

半年度报告 — 2021年3月31日（未经审核）

# 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。只有基于现时基金说明书（或同等文件）及最近之财务报告（如有）所作之认购方为有效。

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

内容	页
投资组合	1 - 5
投资组合持有变动表	6
金融衍生工具详情	7 - 15
财务状况表	16
综合收益表	16
可赎回份额持有人应占净资产变动表	17
现金流量表	17
财务报表之附注	18 - 25

投资组合

截至二零二一年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
<b>上市投资 (97.9%)</b>				Canada Govt Of 0.5%			
				01/09/25	加元 45,000,000	35,316,190	2.4
<b>(I) 债务证券 (73.6%)</b>				Canada Govt Of 2.5%			
				01/06/24	加元 2,200,000	1,876,210	0.1
<b>澳大利亚 (3.3%)</b>				Hydro-Quebec 4%			
ANZ Banking Grp 4.5%	美元			15/02/55	加元 300,000	304,631	0.0
19/03/24-RegS	1,500,000	1,651,618	0.1	Hydro-Quebec No19			
APT Pipelines 3.875%	美元			6.5% 15/02/35	加元 1,700,000	2,000,572	0.1
11/10/22-RegS	3,100,000	3,297,683	0.2	Ontario Prov Of 2.6%			
APT Pipelines 4.2%				02/06/25	加元 600,000	509,000	0.0
23/03/25-RegS	美元 500,000	545,320	0.0	Ontario Prov Of 2.7%			
Ausgrid Finance 4.35%				02/06/29	加元 1,000,000	847,222	0.1
01/08/28-RegS	美元 500,000	556,195	0.0	Ontario Prov Of 3.5%			
Ausgrid Finance Pty Ltd				02/06/24	加元 3,750,000	3,269,807	0.2
3.85% 01/05/23-RegS	美元 500,000	533,175	0.0	Ontario Prov Of 4%			
Ausnet Serv VRN 5.75%				02/06/21	加元 1,500,000	1,216,630	0.1
03/76-RegS	美元 500,000	510,497	0.0	Ontario Teachers 0.5%			
Ausnet Services Holdings				06/05/25-RegS	欧元 4,009,000	4,889,636	0.3
Ser Emtn 11/03/81	欧元 719,000	859,251	0.1	Quebec Prov Of 2.6%			
Australia Govt No 157 1.5%	澳元			06/07/25	加元 2,700,000	2,297,003	0.2
21/6/31	3,250,000	2,417,562	0.2	Quebec Prov Of 3.75%			
Australian Govt No124	澳元			01/09/24	加元 1,250,000	1,097,210	0.1
5.75% 15/5/21	2,400,000	1,879,301	0.1	Quebec Prov Of 4.2%			
Australian Govt No138	澳元			10/03/25-RegS	澳元 1,200,000	1,030,665	0.1
3.25% 21/4/29	6,620,000	5,805,608	0.4	Transcanada Trust			
Australian Govt No140	澳元			15/03/77-RegS	美元 3,500,000	3,670,347	0.2
4.5%4/33-RegS	2,100,000	2,072,803	0.1	<b>开曼群岛 (1.4%)</b>			
Australian Govt No150 3%	澳元			Avolon Holdings Funding			
03/47-RegS	2,200,000	1,781,589	0.1	Ltd 144A 2.875%			
Commonwealth Bk VRN	美元			15/02/25-RegS	美元 770,000	770,916	0.1
3.61% 9/34-RegS	1,500,000	1,556,589	0.1	Avolon Holdings Funding			
Macquarie Bank Ltd	美元			Ltd 144A (4.25%)			
03/03/36-144A	3,000,000	2,883,961	0.2	15/04/26-RegS	美元 1,700,000	1,808,140	0.1
Macquarie Group	美元			CDBL Funding Two			
31/12/49	3,000,000	3,241,735	0.2	1.375% 04/03/24-			
Mirvac Group 3.625%				RegS	美元 2,800,000	2,792,046	0.2
18/03/27-RegS	美元 600,000	645,938	0.1	CDBL Funding Two 2%			
Scentre Group 2 VRN	美元			04/03/26-RegS	美元 1,200,000	1,193,226	0.1
4.75% 9/80-RegS	2,500,000	2,633,559	0.2	CK Hutchison Capit 17			
Scentre Grp Trust 3.625%	美元			31/12/49	美元 2,000,000	2,071,637	0.1
1/26-RegS	2,200,000	2,393,029	0.2	Hutchison Wham Intl2			
SGSP (Aust) 3.5%	美元			3.25% 22-RegS	美元 1,000,000	1,055,479	0.1
07/07/27-RegS	1,200,000	1,310,166	0.1	Mizuho Financial 4.6%			
SGSP (Aust) Stp Cpn 3.3%	美元			27/03/24-RegS	美元 2,000,000	2,190,558	0.1
09/04/23	3,000,000	3,193,982	0.2	Sands China Ltd 5.125%			
SGSP Aus 3.25% 29/07/26-	美元			08/08/25-RegS	美元 2,000,000	2,255,820	0.2
RegS	2,000,000	2,151,414	0.2	Sunny Optical Tech			
Transurban Queen 4.5%	美元			3.75% 23/01/23-RegS	美元 1,250,000	1,306,729	0.1
19/04/28-RegS	2,850,000	3,177,026	0.2	Zhongsheng Group 3%			
Westpac Banking Corp	美元			13/01/26-RegS	美元 4,350,000	4,405,841	0.3
04/02/30-RegS	3,500,000	3,626,078	0.3	<b>中国 (6.4%)</b>			
<b>巴西 (0.1%)</b>				CCB Life Ins VRN 4.5%			
Banco do Brasil 4.625%	美元			21/4/77-RegS	美元 3,000,000	3,098,688	0.2
15/1/25-RegS	2,000,000	2,140,838	0.1	China Dev Bank No2012	人民币		
<b>加拿大 (4.9%)</b>				3.34% 14/7/25	190,000,000	29,663,081	2.0
British Columbia 2.2%	加元			China Dev Bank1.25%			
18/06/30	1,000,000	811,207	0.1	21/01/23-RegS	英镑 824,000	1,149,259	0.1
British Columbia 4.3%	加元						
18/06/42	1,000,000	1,007,522	0.1				
Canada Govt Of 0.25%	加元						
01/02/23	15,000,000	11,952,709	0.8				

投资组合 (续)

(续)

截至二零二一年三月三十一日 (未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
<b>中国 (续)</b>				Bundesrep Deut 0.5%			
China Development Bank	人民币			15/02/25	欧元 9,000,000	11,086,439	0.7
2102 2.98% 08/01/24	50,000,000	7,648,149	0.5	Deutsche Bank Ag			
China Government Bond	人民币			22/12/28-RegS	英镑 500,000	677,088	0.0
3.02% 22/10/25	98,880,000	15,289,670	1.0	Deutsche Bank Ag Ser			
China Govt Of Inbk 3.27%	人民币			Emtn 17/02/27-RegS	欧元 2,100,000	2,458,947	0.2
19/11/30	240,000,000	37,305,779	2.6	State of North			
				Rhine2.15% 3/19-RegS	欧元 1,200,000	2,127,786	0.1
<b>哥伦比亚 (0.2%)</b>				<b>加纳 (0.5%)</b>			
Ecopetrol 5a 6.875%				Republic of Ghana 7.75%			
29/04/30	美元 2,409,000	3,007,487	0.2	07/04/29-RegS	美元 7,000,000	6,949,600	0.5
<b>科特迪瓦 (0.2%)</b>				<b>香港 (0.8%)</b>			
Ivory Coast 4.875%				AIA Group Ltd 3.125%			
30/01/32	欧元 2,500,000	2,921,417	0.2	13/03/23-RegS	美元 1,500,000	1,570,457	0.1
<b>埃及 (0.4%)</b>				Airport Authority HK			
Arab Republic Of Egypt				31/12/49-RegS	美元 4,000,000	4,000,013	0.3
3.875% 16/02/26-	美元 5,999,000	5,826,341	0.4	China Huarong Intl			
RegS				Holding 3.25%			
<b>芬兰 (0.1%)</b>				23/06/21-RegS			
Nokia OYJ 4.375%				HK Electric Fin 2.25%	美元 4,380,000	4,433,423	0.3
12/06/27	美元 2,000,000	2,150,243	0.1	09/06/30-RegS	美元 2,000,000	1,966,882	0.1
<b>法国 (2.9%)</b>				<b>冰岛 (0.1%)</b>			
BPCA SA 1% 22/12/25-				Iceland Rep Of 0.5%			
RegS	英镑 2,500,000	3,435,291	0.2	20/12/22-RegS	欧元 1,500,000	1,786,290	0.1
BPCE SA 5.7% 22/10/23-	美元 1,000,000	1,143,192	0.1	<b>印度(0.6%)</b>			
RegS				Export-Imp Bk IN 3.125%			
BPCE SA VRN 0.5%	欧元 1,300,000	1,540,800	0.1	07/21-RegS	美元 1,000,000	1,013,195	0.0
15/09/27-RegS				NTPC Ltd 4.25%	美元 1,000,000	1,080,738	0.1
Dexia Credit 0.75%	美元 3,016,000	3,048,728	0.2	26/02/26-RegS			
07/05/23-RegS				NTPC Ltd 4.75%	美元 2,350,000	2,525,726	0.2
Dexia Credit 1%	欧元 1,000,000	1,266,040	0.1	03/10/22-RegS			
18/10/27-RegS				NTPC Ltd Ser Emtn	欧元 2,500,000	3,139,007	0.2
Dexia Credit 1.625%	英镑 600,000	859,818	0.1	2.75% 01/02/27-RegS			
08/12/23-RegS				State Bank of India	美元 1,459,000	1,495,053	0.1
Dexia Credit Local 1.25%	欧元 1,200,000	1,500,018	0.1	3.25% 24/01/22-RegS			
11/24-RegS				<b>印度尼西亚 (0.3%)</b>			
France OAT 3.5%	欧元 5,000,000	7,276,039	0.5	Perusahaan Listrik			
25/04/26				2.875%10/25-RegS	欧元 400,000	511,843	0.0
France OAT 5.75%	欧元 7,444,000	14,761,869	1.0	Perusahaan Listrik Negara			
25/10/32				5.45% 21/05/28-RegS	美元 1,351,000	1,593,748	0.1
Societe Generale 4.25%	美元 3,000,000	3,289,092	0.2	Perusahaan			
19/8/26-RegS				Listriki.875% 11/31-	欧元 1,500,000	1,764,086	0.1
Societe Generale 5%	美元 1,750,000	1,929,613	0.1	RegS			
17/01/24-RegS				Rep of Indonesia 1.45%	欧元 397,000	485,993	0.0
Societe	欧元 2,200,000	2,589,174	0.2	18/09/26			
Generale24/11/30-				Rep of Indonesia 3.375%	欧元 400,000	534,814	0.1
RegS				07/25-RegS			
<b>德国 (8.3%)</b>				<b>跨国性 (0.3%)</b>			
Bundeschatzanweisungen				Corp Andina Fomento			
0% 15/08/30-RegS	欧元 30,000,000	36,401,427	2.5	2.375% 12/05/23	美元 3,000,000	3,127,118	0.2
Bundesrep Deut 0%	欧元 33,540,000	40,776,580	2.8	Euro Stability 0.5%			
15/02/30-RegS				02/03/26-RegS	欧元 1,300,000	1,601,096	0.1
Bundesrep Deut 0%	欧元 13,238,000	15,695,444	1.1				
15/05/35-RegS							
Bundesrep Deut 0%	欧元 11,708,200	12,800,044	0.9				
15/08/50-RegS							

