
加元 24,637	美元 18,743	2019年10月21日	131
加元 239,418	美元 180,970	2019年10月21日	99
加元 10,903	美元 8,292	2019年10月21日	55
加元 175,324	美元 132,489	2019年10月21日	39
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 6,959	美元 5,259	2019年10月21日	2
离岸人民币 13,154,810	美元 1,847,056	2019年10月21日	5,574

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 3,515,276	美元 497,395	2019年10月21日	5,308
离岸人民币 2,753,948	美元 389,734	2019年10月21日	4,221
离岸人民币 1,671,419	美元 237,461	2019年10月21日	3,487
离岸人民币 5,028,886	美元 706,098	2019年10月21日	2,127
离岸人民币 5,263,364	美元 738,918	2019年10月21日	2,124
离岸人民币 2,274,392	美元 320,298	2019年10月21日	1,916
离岸人民币 3,447,935	美元 484,339	2019年10月21日	1,678
离岸人民币 1,512,021	美元 213,228	2019年10月21日	1,567
离岸人民币 1,140,804	美元 161,098	2019年10月21日	1,402
离岸人民币 999,412	美元 141,108	2019年10月21日	1,205
离岸人民币 1,193,983	美元 168,222	2019年10月21日	1,082
离岸人民币 1,826,551	美元 256,653	2019年10月21日	963
离岸人民币 1,842,850	美元 258,928	2019年10月21日	956
离岸人民币 2,209,301	美元 310,206	2019年10月21日	936
离岸人民币 1,480,523	美元 208,166	2019年10月21日	915
离岸人民币 1,689,520	美元 237,402	2019年10月21日	894
离岸人民币 779,581	美元 109,931	2019年10月21日	801
离岸人民币 853,668	美元 120,275	2019年10月21日	774
离岸人民币 1,487,513	美元 208,954	2019年10月21日	724
离岸人民币 1,543,922	美元 216,781	2019年10月21日	654
离岸人民币 571,205	美元 80,614	2019年10月21日	654
离岸人民币 527,279	美元 74,447	2019年10月21日	635
离岸人民币 500,388	美元 70,662	2019年10月21日	615
离岸人民币 1,110,563	美元 156,032	2019年10月21日	570
离岸人民币 1,098,028	美元 154,268	2019年10月21日	560
离岸人民币 1,364,092	美元 191,503	2019年10月21日	550
离岸人民币 1,040,046	美元 146,097	2019年10月21日	506
离岸人民币 1,033,203	美元 145,131	2019年10月21日	498
离岸人民币 938,918	美元 131,887	2019年10月21日	452
离岸人民币 361,392	美元 51,034	2019年10月21日	444
离岸人民币 818,922	美元 115,062	2019年10月21日	425
离岸人民币 676,103	美元 95,062	2019年10月21日	418
离岸人民币 352,666	美元 49,772	2019年10月21日	404
离岸人民币 356,586	美元 50,283	2019年10月21日	366
离岸人民币 1,430,989	美元 200,657	2019年10月21日	340
离岸人民币 312,730	美元 44,099	2019年10月21日	321
离岸人民币 568,896	美元 79,932	2019年10月21日	295
离岸人民币 451,832	美元 63,529	2019年10月21日	279
离岸人民币 912,637	美元 127,973	2019年10月21日	217
离岸人民币 380,052	美元 53,399	2019年10月21日	197
离岸人民币 371,995	美元 52,270	2019年10月21日	197
离岸人民币 103,287	美元 14,617	2019年10月21日	158
离岸人民币 292,742	美元 41,129	2019年10月21日	149
离岸人民币 211,636	美元 29,738	2019年10月21日	112
离岸人民币 67,558	美元 9,561	2019年10月21日	104
离岸人民币 404,428	美元 56,709	2019年10月21日	95
离岸人民币 92,093	美元 12,987	2019年10月21日	95
离岸人民币 42,604	美元 6,052	2019年10月21日	89
离岸人民币 158,468	美元 22,267	2019年10月21日	83
离岸人民币 79,569	美元 11,221	2019年10月21日	82
离岸人民币 93,186	美元 13,123	2019年10月21日	79
离岸人民币 36,452	美元 5,179	2019年10月21日	76
离岸人民币 111,922	美元 15,727	2019年10月21日	59
离岸人民币 112,745	美元 15,842	2019年10月21日	59
离岸人民币 56,555	美元 7,975	2019年10月21日	59
离岸人民币 45,285	美元 6,394	2019年10月21日	54
离岸人民币 110,499	美元 15,521	2019年10月21日	53
离岸人民币 102,450	美元 14,395	2019年10月21日	53

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 99,908	美元 14,037	2019年10月21日	51
离岸人民币 92,332	美元 12,974	2019年10月21日	49
离岸人民币 58,234	美元 8,201	2019年10月21日	49
离岸人民币 42,167	美元 5,951	2019年10月21日	48
离岸人民币 237,751	美元 33,329	2019年10月21日	47
离岸人民币 29,822	美元 4,220	2019年10月21日	45
离岸人民币 98,431	美元 13,821	2019年10月21日	42
离岸人民币 18,228	美元 2,590	2019年10月21日	38
离岸人民币 66,836	美元 9,391	2019年10月21日	35
离岸人民币 37,935	美元 5,342	2019年10月21日	32
离岸人民币 61,217	美元 8,602	2019年10月21日	32
离岸人民币 61,549	美元 8,647	2019年10月21日	31
离岸人民币 28,239	美元 3,982	2019年10月21日	29
离岸人民币 23,850	美元 3,366	2019年10月21日	27
离岸人民币 25,154	美元 3,547	2019年10月21日	26
离岸人民币 22,565	美元 3,182	2019年10月21日	23
离岸人民币 14,615	美元 2,068	2019年10月21日	22
离岸人民币 15,046	美元 2,124	2019年10月21日	18
离岸人民币 32,728	美元 4,598	2019年10月21日	17
离岸人民币 7,784	美元 1,106	2019年10月21日	16
离岸人民币 7,784	美元 1,106	2019年10月21日	16
离岸人民币 7,784	美元 1,106	2019年10月21日	16
离岸人民币 30,820	美元 4,329	2019年10月21日	15
离岸人民币 9,672	美元 1,369	2019年10月21日	15
离岸人民币 29,851	美元 4,194	2019年10月21日	15
离岸人民币 24,029	美元 3,376	2019年10月21日	13
离岸人民币 10,567	美元 1,491	2019年10月21日	12
离岸人民币 9,195	美元 1,298	2019年10月21日	11
离岸人民币 18,930	美元 2,660	2019年10月21日	10
离岸人民币 20,106	美元 2,823	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 7,822	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 12,276	美元 1,726	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 7,805	美元 1,101	2019年10月21日	8
离岸人民币 7,805	美元 1,101	2019年10月21日	8
离岸人民币 7,805	美元 1,101	2019年10月21日	8
离岸人民币 35,349	美元 4,957	2019年10月21日	8
离岸人民币 8,120	美元 1,144	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 17,731	美元 2,489	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 12,571	美元 1,766	2019年10月21日	6
离岸人民币 13,204	美元 1,854	2019年10月21日	5
离岸人民币 9,735	美元 1,366	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 7,794	美元 1,095	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 7,843	美元 1,102	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,880	美元 1,107	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,843	美元 1,102	2019年10月21日	4
离岸人民币 7,843	美元 1,102	2019年10月21日	4
离岸人民币 14,851	美元 2,082	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 7,840	美元 1,099	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

