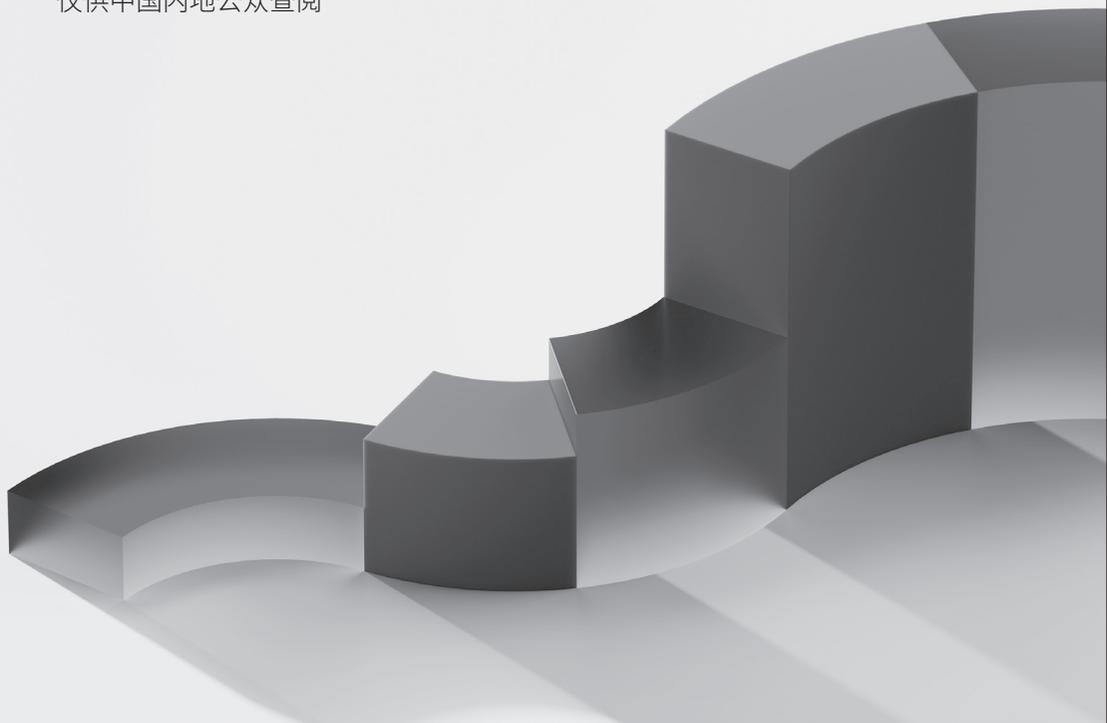


仅供中国内地公众查阅



半年度报告— 2022年3月31日（未经审核）

摩根亚洲股息基金

内地与香港互认基金系列



中国内地代理人：

上投摩根
基金 管 理

基金管理人：

摩根
资 产 管 理

此（等）报告并不构成购买组成本文件内容的任何基金单位之邀请。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 - 2
投资组合持有变动表	3
金融衍生工具详情	4 - 18
财务状况表	19
综合收益表	19 - 20
可赎回份额持有人应占净资产变动表	20
现金流量表	21
财务报表之附注	22 - 33

投资组合

(续)

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

	占资产			占资产		
	单位数目	公平值	净值	单位数目	公平值	净值
		美元	百分比		美元	百分比
上市投资 (99.4%)						
(I) 股票 (99.2%)						
澳大利亚 (23.4%)						
Australia & NZ Bkg Group-AU List	585,767	12,140,736	0.8			
Australian Stock Exchange Ltd	305,765	18,782,444	1.3			
BHP Group Ltd	799,893	31,085,172	2.1			
Brambles Ltd	3,534,113	26,300,567	1.8			
Coles Group	2,523,314	33,937,348	2.3			
Goodman Group Stapled Sec	791,974	13,613,436	0.9			
Insurance Australia Group	3,617,749	11,899,359	0.8			
Macquarie Group Ltd	103,565	15,808,742	1.0			
Medibank Private Ltd	13,391,164	30,972,771	2.1			
Q B E Insurance Group Ltd	2,953,903	25,509,685	1.7			
Rio Tinto-AU List	377,462	33,762,336	2.3			
Santos Ltd	5,598,834	32,542,400	2.2			
Telstra Corporation Ltd	2,185,037	6,497,780	0.4			
Transurban Group Stapled Sec	2,936,226	29,877,193	2.0			
Westpac Banking	409,906	7,461,530	0.5			
Woolworths Group Ltd	660,900	18,492,244	1.2			
中国 (14.4%)						
中国建设银行股份有限公司 H 股	45,795,000	34,442,443	2.3			
中国招商银行股份有限公司 H 股	4,659,000	36,616,882	2.5			
中国海外发展有限公司	1,570,000	4,701,139	0.3			
华润置地有限公司	5,256,000	24,496,769	1.6			
中国长江电力股份有限公司 A 股 (C1)	4,398,950	15,245,018	1.0			
碧桂园服务控股有限公司	1,895,000	8,130,347	0.5			
福耀玻璃工业集团股份有限公司 H 股	2,996,400	12,320,157	0.8			
内蒙古伊利实业集团股份有限公司 A 股 (C1)	4,794,164	27,859,786	1.9			
顾家家居股份有限公司 A 股 (C1)	536,900	5,185,384	0.4			
江苏宁沪高速公路股份有限公司 H 股	8,028,000	8,405,853	0.6			
九阳股份有限公司 A 股 (C2)	3,065,401	7,885,509	0.5			
美的集团股份有限公司 A 股 (C2)	984,028	8,835,651	0.6			
中国 (续)						
中国平安保险(集团)股份有限公司 H 股	491,500	3,492,604	0.2			
中国平安保险(集团)股份有限公司 A 股 (C1)	1,126,873	8,600,526	0.6			
康师傅控股有限公司	3,078,000	5,188,038	0.3			
万华化学集团股份有限公司 A 股 (C1)	291,400	3,713,134	0.3			
香港 (18.0%)						
友邦保险控股有限公司	3,590,000	37,795,989	2.5			
ASM 太平洋科技有限公司	1,516,200	15,391,616	1.0			
中银香港(控股)有限公司	8,059,500	30,565,052	2.1			
中国联塑集团控股有限公司	3,249,000	3,949,547	0.3			
长江基建集团有限公司	652,500	4,370,052	0.3			
中电控股有限公司	1,319,000	12,859,214	0.9			
石药集团有限公司	1,102,000	1,273,476	0.1			
粤海投资有限公司	3,042,000	4,164,037	0.3			
海尔智家股份有限公司 H 股	7,757,801	25,210,823	1.7			
香港宽频网络有限公司	3,157,000	3,624,056	0.2			
香港电讯信托与香港电讯有限公司合订单位	13,541,000	18,604,740	1.3			
香港交易及结算所有限公司	543,635	25,781,602	1.7			
昆仑能源有限公司	7,378,000	6,434,576	0.4			
领展房地产投资信托基金	1,364,340	11,672,342	0.8			
敏华控股有限公司	5,099,200	5,593,141	0.4			
网易股份有限公司	1,859,400	34,142,263	2.3			
中国人民财产保险股份有限公司 H 股	10,816,000	11,076,477	0.7			
滔搏国际控股有限公司	6,259,000	5,234,881	0.4			
信义玻璃控股有限公司	3,950,000	9,583,216	0.6			
印度 (4.0%)						
Infosys Technologies Ltd ADR	1,740,574	43,322,888	2.9			
Power Grid Corp of India	5,685,113	16,265,688	1.1			
印度尼西亚 (4.4%)						
Bank Central Asia	23,622,500	13,116,758	0.9			
Bank Rakyat Indonesia Persero	62,641,900	20,324,543	1.3			
Telkom Indonesia Persero	101,518,200	32,372,731	2.2			

投资组合(续)

(续)

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

	单位数目	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
韩国 (9.6%)				英国 (0.5%)			
BGF Retail Co Ltd	58,006	8,351,179	0.6	RIO Tinto Plc	84,899	6,797,480	0.5
Hana Financial Holdings	211,012	8,461,023	0.6				
Hyundai Motor Co Ltd Pref	91,128	6,511,022	0.4		1,477,842,125		99.2
KB Financial Group	142,874	7,225,920	0.5				
Kiwoom Securities Co Ltd	77,368	6,306,636	0.4	(II) 衍生性产品 (0.2%)			
LG Chem Limited Preference Shares	30,420	6,851,747	0.4	远期外汇合约 (0.2%)		2,658,290	0.2
LG Chemical	3,500	1,536,240	0.1				
Samsung Electronics	1,709,673	98,175,192	6.6				
				总上市投资		1,480,500,415	99.4
新加坡 (8.4%)				其他净资产		8,885,907	0.6
AIMS APAC REIT	5,384,519	5,530,337	0.4				
Capitaland Integrated Commer Reit	2,700,400	4,489,526	0.3				
DBS Group Hldgs	1,163,621	30,806,916	2.1	截至二零二二年三月三十一日可赎回份额 持有人应占净资产		1,489,386,322	100.0
Mapletree Logistics Trust	27,194,827	37,174,738	2.5				
Singapore Exchange	1,873,900	13,804,842	0.9				
United Overseas Bank	1,407,300	33,296,447	2.2				
				总投资, 按成本		1,322,495,536	
台湾 (14.9%)							
智邦科技股份有限公司	560,000	4,348,812	0.3				
研华股份有限公司	721,383	9,303,213	0.6				
日月光投资控股股份有限公司	2,027,000	7,322,287	0.5				
可成科技股份有限公司	395,000	1,992,130	0.1				
中租控股股份有限公司	497,100	4,398,194	0.3				
儒鸿企业股份有限公司	790,000	13,165,977	0.9				
联发科技股份有限公司	199,000	6,285,709	0.4				
亿丰综合工业股份有限公司	509,000	5,977,994	0.4				
统一超商股份有限公司	963,000	8,839,642	0.6				
瑞昱半导体股份有限公司	526,000	7,903,356	0.5				
台湾积体电路制造股份有限公司	6,551,000	136,500,603	9.2				
纬颖科技服务股份有限公司	446,000	15,877,703	1.1				
泰国 (1.6%)							
Advanced Information Service Pcl (F)	1,660,700	11,637,386	0.8				
Siam Commercial Bank Pcl (F)	1,543,900	5,293,371	0.3				
Tisco Financial Group Pcl (F)	2,363,500	7,143,812	0.5				