投资组合 (续)

截至二零二一年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
<b>爱尔兰 (0.2%)</b>				JPN Bank for Intl			
Ireland Treasury 1.3%				01/06/22	美元 1,000,000	1,034,051	0.1
15/05/33-RegS	欧元 667,322	903,733	0.0	Kansai Elec Power			
Zurich Finance Ireland				2.55% 09/24-RegS	美元 800,000	841,623	0.1
19/04/51-RegS	美元 2,500,000	2,437,425	0.2	Nippon Life Insurance			
				5% 18/10/42-RegS	美元 2,000,000	2,150,278	0.1
<b>以色列 (0.2%)</b>				Nissan Motor Co			
Israel Electric				4.345% 17/09/27-RegS	美元 2,500,000	2,728,899	0.2
5%12/11/24-144A/RegS	美元 2,000,000	2,289,461	0.2	NTT Finance Corp			
				1.162% 03/04/26-144A	美元 3,200,000	3,163,666	0.2
<b>意大利 (7.3%)</b>				NTT Finance Corp			
Italy Rep Of (BTP) 0.95%				0.01% 03/03/25-RegS	欧元 1,875,000	2,213,637	0.2
8/30-RegS	欧元 18,000,000	21,901,389	1.5	Sumitomo Mitsui			
Italy Rep Of (BTP) 1.35%				Finance 2.512% 22/01/25-RegS	美元 2,500,000	2,595,689	0.2
04/30-RegS	欧元 23,500,000	29,764,816	2.0				
Italy Rep Of (BTP) 1.45%				<b>韩国 (0.6%)</b>			
15/11/24	欧元 6,000,000	7,505,848	0.5	Export-Imp Bk Kor			
Italy Rep Of (BTP) 6.5%				0.829% 04/25-RegS	欧元 2,447,000	3,018,792	0.2
01/11/27	欧元 4,600,000	7,751,956	0.5	Korea Dev Bank 0%	欧元 429,000	507,085	0.1
Italy Rep Of 0.5%				10/07/24-RegS			
01/02/26-RegS	欧元 23,000,000	27,698,964	1.9	NongHyup Bank 1.25%	美元 3,000,000	2,994,613	0.2
Italy Rep Of 2.375%				20/07/25-RegS			
17/10/24	美元 9,213,000	9,720,189	0.7	Shinhan Fin Grp VRN			
UniCredit Spa VRN				3.34% 2/30-RegS	美元 2,000,000	2,100,423	0.1
3.875% Perp-RegS	欧元 2,500,000	2,808,947	0.2				
<b>日本 (7.7%)</b>				<b>卢森堡 (0.3%)</b>			
Central Nippon Exp				European Fin Stab			
2.091% 9/21-RegS	美元 500,000	509,426	0.0	0.75% 05/27-RegS	欧元 1,550,000	1,957,177	0.1
Central Nippon Exp				European Inv Bank			
2.362% 5/21-RegS	美元 700,000	715,803	0.1	4.875% 15/02/36	美元 800,000	1,074,569	0.1
Chiba Bank 2.65%				Tratton Finance			
30/10/24-RegS	美元 1,600,000	1,702,032	0.1	Luxembrg 0.125% 24/03/25-RegS	欧元 1,200,000	1,410,297	0.1
Dai-ichi Mutual Life							
29/10/49	美元 3,200,000	3,617,360	0.3	<b>墨西哥 (0.4%)</b>			
Dev Bank of Japan				Petroleos Mexicanos			
0.875% 10/25-RegS	欧元 400,000	494,614	0.0	4.75% 26/02/29-RegS	欧元 4,250,000	4,872,510	0.3
Dev Bank of Japan 2%				Petroleos Mexicanos			
19/10/21-RegS	美元 1,000,000	1,018,139	0.1	6.95% 28/01/60-RegS	美元 1,000,000	871,808	0.1
Japan Fin Org 0.875%							
22/09/21-RegS	欧元 800,000	950,577	0.1	<b>摩洛哥 (0.1%)</b>			
Japan Fin Org 3.375%				Kingdom Of Morocco			
27/09/23-RegS	美元 1,000,000	1,068,932	0.1	2% 30/09/30-RegS	欧元 1,150,000	1,344,985	0.1
JGB No1 (40Yr) 2.4%							
20/03/48	日元 250,000,000	3,262,747	0.2	<b>荷兰 (0.2%)</b>			
JGB No10 (40Yr) 0.9%				BNG Bank 5.2%			
20/03/57	日元 617,450,000	5,973,554	0.4	07/12/28-RegS	英镑 400,000	731,368	0.1
JGB No151 (20Yr) 1.2%				Neder Waterscha 3.4% 22/07/25-RegS	澳元 1,800,000	1,525,019	0.1
20/12/34	日元 419,800,000	4,291,975	0.3				
JGB No160 (20Yr) 0.7%				<b>新西兰 (0.2%)</b>			
20/03/37	日元 599,650,000	5,725,684	0.4	Auckland Council			
JGB No20 (30Yr) 2.5%				0.125% 09/29-RegS	欧元 3,000,000	3,512,764	0.2
20/09/35	日元 3,690,400,000	43,896,881	3.0				
JGB No37 (30Yr) 1.9%				<b>葡萄牙 (0.3%)</b>			
20/09/42	日元 528,200,000	6,128,646	0.4	Obrigacoes			
JGB No4 (40Yr) 2.2%				Tes2.875%10/25-RegS/144A	欧元 2,700,000	3,686,745	0.3
20/03/51	日元 1,283,350,000	16,403,152	1.1				
JPN Bank for Intl 1.5%							
21/07/21	美元 500,000	503,356	0.0				

投资组合 (续)

(续)

截至二零二一年三月三十一日 (未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
<b>罗马尼亚 (0.5%)</b>				<b>英国 (6.7%)</b>			
Romania 3.624% 26/05/30-RegS	欧元 4,750,000	6,583,030	0.5	HSBC Holdings Plc 24/07/27	英镑 2,493,000	3,475,359	0.2
<b>沙特阿拉伯 (0.4%)</b>				Imperial Brands Fin Plc 3.125% 26/07/24- Regs	美元 2,080,000	2,211,751	0.2
Saudi International Bond 0% 03/03/24- RegS	欧元 4,887,000	5,736,511	0.4	St Engineering 1.5% 29/04/25-RegS	美元 2,403,000	2,433,918	0.2
<b>新加坡 (0.6%)</b>				Standard Chart 4.05% 12/04/26-RegS	美元 2,000,000	2,234,596	0.2
DBS Group Hldgs VRN 4.52%12/28-RegS	美元 2,000,000	2,196,986	0.2	TESCO PLC 5.125% 10/04/47-RegS	欧元 1,500,000	2,730,336	0.2
Singapore Airlines Ltd 3% 20/07/26-RegS	美元 4,285,000	4,358,589	0.3	UK Treasury 0.5/8% 2050 0.625% 22/10/50-RegS	英镑 20,980,000	23,700,042	1.6
United Over Bk VRN 2.88% 08/03/27	美元 2,000,000	2,042,340	0.1	UK Treasury 0.375% 22/10/30-RegS	英镑 14,400,188	18,991,140	1.3
<b>西班牙 (0.8%)</b>				UK Treasury 4 1/2% 2034 4.5% 07/09/34-RegS	英镑 2,500,000	4,925,036	0.3
Banco Santander Sa Ser Emtn 1.625% 22/10130-RegS	欧元 1,500,000	1,812,446	0.1	UK Treasury 4.75% 07/12/30	英镑 18,750,000	35,658,265	2.4
Bonos Y Oblig Del Estado 0% 31/05/24	欧元 3,000,000	3,573,013	0.2	UK Treasury 5% 07/03/25-RegS	英镑 1,010,000	1,657,560	0.1
Spain Kingdom 1.2% 10/40-RegS/144A	欧元 5,500,000	6,760,491	0.5	<b>美国 (14.5%)</b>			
<b>国际 (0.4%)</b>				Edison Intl 4.125% 15/03/28	美元 2,000,000	2,152,316	0.2
Arab Petroleum Invst 1.26% 10/02/26- RegS	美元 1,610,000	1,605,841	0.1	General Motors Finl Co 2.35% 03/09/25- Regs	英镑 2,500,000	3,608,335	0.3
Asian Dev Bank 1.375% 07/03/25	英镑 500,000	715,303	0.1	Gray Oak Pipeline 2.6%15/10/25-144A	美元 2,000,000	2,060,263	0.1
Banque Ouest Africaine D Ser 2.75% 22/01/33-RegS	欧元 2,000,000	2,439,626	0.2	Hyundai Capital 3% 10/02/27-RegS	美元 2,000,000	2,092,558	0.1
<b>泰国 (0.4%)</b>				Hyundai Capital America 1.8% 08/01/28-RegS	美元 2,000,000	1,922,894	0.1
Bangkok Bank Plc Of Hong Kong 3.875% 27/09/22-RegS	美元 2,000,000	2,091,841	0.2	Southern Copper 7.5% 27/07/35	美元 2,000,000	2,869,216	0.2
Export-Import Bk Thailand 1.457% 15/10/25-RegS	美元 1,800,000	1,802,946	0.1	United Rentals NA 3.875% 15/11/27	美元 2,000,000	2,104,278	0.1
Kasikornbank 2.375% 06/04/22-RegS	美元 2,000,000	2,055,694	0.1	US Treasury 0.125% 31/05/22	美元 5,000,000	5,004,047	0.3
<b>乌克兰 (0.1%)</b>				US Treasury 0.25% 30/06/25	美元 47,290,000	46,372,997	3.2
Ukraine Govt Of 7.253% 15/03/33-RegS	美元 1,500,000	1,501,492	0.1	US Treasury 0.375% 31/01/26	美元 51,727,000	50,482,140	3.5
<b>阿拉伯联合酋长国 (0.2%)</b>							
Sharjah (Govt of) 4% 28/07/50-RegS	USD4,100,000	3,649,295	0.2				