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
纽元 1,340,955	美元 864,095	2019年10月21日	22,914
纽元 507,024	美元 323,314	2019年10月21日	5,258
纽元 408,168	美元 260,929	2019年10月21日	4,885
纽元 225,907	美元 145,416	2019年10月21日	3,705
纽元 203,703	美元 130,864	2019年10月21日	3,081
纽元 348,762	美元 221,492	2019年10月21日	2,714
纽元 222,887	美元 142,279	2019年10月21日	2,462
纽元 149,106	美元 95,871	2019年10月21日	2,337
纽元 121,249	美元 77,854	2019年10月21日	1,794
纽元 113,762	美元 73,080	2019年10月21日	1,717
纽元 96,510	美元 62,034	2019年10月21日	1,493
纽元 71,179	美元 45,759	2019年10月21日	1,108
纽元 102,131	美元 64,615	2019年10月21日	549
纽元 26,441	美元 16,986	2019年10月21日	400
纽元 31,351	美元 19,940	2019年10月21日	274
纽元 11,274	美元 7,264	2019年10月21日	192
纽元 32,840	美元 20,766	2019年10月21日	166
纽元 21,282	美元 13,444	2019年10月21日	94
纽元 4,574	美元 2,937	2019年10月21日	68
纽元 5,885	美元 3,743	2019年10月21日	51
纽元 8,247	美元 5,218	2019年10月21日	45
纽元 9,438	美元 5,952	2019年10月21日	32
纽元 1,857	美元 1,195	2019年10月21日	30
纽元 6,166	美元 3,896	2019年10月21日	27
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 2,088	美元 1,328	2019年10月21日	18
纽元 2,660	美元 1,683	2019年10月21日	14
纽元 1,731	美元 1,100	2019年10月21日	13
纽元 1,734	美元 1,098	2019年10月21日	11
纽元 1,744	美元 1,103	2019年10月21日	9
纽元 1,738	美元 1,097	2019年10月21日	7
纽元 1,745	美元 1,101	2019年10月21日	7
纽元 1,756	美元 1,105	2019年10月21日	3
美元 862,404	加元 1,149,586	2019年10月21日	6,059
美元 3,150,090	离岸人民币 22,539,890	2019年10月21日	5,169
美元 860,769	离岸人民币 6,185,530	2019年10月21日	5,117
美元 686,060	离岸人民币 4,934,690	2019年10月21日	4,726
美元 574,094	离岸人民币 4,129,342	2019年10月21日	3,955
美元 3,482,024	离岸人民币 24,894,730	2019年10月21日	2,877
美元 749,603	离岸人民币 5,373,010	2019年10月21日	2,542
美元 296,143	离岸人民币 2,130,100	2019年10月21日	2,040
美元 1,369,434	加元 1,815,144	2019年10月21日	1,831
美元 1,924,659	加元 2,550,000	2019年10月21日	1,759
美元 284,162	离岸人民币 2,042,000	2019年10月21日	1,689
美元 529,580	加元 702,844	2019年10月21日	1,387
美元 382,959	离岸人民币 2,744,979	2019年10月21日	1,298
美元 566,315	加元 751,279	2019年10月21日	1,245
美元 452,099	加元 600,000	2019年10月21日	1,176
美元 263,085	离岸人民币 1,885,641	2019年10月21日	877
美元 141,300	离岸人民币 1,015,369	2019年10月21日	837
美元 138,224	加元 183,922	2019年10月21日	722
美元 371,628	离岸人民币 2,659,721	2019年10月21日	694
美元 713,384	离岸人民币 5,100,000	2019年10月21日	542
美元 540,243	离岸人民币 3,862,562	2019年10月21日	460
美元 231,004	加元 306,302	2019年10月21日	394
美元 197,190	加元 261,539	2019年10月21日	392
美元 66,872	加元 88,784	2019年10月21日	200

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 61,460	加元 81,539	2019年10月21日	140
美元 75,462	离岸人民币 540,000	2019年10月21日	131
美元 75,266	加元 99,798	2019年10月21日	127
美元 54,861	加元 72,751	2019年10月21日	99
美元 79,360	加元 105,150	2019年10月21日	77
美元 22,243	澳元 33,018	2019年10月21日	41
美元 39,521	纽元 63,050	2019年10月21日	30
美元 60,117	加元 79,616	2019年10月21日	28
美元 274,086	澳元 406,154	2019年10月21日	27
美元 1,746	离岸人民币 12,549	2019年10月21日	10
美元 284,443	加元 376,525	2019年10月21日	6
澳元 32,125,539	美元 21,706,423	2019年11月5日	12,047
澳元 3,053,725	美元 2,064,379	2019年11月5日	2,199
澳元 1,490,100	美元 1,008,046	2019年11月5日	1,781
离岸人民币 152,270,120	美元 21,353,784	2019年11月5日	47,132
离岸人民币 21,958,600	美元 3,078,359	2019年11月5日	5,765
欧元 74,621,666	美元 81,739,043	2019年11月5日	177,562
欧元 101,252,959	美元 110,727,735	2019年11月5日	58,252
欧元 2,172,594	美元 2,398,653	2019年11月5日	24,007
欧元 2,591,178	美元 2,854,696	2019年11月5日	22,538
欧元 4,100,000	美元 4,494,605	2019年11月5日	13,305
欧元 3,800,000	美元 4,166,349	2019年11月5日	12,949
欧元 2,200,708	美元 2,417,656	2019年11月5日	12,282
欧元 2,092,448	美元 2,290,872	2019年11月5日	3,826
日元 18,962,360,398	美元 176,112,254	2019年11月5日	266,189
日元 585,353,582	美元 5,453,494	2019年11月5日	25,260
日元 472,514,035	美元 4,398,147	2019年11月5日	16,323
日元 313,678,150	美元 2,908,963	2019年11月5日	92
英镑 879,448	离岸人民币 7,814,892	2019年11月5日	8,317
英镑 467,863	美元 580,217	2019年11月5日	2,874
英镑 872,806	美元 1,078,867	2019年11月5日	1,824
墨西哥比索 39,777,483	美元 2,008,259	2019年11月5日	4,961
瑞典克朗 7,388,836	美元 754,842	2019年11月5日	1,663
离岸人民币 2,511,472	美元 351,289	2019年11月21日	14
离岸人民币 605,654	美元 84,715	2019年11月21日	4
美元 444,244	离岸人民币 3,176,887	2019年11月21日	100
美元 111,693	加元 147,791	2019年11月21日	16
美元 77,561	纽元 123,568	2019年11月21日	15
美元 22,083	澳元 32,688	2019年11月21日	1
		未实现总收益	7,734,263