投资组合持有变动表

截至二零二二年三月三十一日止期间(未经审计)

	持有占资产净值百分比	
	二零二二年	二零二一年
	三月三十一日	九月三十日
上市投资		
股票		
澳大利亚	23.4	15.2
香港	18.0	18.1
台湾	14.9	17.1
中国	14.4	15.3
韩国	9.6	11.5
新加坡	8.4	7.6
印度尼西亚	4.4	5.0
印度	4.0	4.4
泰国	1.6	3.6
英国	0.5	1.8
衍生性产品		
远期外汇合约	0.2	(0.5)
总上市投资	<u>99.4</u>	<u>99.1</u>
其他净资产	<u>0.6</u>	<u>0.9</u>
可赎回份额持有人应占净资产	<u><u>100.0</u></u>	<u><u>100.0</u></u>

金融衍生工具详情

截至二零二二年三月三十一日 (未经审计)

截至二零二二年三月三十一日，本基金持有之金融衍生工具汇总如下：

远期外汇合约

以下为截至二零二二年三月三十一日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/(亏损) 美元
<u>截至二零二二年三月三十一日</u>				
未平仓合约：				
英镑 20,283	美元 26,754	2022年4月1日	美林国际，伦敦	49
美元 90,911	英镑 69,215	2022年4月1日	加拿大皇家银行	221
美元 44,662	欧元 40,230	2022年4月1日	美国道富银行	101
美元 16,507	离岸人民币 105,222	2022年4月1日	美林国际，伦敦	69
美元 57,667	澳元 76,865	2022年4月1日	加拿大皇家银行	54
美元 7,507	离岸人民币 47,855	2022年4月1日	渣打银行，伦敦	32
美元 2,495	离岸人民币 15,944	2022年4月1日	法国巴黎银行	16
美元 3,076	澳元 4,115	2022年4月1日	法国巴黎银行	14
美元 1,094	加元 1,376	2022年4月1日	法国巴黎银行	8
美元 1,099	离岸人民币 7,021	2022年4月1日	法国巴黎银行	7
美元 1,099	离岸人民币 7,021	2022年4月1日	渣打银行，伦敦	7
美元 1,091	英镑 834	2022年4月1日	渣打银行，伦敦	7
美元 2,193	加元 2,746	2022年4月1日	汇丰银行，伦敦	5
澳元 1,645	美元 1,238	2022年4月4日	美国道富银行	3
美元 2,185	英镑 1,664	2022年4月4日	美国道富银行	6
美元 1,104	澳元 1,471	2022年4月4日	加拿大皇家银行	1
澳元 29,003	美元 21,825	2022年4月6日	加拿大皇家银行	44
加元 10,397	美元 8,351	2022年4月6日	加拿大皇家银行	27
欧元 14,769	美元 16,493	2022年4月6日	美国道富银行	59
英镑 4,908	美元 6,465	2022年4月6日	加拿大皇家银行	4
美元 11,549	离岸人民币 73,432	2022年4月6日	法国巴黎银行	16
美元 1,895	离岸人民币 12,085	2022年4月6日	美国道富银行	8
美元 1,102	离岸人民币 7,026	2022年4月6日	美国道富银行	5
美元 1,103	离岸人民币 7,011	2022年4月6日	法国巴黎银行	2
美元 1,095	欧元 985	2022年4月6日	加拿大皇家银行	1
美元 1,099	英镑 835	2022年4月6日	渣打银行，伦敦	0
美元 1,097	澳元 1,462	2022年4月6日	法国巴黎银行	0
美元 1,096	加元 1,369	2022年4月6日	美国道富银行	0
离岸人民币 174,406	美元 27,466	2022年4月8日	美林国际，伦敦	3
离岸人民币 115,037	美元 18,113	2022年4月11日	美林国际，伦敦	2

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/(亏损) 美元
澳元 1,466	美元 1,103	2022年4月21日	美国道富银行	2
加元 1,377	美元 1,106	2022年4月21日	法国巴黎银行	4
离岸人民币 36,478,505	美元 5,751,829	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	12,529
离岸人民币 27,365,626	美元 4,315,404	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	9,868
离岸人民币 19,114,889	美元 3,012,343	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	4,926
离岸人民币 10,288,667	美元 1,622,075	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	3,321
离岸人民币 3,964,670	美元 624,882	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,105
离岸人民币 2,230,493	美元 351,936	2022年4月21日	美国道富银行	1,005
离岸人民币 4,429,154	美元 697,722	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	867
离岸人民币 1,703,051	美元 268,714	2022年4月21日	美国道富银行	767
离岸人民币 2,523,443	美元 397,718	2022年4月21日	加拿大皇家银行	695
离岸人民币 1,684,467	美元 265,704	2022年4月21日	美国道富银行	681
离岸人民币 1,279,817	美元 201,876	2022年4月21日	美国道富银行	517
离岸人民币 1,179,437	美元 185,949	2022年4月21日	美国道富银行	384
离岸人民币 753,574	美元 118,933	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	370
离岸人民币 892,581	美元 140,723	2022年4月21日	美国道富银行	290
离岸人民币 429,705	美元 67,870	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	263
离岸人民币 577,493	美元 91,057	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	198
离岸人民币 634,691	美元 100,036	2022年4月21日	美国道富银行	178
离岸人民币 429,243	美元 67,689	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	155
离岸人民币 550,770	美元 86,793	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	139
离岸人民币 222,986	美元 35,220	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	137
离岸人民币 458,187	美元 72,216	2022年4月21日	美国道富银行	128
离岸人民币 577,055	美元 90,910	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	120
离岸人民币 235,023	美元 37,092	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	116
离岸人民币 354,258	美元 55,826	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	89
离岸人民币 242,653	美元 38,256	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	78
离岸人民币 300,233	美元 47,314	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	77
离岸人民币 206,379	美元 32,539	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	68
离岸人民币 216,229	美元 34,086	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	66
离岸人民币 86,914	美元 13,727	2022年4月21日	加拿大皇家银行	53
离岸人民币 97,286	美元 15,339	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	32
离岸人民币 105,576	美元 16,640	2022年4月21日	加拿大皇家银行	29
离岸人民币 57,877	美元 9,134	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	29
离岸人民币 132,183	美元 20,823	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	26
离岸人民币 54,905	美元 8,655	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	17
离岸人民币 54,552	美元 8,598	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	15
离岸人民币 44,007	美元 6,937	2022年4月21日	美国道富银行	13
离岸人民币 44,060	美元 6,944	2022年4月21日	加拿大皇家银行	12
离岸人民币 51,489	美元 8,112	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	11
离岸人民币 18,124	美元 2,863	2022年4月21日	美国道富银行	11
离岸人民币 34,852	美元 5,493	2022年4月21日	加拿大皇家银行	10
离岸人民币 12,757	美元 2,011	2022年4月21日	加拿大皇家银行	4
离岸人民币 7,852	美元 1,239	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	4
离岸人民币 6,946	美元 1,097	2022年4月21日	加拿大皇家银行	4