投资组合 (续)  
截至二零二一年三月三十一日 (未经审计)

(续)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
<b>美国 (续)</b>				<b>(III) 衍生性产品 (1.3%)</b>			
US Treasury 1.125% 15/02/31	美元 39,500,000	37,373,497	2.6	<b>远期外汇合约 (1.1%)</b>		15,664,175	1.1
US Treasury 1.375% 15/11/40	美元 11,750,000	10,054,149	0.7	<b>期货 (0.2%)</b>			
US Treasury 1.625% 15/11/50	美元 8,500,000	7,132,506	0.5	CAN 10Yr Bond Futures 21/06/2021	74	(24,140)	0.0
US Treasury 1.875% 15/02/51	美元 11,000,000	9,773,531	0.7	Euro-BOBL Futures 08/06/2021	(173)	(14,303)	0.0
US Treasury 2.875% 15/08/45	美元 6,000,000	6,571,520	0.5	Euro-Bund Futures 08/06/2021	(34)	15,185	0.0
US Treasury 7.625% 15/02/25	美元 15,780,000	20,191,411	1.4	Euro-BUXL 30Yr Bond Futures 08/06/2021	113	(556,481)	0.0
<b>维京群岛 (0.7%)</b>				JPN 10Yr Bond(OSE) Futures 14/06/2021	65	124,027	0.0
Baic Finance Inv Co Ltd 2% 16/03/24-RegS	美元 700,000	705,138	0.1	Long Gilt Futures 28/06/2021	(679)	956,905	0.1
Castle Peak Pwr Fin 2.2% 06/30-RegS	美元 1,900,000	1,852,076	0.1	US 10Yr Note (CBT) Futures 21/06/2021	(1,223)	2,903,203	0.2
Cheung Kong Infra Fin 1% 12/24-RegS	欧元 1,330,000	1,595,493	0.1	US 5Yr Note (CBT) Futures 30/06/2021	(407)	136,008	0.0
HKT Capital No4 3 14/07/26-RegS	美元 2,000,000	2,116,753	0.1	US Long Bond (CBT) Futures 21/06/2021	351	(1,184,625)	(0.1)
Huarong Finance 2017 4.25% 07/11/27- RegS	美元 2,000,000	2,175,926	0.2	US Ultra Bond (CBT) Futures 21/06/2021	(80)	626,031	0.0
PCCW-HKT Cap No5 3.75% 8/3/23-RegS	美元 500,000	526,192	0.0			18,645,985	1.3
Xingsheng BVI 3.375% 25/07/22-RegS	美元 1,000,000	1,030,897	0.1			-----	----
Xingsheng BVI 4.5% 20/09/21-RegS	美元 600,000	608,710	0.0	<b>总上市投资</b>		1,431,162,684	97.9
		1,075,816,389	73.6	<b>其他净资产</b>		30,485,627	2.1
		-----	----			-----	----
<b>(II) 集体投资计划 (23.0%)</b>				<b>截至二零二一年三月三十一日可 赎回份额持有人应占净资产</b>			
<b>卢森堡 (23.0%)</b>							
JPMF-JPM Global Corp Bd'X'- dist-USD**	美元 2,565,393	284,322,531	19.4	<b>总投资, 按成本</b>		1,401,085,269	
JPMIF-JPM GI High Yield'X'(acc)-USD**	美元 273,000	52,377,779	3.6			-----	----
		336,700,310	23.0			-----	----
		-----	----			-----	----

\* 由管理人的关联人士发行和管理  
\* 在香港未获认可及并非供香港公众投资



投资组合持有变动表

(续)

截至二零二一年三月三十一日止期间 (未经审计)

	持有占资产净值百分比		持有占资产净值百分比	
	二零二一年 三月三十一日	二零二零年 九月三十日	二零二一年 三月三十一日	二零二零年 九月三十日
<b>上市投资</b>				
<b>债务证券</b>				
美国	14.5	15.5		
德国	8.3	4.5		
日本	7.7	6.0		
意大利	7.3	6.4		
英国	6.7	4.5		
中国	6.4	9.7		
加拿大	4.9	2.5		
澳大利亚	3.3	6.1		
法国	2.9	2.9		
开曼群岛	1.4	0.4		
西班牙	0.8	0.5		
香港	0.8	0.3		
维京群岛	0.7	0.7		
韩国	0.6	0.9		
新加坡	0.6	0.5		
印度	0.6	0.3		
罗马尼亚	0.5	0.4		
加纳	0.5	-		
墨西哥	0.4	0.1		
泰国	0.4	0.1		
国际	0.4	0.0		
埃及	0.4	-		
沙特阿拉伯	0.4	-		
跨国性	0.3	0.4		
葡萄牙	0.3	0.3		
印度尼西亚	0.3	0.3		
卢森堡	0.3	0.2		
新西兰	0.2	1.8		
荷兰	0.2	0.8		
以色列	0.2	0.2		
爱尔兰	0.2	0.1		
阿拉伯联合酋长国	0.2	0.0		
哥伦比亚	0.2	-		
科特迪瓦	0.2	-		
巴西	0.1	0.1		
芬兰	0.1	0.1		
冰岛	0.1	0.1		
摩洛哥	0.1	-		
乌克兰	0.1	-		
菲律宾	-	0.4		
匈牙利	-	0.3		
卡塔尔	-	0.3		
奥地利	-	0.2		
百慕大	-	0.2		
希腊	-	0.2		
瑞典	-	0.2		
瑞士	-	0.2		
比利时	-	0.0		
<b>集体投资计划</b>				
卢森堡			23.0	26.3
跨国性			-	2.5
欧洲			-	1.0
<b>衍生性产品</b>				
远期外汇合约			1.1	0.2
期货			0.2	(0.0)
<b>总上市投资</b>			<u>97.9</u>	<u>98.0</u>
<b>其他净资产</b>			<u>2.1</u>	<u>2.0</u>
<b>可赎回份额持有人应占净资产</b>			<u><u>100.0</u></u>	<u><u>100.0</u></u>

金融衍生工具详情

截至二零二一年三月三十一日 (未经审计)

截至二零二一年三月三十一日，本基金持有之金融衍生工具汇总如下：

(a) 远期外汇合约

以下为截至二零二一年三月三十一日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
<b>截至二零二一年三月三十一日</b>				
未平仓合约：				
离岸人民币 1,249,000	美元 190,618	2021年4月1日	美林国际，伦敦	256
离岸人民币 42,657	美元 6,510	2021年4月1日	美林国际，伦敦	9
美元 581,397	离岸人民币 3,825,961	2021年4月1日	美国道富银行	1,722
美元 106,500	加元 134,345	2021年4月1日	法国巴黎银行	391
美元 41,206	离岸人民币 271,162	2021年4月1日	美国道富银行	122
美元 89,819	纽元 128,416	2021年4月1日	法国巴黎银行	117
美元 28,112	离岸人民币 184,994	2021年4月1日	美国道富银行	83
美元 1,103	加元 1,387	2021年4月1日	汇丰银行，伦敦	1
日元 10,358,348,974	美元 97,634,061	2021年4月5日	多伦多道明银行	3,890,292
美元 10,584,878	加元 13,357,568	2021年4月5日	汇丰银行，伦敦	43,029
澳元 21,908,341	美元 17,171,495	2021年4月6日	法国巴黎银行	484,569
澳元 5,310,074	美元 4,203,403	2021年4月6日	美国道富银行	158,878
澳元 8,019,544	美元 6,248,524	2021年4月6日	汇丰银行，伦敦	140,278
欧元 112,340,000	美元 136,492,561	2021年4月6日	法国巴黎银行	4,448,462
欧元 112,347,155	美元 136,359,202	2021年4月6日	法国巴黎银行	4,306,693
欧元 45,361,140	美元 54,926,026	2021年4月6日	法国巴黎银行	1,608,678
欧元 5,984,733	美元 7,201,861	2021年4月6日	美国道富银行	167,423
欧元 3,394,134	美元 4,090,622	2021年4月6日	法国巴黎银行	101,166
英镑 74,891,663	美元 104,417,686	2021年4月6日	高盛国际，伦敦	1,088,386
英镑 6,481,104	美元 9,001,003	2021年4月6日	汇丰银行，伦敦	58,914
英镑 1,773,472	美元 2,468,489	2021年4月6日	加拿大皇家银行	21,599
澳元 100,000	美元 76,278	2021年4月7日	花旗银行，伦敦	110
澳元 20,732	美元 15,816	2021年4月7日	花旗银行，伦敦	25
离岸人民币 696,308,210	美元 107,348,153	2021年4月7日	花旗银行，伦敦	1,264,025
离岸人民币 1,257,000	美元 192,018	2021年4月7日	高盛国际，伦敦	512
离岸人民币 61,200	美元 9,349	2021年4月7日	高盛国际，伦敦	25
离岸人民币 8,239	美元 1,256	2021年4月7日	美国道富银行	1
美元 106,073,074	离岸人民币 696,308,210	2021年4月7日	多伦多道明银行	11,054
美元 610,555	离岸人民币 4,016,936	2021年4月7日	高盛国际，伦敦	1,434
美元 473,730	澳元 623,290	2021年4月7日	美国道富银行	1,014
美元 144,102	加元 182,017	2021年4月7日	渣打银行，伦敦	719
美元 28,965	离岸人民币 190,566	2021年4月7日	高盛国际，伦敦	68
美元 16,841	纽元 24,117	2021年4月7日	加拿大皇家银行	49
美元 9,084	离岸人民币 59,764	2021年4月7日	高盛国际，伦敦	21
美元 2,821	离岸人民币 18,576	2021年4月7日	美国道富银行	9
美元 1,097	加元 1,384	2021年4月7日	美林国际，伦敦	4
美元 1,093	离岸人民币 7,196	2021年4月7日	美国道富银行	3
美元 69,898	纽元 99,855	2021年4月8日	巴克莱银行，伦敦	35
美元 257,276	澳元 337,814	2021年4月8日	美国道富银行	30
美元 1,105	离岸人民币 7,272	2021年4月8日	花旗银行，伦敦	3
美元 1,100	离岸人民币 7,238	2021年4月8日	花旗银行，伦敦	3
离岸人民币 1,249,800	美元 190,410	2021年4月12日	高盛国际，伦敦	74
离岸人民币 54,410	美元 8,289	2021年4月12日	高盛国际，伦敦	3
离岸人民币 36,000	美元 5,485	2021年4月12日	高盛国际，伦敦	2
澳元 1,132,047	美元 883,051	2021年4月21日	法国巴黎银行	20,740
澳元 1,098,707	美元 855,282	2021年4月21日	渣打银行，伦敦	18,367
澳元 2,211,296	美元 1,702,542	2021年4月21日	花旗银行，伦敦	18,138
澳元 536,843	美元 418,828	2021年4月21日	法国巴黎银行	9,900
澳元 392,730	美元 306,831	2021年4月21日	法国巴黎银行	7,678
澳元 519,587	美元 402,691	2021年4月21日	花旗银行，伦敦	6,907