加元 751,279	美元 566,138	2019年10月2日	(1,293)
加元 1,815,144	美元 1,369,037	2019年10月2日	(1,918)
美元 5,950	纽元 9,438	2019年10月2日	(31)
美元 912,544	澳元 1,350,521	2019年10月2日	(1,618)
澳元 1,351,372	美元 909,237	2019年10月3日	(2,264)
加元 824,758	美元 618,819	2019年10月3日	(4,110)
加元 36,004,836	美元 27,123,309	2019年10月3日	(70,676)
英镑 790,429	美元 969,986	2019年10月3日	(4,060)
英镑 922,676	美元 1,125,458	2019年10月3日	(11,556)
英镑 576,807	美元 695,262	2019年10月3日	(15,537)
英镑 1,324,328	美元 1,615,008	2019年10月3日	(16,961)
英镑 22,652,884	美元 27,652,387	2019年10月3日	(262,762)
墨西哥比索 39,777,483	美元 1,963,313	2019年10月3日	(51,012)
泰铢 52,960,143	美元 1,730,486	2019年10月3日	(1,120)
泰铢 27,331,973	欧元 811,519	2019年10月3日	(8,872)
美元 1,102	澳元 1,627	2019年10月3日	(5)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 1,101	纽元 1,745	2019年10月3日	(7)
美元 180,917	加元 239,418	2019年10月3日	(88)
美元 453,376	英镑 367,321	2019年10月3日	(725)
美元 753,228	瑞典克朗 7,388,836	2019年10月3日	(1,680)
美元 996,399	日元 107,149,902	2019年10月3日	(4,894)
美元 2,019,240	墨西哥比索 39,777,483	2019年10月3日	(4,916)
美元 498,006	英镑 399,716	2019年10月3日	(5,435)
美元 608,165	日元 64,968,657	2019年10月3日	(6,981)
美元 21,682,490	澳元 32,125,539	2019年10月3日	(13,813)
美元 110,459,830	欧元 101,252,959	2019年10月3日	(63,723)
美元 81,541,296	欧元 74,621,666	2019年10月3日	(181,277)
美元 175,734,824	日元 18,962,360,398	2019年10月3日	(267,712)
美元 1,095	澳元 1,624	2019年10月4日	(0)
澳元 32,688	美元 22,052	2019年10月8日	(0)
加元 147,791	美元 111,623	2019年10月8日	(10)
离岸人民币 6,323,132	美元 881,176	2019年10月8日	(4,268)
离岸人民币 8,562,845	美元 1,193,104	2019年10月8日	(5,973)
离岸人民币 27,000,000	美元 3,767,445	2019年10月8日	(13,432)
离岸人民币 8,581,355	欧元 1,088,353	2019年10月8日	(14,612)
离岸人民币 124,581,009	美元 17,401,587	2019年10月8日	(43,801)
纽元 123,568	美元 77,484	2019年10月8日	(6)
美元 1,099	离岸人民币 7,840	2019年10月8日	(1)
美元 2,083	离岸人民币 14,851	2019年10月8日	(3)
美元 127,999	离岸人民币 912,637	2019年10月8日	(200)
美元 200,699	离岸人民币 1,430,989	2019年10月8日	(314)
美元 734,671	离岸人民币 5,212,713	2019年10月8日	(4,722)
美元 922,677	离岸人民币 6,546,701	2019年10月8日	(5,926)
美元 1,468,666	离岸人民币 10,444,465	2019年10月8日	(6,101)
美元 576,190	离岸人民币 4,058,683	2019年10月8日	(7,842)
美元 1,006,867	离岸人民币 7,092,571	2019年10月8日	(13,676)
美元 1,483,750	离岸人民币 10,475,404	2019年10月8日	(16,853)
美元 21,364,618	离岸人民币 152,270,120	2019年10月8日	(41,854)
美元 1,100	离岸人民币 7,840	2019年10月9日	(2)
美元 4,958	离岸人民币 35,349	2019年10月9日	(8)
美元 14,399	离岸人民币 102,450	2019年10月9日	(52)
美元 53,413	离岸人民币 380,052	2019年10月9日	(194)
美元 84,812	离岸人民币 605,654	2019年10月10日	(3)
美元 1,102	离岸人民币 7,843	2019年10月10日	(4)
美元 4,195	离岸人民币 29,851	2019年10月10日	(15)
美元 1,096	离岸人民币 7,827	2019年10月11日	(0)
美元 2,072	离岸人民币 14,796	2019年10月11日	(0)
离岸人民币 3,594,174	美元 503,204	2019年10月15日	(13)
离岸人民币 3,176,887	美元 444,668	2019年10月15日	(125)
澳元 8,206	美元 5,538	2019年10月21日	(1)
澳元 4,897	美元 3,299	2019年10月21日	(6)
澳元 184,668	美元 124,609	2019年10月21日	(23)
澳元 110,142	美元 74,205	2019年10月21日	(130)
加元 1,782	美元 1,346	2019年10月21日	(0)
加元 1,459	美元 1,101	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 1,101	2019年10月21日	(2)
加元 1,463	美元 1,102	2019年10月21日	(3)
加元 4,076	美元 3,077	2019年10月21日	(3)
加元 3,255	美元 2,453	2019年10月21日	(6)
加元 5,941	美元 4,482	2019年10月21日	(6)
加元 1,465	美元 1,099	2019年10月21日	(8)
加元 11,308	美元 8,530	2019年10月21日	(13)
加元 11,370	美元 8,567	2019年10月21日	(23)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
加元 23,997	美元 18,099	2019年10月21日	(30)
加元 48,968	美元 36,922	2019年10月21日	(71)
加元 88,404	美元 66,611	2019年10月21日	(175)
加元 178,729	美元 134,813	2019年10月21日	(209)
加元 256,213	美元 193,239	2019年10月21日	(319)
加元 1,514,079	美元 1,135,968	2019年10月21日	(7,856)
离岸人民币 7,840	美元 1,099	2019年10月21日	(0)
离岸人民币 10,588	美元 1,481	2019年10月21日	(1)
离岸人民币 7,903	美元 1,105	2019年10月21日	(2)
离岸人民币 29,445	美元 4,119	2019年10月21日	(3)
离岸人民币 45,359	美元 6,345	2019年10月21日	(5)
离岸人民币 41,414	美元 5,788	2019年10月21日	(9)
离岸人民币 41,767	美元 5,837	2019年10月21日	(10)
离岸人民币 48,329	美元 6,753	2019年10月21日	(12)
离岸人民币 112,639	美元 15,756	2019年10月21日	(12)
离岸人民币 29,111	美元 4,062	2019年10月21日	(13)
离岸人民币 32,451	美元 4,527	2019年10月21日	(15)
离岸人民币 18,286	美元 2,542	2019年10月21日	(17)
离岸人民币 79,604	美元 11,126	2019年10月21日	(17)
离岸人民币 19,909	美元 2,768	2019年10月21日	(19)
离岸人民币 26,099	美元 3,632	2019年10月21日	(22)
离岸人民币 51,230	美元 7,129	2019年10月21日	(42)
离岸人民币 96,633	美元 13,482	2019年10月21日	(45)
离岸人民币 458,228	美元 64,099	2019年10月21日	(46)
离岸人民币 50,216	美元 6,982	2019年10月21日	(48)
离岸人民币 200,356	美元 27,997	2019年10月21日	(50)
离岸人民币 305,665	美元 42,717	2019年10月21日	(72)
离岸人民币 102,536	美元 14,269	2019年10月21日	(85)
离岸人民币 105,353	美元 14,661	2019年10月21日	(87)
离岸人民币 109,032	美元 15,159	2019年10月21日	(104)
离岸人民币 744,048	美元 103,981	2019年10月21日	(175)
离岸人民币 515,890	美元 71,790	2019年10月21日	(427)
离岸人民币 502,910	美元 69,919	2019年10月21日	(481)
离岸人民币 2,518,106	美元 351,873	2019年10月21日	(625)
离岸人民币 774,726	美元 107,809	2019年10月21日	(641)
离岸人民币 2,029,117	美元 283,098	2019年10月21日	(949)
离岸人民币 2,547,432	美元 355,439	2019年10月21日	(1,165)
离岸人民币 6,858,940	美元 953,593	2019年10月21日	(6,558)
纽元 4,190	美元 2,626	2019年10月21日	(2)
美元 1,560	离岸人民币 11,120	2019年10月21日	(3)
美元 1,803	离岸人民币 12,845	2019年10月21日	(5)
美元 2,084	离岸人民币 14,840	2019年10月21日	(6)
美元 717	离岸人民币 5,069	2019年10月21日	(8)
美元 1,876	澳元 2,767	2019年10月21日	(9)
美元 2,287	离岸人民币 16,259	2019年10月21日	(11)
美元 1,100	离岸人民币 7,774	2019年10月21日	(12)
美元 1,102	离岸人民币 7,784	2019年10月21日	(12)
美元 1,950	离岸人民币 13,839	2019年10月21日	(12)
美元 1,833	离岸人民币 12,993	2019年10月21日	(14)
美元 1,425	离岸人民币 10,072	2019年10月21日	(15)
美元 1,106	离岸人民币 7,784	2019年10月21日	(16)
美元 9,989	离岸人民币 71,233	2019年10月21日	(17)
美元 1,546	纽元 2,432	2019年10月21日	(21)
美元 1,579	纽元 2,476	2019年10月21日	(26)
美元 7,033	离岸人民币 50,060	2019年10月21日	(26)
美元 17,206	离岸人民币 122,704	2019年10月21日	(29)
美元 21,139	离岸人民币 150,750	2019年10月21日	(36)
美元 1,597	纽元 2,478	2019年10月21日	(42)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 3,665	澳元 5,338	2019年10月21日	(62)
美元 60,919	纽元 96,983	2019年10月21日	(82)
美元 47,332	澳元 70,000	2019年10月21日	(89)
美元 61,959	离岸人民币 441,769	2019年10月21日	(117)
美元 35,352	离岸人民币 251,600	2019年10月21日	(132)
美元 43,456	离岸人民币 309,296	2019年10月21日	(159)
美元 120,455	澳元 178,224	2019年10月21日	(172)