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/(亏损) 美元
离岸人民币 6,946	美元 1,097	2022年4月21日	加拿大皇家银行	4
离岸人民币 6,946	美元 1,097	2022年4月21日	美国道富银行	4
离岸人民币 6,946	美元 1,097	2022年4月21日	美国道富银行	4
离岸人民币 6,941	美元 1,095	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	4
离岸人民币 6,941	美元 1,095	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	4
离岸人民币 6,941	美元 1,095	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	4
离岸人民币 7,279	美元 1,147	2022年4月21日	美国道富银行	2
离岸人民币 7,013	美元 1,105	2022年4月21日	美国道富银行	2
离岸人民币 6,973	美元 1,099	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	2
离岸人民币 6,961	美元 1,097	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	2
离岸人民币 6,961	美元 1,097	2022年4月21日	美国道富银行	2
离岸人民币 6,959	美元 1,097	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	2
离岸人民币 6,958	美元 1,097	2022年4月21日	美国道富银行	2
离岸人民币 6,958	美元 1,097	2022年4月21日	美国道富银行	2
离岸人民币 6,957	美元 1,097	2022年4月21日	加拿大皇家银行	2
离岸人民币 6,957	美元 1,097	2022年4月21日	美国道富银行	2
离岸人民币 6,957	美元 1,097	2022年4月21日	美国道富银行	2
离岸人民币 6,956	美元 1,096	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	2
离岸人民币 6,956	美元 1,096	2022年4月21日	加拿大皇家银行	2
离岸人民币 6,956	美元 1,096	2022年4月21日	加拿大皇家银行	2
离岸人民币 6,946	美元 1,094	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	1
离岸人民币 6,946	美元 1,094	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	1
离岸人民币 6,946	美元 1,094	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	1
离岸人民币 6,946	美元 1,094	2022年4月21日	加拿大皇家银行	1
离岸人民币 6,946	美元 1,094	2022年4月21日	加拿大皇家银行	1
欧元 991	美元 1,107	2022年4月21日	加拿大皇家银行	4
英镑 434,665	美元 579,476	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	7,247
英镑 309,020	美元 408,446	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	1,626
英镑 429,385	美元 566,687	2022年4月21日	加拿大皇家银行	1,410
英镑 774,043	美元 1,019,192	2022年4月21日	加拿大皇家银行	178
英镑 69,683	美元 91,862	2022年4月21日	美国道富银行	126
英镑 2,901	美元 3,874	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	55
英镑 820	美元 1,100	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	21
英镑 820	美元 1,100	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	21
英镑 826	美元 1,102	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	14
英镑 833	美元 1,104	2022年4月21日	加拿大皇家银行	8
英镑 1,623	美元 2,142	2022年4月21日	加拿大皇家银行	5
英镑 830	美元 1,096	2022年4月21日	美国道富银行	4
英镑 1,321	美元 1,741	2022年4月21日	美国道富银行	2
英镑 834	美元 1,100	2022年4月21日	美国道富银行	2
英镑 837	美元 1,103	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	1
英镑 836	美元 1,101	2022年4月21日	加拿大皇家银行	0
纽元 1,589	美元 1,110	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	6
美元 119,895,584	澳元 161,886,737	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,700,296
美元 54,182,644	加元 68,901,517	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	975,856

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 19,312,632	欧元 17,748,633	2022年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	446,353
美元 34,711,113	纽元 50,421,931	2022年4月21日	多伦多道明银行	350,281
美元 6,160,636	澳元 8,376,465	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	131,069
美元 2,375,715	澳元 3,244,970	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	61,637
美元 1,443,937	澳元 1,990,547	2022年4月21日	加拿大皇家银行	51,197
美元 5,943,614	新加坡元 8,110,995	2022年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	49,113
美元 13,416,777	离岸人民币 85,528,733	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	39,778
美元 2,795,036	加元 3,540,071	2022年4月21日	多伦多道明银行	38,937
美元 1,076,299	加元 1,374,449	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	24,004
美元 1,788,081	纽元 2,604,350	2022年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	22,881
美元 707,658	澳元 971,077	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	21,735
美元 542,487	澳元 746,753	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	18,413
美元 702,811	澳元 956,371	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	15,535
美元 2,129,074	离岸人民币 13,605,718	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	11,564
美元 690,443	纽元 1,009,334	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	11,407
美元 3,171,842	英镑 2,417,524	2022年4月21日	加拿大皇家银行	10,785
美元 1,227,847	英镑 939,176	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	8,561
美元 364,671	澳元 495,173	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	7,262
美元 317,950	加元 406,126	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	7,170
美元 1,391,680	离岸人民币 8,887,664	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	6,649
美元 256,244	澳元 349,900	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	6,572
美元 171,540	澳元 236,221	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	5,890
美元 385,867	欧元 351,241	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	5,158
美元 136,434	澳元 188,014	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	4,786
美元 179,445	纽元 264,910	2022年4月21日	美国道富银行	4,763
美元 1,125,084	澳元 1,503,895	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	4,517
美元 146,144	加元 188,045	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	4,393
美元 547,260	离岸人民币 3,505,182	2022年4月21日	加拿大皇家银行	4,224
美元 167,208	澳元 228,000	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	4,047
美元 298,315	加元 377,584	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	3,957
美元 203,027	纽元 297,537	2022年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	3,868
美元 145,712	澳元 199,000	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	3,760
美元 661,124	离岸人民币 4,224,853	2022年4月21日	美国道富银行	3,587
美元 983,486	欧元 886,364	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	3,275
美元 287,815	加元 363,292	2022年4月21日	加拿大皇家银行	3,015
美元 151,315	纽元 221,632	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	2,798
美元 329,778	离岸人民币 2,112,980	2022年4月21日	加拿大皇家银行	2,666
美元 825,552	离岸人民币 5,263,494	2022年4月21日	美国道富银行	2,573
美元 5,170,043	离岸人民币 32,875,693	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	2,413
美元 336,810	欧元 304,677	2022年4月21日	加拿大皇家银行	2,377
美元 317,136	离岸人民币 2,029,782	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	2,217
美元 153,448	澳元 207,235	2022年4月21日	美国道富银行	2,210
美元 98,855	澳元 134,535	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	2,197
美元 113,117	欧元 103,544	2022年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	2,154
美元 641,924	离岸人民币 4,092,731	2022年4月21日	美国道富银行	2,001

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 867,582	英镑 660,519	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,979
美元 158,014	澳元 213,008	2022年4月21日	加拿大皇家银行	1,979
美元 87,041	加元 111,144	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	1,934
美元 175,628	欧元 159,481	2022年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	1,917
美元 446,912	加元 560,441	2022年4月21日	加拿大皇家银行	1,744
美元 329,444	离岸人民币 2,103,854	2022年4月21日	美国道富银行	1,563
美元 74,354	纽元 109,123	2022年4月21日	美国道富银行	1,526
美元 182,318	纽元 264,370	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	1,514
美元 222,240	欧元 200,976	2022年4月21日	美国道富银行	1,499
美元 257,849	离岸人民币 1,648,274	2022年4月21日	美国道富银行	1,480
美元 267,503	离岸人民币 1,707,960	2022年4月21日	加拿大皇家银行	1,217
美元 211,636	欧元 191,064	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	1,069
美元 157,260	离岸人民币 1,006,085	2022年4月21日	美国道富银行	1,031
美元 30,775	澳元 42,341	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	1,028
美元 232,503	离岸人民币 1,483,887	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	963
美元 85,289	加元 107,742	2022年4月21日	加拿大皇家银行	963
美元 136,681	英镑 104,491	2022年4月21日	加拿大皇家银行	879
美元 319,721	英镑 243,486	2022年4月21日	加拿大皇家银行	824
美元 464,948	离岸人民币 2,960,391	2022年4月21日	加拿大皇家银行	821
美元 202,713	离岸人民币 1,293,308	2022年4月21日	美国道富银行	768
美元 128,714	离岸人民币 822,769	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	735
美元 81,097	英镑 62,160	2022年4月21日	美国道富银行	735
美元 27,741	加元 35,550	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	718
美元 698,969	澳元 931,512	2022年4月21日	美国道富银行	706
美元 119,529	新加坡元 162,698	2022年4月21日	法国巴黎银行	679
美元 20,172	澳元 27,752	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	673
美元 207,777	离岸人民币 1,324,529	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	616
美元 51,722	欧元 46,975	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	574
美元 117,405	离岸人民币 749,713	2022年4月21日	美国道富银行	550
美元 95,280	离岸人民币 609,051	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	544
美元 24,343	纽元 35,788	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	542
美元 76,913	加元 96,749	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	538
美元 17,610	纽元 26,033	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	493
美元 85,803	离岸人民币 548,455	2022年4月21日	美国道富银行	488
美元 14,377	纽元 21,325	2022年4月21日	美国道富银行	452
美元 27,550	加元 34,920	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	405
美元 65,051	离岸人民币 415,806	2022年4月21日	美国道富银行	370
美元 14,167	澳元 19,343	2022年4月21日	法国巴黎银行	362
美元 308,725	新加坡元 418,336	2022年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	358
美元 21,687	加元 27,533	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	354
美元 83,906	英镑 64,002	2022年4月21日	加拿大皇家银行	352
美元 50,351	离岸人民币 322,116	2022年4月21日	法国巴黎银行	329
美元 7,114	澳元 9,883	2022年4月21日	加拿大皇家银行	309
美元 386,528	澳元 515,011	2022年4月21日	加拿大皇家银行	305
美元 190,943	澳元 254,609	2022年4月21日	加拿大皇家银行	298