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损)	
					美元
澳元 570,834	美元 441,147	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦		6,327
澳元 421,990	美元 327,751	2021年4月21日	法国巴黎银行		6,310
澳元 386,956	美元 299,811	2021年4月21日	加拿大皇家银行		5,056
澳元 456,928	美元 352,963	2021年4月21日	美国道富银行		4,909
澳元 367,809	美元 284,909	2021年4月21日	加拿大皇家银行		4,739
澳元 879,193	美元 674,322	2021年4月21日	法国巴黎银行		4,617
澳元 482,477	美元 372,053	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		4,537
澳元 231,274	美元 180,212	2021年4月21日	法国巴黎银行		4,044
澳元 195,311	美元 152,262	2021年4月21日	美国道富银行		3,489
澳元 276,433	美元 213,852	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦		3,286
澳元 281,204	美元 216,793	2021年4月21日	加拿大皇家银行		2,592
澳元 189,789	美元 147,094	2021年4月21日	加拿大皇家银行		2,526
澳元 318,139	美元 244,405	2021年4月21日	加拿大皇家银行		2,070
澳元 397,619	美元 304,878	2021年4月21日	法国巴黎银行		2,001
澳元 100,308	美元 78,367	2021年4月21日	法国巴黎银行		1,960
澳元 111,504	美元 86,368	2021年4月21日	法国巴黎银行		1,433
澳元 89,062	美元 69,004	2021年4月21日	加拿大皇家银行		1,164
澳元 65,636	美元 50,631	2021年4月21日	法国巴黎银行		634
澳元 1,016,614	美元 774,982	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		600
澳元 277,865	美元 211,992	2021年4月21日	美国道富银行		335
澳元 16,027	美元 12,312	2021年4月21日	加拿大皇家银行		104
澳元 14,088	美元 10,802	2021年4月21日	法国巴黎银行		71
澳元 59,598	美元 45,458	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		61
澳元 2,797	美元 2,168	2021年4月21日	美国道富银行		37
澳元 3,766	美元 2,900	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		31
澳元 1,413	美元 1,104	2021年4月21日	法国巴黎银行		28
澳元 1,410	美元 1,100	2021年4月21日	法国巴黎银行		26
澳元 2,246	美元 1,732	2021年4月21日	法国巴黎银行		22
澳元 1,420	美元 1,101	2021年4月21日	加拿大皇家银行		19
澳元 1,416	美元 1,098	2021年4月21日	美国道富银行		19
澳元 1,411	美元 1,093	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		18
澳元 1,411	美元 1,093	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		18
澳元 1,382	美元 1,070	2021年4月21日	法国巴黎银行		17
澳元 1,419	美元 1,097	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		16
澳元 1,429	美元 1,103	2021年4月21日	法国巴黎银行		14
澳元 2,170	美元 1,665	2021年4月21日	法国巴黎银行		11
澳元 1,420	美元 1,091	2021年4月21日	法国巴黎银行		9
澳元 6,779	美元 5,172	2021年4月21日	美国道富银行		8
澳元 5,679	美元 4,333	2021年4月21日	美国道富银行		7
澳元 1,432	美元 1,092	2021年4月21日	加拿大皇家银行		1
加元 695,669	美元 559,507	2021年4月21日	加拿大皇家银行		5,985
加元 1,653,358	美元 1,319,834	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦		4,308
加元 795,890	美元 636,953	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		3,688
加元 483,723	美元 388,515	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		3,631
加元 895,043	美元 715,485	2021年4月21日	加拿大皇家银行		3,326
加元 180,900	美元 145,018	2021年4月21日	加拿大皇家银行		1,082
加元 205,993	美元 164,975	2021年4月21日	多伦多道明银行		1,073
加元 66,711	美元 53,580	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		501
加元 6,070	美元 4,852	2021年4月21日	加拿大皇家银行		23
加元 4,699	美元 3,762	2021年4月21日	加拿大皇家银行		23
加元 1,383	美元 1,106	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		6
加元 3,358	美元 2,676	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		5
加元 1,376	美元 1,099	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦		4
加元 148,343	美元 118,036	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		3
加元 1,380	美元 1,100	2021年4月21日	美国道富银行		2
离岸人民币 12,943,830	美元 1,990,337	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		20,436
离岸人民币 7,703,967	美元 1,186,408	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		13,954
离岸人民币 6,072,855	美元 935,851	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		11,633
离岸人民币 4,233,114	美元 652,683	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		8,452
离岸人民币 6,248,799	美元 958,536	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		7,542
离岸人民币 4,014,195	美元 616,749	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		5,835
离岸人民币 3,874,963	美元 594,756	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		5,031
离岸人民币 4,156,744	美元 636,966	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		4,358
离岸人民币 2,835,448	美元 435,823	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		4,301

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损)	
					美元
离岸人民币 4,646,419	美元 711,265	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		4,133
离岸人民币 4,797,554	美元 733,566	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		3,433
离岸人民币 3,921,517	美元 599,794	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		2,985
离岸人民币 2,319,733	美元 355,813	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		2,776
离岸人民币 1,320,192	美元 203,447	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		2,529
离岸人民币 1,734,036	美元 266,044	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		2,144
离岸人民币 1,546,643	美元 237,293	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		1,912
离岸人民币 1,074,027	美元 165,268	2021年4月21日	美国道富银行		1,813
离岸人民币 1,109,668	美元 170,083	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		1,205
离岸人民币 620,950	美元 95,691	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		1,189
离岸人民币 1,731,222	美元 264,549	2021年4月21日	多伦多道明银行		1,077
离岸人民币 988,575	美元 151,493	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		1,043
离岸人民币 506,339	美元 78,070	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		1,011
离岸人民币 594,360	美元 91,458	2021年4月21日	美国道富银行		1,004
离岸人民币 765,496	美元 117,444	2021年4月21日	美国道富银行		944
离岸人民币 526,409	美元 80,945	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		831
离岸人民币 405,529	美元 62,527	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		810
离岸人民币 668,833	美元 102,589	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		800
离岸人民币 607,374	美元 93,194	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		759
离岸人民币 954,048	美元 145,878	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		683
离岸人民币 417,559	美元 64,155	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		607
离岸人民币 302,529	美元 46,589	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		548
离岸人民币 395,278	美元 60,670	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		513
离岸人民币 654,389	美元 100,089	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		498
离岸人民币 4,838,225	美元 736,794	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		472
离岸人民币 324,414	美元 49,844	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		472
离岸人民币 305,909	美元 47,020	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		464
离岸人民币 311,786	美元 47,855	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		405
离岸人民币 380,177	美元 58,260	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		401
离岸人民币 193,278	美元 29,785	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		370
离岸人民币 261,654	美元 40,144	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		323
离岸人民币 189,310	美元 29,130	2021年4月21日	美国道富银行		320
离岸人民币 196,964	美元 30,274	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		299
离岸人民币 239,903	美元 36,807	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		297
离岸人民币 454,384	美元 69,435	2021年4月21日	多伦多道明银行		283
离岸人民币 667,906	美元 101,927	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		279
离岸人民币 264,758	美元 40,571	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		278
离岸人民币 324,924	美元 49,697	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		247
离岸人民币 198,031	美元 30,383	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		245
离岸人民币 133,289	美元 20,452	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		167
离岸人民币 176,833	美元 27,044	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		132
离岸人民币 192,911	美元 29,479	2021年4月21日	多伦多道明银行		120
离岸人民币 81,017	美元 12,430	2021年4月21日	美国道富银行		100
离岸人民币 67,135	美元 10,300	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		83
离岸人民币 42,441	美元 6,536	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		77
离岸人民币 58,840	美元 9,027	2021年4月21日	美国道富银行		73
离岸人民币 354,466	美元 54,010	2021年4月21日	美国道富银行		65
离岸人民币 44,534	美元 6,842	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		65
离岸人民币 51,253	美元 7,864	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		64
离岸人民币 44,101	美元 6,769	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		57
离岸人民币 48,206	美元 7,387	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		51
离岸人民币 50,526	美元 7,734	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		45
离岸人民币 432,775	美元 65,906	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		42
离岸人民币 22,474	美元 3,462	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		41
离岸人民币 37,814	美元 5,794	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		40
离岸人民币 21,434	美元 3,301	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		39
离岸人民币 88,713	美元 13,538	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		37
离岸人民币 48,635	美元 7,437	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		35
离岸人民币 20,270	美元 3,117	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		32
离岸人民币 14,785	美元 2,278	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		28
离岸人民币 133,199	美元 20,296	2021年4月21日	美国道富银行		24
离岸人民币 14,898	美元 2,290	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		23
离岸人民币 16,768	美元 2,572	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		20
离岸人民币 15,813	美元 2,426	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		20