美元 92,144	离岸人民币 656,993	2019年10月21日	(175)
美元 21,233	澳元 31,194	2019年10月21日	(180)
美元 70,386	离岸人民币 501,469	2019年10月21日	(188)
美元 46,892	澳元 69,170	2019年10月21日	(209)
美元 31,077	纽元 49,200	2019年10月21日	(214)
美元 50,647	澳元 74,723	2019年10月21日	(216)
美元 53,476	纽元 84,901	2019年10月21日	(218)
美元 97,705	离岸人民币 696,102	2019年10月21日	(261)
美元 50,449	纽元 80,000	2019年10月21日	(265)
美元 47,225	离岸人民币 335,336	2019年10月21日	(283)
美元 215,708	离岸人民币 1,538,881	2019年10月21日	(287)
美元 97,042	澳元 143,326	2019年10月21日	(311)
美元 59,470	加元 78,287	2019年10月21日	(327)
美元 206,717	离岸人民币 1,474,204	2019年10月21日	(350)
美元 186,304	离岸人民币 1,328,361	2019年10月21日	(353)
美元 252,890	离岸人民币 1,804,010	2019年10月21日	(355)
美元 76,790	纽元 121,840	2019年10月21日	(360)
美元 223,798	离岸人民币 1,596,001	2019年10月21日	(381)
美元 106,506	离岸人民币 758,000	2019年10月21日	(397)
美元 64,933	纽元 102,877	2019年10月21日	(398)
美元 56,691	离岸人民币 402,018	2019年10月21日	(415)
美元 773,612	加元 1,023,469	2019年10月21日	(424)
美元 119,370	离岸人民币 849,615	2019年10月21日	(436)
美元 113,097	澳元 166,925	2019年10月21日	(439)
美元 89,930	离岸人民币 639,270	2019年10月21日	(442)
美元 127,054	离岸人民币 904,310	2019年10月21日	(464)
美元 136,974	加元 180,676	2019年10月21日	(480)
美元 29,170	澳元 42,500	2019年10月21日	(486)
美元 106,736	澳元 157,424	2019年10月21日	(490)
美元 74,046	加元 97,338	2019年10月21日	(511)
美元 153,214	离岸人民币 1,090,504	2019年10月21日	(559)
美元 194,443	离岸人民币 1,384,930	2019年10月21日	(574)
美元 215,009	离岸人民币 1,531,836	2019年10月21日	(574)
美元 166,823	离岸人民币 1,187,246	2019年10月21日	(626)
美元 127,895	离岸人民币 909,147	2019年10月21日	(628)
美元 95,968	加元 126,196	2019年10月21日	(633)
美元 90,454	离岸人民币 641,440	2019年10月21日	(662)
美元 105,515	离岸人民币 749,031	2019年10月21日	(662)
美元 90,613	离岸人民币 642,569	2019年10月21日	(663)
美元 367,129	纽元 584,190	2019年10月21日	(666)
美元 61,991	纽元 97,678	2019年10月21日	(717)
美元 64,485	纽元 101,543	2019年10月21日	(787)
美元 30,012	纽元 46,582	2019年10月21日	(791)
美元 80,935	纽元 127,750	2019年10月21日	(797)
美元 103,155	离岸人民币 730,967	2019年10月21日	(831)
美元 120,316	澳元 177,036	2019年10月21日	(835)
美元 368,684	澳元 545,031	2019年10月21日	(842)
美元 114,389	纽元 180,913	2019年10月21日	(902)
美元 146,299	离岸人民币 1,038,543	2019年10月21日	(918)
美元 142,920	澳元 210,264	2019年10月21日	(1,012)
美元 340,032	离岸人民币 2,420,724	2019年10月21日	(1,167)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 327,268	离岸人民币 2,329,159	2019年10月21日	(1,221)
美元 335,429	离岸人民币 2,387,400	2019年10月21日	(1,228)
美元 272,738	离岸人民币 1,938,766	2019年10月21日	(1,340)
美元 233,116	离岸人民币 1,654,841	2019年10月21日	(1,463)
美元 109,708	纽元 172,551	2019年10月21日	(1,466)
美元 248,853	纽元 394,344	2019年10月21日	(1,480)
美元 504,947	纽元 802,587	2019年10月21日	(1,483)
美元 72,582	澳元 105,317	2019年10月21日	(1,502)
美元 438,567	离岸人民币 3,122,200	2019年10月21日	(1,505)
美元 78,335	澳元 113,815	2019年10月21日	(1,520)
美元 549,875	离岸人民币 3,916,771	2019年10月21日	(1,584)
美元 187,839	纽元 296,891	2019年10月21日	(1,599)
美元 218,546	离岸人民币 1,549,183	2019年10月21日	(1,684)
美元 114,028	澳元 166,388	2019年10月21日	(1,732)
美元 162,856	离岸人民币 1,150,800	2019年10月21日	(1,761)
美元 122,351	澳元 178,240	2019年10月21日	(2,056)
美元 705,539	离岸人民币 5,025,224	2019年10月21日	(2,081)
美元 115,991	纽元 181,460	2019年10月21日	(2,161)
美元 300,602	离岸人民币 2,131,681	2019年10月21日	(2,199)
美元 87,887	纽元 136,571	2019年10月21日	(2,216)
美元 303,342	离岸人民币 2,151,110	2019年10月21日	(2,219)
美元 283,999	离岸人民币 2,012,444	2019年10月21日	(2,287)
美元 851,271	离岸人民币 6,064,031	2019年10月21日	(2,397)
美元 222,027	离岸人民币 1,568,928	2019年10月21日	(2,401)
美元 807,322	离岸人民币 5,750,000	2019年10月21日	(2,407)
美元 406,203	离岸人民币 2,884,349	2019年10月21日	(2,437)
美元 328,466	澳元 483,069	2019年10月21日	(2,441)
美元 875,801	离岸人民币 6,237,724	2019年10月21日	(2,611)
美元 319,399	离岸人民币 2,262,395	2019年10月21日	(2,697)
美元 326,124	纽元 515,475	2019年10月21日	(2,765)
美元 329,395	离岸人民币 2,333,104	2019年10月21日	(2,796)
美元 1,016,623	离岸人民币 7,240,478	2019年10月21日	(3,063)
美元 186,988	澳元 272,284	2019年10月21日	(3,221)
美元 142,923	纽元 222,613	2019年10月21日	(3,277)
美元 233,174	澳元 340,497	2019年10月21日	(3,370)
美元 571,488	离岸人民币 4,058,000	2019年10月21日	(3,428)
美元 409,152	离岸人民币 2,898,142	2019年10月21日	(3,455)
美元 463,112	离岸人民币 3,281,650	2019年10月21日	(3,730)
美元 282,084	纽元 443,519	2019年10月21日	(3,863)
美元 597,548	澳元 878,966	2019年10月21日	(4,331)
美元 902,130	加元 1,188,011	2019年10月21日	(4,636)
美元 461,153	离岸人民币 3,258,686	2019年10月21日	(4,986)
美元 270,411	澳元 393,043	2019年10月21日	(5,144)
美元 830,041	离岸人民币 5,886,120	2019年10月21日	(6,072)
美元 1,796,800	离岸人民币 12,788,774	2019年10月21日	(6,559)
美元 296,772	纽元 461,990	2019年10月21日	(6,963)
美元 967,989	澳元 1,419,373	2019年10月21日	(10,047)
美元 728,176	纽元 1,141,961	2019年10月21日	(11,819)
美元 708,869	澳元 1,032,490	2019年10月21日	(12,034)
美元 3,682,544	离岸人民币 26,216,400	2019年10月21日	(12,635)
美元 1,209,409	离岸人民币 8,513,198	2019年10月21日	(17,691)
美元 1,055,317	澳元 1,536,354	2019年10月21日	(18,420)
美元 25,892,102	加元 34,192,203	2019年10月21日	(61,307)
美元 28,712,658	离岸人民币 204,339,169	2019年10月21日	(108,184)
美元 39,193,366	离岸人民币 278,927,152	2019年10月21日	(147,677)
美元 96,553,331	离岸人民币 687,797,944	2019年10月21日	(271,722)
美元 28,268,457	纽元 44,018,974	2019年10月21日	(655,092)
美元 50,922,965	澳元 74,393,538	2019年10月21日	(714,288)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
加元 644,258	美元 485,931	2019年11月5日	(890)
加元 2,176,164	美元 1,640,861	2019年11月5日	(3,513)
加元 41,898,551	美元 31,651,910	2019年11月5日	(7,869)
英镑 2,983,766	美元 3,676,953	2019年11月5日	(5,014)
英镑 27,800,561	美元 34,254,156	2019年11月5日	(51,737)
纽元 848,148	美元 531,776	2019年11月5日	(521)
波兰兹罗提 4,837,696	美元 1,205,505	2019年11月5日	(1,716)
泰铢 80,292,116	美元 2,624,629	2019年11月5日	(2,361)
美元 907,742	日元 97,761,023	2019年11月5日	(1,160)
美元 1,014,619	离岸人民币 7,230,462	2019年11月5日	(2,887)
美元 1,192,592	欧元 1,088,353	2019年11月5日	(3,015)
美元 1,695,151	英镑 1,371,103	2019年11月5日	(3,205)
澳元 1,624	美元 1,097	2019年11月21日	(0)
加元 10,155	美元 7,675	2019年11月21日	(1)
离岸人民币 7,827	美元 1,095	2019年11月21日	(0)
离岸人民币 14,796	美元 2,070	2019年11月21日	(0)
纽元 366,220	美元 229,894	2019年11月21日	(19)
美元 2,395	离岸人民币 17,123	2019年11月21日	(0)
美元 218,085	离岸人民币 1,559,135	2019年11月21日	(12)
美元 502,729	离岸人民币 3,594,174	2019年11月21日	(19)
		未实现总亏损	(3,484,688)
		未实现净收益	4,249,575