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 23,343	欧元 21,235	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	297
美元 13,649	纽元 20,000	2022年4月21日	美国道富银行	258
美元 209,359	离岸人民币 1,332,287	2022年4月21日	美国道富银行	254
美元 15,396	澳元 20,832	2022年4月21日	加拿大皇家银行	252
美元 35,055	新加坡元 47,769	2022年4月21日	加拿大皇家银行	239
美元 48,799	澳元 65,250	2022年4月21日	加拿大皇家银行	211
美元 32,996	离岸人民币 210,860	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	179
美元 13,868	纽元 20,200	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	178
美元 55,350	新加坡元 75,154	2022年4月21日	加拿大皇家银行	177
美元 6,779	纽元 10,000	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	175
美元 24,412	离岸人民币 156,180	2022年4月21日	美国道富银行	160
美元 11,864	欧元 10,800	2022年4月21日	加拿大皇家银行	159
美元 47,966	新加坡元 65,130	2022年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	155
美元 53,518	英镑 40,753	2022年4月21日	加拿大皇家银行	132
美元 125,805	欧元 113,103	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	109
美元 18,692	离岸人民币 119,490	2022年4月21日	美国道富银行	107
美元 21,562	离岸人民币 137,703	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	103
美元 24,547	离岸人民币 156,610	2022年4月21日	美国道富银行	93
美元 3,469	澳元 4,738	2022年4月21日	加拿大皇家银行	90
美元 19,376	离岸人民币 123,715	2022年4月21日	加拿大皇家银行	88
美元 14,110	英镑 10,785	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	87
美元 18,102	离岸人民币 115,595	2022年4月21日	美国道富银行	85
美元 3,812	欧元 3,500	2022年4月21日	加拿大皇家银行	85
美元 31,920	新加坡元 43,316	2022年4月21日	加拿大皇家银行	83
美元 10,348	纽元 15,000	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	83
美元 16,766	离岸人民币 107,005	2022年4月21日	加拿大皇家银行	69
美元 3,296	纽元 4,837	2022年4月21日	美国道富银行	68
美元 93,119	英镑 70,783	2022年4月21日	加拿大皇家银行	65
美元 1,728	澳元 2,380	2022年4月21日	法国巴黎银行	59
美元 11,677	纽元 16,876	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	58
美元 31,028	新加坡元 42,069	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	55
美元 15,927	新加坡元 21,628	2022年4月21日	法国巴黎银行	52
美元 2,122	澳元 2,894	2022年4月21日	加拿大皇家银行	51
美元 1,269	澳元 1,755	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	49
美元 8,862	加元 11,129	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	47
美元 1,618	加元 2,072	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	41
美元 81,010	离岸人民币 515,136	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	38
美元 7,106	离岸人民币 45,378	2022年4月21日	美国道富银行	34
美元 18,368	离岸人民币 116,950	2022年4月21日	加拿大皇家银行	32
美元 2,300	加元 2,913	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	32
美元 3,366	加元 4,242	2022年4月21日	加拿大皇家银行	31
美元 10,201	离岸人民币 65,000	2022年4月21日	加拿大皇家银行	26
美元 13,073	离岸人民币 83,237	2022年4月21日	加拿大皇家银行	23
美元 2,855	离岸人民币 18,295	2022年4月21日	加拿大皇家银行	23
美元 3,202	欧元 2,895	2022年4月21日	加拿大皇家银行	22

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 1,248	加元 1,585	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	21
美元 14,667	离岸人民币 93,353	2022年4月21日	美国道富银行	20
美元 7,927	离岸人民币 50,509	2022年4月21日	加拿大皇家银行	20
美元 3,632	离岸人民币 23,191	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	17
美元 9,300	加元 11,637	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	16
美元 2,124	离岸人民币 13,602	2022年4月21日	加拿大皇家银行	16
美元 1,985	离岸人民币 12,720	2022年4月21日	加拿大皇家银行	16
美元 2,174	离岸人民币 13,913	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	15
美元 1,633	离岸人民币 10,459	2022年4月21日	加拿大皇家银行	13
美元 4,773	英镑 3,635	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	12
美元 2,654	英镑 2,026	2022年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	12
美元 2,521	离岸人民币 16,102	2022年4月21日	美国道富银行	12
美元 2,118	离岸人民币 13,534	2022年4月21日	美国道富银行	12
美元 1,871	离岸人民币 11,959	2022年4月21日	美国道富银行	11
美元 2,531	离岸人民币 16,155	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	10
美元 1,736	新加坡元 2,362	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	9
美元 604	加元 766	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	8
美元 1,312	离岸人民币 8,376	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	6
美元 1,644	加元 2,060	2022年4月21日	加拿大皇家银行	5
美元 1,189	离岸人民币 7,588	2022年4月21日	美国道富银行	5
美元 1,161	离岸人民币 7,406	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	4
美元 8,789	澳元 11,706	2022年4月21日	法国巴黎银行	3
美元 1,275	新加坡元 1,728	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	2
美元 1,122	离岸人民币 7,140	2022年4月21日	美国道富银行	1
离岸人民币 216,620	美元 34,025	2022年5月20日	美林国际, 伦敦	3
离岸人民币 13,125	美元 2,062	2022年5月20日	汇丰银行, 伦敦	0
离岸人民币 6,992	美元 1,098	2022年5月20日	美林国际, 伦敦	0
离岸人民币 6,992	美元 1,098	2022年5月20日	美林国际, 伦敦	0
离岸人民币 6,992	美元 1,098	2022年5月20日	美国道富银行	0
美元 1,740,169	澳元 2,323,887	2022年5月20日	美国道富银行	6,253
美元 989,982	英镑 754,929	2022年5月20日	加拿大皇家银行	3,747
美元 891,217	加元 1,116,865	2022年5月20日	加拿大皇家银行	2,823
美元 501,140	纽元 723,564	2022年5月20日	加拿大皇家银行	1,729
美元 283,219	欧元 254,415	2022年5月20日	美林国际, 伦敦	338
美元 260,010	离岸人民币 1,656,234	2022年5月20日	高盛国际, 伦敦	113
美元 189,643	离岸人民币 1,208,002	2022年5月20日	高盛国际, 伦敦	83
美元 98,274	新加坡元 133,112	2022年5月20日	法国巴黎银行	73
美元 4,241,445	离岸人民币 27,006,203	2022年5月20日	花旗银行, 伦敦	71
美元 43,978	澳元 58,539	2022年5月20日	汇丰银行, 伦敦	14
美元 38,736	英镑 29,432	2022年5月20日	加拿大皇家银行	6
美元 65,529	离岸人民币 417,238	2022年5月20日	花旗银行, 伦敦	1
			未实现总收益	4,210,289

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 515,011	美元 386,452	2022年4月1日	加拿大皇家银行	(296)
加元 11,637	美元 9,301	2022年4月1日	渣打银行, 伦敦	(16)
离岸人民币 11,959	美元 1,873	2022年4月1日	美国道富银行	(11)
离岸人民币 119,490	美元 18,715	2022年4月1日	美国道富银行	(108)
离岸人民币 1,648,274	美元 258,157	2022年4月1日	美国道富银行	(1,491)
澳元 65,250	美元 48,791	2022年4月4日	加拿大皇家银行	(210)
英镑 104,491	美元 136,692	2022年4月4日	加拿大皇家银行	(883)
澳元 931,512	美元 698,859	2022年4月6日	美国道富银行	(691)
离岸人民币 16,155	美元 2,533	2022年4月6日	花旗银行, 伦敦	(11)
离岸人民币 156,180	美元 24,434	2022年4月6日	美国道富银行	(162)
离岸人民币 322,116	美元 50,397	2022年4月6日	法国巴黎银行	(332)
离岸人民币 1,483,887	美元 232,702	2022年4月6日	花旗银行, 伦敦	(994)
离岸人民币 1,006,085	美元 157,406	2022年4月6日	美国道富银行	(1,042)
英镑 40,753	美元 53,523	2022年4月6日	加拿大皇家银行	(132)
纽元 16,876	美元 11,680	2022年4月6日	美林国际, 伦敦	(58)
新加坡元 1,728	美元 1,275	2022年4月6日	汇丰银行, 伦敦	(2)
美元 1,111	纽元 1,589	2022年4月6日	汇丰银行, 伦敦	(6)
澳元 58,539	美元 43,950	2022年4月7日	汇丰银行, 伦敦	(12)
离岸人民币 107,005	美元 16,780	2022年4月7日	加拿大皇家银行	(71)
离岸人民币 1,332,287	美元 209,517	2022年4月7日	美国道富银行	(290)
英镑 29,432	美元 38,744	2022年4月7日	加拿大皇家银行	(6)
美元 2,067	离岸人民币 13,125	2022年4月7日	汇丰银行, 伦敦	(0)
离岸人民币 7,140	美元 1,123	2022年4月8日	美国道富银行	(2)
离岸人民币 93,353	美元 14,678	2022年4月8日	美国道富银行	(23)
美元 1,101	离岸人民币 6,992	2022年4月8日	美林国际, 伦敦	(0)
美元 1,101	离岸人民币 6,992	2022年4月8日	美林国际, 伦敦	(0)
澳元 4,828	美元 3,625	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(1)
澳元 2,535	美元 1,903	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(1)
澳元 1,471	美元 1,104	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(1)
澳元 1,466	美元 1,100	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(1)
澳元 12,962	美元 9,732	2022年4月21日	美国道富银行	(4)
澳元 1,641	美元 1,221	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(12)
澳元 4,115	美元 3,077	2022年4月21日	法国巴黎银行	(13)
澳元 1,489	美元 1,102	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(16)
澳元 1,489	美元 1,102	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(16)
澳元 1,503	美元 1,107	2022年4月21日	美国道富银行	(22)
澳元 1,503	美元 1,107	2022年4月21日	美国道富银行	(22)
澳元 1,593	美元 1,168	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(28)
澳元 3,528	美元 2,618	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(33)
澳元 1,522	美元 1,105	2022年4月21日	法国巴黎银行	(38)
澳元 1,503	美元 1,087	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(42)
澳元 1,522	美元 1,096	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(48)
澳元 2,075	美元 1,507	2022年4月21日	美国道富银行	(51)
澳元 2,140	美元 1,555	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(52)