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
离岸人民币 12,858	美元 1,977	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	20
离岸人民币 15,040	美元 2,307	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	18
离岸人民币 15,463	美元 2,370	2021年4月21日	加拿大皇家银行	17
离岸人民币 14,633	美元 2,242	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	15
离岸人民币 8,674	美元 1,335	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	15
离岸人民币 11,011	美元 1,689	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	14
离岸人民币 7,128	美元 1,099	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	14
离岸人民币 7,128	美元 1,099	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	14
离岸人民币 7,125	美元 1,098	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	14
离岸人民币 7,125	美元 1,098	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	14
离岸人民币 7,138	美元 1,098	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	12
离岸人民币 7,113	美元 1,095	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	12
离岸人民币 7,113	美元 1,095	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	12
离岸人民币 58,906	美元 8,976	2021年4月21日	美国道富银行	11
离岸人民币 7,163	美元 1,101	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	11
离岸人民币 7,163	美元 1,101	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	11
离岸人民币 7,163	美元 1,101	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	11
离岸人民币 7,163	美元 1,101	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	11
离岸人民币 16,387	美元 2,504	2021年4月21日	多伦多道明银行	10
离岸人民币 7,724	美元 1,185	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	9
离岸人民币 7,162	美元 1,099	2021年4月21日	美国道富银行	9
离岸人民币 7,162	美元 1,099	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	9
离岸人民币 7,160	美元 1,098	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	9
离岸人民币 7,152	美元 1,097	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	9
离岸人民币 7,152	美元 1,097	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	9
离岸人民币 7,151	美元 1,097	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	9
离岸人民币 7,151	美元 1,097	2021年4月21日	美国道富银行	9
离岸人民币 7,138	美元 1,095	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	9
离岸人民币 7,138	美元 1,095	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	9
离岸人民币 7,138	美元 1,095	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	9
离岸人民币 7,138	美元 1,095	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	9
离岸人民币 7,154	美元 1,096	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	8
离岸人民币 7,154	美元 1,096	2021年4月21日	美国道富银行	8
离岸人民币 7,154	美元 1,096	2021年4月21日	美国道富银行	8
离岸人民币 7,154	美元 1,096	2021年4月21日	美国道富银行	8
离岸人民币 7,151	美元 1,096	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	7
离岸人民币 7,151	美元 1,096	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	7
离岸人民币 14,480	美元 2,210	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	6
离岸人民币 7,177	美元 1,099	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	6
离岸人民币 7,177	美元 1,099	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	6
离岸人民币 7,177	美元 1,099	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	6
离岸人民币 7,177	美元 1,099	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	6
离岸人民币 7,165	美元 1,096	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	5
离岸人民币 7,165	美元 1,096	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	5
离岸人民币 7,165	美元 1,096	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	5
离岸人民币 7,122	美元 1,089	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	5
离岸人民币 34,083	美元 5,190	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	3
离岸人民币 7,205	美元 1,099	2021年4月21日	美国道富银行	3
离岸人民币 7,205	美元 1,099	2021年4月21日	美国道富银行	3
离岸人民币 7,205	美元 1,100	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	3
离岸人民币 7,205	美元 1,099	2021年4月21日	美国道富银行	3
离岸人民币 8,321	美元 1,268	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1
离岸人民币 7,177	美元 1,094	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	1
纽元 1,433,745	美元 1,043,352	2021年4月21日	美国道富银行	39,262
纽元 915,676	美元 664,593	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	23,321
纽元 518,833	美元 372,566	2021年4月21日	美国道富银行	9,214
纽元 500,002	美元 358,583	2021年4月21日	多伦多道明银行	8,419
纽元 373,823	美元 267,020	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	5,221
纽元 193,314	美元 139,016	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	3,633
纽元 127,100	美元 92,496	2021年4月21日	美国道富银行	3,484
纽元 138,341	美元 100,279	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	3,395
纽元 161,640	美元 116,022	2021年4月21日	法国巴黎银行	2,822

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损)	
					美元
纽元 127,762	美元 91,452	2021年4月21日	多伦多道明银行		1,977
纽元 69,482	美元 50,565	2021年4月21日	美国道富银行		1,905
纽元 62,928	美元 45,770	2021年4月21日	美国道富银行		1,700
纽元 68,152	美元 49,419	2021年4月21日	法国巴黎银行		1,691
纽元 81,758	美元 58,769	2021年4月21日	多伦多道明银行		1,511
纽元 53,175	美元 38,248	2021年4月21日	法国巴黎银行		1,009
纽元 57,499	美元 41,172	2021年4月21日	法国巴黎银行		904
纽元 26,893	美元 19,340	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		505
纽元 6,796	美元 4,851	2021年4月21日	法国巴黎银行		92
纽元 20,354	美元 14,313	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		58
纽元 1,513	美元 1,101	2021年4月21日	美国道富银行		41
纽元 1,511	美元 1,100	2021年4月21日	法国巴黎银行		41
纽元 1,479	美元 1,077	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦		41
纽元 1,516	美元 1,100	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦		38
纽元 1,534	美元 1,105	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		31
纽元 1,532	美元 1,101	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		29
纽元 1,526	美元 1,095	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		26
纽元 1,533	美元 1,078	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		4
美元 82,533,186	加元 104,742,569	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦		807,231
美元 633,496	加元 800,000	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		3,039
美元 169,762	加元 214,843	2021年4月21日	法国巴黎银行		1,182
美元 199,590	加元 252,039	2021年4月21日	加拿大皇家银行		950
美元 63,818	离岸人民币 420,695	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		207
美元 68,447	离岸人民币 450,815	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		161
美元 131,005	加元 164,820	2021年4月21日	美国道富银行		137
美元 79,144	纽元 113,165	2021年4月21日	多伦多道明银行		109
美元 118,266	加元 148,731	2021年4月21日	法国巴黎银行		75
美元 18,961	加元 23,915	2021年4月21日	法国巴黎银行		67
美元 222,795	加元 280,089	2021年4月21日	多伦多道明银行		64
美元 41,820	纽元 59,771	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦		39
美元 2,704	加元 3,424	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		20
美元 7,827	离岸人民币 51,554	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		18
美元 2,388	加元 3,024	2021年4月21日	美林国际, 伦敦		18
美元 2,637	离岸人民币 17,384	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦		9
美元 1,150	加元 1,453	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦		7
美元 1,495	加元 1,885	2021年4月21日	法国巴黎银行		5
美元 7,138	加元 8,976	2021年4月21日	加拿大皇家银行		4
欧元 1,904,074	美元 2,255,189	2021年5月5日	巴克莱银行, 伦敦		15,792
美元 7,584,024	英镑 5,516,928	2021年5月5日	法国巴黎银行		28,514
美元 2,447,856	欧元 2,086,620	2021年5月5日	多伦多道明银行		6,234
加元 127,299	美元 101,310	2021年5月21日	加拿大皇家银行		20
加元 1,389	美元 1,106	2021年5月21日	加拿大皇家银行		0
离岸人民币 2,041,832	美元 310,226	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦		196
离岸人民币 932,721	美元 141,699	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦		76
离岸人民币 271,850	美元 41,299	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦		22
离岸人民币 209,529	美元 31,835	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦		20
离岸人民币 163,052	美元 24,773	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦		16
离岸人民币 93,935	美元 14,271	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦		8
离岸人民币 23,233	美元 3,530	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦		2
离岸人民币 9,326	美元 1,417	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦		1
离岸人民币 7,234	美元 1,099	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦		1
			未实现总收益		19,067,386
					-----
加元 23,915	美元 18,960	2021年4月1日	法国巴黎银行		(67)
美元 1,101	离岸人民币 7,205	2021年4月1日	高盛国际, 伦敦		(3)
美元 2,213	离岸人民币 14,480	2021年4月1日	高盛国际, 伦敦		(6)
美元 211,973	澳元 277,865	2021年4月1日	美国道富银行		(337)
加元 14,615,149	美元 11,552,713	2021年4月5日	汇丰银行, 伦敦		(75,784)
加元 80,296,503	美元 63,754,257	2021年4月5日	汇丰银行, 伦敦		(133,404)
美元 1,935,148	加元 2,427,430	2021年4月5日	加拿大皇家银行		(3,771)
美元 1,933,546	日元 210,809,120	2021年4月5日	美国道富银行		(25,709)
美元 3,744,330	日元 408,751,625	2021年4月5日	法国巴黎银行		(45,099)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 2,471,494	日元 260,009,102	2021年4月5日	巴克莱银行, 伦敦	(118,394)
英镑 2,944,245	美元 4,054,158	2021年4月6日	加拿大皇家银行	(8,067)
美元 813,039	欧元 683,172	2021年4月6日	法国巴黎银行	(10,041)
美元 2,646,473	欧元 2,223,822	2021年4月6日	多伦多道明银行	(32,600)
美元 3,576,427	欧元 3,000,000	2021年4月6日	多伦多道明银行	(50,236)
美元 6,863,485	英镑 4,937,466	2021年4月6日	巴克莱银行, 伦敦	(51,179)
美元 2,565,727	英镑 1,815,132	2021年4月6日	巴克莱银行, 伦敦	(61,359)
美元 2,761,303	欧元 2,274,887	2021年4月6日	美林国际, 伦敦	(87,408)
美元 8,619,639	澳元 11,129,375	2021年4月6日	巴克莱银行, 伦敦	(142,729)
美元 23,325,449	离岸人民币 151,300,000	2021年4月6日	美国道富银行	(272,772)
加元 8,976	美元 7,138	2021年4月7日	加拿大皇家银行	(4)
美元 1,106	加元 1,389	2021年4月7日	加拿大皇家银行	(0)
离岸人民币 17,384	美元 2,640	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	(9)
离岸人民币 420,695	美元 63,882	2021年4月8日	花旗银行, 伦敦	(207)
美元 14,318	离岸人民币 93,935	2021年4月8日	高盛国际, 伦敦	(8)
美元 101,306	加元 127,299	2021年4月8日	加拿大皇家银行	(21)
美元 41,436	离岸人民币 271,850	2021年4月8日	高盛国际, 伦敦	(22)
美元 142,168	离岸人民币 932,721	2021年4月8日	高盛国际, 伦敦	(76)
离岸人民币 51,554	美元 7,834	2021年4月9日	花旗银行, 伦敦	(19)
离岸人民币 450,815	美元 68,505	2021年4月9日	花旗银行, 伦敦	(167)
美元 1,421	离岸人民币 9,326	2021年4月9日	高盛国际, 伦敦	(1)
美元 1,103	离岸人民币 7,234	2021年4月9日	高盛国际, 伦敦	(1)
澳元 276,241	美元 210,141	2021年4月21日	美国道富银行	(280)
澳元 623,290	美元 473,765	2021年4月21日	美国道富银行	(1,012)
澳元 238,380	美元 180,487	2021年4月21日	美国道富银行	(1,093)
加元 1,387	美元 1,103	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(1)
加元 1,387	美元 1,103	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(1)
加元 1,384	美元 1,097	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(4)
加元 1,391	美元 1,100	2021年4月21日	法国巴黎银行	(6)
加元 2,127	美元 1,685	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(7)
加元 1,393	美元 1,102	2021年4月21日	法国巴黎银行	(7)
加元 1,377	美元 1,088	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(8)
加元 6,349	美元 5,036	2021年4月21日	法国巴黎银行	(16)
加元 5,106	美元 4,045	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(18)
加元 166,929	美元 132,713	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(107)
加元 30,060	美元 23,740	2021年4月21日	法国巴黎银行	(178)
加元 134,345	美元 106,505	2021年4月21日	法国巴黎银行	(389)
加元 221,438	美元 175,582	2021年4月21日	美国道富银行	(609)
加元 182,017	美元 144,105	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(720)
加元 287,400	美元 227,952	2021年4月21日	法国巴黎银行	(723)
加元 195,611	美元 154,873	2021年4月21日	美国道富银行	(769)
加元 164,174	美元 129,859	2021年4月21日	法国巴黎银行	(769)
加元 299,287	美元 237,027	2021年4月21日	法国巴黎银行	(1,106)
加元 194,544	美元 153,667	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(1,125)
加元 334,221	美元 264,735	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(1,194)
加元 487,906	美元 385,984	2021年4月21日	法国巴黎银行	(2,228)
加元 353,927	美元 278,267	2021年4月21日	法国巴黎银行	(3,342)
加元 979,165	美元 775,649	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(3,443)
加元 934,865	美元 740,387	2021年4月21日	法国巴黎银行	(3,456)
加元 616,370	美元 486,222	2021年4月21日	法国巴黎银行	(4,205)
加元 2,524,616	美元 1,994,956	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(13,803)
离岸人民币 7,272	美元 1,104	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(3)
离岸人民币 7,238	美元 1,099	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(3)
离岸人民币 7,196	美元 1,092	2021年4月21日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 18,576	美元 2,818	2021年4月21日	美国道富银行	(9)
离岸人民币 27,473	美元 4,168	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(13)
离岸人民币 59,764	美元 9,074	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(21)
离岸人民币 190,566	美元 28,934	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(68)
离岸人民币 184,994	美元 28,065	2021年4月21日	美国道富银行	(89)
离岸人民币 199,519	美元 30,272	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(93)
离岸人民币 248,803	美元 37,750	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(115)
离岸人民币 271,162	美元 41,138	2021年4月21日	美国道富银行	(130)
离岸人民币 2,410,227	美元 365,691	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(1,118)
离岸人民币 4,016,936	美元 609,893	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(1,438)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
离岸人民币 3,825,961	美元 580,437	2021年4月21日	美国道富银行	(1,830)
纽元 1,564	美元 1,092	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(3)
纽元 24,117	美元 16,841	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(49)
纽元 128,416	美元 89,815	2021年4月21日	法国巴黎银行	(118)
纽元 142,542	美元 99,703	2021年4月21日	渣打银行, 伦敦	(123)
纽元 77,819	美元 54,306	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(193)
纽元 156,041	美元 108,960	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(320)
美元 1,136	离岸人民币 7,461	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(1)
美元 1,204	离岸人民币 7,887	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(3)
美元 1,543	离岸人民币 10,098	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(6)
美元 1,518	离岸人民币 9,935	2021年4月21日	多伦多道明银行	(6)
美元 6,500	离岸人民币 42,657	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(8)
美元 3,191	离岸人民币 20,916	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(8)
美元 1,371	离岸人民币 8,957	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(8)
美元 1,280	离岸人民币 8,355	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(9)
美元 1,099	离岸人民币 7,163	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(9)
美元 1,309	离岸人民币 8,535	2021年4月21日	美国道富银行	(10)
美元 1,234	离岸人民币 8,045	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(10)
美元 1,862	离岸人民币 12,148	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(13)
美元 1,858	离岸人民币 12,111	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(15)
美元 2,578	加元 3,220	2021年4月21日	美国道富银行	(16)
美元 3,456	离岸人民币 22,596	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(17)
美元 1,555	离岸人民币 10,100	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(18)
美元 1,729	离岸人民币 11,230	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(20)
美元 2,750	离岸人民币 17,926	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(21)
美元 2,949	离岸人民币 19,220	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(24)
美元 15,817	澳元 20,732	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(25)
美元 9,339	离岸人民币 61,200	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(25)
美元 2,610	离岸人民币 16,983	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(26)
美元 3,883	离岸人民币 25,319	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(30)
美元 6,238	离岸人民币 40,770	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(33)
美元 4,011	离岸人民币 26,139	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(33)
美元 3,805	离岸人民币 24,728	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(42)
美元 7,684	离岸人民币 50,200	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(44)
美元 3,573	离岸人民币 23,184	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(45)
美元 27,895	加元 35,000	2021年4月21日	多伦多道明银行	(47)
美元 1,343	纽元 1,851	2021年4月21日	法国巴黎银行	(47)
美元 3,012	纽元 4,221	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(56)
美元 23,060	离岸人民币 151,134	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(59)
美元 15,281	离岸人民币 100,000	2021年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(62)
美元 28,568	离岸人民币 187,230	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(74)
美元 6,115	离岸人民币 39,671	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(77)
美元 4,942	澳元 6,376	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(85)
美元 7,893	离岸人民币 51,292	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(87)
美元 76,282	澳元 100,000	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(109)
美元 14,465	离岸人民币 94,285	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(116)
美元 5,460	澳元 7,000	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(128)
美元 246,469	离岸人民币 1,618,496	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(153)
美元 36,464	离岸人民币 238,399	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(182)
美元 39,283	离岸人民币 256,744	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(209)
美元 30,647	离岸人民币 200,000	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(209)
美元 190,310	离岸人民币 1,249,000	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(227)
美元 51,489	离岸人民币 336,520	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(274)
美元 161,349	澳元 211,454	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(279)
美元 34,852	离岸人民币 227,166	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(280)
美元 35,815	离岸人民币 233,400	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(294)
美元 27,377	离岸人民币 177,900	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(302)
美元 37,193	离岸人民币 242,384	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(305)
美元 26,017	离岸人民币 168,807	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(326)
美元 36,999	澳元 48,053	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(396)
美元 297,832	澳元 390,471	2021年4月21日	美国道富银行	(400)
美元 11,117	纽元 15,284	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(412)
美元 43,405	离岸人民币 282,301	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(442)
美元 13,255	纽元 18,264	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(464)
美元 21,438	澳元 27,500	2021年4月21日	法国巴黎银行	(490)