2018

未平仓合约:

澳元 565,236	美元 410,690	2018年10月2日	1,685
美元 2,060	加元 2,672	2018年10月2日	7
美元 1,744,833	澳元 2,416,795	2018年10月3日	3,960
澳元 196,627	美元 142,724	2018年10月4日	445
美元 34,301	澳元 47,408	2018年10月4日	4
美元 1,405	澳元 1,947	2018年10月4日	3
人民币 240,000	美元 34,941	2018年10月9日	34
澳元 46,505,137	美元 33,697,353	2018年10月10日	46,235
澳元 330,503	美元 242,829	2018年10月10日	3,677
澳元 265,936	美元 194,939	2018年10月10日	2,508
澳元 81,117	美元 59,648	2018年10月10日	952
澳元 186,028	美元 135,515	2018年10月10日	905
澳元 71,831	美元 52,389	2018年10月10日	412
澳元 43,258	美元 31,543	2018年10月10日	241
澳元 7,835	美元 5,756	2018年10月10日	87
澳元 3,737	美元 2,748	2018年10月10日	44
澳元 2,148	美元 1,578	2018年10月10日	24
澳元 3,069	美元 2,236	2018年10月10日	15
澳元 1,526	美元 1,108	2018年10月10日	4
加元 2,422	美元 1,878	2018年10月10日	4
离岸人民币 3,781,984	美元 552,806	2018年10月10日	2,771
离岸人民币 1,965,456	美元 287,122	2018年10月10日	1,275
离岸人民币 3,102,708	美元 451,951	2018年10月10日	707
离岸人民币 375,947	美元 55,331	2018年10月10日	655
离岸人民币 1,011,388	美元 147,747	2018年10月10日	655
离岸人民币 1,584,066	美元 231,028	2018年10月10日	648
离岸人民币 1,085,731	美元 158,496	2018年10月10日	592
离岸人民币 1,318,049	美元 192,171	2018年10月10日	480
离岸人民币 406,629	美元 59,614	2018年10月10日	476
离岸人民币 1,140,518	美元 166,318	2018年10月10日	446