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 2,820	美元 2,065	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(53)
澳元 2,110	美元 1,532	2022年4月21日	美国道富银行	(54)
澳元 76,865	美元 57,680	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(55)
澳元 3,425	美元 2,517	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(56)
澳元 2,230	美元 1,620	2022年4月21日	法国巴黎银行	(56)
澳元 5,064	美元 3,709	2022年4月21日	美国道富银行	(95)
澳元 15,847	美元 11,712	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(191)
澳元 34,706	美元 25,746	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(322)
澳元 17,936	美元 12,910	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(561)
澳元 74,993	美元 54,928	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(1,401)
澳元 1,517,494	美元 1,138,038	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(1,777)
澳元 286,878	美元 212,021	2022年4月21日	美国道富银行	(3,458)
澳元 252,034	美元 185,197	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(4,110)
澳元 260,945	美元 191,073	2022年4月21日	美国道富银行	(4,927)
澳元 273,338	美元 198,722	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(6,587)
澳元 1,898,109	美元 1,406,526	2022年4月21日	美国道富银行	(19,176)
澳元 698,901	美元 505,474	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(19,483)
澳元 1,095,046	美元 803,015	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(19,493)
澳元 1,139,366	美元 826,614	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(29,183)
澳元 1,544,638	美元 1,130,247	2022年4月21日	美国道富银行	(29,957)
澳元 2,746,212	美元 2,011,564	2022年4月21日	美国道富银行	(51,162)
澳元 2,069,847	美元 1,489,140	2022年4月21日	多伦多道明银行	(65,557)
澳元 4,048,562	美元 2,954,385	2022年4月21日	美国道富银行	(86,559)
澳元 3,799,201	美元 2,761,081	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(92,564)
加元 1,381	美元 1,102	2022年4月21日	法国巴黎银行	(3)
加元 1,381	美元 1,102	2022年4月21日	美国道富银行	(3)
加元 2,746	美元 2,193	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(5)
加元 1,387	美元 1,104	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(6)
加元 1,390	美元 1,105	2022年4月21日	法国巴黎银行	(8)
加元 1,390	美元 1,105	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(8)
加元 1,376	美元 1,094	2022年4月21日	法国巴黎银行	(8)
加元 1,384	美元 1,098	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(10)
加元 8,130	美元 6,498	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(11)
加元 1,397	美元 1,103	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(15)
加元 1,401	美元 1,105	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(17)
加元 1,394	美元 1,098	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(18)
加元 1,409	美元 1,106	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(22)
加元 1,410	美元 1,103	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(25)
加元 1,397	美元 1,094	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(25)
加元 1,804	美元 1,408	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(36)
加元 1,918	美元 1,491	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(45)
加元 379,436	美元 303,666	2022年4月21日	美国道富银行	(89)
加元 19,110	美元 15,121	2022年4月21日	美国道富银行	(178)
加元 18,475	美元 14,461	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(329)
加元 146,580	美元 116,744	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(599)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/(亏损) 美元
加元 91,125	美元 72,135	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(814)
加元 148,104	美元 115,582	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(2,982)
加元 289,574	美元 228,109	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(3,707)
加元 342,531	美元 268,870	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(5,341)
加元 651,187	美元 513,690	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(7,612)
加元 486,352	美元 381,199	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(8,146)
加元 804,999	美元 633,109	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(11,327)
加元 865,745	美元 676,363	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(16,701)
加元 1,595,863	美元 1,257,089	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(20,465)
加元 1,146,379	美元 894,588	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(23,135)
加元 1,681,539	美元 1,310,033	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(36,108)
离岸人民币 7,011	美元 1,102	2022年4月21日	法国巴黎银行	(1)
离岸人民币 7,011	美元 1,102	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(1)
离岸人民币 6,961	美元 1,093	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(2)
离岸人民币 6,961	美元 1,093	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(2)
离岸人民币 6,961	美元 1,093	2022年4月21日	美国道富银行	(2)
离岸人民币 9,547	美元 1,499	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(3)
离岸人民币 7,006	美元 1,100	2022年4月21日	美国道富银行	(3)
离岸人民币 13,788	美元 2,165	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(4)
离岸人民币 7,009	美元 1,099	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(4)
离岸人民币 7,009	美元 1,099	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(4)
离岸人民币 7,009	美元 1,099	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(4)
离岸人民币 11,352	美元 1,781	2022年4月21日	美国道富银行	(5)
离岸人民币 7,030	美元 1,101	2022年4月21日	美国道富银行	(5)
离岸人民币 7,026	美元 1,101	2022年4月21日	美国道富银行	(5)
离岸人民币 7,003	美元 1,097	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 7,003	美元 1,097	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 6,994	美元 1,095	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(5)
离岸人民币 6,994	美元 1,095	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(5)
离岸人民币 7,027	美元 1,100	2022年4月21日	美国道富银行	(6)
离岸人民币 7,019	美元 1,098	2022年4月21日	美国道富银行	(6)
离岸人民币 9,354	美元 1,465	2022年4月21日	美国道富银行	(7)
离岸人民币 7,021	美元 1,097	2022年4月21日	法国巴黎银行	(7)
离岸人民币 7,021	美元 1,097	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(7)
离岸人民币 12,085	美元 1,894	2022年4月21日	美国道富银行	(8)
离岸人民币 7,013	美元 1,096	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(8)
离岸人民币 7,013	美元 1,096	2022年4月21日	美国道富银行	(8)
离岸人民币 7,013	美元 1,096	2022年4月21日	美国道富银行	(8)
离岸人民币 6,986	美元 1,091	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(8)
离岸人民币 6,986	美元 1,091	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(8)
离岸人民币 49,405	美元 7,764	2022年4月21日	法国巴黎银行	(9)
离岸人民币 12,786	美元 2,002	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(9)
离岸人民币 11,550	美元 1,809	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(9)
离岸人民币 7,029	美元 1,097	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(9)
离岸人民币 7,029	美元 1,097	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(9)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/(亏损) 美元
离岸人民币 19,762	美元 3,098	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(11)
离岸人民币 44,675	美元 7,016	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(12)
离岸人民币 28,882	美元 4,533	2022年4月21日	美国道富银行	(12)
离岸人民币 15,455	美元 2,418	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(13)
离岸人民币 11,615	美元 1,815	2022年4月21日	美国道富银行	(13)
离岸人民币 73,432	美元 11,539	2022年4月21日	法国巴黎银行	(14)
离岸人民币 18,775	美元 2,940	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(14)
离岸人民币 21,484	美元 3,365	2022年4月21日	美国道富银行	(15)
离岸人民币 21,120	美元 3,307	2022年4月21日	美国道富银行	(16)
离岸人民币 15,944	美元 2,492	2022年4月21日	法国巴黎银行	(16)
离岸人民币 24,108	美元 3,773	2022年4月21日	美国道富银行	(20)
离岸人民币 18,489	美元 2,887	2022年4月21日	美国道富银行	(22)
离岸人民币 32,704	美元 5,116	2022年4月21日	美国道富银行	(29)
离岸人民币 47,855	美元 7,498	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(31)
离岸人民币 98,572	美元 15,469	2022年4月21日	美国道富银行	(39)
离岸人民币 33,982	美元 5,305	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(41)
离岸人民币 38,379	美元 5,990	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(48)
离岸人民币 41,665	美元 6,505	2022年4月21日	美国道富银行	(50)
离岸人民币 184,429	美元 28,965	2022年4月21日	美国道富银行	(52)
离岸人民币 214,808	美元 33,736	2022年4月21日	美国道富银行	(61)
离岸人民币 105,222	美元 16,487	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(68)
离岸人民币 172,036	美元 26,998	2022年4月21日	美国道富银行	(69)
离岸人民币 194,979	美元 30,539	2022年4月21日	美国道富银行	(138)
离岸人民币 142,288	美元 22,244	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(143)
离岸人民币 269,726	美元 42,283	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(154)
离岸人民币 179,804	美元 28,105	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(184)
离岸人民币 148,100	美元 23,115	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(186)
离岸人民币 234,902	美元 36,747	2022年4月21日	美国道富银行	(211)
离岸人民币 593,671	美元 93,044	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(361)
离岸人民币 364,397	美元 56,958	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(374)
离岸人民币 565,144	美元 88,496	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(420)
离岸人民币 335,111	美元 52,304	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(420)
离岸人民币 412,493	美元 64,478	2022年4月21日	法国巴黎银行	(421)
离岸人民币 320,043	美元 49,926	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(428)
离岸人民币 421,294	美元 65,834	2022年4月21日	美国道富银行	(450)
离岸人民币 555,494	美元 86,844	2022年4月21日	法国巴黎银行	(553)
离岸人民币 674,792	美元 105,596	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(572)
离岸人民币 563,003	美元 87,978	2022年4月21日	美国道富银行	(601)
离岸人民币 715,084	美元 111,794	2022年4月21日	法国巴黎银行	(712)
离岸人民币 2,342,705	美元 367,648	2022年4月21日	美国道富银行	(939)
离岸人民币 1,863,733	美元 292,263	2022年4月21日	美国道富银行	(965)
离岸人民币 946,198	美元 147,682	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(1,186)
离岸人民币 2,378,116	美元 372,927	2022年4月21日	美国道富银行	(1,231)
离岸人民币 1,747,569	美元 273,714	2022年4月21日	美国道富银行	(1,237)
离岸人民币 999,783	美元 155,777	2022年4月21日	法国巴黎银行	(1,523)