交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 20,452	纽元 28,485	2021年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(503)
美元 191,820	离岸人民币 1,257,000	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(519)
美元 44,552	离岸人民币 289,240	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(533)
美元 93,896	离岸人民币 613,405	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(543)
美元 57,044	离岸人民币 371,131	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(562)
美元 46,608	离岸人民币 302,380	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(589)
美元 25,148	纽元 34,901	2021年4月21日	加拿大皇家银行	(707)
美元 279,026	离岸人民币 1,828,708	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(718)
美元 109,060	离岸人民币 710,809	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(883)
美元 141,955	澳元 185,137	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(931)
美元 145,342	离岸人民币 948,491	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(992)
美元 151,178	离岸人民币 985,366	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,217)
美元 160,793	离岸人民币 1,048,333	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(1,249)
美元 183,295	离岸人民币 1,195,894	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,294)
美元 197,252	澳元 257,181	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,351)
美元 47,540	纽元 65,767	2021年4月21日	多伦多道明银行	(1,481)
美元 69,234	澳元 88,936	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,489)
美元 186,604	离岸人民币 1,216,209	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,511)
美元 397,558	加元 496,734	2021年4月21日	法国巴黎银行	(2,322)
美元 212,967	离岸人民币 1,384,000	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(2,339)
美元 525,716	离岸人民币 3,438,146	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(2,470)
美元 70,241	纽元 96,527	2021年4月21日	法国巴黎银行	(2,641)
美元 510,340	离岸人民币 3,335,491	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(2,717)
美元 2,063,955	离岸人民币 13,543,414	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(2,804)
美元 354,156	离岸人民币 2,308,004	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(2,905)
美元 256,293	离岸人民币 1,663,694	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(3,098)
美元 168,990	澳元 217,364	2021年4月21日	美国道富银行	(3,417)
美元 119,136	纽元 164,437	2021年4月21日	多伦多道明银行	(3,976)
美元 372,657	离岸人民币 2,419,386	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(4,455)
美元 697,863	离岸人民币 4,549,741	2021年4月21日	花旗银行, 伦敦	(5,445)
美元 346,839	澳元 446,575	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(6,670)
美元 703,202	加元 874,318	2021年4月21日	法国巴黎银行	(7,534)
美元 737,554	离岸人民币 4,789,749	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(8,610)
美元 440,945	澳元 566,557	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(9,383)
美元 1,044,936	澳元 1,348,235	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(17,949)
美元 810,804	澳元 1,039,273	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(19,161)
美元 14,915,764	离岸人民币 97,875,378	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(20,264)
美元 19,044,882	离岸人民币 124,970,133	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(25,874)
美元 186,129,374	离岸人民币 1,221,357,686	2021年4月21日	高盛国际, 伦敦	(252,873)
美元 107,961,562	澳元 141,279,139	2021年4月21日	法国巴黎银行	(345,427)
美元 30,216,874	纽元 42,497,619	2021年4月21日	美林国际, 伦敦	(454,644)
澳元 24,108,585	美元 18,361,665	2021年5月5日	花旗银行, 伦敦	(3,604)
美元 337,814	美元 62,804,515	2021年5月5日	法国巴黎银行	(155,164)
欧元 2,656,660	美元 3,119,690	2021年5月5日	美国道富银行	(4,830)
欧元 271,245,282	美元 318,450,370	2021年5月5日	汇丰银行, 伦敦	(563,376)
英镑 79,337,886	美元 109,314,325	2021年5月5日	巴克莱银行, 伦敦	(160,136)
离岸人民币 52,000,000	美元 7,903,658	2021年5月6日	美国道富银行	(1,044)
离岸人民币 696,308,210	美元 105,841,121	2021年5月6日	多伦多道明银行	(7,129)
日元 9,478,779,127	美元 85,701,488	2021年5月6日	汇丰银行, 伦敦	(109,968)
美元 22,999,863	离岸人民币 151,300,000	2021年5月6日	美国道富银行	(220)
澳元 232,415	美元 257,326	2021年5月21日	美国道富银行	(26)
加元 165,174	美元 176,824	2021年5月21日	多伦多道明银行	(233)
纽元 99,855	美元 131,139	2021年5月21日	法国巴黎银行	(288)
纽元 65,839	美元 69,892	2021年5月21日	巴克莱银行, 伦敦	(34)
美元 1,252	美元 46,066	2021年5月21日	法国巴黎银行	(39)
美元 5,469	离岸人民币 8,239	2021年5月21日	美国道富银行	(1)
美元 8,265	离岸人民币 36,000	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦	(3)
美元 189,857	离岸人民币 54,410	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦	(4)
	离岸人民币 1,249,800	2021年5月21日	高盛国际, 伦敦	(88)
			未实现总亏损	(3,403,211)
			未实现净收益	15,664,175