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 664,785	美元 97,093	2018年10月10日	409
离岸人民币 780,223	美元 113,866	2018年10月10日	394
离岸人民币 1,406,764	美元 204,919	2018年10月10日	325
离岸人民币 161,866	美元 23,787	2018年10月10日	246
离岸人民币 1,224,164	美元 178,196	2018年10月10日	159
离岸人民币 674,549	美元 98,141	2018年10月10日	38
离岸人民币 39,028	美元 5,709	2018年10月10日	33
离岸人民币 11,832	美元 1,741	2018年10月10日	21
离岸人民币 28,222	美元 4,123	2018年10月10日	18
离岸人民币 21,653	美元 3,163	2018年10月10日	13
离岸人民币 7,478	美元 1,101	2018年10月10日	13
离岸人民币 7,576	美元 1,113	2018年10月10日	12
离岸人民币 9,676	美元 1,415	2018年10月10日	8
离岸人民币 13,828	美元 2,018	2018年10月10日	7
离岸人民币 10,600	美元 1,547	2018年10月10日	6
离岸人民币 7,534	美元 1,102	2018年10月10日	6
离岸人民币 7,770	美元 1,136	2018年10月10日	6
离岸人民币 15,398	美元 2,245	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 11,226	美元 1,635	2018年10月10日	3
离岸人民币 7,542	美元 1,100	2018年10月10日	3
离岸人民币 4,881	美元 712	2018年10月10日	2
离岸人民币 7,526	美元 1,096	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
离岸人民币 7,552	美元 1,099	2018年10月10日	0
纽元 11,948,671	美元 7,939,301	2018年10月10日	17,332
纽元 18,700	美元 12,523	2018年10月10日	125
纽元 2,811	美元 1,887	2018年10月10日	23
纽元 1,643	美元 1,102	2018年10月10日	13
纽元 24,205	美元 16,055	2018年10月10日	7
美元 651,676	澳元 918,389	2018年10月10日	12,870
美元 1,616,604	澳元 2,249,002	2018年10月10日	10,773
美元 14,215,005	加元 18,383,683	2018年10月10日	9,447
美元 170,392	澳元 238,822	2018年10月10日	2,419
美元 127,206	纽元 195,503	2018年10月10日	2,412
美元 163,378	澳元 228,914	2018年10月10日	2,263
美元 230,486	加元 300,000	2018年10月10日	1,640
美元 95,350	澳元 133,922	2018年10月10日	1,556
美元 200,811	澳元 279,650	2018年10月10日	1,543
美元 78,017	加元 102,669	2018年10月10日	1,423
美元 128,429	纽元 195,789	2018年10月10日	1,378
美元 161,291	澳元 224,607	2018年10月10日	1,234
美元 60,709	加元 80,000	2018年10月10日	1,192
美元 178,968	澳元 248,891	2018年10月10日	1,130
美元 50,679	加元 66,839	2018年10月10日	1,038
美元 73,797	纽元 112,799	2018年10月10日	989
美元 94,181	纽元 143,061	2018年10月10日	669
美元 249,827	加元 323,557	2018年10月10日	527
美元 45,758	纽元 69,812	2018年10月10日	527
美元 127,725	澳元 177,225	2018年10月10日	515
美元 38,368	纽元 58,539	2018年10月10日	443
美元 59,240	纽元 90,000	2018年10月10日	430
美元 88,660	纽元 134,141	2018年10月10日	275
美元 140,147	澳元 193,996	2018年10月10日	229
美元 15,851	澳元 22,186	2018年10月10日	203
美元 368,814	离岸人民币 2,537,305	2018年10月10日	200
美元 65,024	离岸人民币 448,286	2018年10月10日	173
美元 39,385	澳元 54,645	2018年10月10日	156
美元 21,167	加元 27,558	2018年10月10日	156
美元 61,197	离岸人民币 421,164	2018年10月10日	55
美元 166,828	离岸人民币 1,147,446	2018年10月10日	51
美元 3,838	加元 5,000	2018年10月10日	30
美元 191,965	加元 248,130	2018年10月10日	27
澳元 6,972,884	美元 5,067,623	2018年10月31日	21,347
加元 10,570,661	美元 8,191,117	2018年10月31日	8,224

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
欧元 70,710,519	美元 82,931,206	2018年10月31日	617,091
欧元 748,847	美元 883,566	2018年10月31日	11,832
欧元 923,260	美元 1,084,106	2018年10月31日	9,339
欧元 259,944	美元 305,121	2018年10月31日	2,520
欧元 304,609	美元 356,931	2018年10月31日	2,336
英镑 10,863,473	美元 14,367,388	2018年10月31日	182,952
英镑 703,483	美元 926,787	2018年10月31日	8,250
匈牙利福林 1,168,326,279	美元 4,235,704	2018年10月31日	31,843
日元 7,619,347,455	美元 68,035,969	2018年10月31日	816,970
日元 165,706,285	美元 1,483,162	2018年10月31日	21,277
日元 97,405,436	美元 870,521	2018年10月31日	11,196
日元 35,659,907	美元 317,629	2018年10月31日	3,032
纽元 370,485	美元 246,722	2018年10月31日	1,090
波兰兹罗提 1,099,736	美元 299,869	2018年10月31日	1,344
瑞典克朗 13,634,590	美元 1,543,317	2018年10月31日	6,541
澳元 111,350	美元 81,120	2018年11月13日	525
澳元 5,594	美元 4,062	2018年11月13日	13
加元 43,951	美元 34,114	2018年11月13日	80
加元 2,707	美元 2,100	2018年11月13日	3
加元 1,420	美元 1,100	2018年11月13日	1
离岸人民币 2,907,518	美元 423,772	2018年11月13日	1,818
离岸人民币 396,341	美元 57,779	2018年11月13日	260
离岸人民币 225,340	美元 32,800	2018年11月13日	98
离岸人民币 455,811	美元 66,231	2018年11月13日	81
离岸人民币 160,892	美元 23,369	2018年11月13日	20
离岸人民币 7,538	美元 1,099	2018年11月13日	5
离岸人民币 7,525	美元 1,097	2018年11月13日	5
离岸人民币 3,768	美元 550	2018年11月13日	3
纽元 716,127	美元 478,811	2018年11月13日	3,947
纽元 93,938	美元 62,484	2018年11月13日	194
纽元 16,851	美元 11,196	2018年11月13日	22
纽元 1,645	美元 1,094	2018年11月13日	3
纽元 3,342	美元 2,216	2018年11月13日	0
美元 14,262,554	加元 18,466,813	2018年11月13日	37,251
美元 72,000,461	离岸人民币 496,152,297	2018年11月13日	3,770
美元 253,324	纽元 382,141	2018年11月13日	73
美元 149,578	离岸人民币 1,031,062	2018年11月13日	55
美元 136,369	加元 176,166	2018年11月13日	46
美元 151,875	离岸人民币 1,046,765	2018年11月13日	38
美元 322,230	离岸人民币 2,220,472	2018年11月13日	17
美元 55,896	澳元 77,236	2018年11月13日	8
美元 11,761	离岸人民币 81,048	2018年11月13日	1
		未实现总收益	1,952,678