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 3,946,557	美元 619,345	2022年4月21日	美国道富银行	(1,582)
离岸人民币 1,453,721	美元 226,967	2022年4月21日	美国道富银行	(1,752)
离岸人民币 1,284,012	美元 200,063	2022年4月21日	法国巴黎银行	(1,956)
离岸人民币 3,056,718	美元 478,761	2022年4月21日	美国道富银行	(2,164)
离岸人民币 9,208,111	美元 1,439,506	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(9,240)
离岸人民币 11,489,402	美元 1,795,924	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(11,746)
离岸人民币 38,497,339	美元 6,033,548	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(23,382)
离岸人民币 20,790,423	美元 3,243,251	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(27,784)
欧元 2,060	美元 2,291	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(2)
欧元 990	美元 1,095	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(7)
欧元 996	美元 1,099	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(10)
欧元 1,000	美元 1,101	2022年4月21日	美国道富银行	(12)
欧元 1,002	美元 1,103	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(13)
欧元 1,002	美元 1,101	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(15)
欧元 2,177	美元 2,397	2022年4月21日	美国道富银行	(27)
欧元 2,779	美元 3,066	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(28)
欧元 3,922	美元 4,335	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(31)
欧元 2,067	美元 2,260	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(40)
欧元 40,230	美元 44,688	2022年4月21日	美国道富银行	(99)
欧元 168,881	美元 186,903	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(1,108)
欧元 300,632	美元 333,237	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(1,447)
欧元 119,705	美元 131,360	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,903)
欧元 213,247	美元 233,872	2022年4月21日	巴克莱银行, 伦敦	(3,529)
欧元 397,086	美元 437,425	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(4,638)
欧元 211,194	美元 229,067	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(6,049)
欧元 912,299	美元 1,008,827	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(6,806)
欧元 460,864	美元 502,069	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(10,996)
英镑 839	美元 1,104	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(1)
英镑 1,664	美元 2,185	2022年4月21日	美国道富银行	(6)
英镑 7,791	美元 10,250	2022年4月21日	美国道富银行	(7)
英镑 834	美元 1,091	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(7)
英镑 843	美元 1,101	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(8)
英镑 884	美元 1,153	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(10)
英镑 17,312	美元 22,690	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(101)
英镑 69,215	美元 90,899	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(221)
英镑 81,754	美元 107,369	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(258)
英镑 44,943	美元 58,904	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(263)
英镑 30,395	美元 39,656	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(358)
英镑 543,053	美元 714,133	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(787)
英镑 257,034	美元 336,818	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,563)
英镑 1,123,109	美元 1,474,723	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(3,829)
英镑 326,631	美元 425,850	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(4,155)
英镑 582,630	美元 760,499	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(6,522)
英镑 1,082,096	美元 1,416,846	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(7,713)
纽元 1,596	美元 1,101	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(9)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/(亏损) 美元
纽元 1,616	美元 1,113	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(10)
纽元 1,614	美元 1,104	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(19)
纽元 1,601	美元 1,095	2022年4月21日	美国道富银行	(19)
纽元 1,611	美元 1,098	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(22)
纽元 1,625	美元 1,106	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(24)
纽元 2,194	美元 1,498	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(28)
纽元 1,630	美元 1,106	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(28)
纽元 1,632	美元 1,104	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(31)
纽元 1,625	美元 1,096	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(34)
纽元 6,477	美元 4,469	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(35)
纽元 3,303	美元 2,258	2022年4月21日	美国道富银行	(39)
纽元 19,152	美元 13,093	2022年4月21日	美国道富银行	(224)
纽元 37,340	美元 25,496	2022年4月21日	法国巴黎银行	(469)
纽元 113,904	美元 78,582	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(623)
纽元 52,077	美元 35,303	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(909)
纽元 199,027	美元 137,125	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,271)
纽元 179,610	美元 123,315	2022年4月21日	美国道富银行	(1,578)
纽元 96,144	美元 65,038	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(1,817)
纽元 202,301	美元 138,080	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(2,591)
纽元 586,255	美元 403,133	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(4,525)
纽元 352,773	美元 239,680	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(5,624)
纽元 476,949	美元 323,366	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(8,285)
纽元 836,393	美元 572,433	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(9,161)
纽元 637,338	美元 430,776	2022年4月21日	多伦多道明银行	(12,404)
纽元 1,203,063	美元 821,856	2022年4月21日	渣打银行, 伦敦	(14,705)
纽元 1,174,537	美元 800,037	2022年4月21日	美国道富银行	(16,689)
新加坡元 1,493	美元 1,100	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(3)
新加坡元 1,493	美元 1,099	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(4)
新加坡元 1,496	美元 1,097	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(8)
新加坡元 44,994	美元 33,066	2022年4月21日	美国道富银行	(177)
新加坡元 76,660	美元 56,432	2022年4月21日	美国道富银行	(208)
新加坡元 133,915	美元 98,670	2022年4月21日	美国道富银行	(271)
新加坡元 58,261	美元 42,699	2022年4月21日	法国巴黎银行	(347)
新加坡元 95,063	美元 69,713	2022年4月21日	美国道富银行	(523)
新加坡元 100,509	美元 73,543	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(717)
新加坡元 188,530	美元 138,569	2022年4月21日	法国巴黎银行	(724)
新加坡元 196,928	美元 144,378	2022年4月21日	美国道富银行	(1,120)
美元 1,523	离岸人民币 9,665	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(2)
美元 1,139	离岸人民币 7,226	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(2)
美元 6,464	英镑 4,908	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(3)
美元 1,616	离岸人民币 10,252	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(3)
美元 1,425	离岸人民币 9,038	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(3)
美元 1,375	离岸人民币 8,718	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(3)
美元 1,238	澳元 1,645	2022年4月21日	美国道富银行	(3)
美元 3,399	离岸人民币 21,566	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(6)

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 3,235	离岸人民币 20,527	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(6)
美元 5,511	离岸人民币 34,971	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(9)
美元 5,863	离岸人民币 37,201	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(10)
美元 5,835	离岸人民币 37,019	2022年4月21日	美国道富银行	(11)
美元 11,245	离岸人民币 71,393	2022年4月21日	美国道富银行	(12)
美元 4,030	离岸人民币 25,512	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(16)
美元 102,545	英镑 77,879	2022年4月21日	美国道富银行	(19)
美元 23,696	离岸人民币 150,457	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(24)
美元 15,298	离岸人民币 97,063	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(26)
美元 8,628	离岸人民币 54,672	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(26)
美元 8,351	加元 10,397	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(27)
美元 3,976	英镑 2,999	2022年4月21日	法国巴黎银行	(28)
美元 10,087	离岸人民币 63,921	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(30)
美元 18,913	离岸人民币 120,000	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(33)
美元 21,829	澳元 29,003	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(44)
美元 11,470	离岸人民币 72,616	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(45)
美元 42,783	离岸人民币 271,630	2022年4月21日	美国道富银行	(47)
美元 26,751	英镑 20,283	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(49)
美元 16,500	欧元 14,769	2022年4月21日	美国道富银行	(59)
美元 41,300	离岸人民币 262,034	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(74)
美元 35,362	离岸人民币 224,278	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(76)
美元 31,163	英镑 23,614	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(76)
美元 50,841	离岸人民币 322,614	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(83)
美元 86,343	英镑 65,500	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(114)
美元 42,382	离岸人民币 268,571	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(127)
美元 33,417	离岸人民币 211,564	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(131)
美元 70,970	离岸人民币 450,176	2022年4月21日	美国道富银行	(142)
美元 498,525	英镑 378,564	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(151)
美元 92,646	离岸人民币 587,803	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(165)
美元 319,902	纽元 459,811	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(168)
美元 62,886	离岸人民币 398,600	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(173)
美元 82,498	离岸人民币 523,250	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(174)
美元 93,019	离岸人民币 590,040	2022年4月21日	美国道富银行	(186)
美元 113,906	离岸人民币 722,738	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(194)
美元 246,757	离岸人民币 1,566,628	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(274)
美元 167,947	离岸人民币 1,065,557	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(299)
美元 88,181	英镑 66,754	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(299)
美元 43,107	英镑 32,516	2022年4月21日	法国巴黎银行	(300)
美元 319,936	离岸人民币 2,031,228	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(355)
美元 410,126	离岸人民币 2,603,879	2022年4月21日	美国道富银行	(448)
美元 275,084	离岸人民币 1,744,729	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(579)
美元 339,743	离岸人民币 2,154,832	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(715)
美元 87,783	英镑 65,941	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(973)
美元 582,373	离岸人民币 3,695,069	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,014)
美元 840,350	离岸人民币 5,333,920	2022年4月21日	花旗银行, 伦敦	(1,144)

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 357,364	英镑 270,543	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(1,199)
美元 1,507,933	离岸人民币 9,574,475	2022年4月21日	汇丰银行, 伦敦	(1,545)
美元 803,288	离岸人民币 5,085,591	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(3,153)
美元 329,011	英镑 246,130	2022年4月21日	美国道富银行	(4,986)
美元 388,598	英镑 289,511	2022年4月21日	加拿大皇家银行	(7,461)
美元 4,047,070	离岸人民币 25,667,104	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(8,769)
美元 12,152,354	离岸人民币 77,080,317	2022年4月21日	法国巴黎银行	(25,020)
美元 15,955,206	离岸人民币 101,201,157	2022年4月21日	法国巴黎银行	(32,850)
美元 60,469,977	英镑 45,876,603	2022年4月21日	美林国际, 伦敦	(74,256)
美元 258,544,300	离岸人民币 1,639,725,442	2022年4月21日	高盛国际, 伦敦	(560,173)
澳元 1,462	美元 1,098	2022年5月20日	法国巴黎银行	(0)
加元 1,369	美元 1,096	2022年5月20日	美国道富银行	(0)
欧元 985	美元 1,097	2022年5月20日	加拿大皇家银行	(1)
英镑 835	美元 1,099	2022年5月20日	渣打银行, 伦敦	(0)
美元 1,257	离岸人民币 8,003	2022年5月20日	美林国际, 伦敦	(0)
美元 18,069	离岸人民币 115,037	2022年5月20日	美林国际, 伦敦	(2)
美元 27,394	离岸人民币 174,406	2022年5月20日	美林国际, 伦敦	(3)
			未实现总亏损	(1,551,999)
			未实现净收益	2,658,290