(b) 期货

以下为截至二零二一年三月三十一日之未平仓期货合约：

	标的资产	交易对手	未实现收益／（亏损） 美元
<u>截至二零二一年三月三十一日</u>			
Euro-Bund Future 08/06/2021	Euro Stoxx 50 Price EUR	花旗集团全球市场公司伦敦分行	15,185
JPN 10Yr Bond (OSE) 14/06/2021	Japan (10 Year Issue) 0.1 20/06/28	花旗集团全球市场公司伦敦分行	124,027
Long Gilt Future 28/06/2021	UK TSY 4 3/4% 2030 4.75 07/12/30	花旗集团全球市场公司伦敦分行	956,905
US 10Yr Note (CBT) 21/06/2021	US Treasury N/B 2.75 15/02/28	花旗集团全球市场公司伦敦分行	2,903,203
US 5Yr Note (CBT) 30/06/2021	US Treasury N/B 0.25 31/08/25	花旗集团全球市场公司伦敦分行	136,008
US Ultra Bond CBT 21/06/2021	US Treasury N/B 3 15/02/47	花旗集团全球市场公司伦敦分行	626,031
		未实现总收益	4,761,359
			-----
Can 10Yr Bond Fut 21/06/2021	Canadian Government 2.25 01/06/29	花旗集团全球市场公司伦敦分行	(24,140)
	Bundesrepub. Deutschland 0.5		(14,303)
Euro-BOBL Future 08/06/2021	15/02/26	花旗集团全球市场公司伦敦分行	
	Bundesrepub. Deutschland 2.5		(556,481)
Euro-BUXL 30Yr Bd 08/06/2021	15/08/46	花旗集团全球市场公司伦敦分行	
US Long Bond(CBT) 21/06/2021	US Treasury N/B 5 15/05/37	花旗集团全球市场公司伦敦分行	(1,184,625)
		未实现总亏损	(1,779,549)
			-----
		未实现净收益	2,981,810
			=====

财务状况表

截至二零二一年三月三十一日 (未经审计)

	二零二一年 三月三十一日 美元	二零二零年 九月三十日 美元
<b>资产</b>		
银行现金	53,755,786	28,639,507
应收经纪款项	-	12,067,946
分配应收款项	5,383,721	25,435,048
保证金	6,262,921	1,190,875
衍生性产品	23,828,745	12,329,811
投资	1,412,516,699	1,512,467,160
利息及其他应收款项	970,692	864,771
<b>总资产</b>	<u>1,502,718,564</u>	<u>1,592,995,118</u>
	-----	-----
<b>负债</b>		
透支经纪款项	2,642,469	-
应付经纪款项	18,290,828	15,257,387
赎回应付款项	9,088,244	15,218,014
应付收益分配 [附注 6]	4,725,529	5,229,152
衍生性产品	5,182,760	8,970,240
其他应付款项	1,140,423	1,226,932
<b>总负债 (不含可赎回份额持有人应占净资产)</b>	<u>41,070,253</u>	<u>45,901,725</u>
	-----	-----
<b>可赎回份额持有人应占净资产</b> [附注 3]	<u>1,461,648,311</u>	<u>1,547,093,393</u>

综合收益表

截至二零二一年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元	二零一九年 十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元
<b>收入</b>		
投资及衍生性产品净收益/ (亏损) [附注 4]	23,206,498	(2,917,480)
汇兑净收益/(亏损)	1,449,542	(1,702,888)
存款利息	6,746	30,320
股息收入	-	97,909
其他收益	128	17
	<u>24,662,914</u>	<u>(4,492,122)</u>
	-----	-----
<b>支出</b>		
管理费用 [附注 5(a)]	6,480,946	4,166,650
托管费用及银行费用 [附注 5(a)]	182,229	195,741
受托人费用 [附注 5(b)]	145,389	93,958
基金注册登记机构费用 [附注 5(a)]	69,912	49,538
交易成本 [附注 5(a)]	39,050	12,385
法律及专业费用	30,492	36,421
印刷及出版支出	15,016	568
核数师酬金	13,213	20,154
其他经营费用		
	3,493	1,687
	<u>6,979,740</u>	<u>4,577,102</u>
	-----	-----
<b>净经营利润/(亏损)</b>	<u>17,683,174</u>	<u>(9,069,224)</u>
	-----	-----
<b>财务成本</b>		
收益分配 [附注 6]	(29,552,018)	(15,961,516)
利息支出	(17)	(203)
	<u>(29,552,035)</u>	<u>(15,961,719)</u>
	-----	-----
<b>除税前亏损</b>	<u>(11,868,861)</u>	<u>(25,030,943)</u>
	-----	-----
税项	(11,764)	(475,443)
	<u>(11,880,625)</u>	<u>(25,506,386)</u>
	-----	-----
<b>可赎回份额持有人应占净资产 及总综合收益之减少</b>	<u>(11,880,625)</u>	<u>(25,506,386)</u>

可赎回份额持有人应占净资产变动表  
截至二零二一年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元	二零一九年 十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元
期初可赎回份额持有人应占净资产	1,547,093,393	1,030,798,393
分配可赎回份额(附注 3)	642,030,234	551,413,915
赎回可赎回份额(附注 3)	(715,594,691)	(592,363,692)
<b>净赎回</b>	<u>(73,564,457)</u>	<u>(40,949,777)</u>
	1,473,528,936	989,848,616
可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之减少	<u>(11,880,625)</u>	<u>(25,506,386)</u>
期末可赎回份额持有人应占净资产	<u>1,461,648,311</u>	<u>964,342,230</u>

现金流量表  
截至二零二一年三月三十一日止期间 (未经审计)

	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元	二零一九年 十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元
<b>经营业务</b>		
购入投资及衍生性产品	(992,783,158)	(956,898,592)
出售投资及衍生性产品所得款项	1,115,741,686	1,007,501,723
透支经纪款项之增加	2,642,469	-
已收利息	11,326	36,901
已收股息	-	97,909
已付税项	(11,764)	(459,440)
已付交易成本	(40,588)	(15,790)
已付基金注册登记机构费用	(136,042)	(103,222)
已付受托人费用	(143,251)	(92,264)
保证金之增加	(5,072,046)	(1,405,414)
已付管理费用	(6,388,874)	(4,098,167)
其他	809,980	(2,027,985)
<b>经营业务所产生之现金净额</b>	<u>114,629,738</u>	<u>42,535,659</u>
<b>融资活动</b>		
已付利息	(17)	(203)
分配可赎回份额所得款项	662,081,561	566,723,145
赎回可赎回份额付款	(721,724,461)	(591,935,684)
已付收益分配	(30,055,641)	(15,825,995)
<b>融资活动所运用之现金净额</b>	<u>(89,698,558)</u>	<u>(41,038,737)</u>
<b>现金及现金等价物之增加</b>	<u>24,931,180</u>	<u>1,496,922</u>
期初现金及现金等价物	28,639,507	22,744,035
现金及现金等价物之汇兑收益	185,099	27,288
<b>期末现金及现金等价物</b>	<u>53,755,786</u>	<u>24,268,245</u>
<b>现金及现金等价物余额分析:</b>		
银行现金	<u>53,755,786</u>	<u>24,268,245</u>

财务报表之附注

1 本基金

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

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

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

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

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

2 主要会计政策概览

(a) 中期财务报表之会计政策

编制本未经审计简明中期财务报表所使用的会计政策和计算方法与截至二零二零年九月三十日止年度财务报表所采纳的会计政策和计算方法一致。

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公允价值为负数的衍生性产品合约列示为按公允价值透过损益列账的负债。

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

因此，本基金将所有的投资组合归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。

确认、终止确认及计量

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

公允价值估计

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

债务证券的公允价值按包括应计利息的报价计算。

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

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

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

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

**(c) 证券借贷**

本基金可订立以卖空为目的之证券借贷安排。短仓指提供已售，但尚未购买的证券之责任，并以投资的公允价值列账。于期/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) 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。

外币交易和按期/年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

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

**(e) 销售份额所得款项及赎回份额支付款项**

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

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

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

二零二零年十月一日至二零二一年三月三十一日

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	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:					
期初	14,436,547.412	9,382,696.758	235,151,461.228	4,111,393.284	588,271.460
总分配	4,920,229.153	4,537,600.533	120,742,646.634	967,485.433	494,201.509
总赎回	(6,000,230.120)	(4,338,784.585)	(98,081,805.841)	(1,275,770.916)	(88,576.035)
期末	<u>13,356,546.445</u>	<u>9,581,512.706</u>	<u>257,812,302.021</u>	<u>3,803,107.801</u>	<u>993,896.934</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:					
期初	104,718,064.063	60,206,849.006	1,530,585.527	14,623,868.390	12,880,898.180
总分配	55,959,428.575	30,387,562.479	98,771.529	141,832.760	169,804.270
总赎回	(41,523,741.452)	(30,371,573.399)	(983,918.294)	(4,640,876.670)	(2,835,005.810)
期末	<u>119,153,751.186</u>	<u>60,222,838.086</u>	<u>645,438.762</u>	<u>10,124,824.480</u>	<u>10,215,696.640</u>

	PRC 人民币对冲份 额 (累计) 份额	PRC 人民币对冲份 额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额
已发行份额数目:				
期初	14,754,895.250	18,676,582.420	8,504,386.090	5,217,152.340
总分配	514,727.970	344,301.680	667,827.060	131,136.060
总赎回	(6,934,808.900)	(7,213,245.480)	(5,207,126.210)	(1,482,027.550)
期末	<u>8,334,814.320</u>	<u>11,807,638.620</u>	<u>3,965,086.940</u>	<u>3,866,260.850</u>

二零一九年十月一日至二零二零年三月三十一日

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	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:					
期初	7,444,011.787	4,244,250.403	120,496,839.798	4,545,798.754	476,522.596
总分配	4,007,594.009	3,465,953.964	64,250,378.149	1,438,169.074	55,804.296
总赎回	(3,432,056.405)	(1,844,260.548)	(70,738,627.806)	(2,786,898.411)	(49,676.642)
期末	<u>8,019,549.391</u>	<u>5,865,943.819</u>	<u>114,008,590.141</u>	<u>3,197,069.417</u>	<u>482,650.250</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:					
期初	71,664,480.866	34,591,420.909	585,059.950	47,956,241.690	12,459,676.480
总分配	20,476,837.645	21,647,498.034	1,016,849.642	12,074,089.880	9,045,422.870
总赎回	(25,401,197.377)	(23,832,341.385)	(491,274.901)	(35,348,526.800)	(6,643,053.350)
期末	<u>66,740,121.134</u>	<u>32,406,577.558</u>	<u>1,110,634.691</u>	<u>24,681,804.770</u>	<u>14,862,046.000</u>

	PRC 人民币对冲份 额 (累计) 份额	PRC 人民币对冲份 额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额
已发行份额数目:				
期初	33,812,398.910	23,360,446.870	6,836,468.040	4,282,638.440
总分配	20,068,206.450	7,190,217.540	3,004,615.100	2,805,009.180
总赎回	(30,302,402.530)	(5,759,075.280)	(2,615,022.520)	(1,260,069.110)
期末	<u>23,578,202.830</u>	<u>24,791,589.130</u>	<u>7,226,060.620</u>	<u>5,827,578.510</u>