加元 176,166	美元 136,258	2018年10月2日	(30)
美元 4,061	澳元 5,594	2018年10月2日	(13)
美元 62,474	纽元 93,938	2018年10月2日	(194)
纽元 382,141	美元 253,272	2018年10月4日	(88)
美元 2,216	纽元 3,342	2018年10月4日	(0)
澳元 77,236	美元 55,882	2018年10月9日	(6)
离岸人民币 1,046,765	美元 152,107	2018年10月9日	(141)
澳元 1,921	美元 1,387	2018年10月10日	(3)
澳元 1,974	美元 1,423	2018年10月10日	(6)
澳元 7,037	美元 5,084	2018年10月10日	(8)
澳元 1,817	美元 1,306	2018年10月10日	(9)
澳元 2,631	美元 1,892	2018年10月10日	(12)
澳元 2,239	美元 1,608	2018年10月10日	(12)
澳元 1,755	美元 1,254	2018年10月10日	(16)
澳元 1,539	美元 1,096	2018年10月10日	(18)
澳元 2,572	美元 1,825	2018年10月10日	(36)
澳元 10,034	美元 7,162	2018年10月10日	(98)
澳元 22,546	美元 16,191	2018年10月10日	(123)
澳元 16,314	美元 11,616	2018年10月10日	(189)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
澳元 28,662	美元 20,479	2018年10月10日	(261)
澳元 124,727	美元 89,887	2018年10月10日	(365)
澳元 282,140	美元 203,680	2018年10月10日	(477)
澳元 115,925	美元 83,251	2018年10月10日	(633)
澳元 132,608	美元 95,234	2018年10月10日	(721)
澳元 429,390	美元 308,363	2018年10月10日	(2,344)
澳元 285,298	美元 202,463	2018年10月10日	(3,979)
加元 1,427	美元 1,104	2018年10月10日	(0)
加元 61,718	美元 47,750	2018年10月10日	(4)
加元 2,970	美元 2,280	2018年10月10日	(18)
加元 1,452	美元 1,104	2018年10月10日	(19)
加元 1,452	美元 1,104	2018年10月10日	(19)
加元 1,451	美元 1,100	2018年10月10日	(22)
加元 41,559	美元 32,127	2018年10月10日	(30)
加元 11,236	美元 8,545	2018年10月10日	(149)
加元 150,507	美元 116,210	2018年10月10日	(245)
加元 124,869	美元 96,028	2018年10月10日	(590)
加元 106,319	美元 81,643	2018年10月10日	(621)
加元 43,121	美元 32,724	2018年10月10日	(641)
加元 45,542	美元 34,533	2018年10月10日	(705)
加元 50,654	美元 38,453	2018年10月10日	(741)
加元 180,783	美元 139,027	2018年10月10日	(854)
加元 59,518	美元 45,132	2018年10月10日	(921)
加元 183,625	美元 140,873	2018年10月10日	(1,208)
加元 18,466,813	美元 14,253,511	2018年10月10日	(35,264)
离岸人民币 7,532	美元 1,095	2018年10月10日	(0)
离岸人民币 7,528	美元 1,092	2018年10月10日	(3)
离岸人民币 53,563	美元 7,787	2018年10月10日	(3)
离岸人民币 11,366	美元 1,648	2018年10月10日	(5)
离岸人民币 21,001	美元 3,046	2018年10月10日	(8)
离岸人民币 392,014	美元 56,981	2018年10月10日	(32)
离岸人民币 92,287	美元 13,387	2018年10月10日	(35)
离岸人民币 2,220,472	美元 322,670	2018年10月10日	(266)
离岸人民币 496,152,297	美元 72,098,811	2018年10月10日	(59,349)
纽元 1,658	美元 1,096	2018年10月10日	(3)
纽元 1,671	美元 1,103	2018年10月10日	(5)
纽元 1,671	美元 1,101	2018年10月10日	(7)
纽元 1,936	美元 1,274	2018年10月10日	(9)
纽元 1,681	美元 1,103	2018年10月10日	(12)
纽元 1,666	美元 1,092	2018年10月10日	(13)
纽元 2,181	美元 1,427	2018年10月10日	(18)
纽元 1,931	美元 1,262	2018年10月10日	(18)
纽元 16,125	美元 10,645	2018年10月10日	(46)
纽元 17,922	美元 11,830	2018年10月10日	(53)
纽元 32,867	美元 21,706	2018年10月10日	(84)
纽元 36,243	美元 23,723	2018年10月10日	(306)
纽元 37,870	美元 24,794	2018年10月10日	(314)
纽元 107,810	美元 70,155	2018年10月10日	(1,322)
纽元 1,316,055	美元 862,589	2018年10月10日	(9,956)
美元 1,753	离岸人民币 12,035	2018年10月10日	(3)
美元 23,215	纽元 35,000	2018年10月10日	(10)
美元 39,065	离岸人民币 268,489	2018年10月10日	(17)
美元 32,668	离岸人民币 224,443	2018年10月10日	(26)
美元 5,976	纽元 8,935	2018年10月10日	(52)
美元 44,140	离岸人民币 303,041	2018年10月10日	(67)
美元 39,136	离岸人民币 268,437	2018年10月10日	(96)
美元 10,178	纽元 15,176	2018年10月10日	(116)
美元 10,481	离岸人民币 71,155	2018年10月10日	(132)
美元 37,031	离岸人民币 253,506	2018年10月10日	(163)
美元 79,393	离岸人民币 543,881	2018年10月10日	(293)
美元 117,223	离岸人民币 803,227	2018年10月10日	(405)
美元 87,612	离岸人民币 598,962	2018年10月10日	(502)
美元 116,723	离岸人民币 798,768	2018年10月10日	(554)
美元 384,975	离岸人民币 2,642,660	2018年10月10日	(639)
美元 46,324	澳元 62,970	2018年10月10日	(759)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
美元 164,295	离岸人民币 1,124,000	2018年10月10日	(826)
美元 114,243	离岸人民币 777,391	2018年10月10日	(1,183)
美元 305,814	离岸人民币 2,093,996	2018年10月10日	(1,273)
美元 192,064	离岸人民币 1,310,188	2018年10月10日	(1,516)
美元 226,026	澳元 310,000	2018年10月10日	(1,710)
美元 191,484	纽元 285,464	2018年10月10日	(2,221)
美元 176,257	澳元 240,459	2018年10月10日	(2,261)
美元 491,441	澳元 674,695	2018年10月10日	(3,231)
美元 327,053	离岸人民币 2,223,918	2018年10月10日	(3,616)
美元 444,910	离岸人民币 3,023,182	2018年10月10日	(5,233)
美元 1,416,793	纽元 2,128,941	2018年10月10日	(5,305)
美元 586,315	澳元 798,019	2018年10月10日	(8,868)
美元 6,775,745	纽元 10,102,158	2018年10月10日	(78,008)
美元 30,808,265	澳元 41,916,862	2018年10月10日	(477,191)
美元 73,233,916	离岸人民币 497,981,838	2018年10月10日	(809,734)
墨西哥比索 30,370,003	美元 1,610,232	2018年10月31日	(5,890)
美元 107,302	匈牙利福林 29,625,001	2018年10月31日	(704)
美元 201,776	日元 22,738,294	2018年10月31日	(1,173)
美元 204,036	日元 22,975,688	2018年10月31日	(1,339)
美元 495,615	英镑 377,775	2018年10月31日	(2,351)
美元 297,227	欧元 251,624	2018年10月31日	(4,302)
澳元 1,947	美元 1,406	2018年11月13日	(3)
澳元 47,408	美元 34,310	2018年11月13日	(4)
澳元 2,416,795	美元 1,745,303	2018年11月13日	(3,973)
加元 2,672	美元 2,062	2018年11月13日	(7)
加元 153,134	美元 118,546	2018年11月13日	(34)
离岸人民币 418,602	美元 60,739	2018年11月13日	(10)
离岸人民币 421,164	美元 61,099	2018年11月13日	(22)
离岸人民币 2,990,845	美元 433,888	2018年11月13日	(159)
美元 34,875	离岸人民币 240,000	2018年11月13日	(46)
美元 20,217	离岸人民币 138,682	2018年11月13日	(91)
美元 13,370	纽元 20,000	2018年11月13日	(108)
美元 73,782	加元 95,140	2018年11月13日	(110)
美元 38,733	离岸人民币 266,113	2018年11月13日	(114)
美元 44,861	澳元 61,545	2018年11月13日	(315)
美元 142,757	澳元 196,627	2018年11月13日	(439)
美元 410,776	澳元 565,236	2018年11月13日	(1,657)
美元 7,940,272	纽元 11,948,671	2018年11月13日	(17,104)
美元 33,704,226	澳元 46,505,137	2018年11月13日	(43,793)
		未实现总亏损	(1,613,458)
		未实现净收益	339,220