财务状况表

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

	二零二二年 三月三十一日 美元	二零二一年 九月三十日 美元
资产		
银行现金	12,843,929	15,996,141
应收经纪款项	19,763,082	7,220,184
分配应收款项	3,699,392	9,810,492
衍生性产品	4,210,289	1,108,362
投资	1,477,842,125	1,292,211,675
股息及其他应收款项	6,365,531	4,174,450
总资产	1,524,724,348	1,330,521,304
负债		
短期银行借款 - 无抵押	-	2,000,000
应付经纪款项	22,120,192	8,443,967
赎回应付款项	2,878,958	8,051,088
应付收益分配 [附注 6]	6,225,948	4,997,620
衍生性产品	1,551,999	7,161,756
应付税项	725,971	432,561
其他应付款项	1,834,958	1,768,064
总负债(不含可赎回份额持有人 应占净资产)	35,338,026	32,855,056
可赎回份额持有人应占净资产 [附注 3]	1,489,386,322	1,297,666,248

综合收益表

截至二零二二年三月三十一日止期间(未经审计)

	二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元
收入		
投资及衍生性产品净收益 [附注 4]	35,907,473	326,104,041
股息收入	16,528,081	15,311,150
存款利息	13,171	34,211
汇兑净亏损	(311,683)	(687,715)
其他收益	-	1,488,906
	52,137,042	342,250,593
支出		
管理费用 [附注 5(a)]	9,713,972	9,133,575
交易成本 [附注 5(a), 5(b)]	1,222,921	1,671,133
托管费用及银行费用 [附注 5(a), 5(b)]	213,799	217,286
受托人费用 [附注 5(b)]	179,782	168,800
基金注册登记机构费用 [附注 5(a)]	55,544	59,247
法律及专业费用	10,583	23,268
估值费用 [附注 5(a)]	8,540	8,540
核数师酬金	3,621	20,695
印刷及出版支出	1,163	6,084
其他经营费用	11,601	11,589
	11,421,526	11,320,217
净经营利润	40,715,516	330,930,376
财务成本		
收益分配 [附注 6]	(30,124,649)	(25,077,245)
利息费用 [附注 5(b)]	(12,906)	(6,300)
	(30,137,555)	(25,083,545)

综合收益表(续)

截至二零二二年三月三十一日止期间(未经审计)

可赎回份额持有人应占净资产变动表

截至二零二二年三月三十一日止期间(未经审计)

	二零二一年	二零二零年		二零二一年	二零二零年
	十月一日至	十月一日至		十月一日至	十月一日至
	二零二二年	二零二一年		二零二二年	二零二一年
	三月三十一日	三月三十一日		三月三十一日	三月三十一日
	美元	美元		美元	美元
除税前利润	10,577,961	305,846,831	期初可赎回份额持有人应占净资产	1,297,666,248	1,102,603,422
税项	(1,795,644)	(1,915,377)		-----	-----
可赎回份额持有人应占净资产及 总综合收益之增加	8,782,317	303,931,454	分配可赎回份额 [附注 3]	589,263,531	439,200,135
	=====	=====	赎回可赎回份额 [附注 3]	(406,325,774)	(441,857,755)
			净分配 / (赎回)	182,937,757	(2,657,620)
				-----	-----
				1,480,604,005	1,099,945,802
			可赎回份额持有人应占净资产及 总综合收益之增加	8,782,317	303,931,454
				-----	-----
			期末可赎回份额持有人应占净资产	1,489,386,322	1,403,877,256
				=====	=====

第二十二至三十三页之附注乃属本财务报表之一部分。

现金流量表

(续)

截至二零二二年三月三十一日止期间(未经审计)

	二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元		二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元
经营业务			现金及现金等价物之(减少)/增		
购入投资及衍生性产品	(539,115,947)	(508,268,462)	加	(1,230,770)	4,354,290
出售投资及衍生性产品所得款项	381,735,022	535,507,701	期初现金及现金等价物	13,996,141	9,423,325
已收股息	12,351,300	12,687,082	现金及现金等价物之汇兑收益	78,558	324,653
已收利息	13,302	31,876			
已付基金注册登记机构费用	(114,371)	(115,263)			
已付受托人费用	(176,558)	(160,038)	期末现金及现金等价物	12,843,929	14,102,268
已付交易成本	(1,144,945)	(1,636,033)			
已付税项	(1,502,234)	(1,813,240)			
已付管理费用	(9,505,841)	(8,666,492)	现金及现金等价物余额分析:		
其他	1,262,002	126,403	银行现金	12,843,929	14,102,268
经营业务所(运用)/产生之现金					
净额	(156,198,270)	27,693,534			
融资活动					
已付利息	(12,906)	(6,300)			
分配可赎回份额所得款项	595,374,631	441,832,745			
赎回可赎回份额付款	(411,497,904)	(440,561,885)			
已付收益分配	(28,896,321)	(24,603,804)			
融资活动所产生/(运用)之现金					
净额	154,967,500	(23,339,244)			

财务报表之附注

1 本基金

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

本基金的投资目标为通过主要投资(即至少为资产净值总额的 70%)于亚太区(日本除外)内的、投资管理预期会派发股息公司的股票,以提供收益及长期资本增长。本基金所持有的此等股票将根据公司的过往派息纪录及公告,以及其长期资本增长潜力而挑选。

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

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

2 主要会计政策概览

(a) 中期财务报表之会计政策

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

(b) 投资及衍生性产品

分类

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

公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，按最后成交价计算。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。在非活跃市场中进行金融工具交易时，以市场报价、交易商/经纪报价或其他获可观察输入值支持的报价来源作为估值。

债务证券的公允价值按包括应计利息的报价计算。

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

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。最后成交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。最后成交价与溢价金额/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) 外币折算

功能及呈列货币

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

交易及结余

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按期/年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

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

(d) 销售份额所得款项及赎回份额支付款项

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

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

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产(每份额)

二零二一年十月一日至二零二二年三月三十一日

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	15,818,277.479	7,456,412.191	1,919,678.947	4,439,007.661	1,196,639.730
总分配	4,408,026.331	1,074,972.810	331,739.922	1,773,995.540	1,306,714.465
总赎回	(3,039,159.143)	(1,618,050.622)	(559,788.575)	(1,647,417.931)	(150,804.067)
期末	17,187,144.667	6,913,334.379	1,691,630.294	4,565,585.270	2,352,550.128

	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	新加坡元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
期初	161,313,873.521	4,705,292.384	1,342,654.039	149,221,298.724	1,056,230.405
总分配	93,667,254.625	995,168.357	210,325.435	30,171,530.364	67,226.443
总赎回	(42,267,748.038)	(540,921.666)	(189,781.795)	(24,979,480.542)	(309,352.070)
期末	212,713,380.108	5,159,539.075	1,363,197.679	154,413,348.546	814,104.778

	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每季派息) 份额	美元 C 类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	452,651.110	30,511,465.339	1,026,607.148	11,819,722.942	1,911,295.530
总分配	210,516.709	17,989,000.534	9,403,622.774	809,272.660	261,216.210
总赎回	(69,315.800)	(7,444,893.965)	(906,607.921)	(10,881,357.816)	(550,625.280)
期末	593,852.019	41,055,571.908	9,523,622.001	1,747,637.786	1,621,886.460

	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额	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	1,891,564.740	7,641,018.160	10,422,468.550	2,137,889.830	1,822,820.030
总分配	107,151.010	1,378,721.110	1,062,517.790	215,092.250	205,038.790
总赎回	(331,573.670)	(3,062,246.770)	(1,681,563.550)	(613,060.590)	(424,663.870)
期末	1,667,142.080	5,957,492.500	9,803,422.790	1,739,921.490	1,603,194.950

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	欧元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	18,288,390.411	8,291,310.412	1,353,952.956	3,644,545.871	1,315,720.065
总分配	4,409,953.397	2,527,738.536	963,321.863	1,507,634.658	1,477,054.217
总赎回	(6,023,674.342)	(2,685,564.570)	(399,819.919)	(934,577.742)	(1,208,549.872)
期末	16,674,669.466	8,133,484.378	1,917,454.900	4,217,602.787	1,584,224.410

	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	新加坡元对冲 类别(每月派息) 份额
已发行份额数目:					
期初	160,240,761.757	4,742,186.011	972,733.833	141,673,624.018	666,937.330
总分配	63,871,731.456	1,451,061.653	600,958.092	37,267,020.407	475,877.448
总赎回	(55,750,423.019)	(1,610,941.928)	(216,530.845)	(32,550,449.178)	(107,316.766)
期末	168,362,070.194	4,582,305.736	1,357,161.080	146,390,195.247	1,035,498.012