二零二一年三月三十一日

	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	港元类别 (每月派息) 港元	纽元对冲类别 (每月派息) 纽元	人民币对冲类别 (累计) 人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	131,160,985	94,308,066	2,549,270,789	37,376,477	13,371,529
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	9.82	9.84	9.89	9.83	13.45
	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	美元类别 (每月派息) 美元	美元类别 (每半年派息) 美元	PRC 人民币份额 (累计) 人民币	PRC 人民币份额 (每月派息) 人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	1,156,310,064	593,831,980	14,377,515	107,379,332	100,625,373
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	9.70	9.86	22.28	10.61	9.85
	PRC 人民币对冲份 额 (累计) 人民币	PRC 人民币对冲份 额 (每月派息) 人民币	PRC 美元份额 (累计) 美元	PRC 美元份额 (每月派息) 美元	
可赎回份额持有人应占 净资产	93,135,628	119,015,609	43,073,927	39,041,608	
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	11.17	10.08	10.86	10.10	

二零二零年九月三十日

	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	港元类别 (每月派息) 港元	纽元对冲类别 (每月派息) 纽元	人民币对冲类别 (累计) 人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	144,971,464	94,447,093	2,370,635,364	41,329,678	7,863,998
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	10.04	10.07	10.08	10.05	13.37
	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	美元类别 (每月派息) 美元	美元类别 (每半年派息) 美元	PRC 人民币份额 (累计) 人民币	PRC 人民币份额 (每月派息) 人民币
可赎回份额持有人应占 净资产	1,041,227,933	607,211,274	34,884,729	161,056,618	134,157,374
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	9.94	10.09	22.79	11.01	10.42

	PRC 人民币对冲份 额 (累计) 人民币	PRC 人民币对冲份 额 (每月派息) 人民币	PRC 美元份额 (累计) 美元	PRC 美元份额 (每月派息) 美元
可赎回份额持有人应占 净资产	163,705,196	192,660,573	92,719,432	53,851,477
可赎回份额持有人应占 净资产 (每份额)	11.09	10.32	10.90	10.32

4 投资及衍生性产品净收益/(亏损)

	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元	二零一九年 十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益/亏损之变动	(21,378,904)	(25,985,874)
投资及衍生性产品销售之实现收益	44,585,402	23,068,394
	<u>23,206,498</u>	<u>(2,917,480)</u>

5 与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之交易

(a) 截至二零二一年三月三十一日及二零二零年三月三十一日止期间，支付给管理人，摩根基金（亚洲）有限公司，及其关联人士的金額如下：

	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元	二零一九年 十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元
管理费用	6,480,946	4,166,650
托管费用及银行费用	146,030	156,174
基金注册登记机构费用	69,912	49,538
交易成本	2,530	4,968
	<u>6,700,418</u>	<u>4,377,330</u>

(b) 截至二零二一年三月三十一日及二零二零年三月三十一日止期间，支付给受托人，东亚银行（信托）有限公司，及其关联人士的金額如下：

	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元	二零一九年 十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元
受托人费用	145,389	93,958
	<u>145,389</u>	<u>93,958</u>

6 收益分配

二零二零年八月三十一日之前，管理人有意就每个会计期应占收入的至少 85%拨作收益分配类别，在分别收取每收益分配类别的费用后，分配予该等收益分配类别的份额持有人。

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

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零二零年	二零一九年
					十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元	十月一日至 二零二零年 三月三十一日 美元
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	澳元 0.0300	15,532,724.626	(326,420)	
加元对冲类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	加元 0.0301	10,768,268.700	(242,500)	
港元类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	港元 0.0310	257,026,392.219	(1,027,655)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	纽元 0.0309	4,436,865.111	(90,609)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	人民币 0.0542	106,802,319.116	(861,322)	
美元类别 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0310	67,641,658.335	(2,096,891)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	人民币 0.0315	12,571,710.000	(59,139)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	人民币 0.0562	17,942,181.780	(150,584)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0317	5,162,583.950	(163,654)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	澳元 0.0291	16,344,179.735	(331,860)	
加元对冲类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	加元 0.0299	10,761,199.966	(247,975)	
港元类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	港元 0.0310	274,712,409.393	(1,098,743)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	纽元 0.0306	4,452,255.286	(95,858)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	人民币 0.0521	113,862,990.402	(903,131)	
美元类别 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0310	67,380,016.374	(2,088,781)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	人民币 0.0311	12,337,463.560	(58,414)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	人民币 0.0540	16,848,565.810	(138,512)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0317	4,932,013.930	(156,345)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	澳元 0.0266	16,414,088.450	(335,538)	
加元对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	加元 0.0280	10,882,028.471	(238,828)	
港元类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	港元 0.0310	283,536,272.040	(1,133,800)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	纽元 0.0295	4,391,643.910	(93,324)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	人民币 0.0522	116,777,407.195	(937,221)	
美元类别 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0310	69,049,204.797	(2,140,525)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	人民币 0.0308	10,902,956.930	(51,631)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	人民币 0.0541	14,679,537.300	(122,102)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0317	4,446,741.780	(140,962)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	澳元 0.0257	14,655,034.248	(288,860)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	加元 0.0268	11,132,799.728	(233,002)	
港元类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	港元 0.0290	271,086,704.217	(1,013,976)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月9日	纽元 0.0273	4,315,658.363	(84,369)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	人民币 0.0472	128,827,175.308	(939,110)	
美元类别 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0290	66,274,857.547	(1,921,971)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	人民币 0.0285	10,625,698.960	(46,770)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	人民币 0.0490	13,231,520.350	(100,132)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0297	4,194,363.440	(124,573)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	澳元 0.0274	14,251,894.864	(310,742)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	加元 0.0283	10,540,614.426	(238,325)	
港元类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	港元 0.0290	270,142,813.913	(1,010,322)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	纽元 0.0290	4,282,591.106	(92,383)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	人民币 0.0489	124,189,269.449	(939,794)	
美元类别 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0290	64,453,268.392	(1,869,145)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	人民币 0.0285	10,528,193.990	(46,434)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	人民币 0.0507	12,235,851.560	(96,002)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0297	3,981,638.970	(118,255)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	澳元 0.0275	13,391,010.952	(280,480)	
加元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	加元 0.0282	9,594,537.748	(215,273)	
港元类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	港元 0.0291	258,187,355.537	(966,403)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	纽元 0.0293	3,813,250.327	(78,249)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	人民币 0.0506	119,123,116.914	(918,678)	
美元类别 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0290	60,358,507.946	(1,750,397)	
美元类别 (每半年派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.4048	645,443.959	(261,276)	
PRC 人民币份额 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	人民币 0.0287	10,227,686.550	(44,738)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	人民币 0.0526	11,813,447.690	(94,706)	

二零二零年 二零一九年  
 十月一日至 十月一日至  
 二零二一年 二零二零年  
 三月三十一日 三月三十一日

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	美元	美元
PRC 美元份额 (每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0297	3,883,144.300	(115,329)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	澳元 0.0206	7,153,969.309		(101,532)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	加元 0.0272	4,627,905.911		(95,773)
港元类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	港元 0.0313	121,517,635.558		(485,283)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	纽元 0.0233	4,558,286.239		(68,111)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	人民币 0.0376	77,176,638.149		(411,921)
美元类别 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0310	36,662,785.099		(1,136,547)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	人民币 0.0334	13,611,028.980		(64,532)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	人民币 0.0390	24,594,510.770		(136,158)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年10月31日	2019年11月8日	美元 0.0317	4,700,366.190		(149,002)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	澳元 0.0228	7,185,455.570		(110,814)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	加元 0.0301	4,745,699.786		(107,544)
港元类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	港元 0.0313	118,720,579.280		(474,715)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	纽元 0.0252	4,515,811.532		(73,047)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	人民币 0.0387	76,906,211.381		(423,370)
美元类别 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0310	35,665,719.957		(1,105,638)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	人民币 0.0332	15,162,912.980		(71,609)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	人民币 0.0402	24,943,263.780		(142,635)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年11月29日	2019年12月9日	美元 0.0317	5,063,086.040		(160,500)
澳元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	澳元 0.0232	7,255,372.126		(118,324)
加元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	加元 0.0283	4,573,084.848		(99,802)
港元类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	港元 0.0312	111,512,310.091		(446,519)
纽元对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	纽元 0.0260	4,231,913.170		(74,232)
人民币对冲类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	人民币 0.0399	74,288,379.840		(425,562)
美元类别 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0310	32,688,515.208		(1,013,345)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	人民币 0.0330	11,970,052.880		(56,713)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	人民币 0.0414	24,064,372.580		(143,036)
PRC 美元份额 (每月派息)	2019年12月31日	2020年1月9日	美元 0.0317	5,057,076.960		(160,309)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	澳元 0.0235	6,746,411.679		(106,135)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	加元 0.0292	4,810,247.051		(106,203)
港元类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	港元 0.0311	101,266,892.770		(405,594)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月11日	纽元 0.0262	4,177,859.990		(70,837)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	人民币 0.0394	71,660,833.058		(403,187)
美元类别 (每月派息)	2020年1月31日	2020年2月10日	美元 0.0310	32,845,276.613		(1,018,204)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	人民币 0.0324	12,665,592.640		(58,487)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	人民币 0.0409	24,797,800.430		(144,552)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年2月3日	2020年2月11日	美元 0.0317	5,251,269.770		(166,465)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	澳元 0.0249	7,338,354.473		(117,812)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	加元 0.0316	5,181,938.890		(121,987)
港元类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	港元 0.0311	108,881,517.981		(434,517)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	纽元 0.0270	4,202,456.163		(70,377)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	人民币 0.0399	69,076,332.699		(394,287)
美元类别 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0310	35,384,344.684		(1,096,915)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	人民币 0.0331	13,776,444.580		(65,234)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	人民币 0.0413	25,862,121.550		(152,800)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年2月28日	2020年3月9日	美元 0.0317	5,521,209.440		(175,022)
澳元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	澳元 0.0280	8,010,632.850		(137,281)
加元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	加元 0.0303	5,854,661.599		(124,633)
港元类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	港元 0.0310	114,149,127.027		(456,543)
纽元对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	纽元 0.0320	3,199,124.278		(60,691)
人民币对冲类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	人民币 0.0375	66,807,543.367		(353,444)
美元类别 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0310	32,612,036.518		(1,010,974)
美元类别 (每半年派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.4158	1,112,721.022		(462,669)
PRC 人民币份额 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	人民币 0.0336	14,679,647.460		(69,586)
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	人民币 0.0390	24,792,279.520		(136,410)
PRC 美元份额 (每月派息)	2020年3月31日	2020年4月8日	美元 0.0317	5,807,473.640		(184,097)
可赎回份额持有人的总收益分配					(29,552,018)	(15,961,516)