(b) 以下为截至九月三十日之未平仓期货合约：

	合约数多头/ (空头)	合约金额 美元	交割日期	未实现收益/ (亏损) 美元
<u>2019</u>				
Euro BUXL 30Yr Bd (EUX) Futures	6	1,451,623	2019 年 12 月	(28,912)
Euro-BTP (EUX) Futures	65	10,221,911	2019 年 12 月	112,748
Euro-Bund (EUX) Futures	(122)	(23,355,736)	2019 年 12 月	179,719
Euro-OAT (EUX) Futures	55	10,320,487	2019 年 12 月	(108,529)
				155,026
<u>2018</u>				
Euro-BUXL (EUX) Futures	(1)	(176,660)	2018 年 12 月	2,718
Euro-BOBL (EUX) Futures	(47)	(6,180,970)	2018 年 12 月	44,218
Euro-Bund (EUX) Futures	(42)	(6,734,420)	2018 年 12 月	75,776
Euro-OAT (EUX) Futures	(11)	(1,673,100)	2018 年 12 月	13,415
Mini JGB 10Years Bond (SGX) Futures	7	105,175,000	2018 年 12 月	(1,048)
US 10 Years Note (CBT) Futures	(6)	(721,344)	2018 年 12 月	8,656
US 2 Years Note (CBT) Futures	(10)	(2,113,594)	2018 年 12 月	6,250
US 5 Years Note (CBT) Futures	149	16,901,023	2018 年 12 月	(142,016)
US Long Bond (CBT) Futures	(42)	(6,072,938)	2018 年 12 月	171,938
US Ultra Bond (CBT) Futures	(9)	(1,439,719)	2018 年 12 月	51,188
				231,095

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：26,234 美元）。

独立核数师报告

致摩根国际债券基金（“贵基金”）份额持有人

就财务报表审计作出的报告

意见

我们已审计的内容

摩根国际债券基金列载于第九至第四十五页的财务报表，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“核数师就财务报表承担的责任”部分中作进一步阐述。

我们相信，我们所获取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。

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

核数师就审计财务报表承担的责任

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

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

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

独立核数师报告（续）

致摩根国际债券基金（“贵基金”）份额持有人

核数师就审计财务报表承担的责任（续）

- 对管理层采用持续经营会计基础的恰当性作出结论。根据所获取的审计凭证，确定是否存在与事项或情况有关的重大不确定性，从而可能导致对贵基金的持续经营能力产生重大疑虑。如果我们认为存在重大不确定性，则有必要在核数师报告中提请使用者注意财务报表中的相关披露。假若有关的披露不足，则我们应当发表非无保留意见。我们的结论是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；
- 保护本基金的财产及附带权利；及
- 就每一个会计年度，向份额持有人报告关于管理人管理本基金的行为操守。

受托人对份额持有人的报告

本受托人谨确认管理人于截至二零一九年九月三十日止财政年度在各个重要方面均依照一九七九年四月三十日所订立之信托契约（经修订）之条款管理本基金。

东亚银行(信托)有限公司，受托人
二零二零年一月二十二日

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） - 加元对冲类别（每月派息） - 港元类别（每月派息） - 纽元对冲类别（每月派息） - 人民币对冲类别（累计） - 人民币对冲类别（每月派息） - 美元类别（每月派息） - 美元类别（每半年派息） - PRC 人民币份额（累计） - PRC 人民币份额（每月派息） - PRC 人民币对冲份额（累计） - PRC 人民币对冲份额（每月派息） - PRC 美元份额（累计） - PRC 美元份额（每月派息）	澳元 75,379,036 加元 42,996,672 港元 1,235,343,698 纽元 46,035,618 人民币 6,094,496 人民币 717,124,629 美元 350,740,212 美元 13,405,615 人民币 538,799,669 人民币 137,346,857 人民币 358,901,326 人民币 242,583,238 美元 72,249,710 美元 44,456,561	澳元 10.13 加元 10.13 港元 10.25 纽元 10.13 人民币 12.79 人民币 10.01 美元 10.14 美元 22.91 人民币 11.24 人民币 11.02 人民币 10.61 人民币 10.38 美元 10.57 美元 10.38
30/9/18 - 澳元对冲类别（每月派息） - 加元对冲类别（每月派息） - 港元类别（每月派息） - 纽元对冲类别（每月派息） - 人民币对冲类别（累计） - 人民币对冲类别（每月派息） - 美元类别（每月派息） - 美元类别（每半年派息）	澳元 44,711,934 加元 18,500,087 港元 536,431,426 纽元 11,491,342 人民币 2,211,940 人民币 487,434,570 美元 150,841,303 美元 10,950,129	澳元 9.49 加元 9.50 港元 9.61 纽元 9.50 人民币 11.51 人民币 9.39 美元 9.52 美元 21.52
30/9/17 - 澳元对冲类别（每月派息） - 加元对冲类别（每月派息） - 港元类别（每月派息） - 纽元对冲类别（每月派息） - 人民币对冲类别（累计） - 人民币对冲类别（每月派息） - 美元类别（每月派息） - 美元类别（每半年派息）	澳元 62,623,626 加元 23,856,042 港元 696,586,915 纽元 18,686,536 人民币 3,029,878 人民币 738,415,473 美元 226,749,999 美元 14,191,027	澳元 9.76 加元 9.77 港元 9.88 纽元 9.78 人民币 11.29 人民币 9.67 美元 9.80 美元 22.15

业绩记录 - 未经审计 (续)

最高卖出价/最低买入价

财务期结算日	最高卖出价	最低买入价
30/9/19		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.25	澳元 9.41
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.26	加元 9.43
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.40	港元 9.54
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.26	纽元 9.43
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 12.88	人民币 11.41
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.15	人民币 9.31
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.28	美元 9.45
- 美元类别 (每半年派息)	美元 23.55	美元 21.37
- PRC 人民币份额 (累计)	人民币 11.39	人民币 9.90
- PRC 人民币份额 (每月派息)	人民币 11.22	人民币 9.90
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 10.69	人民币 9.96
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.53	人民币 9.96
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.65	美元 9.96
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.52	美元 9.96
30/9/18		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.82	澳元 9.49
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.83	加元 9.50
- 港元类别 (每月派息)	港元 9.93	港元 9.61
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.83	纽元 9.50
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 11.58	人民币 11.29
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.74	人民币 9.39
- 美元类别 (每月派息)	美元 9.85	美元 9.52
- 美元类别 (每半年派息)	美元 22.38	美元 21.52
30/9/17		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.49	澳元 9.69
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.51	加元 9.69
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.53	港元 9.74
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.51	纽元 9.70
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 11.38	人民币 10.63
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.43	人民币 9.59
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.52	美元 9.72
- 美元类别 (每半年派息)	美元 23.79	美元 22.15
30/9/16		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.64	澳元 9.81
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.66	加元 9.82
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.69	港元 9.83
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.67	纽元 9.83
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 11.42	人民币 10.10
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.60	人民币 9.73
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.68	美元 9.82
- 美元类别 (每半年派息)	美元 24.31	美元 22.30
30/9/15		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.38	澳元 9.86
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.38	加元 9.85
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.37	港元 9.86
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.40	纽元 9.87
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 10.41	人民币 9.89
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.38	人民币 9.86
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.38	美元 9.86
- 美元类别 (每半年派息)	美元 24.94	美元 22.38
30/9/14		
- 美元类别 (每半年派息)	美元 25.48	美元 23.46
30/9/13		
- 美元类别 (每半年派息)	美元 26.36	美元 23.04
30/9/12	美元 26.52	美元 24.33
30/9/11	美元 26.36	美元 23.23
30/9/10	美元 25.24	美元 22.03

经营与管理

管理人及服务提供者

摩根基金(亚洲)有限公司
香港
中环干诺道中 8 号
遮打大厦 21 楼

投资管理人

摩根资产管理(亚太)有限公司
(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

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

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

基金注册登记机构

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

核数师

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