	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	美元 C 类别 (每季派息) 份额	美元 C 类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币份额 (累计) 份额
已发行份额数目:					
期初	293,253.873	34,126,677.797	914,860.915	10,021,705.390	3,171,514.040
总分配	414,246.610	13,004,817.938	143,259.988	2,209,257.386	1,206,760.180
总赎回	(222,648.472)	(12,847,857.397)	(45,442.005)	(265,582.840)	(1,407,861.030)
期末	484,852.011	34,283,638.338	1,012,678.898	11,965,379.936	2,970,413.190

	PRC 人民币份额 (每月派息) 份额	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	3,359,026.210	18,955,920.350	22,429,544.450	3,652,162.510	3,347,321.140
总分配	33,391.350	3,488,716.840	1,895,685.360	653,847.720	464,347.960
总赎回	(1,205,063.200)	(12,017,681.210)	(13,065,192.710)	(1,841,830.240)	(2,061,847.890)
期末	2,187,354.360	10,426,955.980	11,260,037.100	2,464,179.990	1,749,821.210

二零二二年三月三十一日

	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	欧元对冲类别 (每月派息) 欧元	英镑对冲类别 (每月派息) 英镑	港元类别 (累计) 港元
可赎回份额持有人应占净资产	163,128,365	68,034,269	17,457,504	46,287,445	36,852,695
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.49	9.84	10.32	10.14	15.66
	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	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	新加坡元对冲 类别(每月派息) 新加坡元
可赎回份额持有人应占净资产	2,225,225,635	49,918,028	25,534,388	1,647,015,537	8,157,542
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	10.46	9.67	18.73	10.67	10.02
	美元类别 (累计) 美元	美元类别 (每月派息) 美元	美元 C 类别 (每季派息) 美元	美元 C 类别 (每月派息) 美元	PRC 人民币份额 (累计) 人民币
可赎回份额持有人应占净资产	9,255,750	425,909,923	114,318,479	19,070,333	18,242,040
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	15.59	10.37	12.00	10.91	11.25
	PRC 人民币份额 (每月派息) 人民币	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	16,436,609	74,063,975	101,036,986	20,675,142	16,704,214
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.86	12.43	10.31	11.88	10.42

二零二一年九月三十日

	澳元对冲类别 (每月派息) 澳元	加元对冲类别 (每月派息) 加元	欧元对冲类别 (每月派息) 欧元	英镑对冲类别 (每月派息) 英镑	港元类别 (累计) 港元
可赎回份额持有人应占净资产	149,977,939	73,226,870	19,759,475	44,864,442	18,177,591
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.48	9.82	10.29	10.11	15.19
	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	人民币对冲类别 (每月派息) 人民币	新加坡元对冲 类别(每月派息) 新加坡元
可赎回份额持有人应占净资产	1,669,881,158	45,460,057	24,230,222	1,586,493,943	10,554,577
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	10.35	9.66	18.05	10.63	9.99
	美元类别 (累计) 美元	美元类别 (每月派息) 美元	美元 C 类别 (每季派息) 美元	美元 C 类别 (每月派息) 美元	PRC 人民币份额 (累计) 人民币
可赎回份额持有人应占净资产	6,882,906	315,082,437	12,216,484	127,689,157	21,317,997
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	15.21	10.33	11.90	10.80	11.15
	PRC 人民币份额 (每月派息) 人民币	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	18,880,389	91,573,350	107,106,589	24,790,120	18,911,109
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.98	11.98	10.28	11.60	10.37

4 投资及衍生性产品净收益

	二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益/亏损之变动	(74,302)	228,502,796
投资及衍生性产品销售之实现收益	35,981,775	97,601,245
	<u>35,907,473</u>	<u>326,104,041</u>

5 与受托人及其关联人士以及管理人及其关联人士之交易

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

	二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元
管理费用	9,713,972	9,133,575
基金注册登记机构费用	55,544	59,247
交易成本	52,351	37,963
托管费用及银行费用	11,459	10,600
估值费用	8,540	8,540
	<u>9,841,866</u>	<u>9,250,925</u>

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

	二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元
受托人费用	179,782	168,800
托管费用及银行费用	176,883	167,191
交易成本	36,942	74,360
利息费用	12,906	6,300
	<u>396,513</u>	<u>416,651</u>

6 收益分配

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

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零二一年	二零二二年
					十月一日至	十月一日至
					二零二一年	二零二二年
					三月三十一日	三月三十一日
					美元	美元
澳元对冲类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	澳元 0.0309	15,798,906.499	(368,556)	
加元对冲类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	加元 0.0337	7,453,695.731	(203,648)	
欧元对冲类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	欧元 0.0287	1,907,573.206	(63,926)	
英镑对冲类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	英镑 0.0339	4,437,121.286	(207,562)	
港元类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	港元 0.0350	162,705,608.385	(732,220)	
纽元对冲类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	纽元 0.0351	4,572,868.313	(115,766)	
人民币对冲类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	人民币 0.0646	149,162,983.922	(1,508,218)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	新加坡元 0.0348	1,042,064.115	(26,977)	
美元类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	美元 0.0350	30,357,742.018	(1,062,521)	
美元 C 类别(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	美元 0.0366	11,962,302.095	(437,820)	
PRC 人民币份额(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	人民币 0.0335	1,858,625.180	(9,746)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	人民币 0.0625	10,229,138.600	(100,067)	
PRC 美元份额(每月派息)	2021年10月29日	2021年11月8日	美元 0.0352	1,808,866.930	(63,672)	
澳元对冲类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	澳元 0.0310	15,535,818.497	(342,714)	
加元对冲类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	加元 0.0336	7,566,053.334	(198,725)	
欧元对冲类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	欧元 0.0288	1,922,166.764	(62,381)	
英镑对冲类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	英镑 0.0339	5,182,332.610	(233,586)	
港元类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	港元 0.0351	161,286,375.091	(725,826)	
纽元对冲类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	纽元 0.0368	4,508,711.948	(112,718)	
人民币对冲类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	人民币 0.0600	147,383,622.819	(1,383,537)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	新加坡元 0.0352	988,788.466	(25,397)	
美元类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	美元 0.0350	30,347,912.578	(1,062,177)	
美元 C 类别(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	美元 0.0366	11,591,153.345	(424,236)	
PRC 人民币份额(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	人民币 0.0335	1,828,453.790	(9,583)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	人民币 0.0580	10,127,002.910	(91,897)	
PRC 美元份额(每月派息)	2021年11月30日	2021年12月8日	美元 0.0351	1,779,314.100	(62,454)	
澳元对冲类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	澳元 0.0289	15,439,413.106	(323,651)	
加元对冲类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	加元 0.0309	7,499,750.852	(181,226)	
欧元对冲类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	欧元 0.0241	1,928,066.905	(52,651)	
英镑对冲类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	英镑 0.0299	5,118,707.487	(206,563)	
港元类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	港元 0.0352	158,660,355.660	(715,969)	
纽元对冲类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	纽元 0.0365	4,484,140.659	(111,910)	
人民币对冲类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	人民币 0.0604	143,600,341.247	(1,360,404)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	新加坡元 0.0356	817,879.670	(21,533)	
美元类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	美元 0.0350	30,704,122.424	(1,074,644)	
美元 C 类别(每季派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	美元 0.1229	1,036,816.691	(126,492)	
美元 C 类别(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	美元 0.0367	11,758,882.180	(431,551)	
PRC 人民币份额(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	人民币 0.0334	1,660,992.020	(8,701)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	人民币 0.0584	9,774,689.520	(89,535)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零二一年	二零二零年
					十月一日至	十月一日至
					二零二二年	二零二一年
					三月三十一日	三月三十一日
					美元	美元
PRC 美元份额(每月派息)	2021年12月31日	2022年1月10日	美元 0.035	1,677,425.250	(59,045)	
澳元对冲类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	澳元 0.0312	16,403,034.997	(357,961)	
加元对冲类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	加元 0.0334	7,345,515.442	(192,085)	
欧元对冲类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	欧元 0.0275	1,771,264.990	(54,387)	
英镑对冲类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	英镑 0.0346	4,581,222.799	(212,626)	
港元类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	港元 0.0351	187,328,523.797	(843,665)	
纽元对冲类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	纽元 0.0369	4,851,026.702	(117,372)	
人民币对冲类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	人民币 0.0566	148,981,499.568	(1,324,644)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	新加坡元 0.0350	851,113.446	(22,285)	
美元类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	美元 0.0350	35,744,141.658	(1,251,045)	
美元 C 类别(每月派息)	2022年1月31日	2022年2月11日	美元 0.0368	1,604,735.010	(59,054)	
PRC 人民币份额(每月派息)	2022年1月28日	2022年2月11日	人民币 0.0333	1,674,464.160	(8,754)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2022年1月28日	2022年2月11日	人民币 0.0547	9,356,237.910	(80,346)	
PRC 美元份额(每月派息)	2022年1月28日	2022年2月11日	美元 0.0352	1,626,483.210	(57,252)	
澳元对冲类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	澳元 0.0310	16,946,854.617	(379,646)	
加元对冲类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	加元 0.0338	6,957,953.515	(184,606)	
欧元对冲类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	欧元 0.0284	1,711,901.488	(54,673)	
英镑对冲类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	英镑 0.0363	4,503,171.270	(219,329)	
港元类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	港元 0.0351	199,777,385.278	(897,968)	
纽元对冲类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	纽元 0.0375	5,176,586.920	(130,809)	
人民币对冲类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	人民币 0.0593	152,298,923.969	(1,430,229)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	新加坡元 0.0352	804,466.281	(20,925)	
美元类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	美元 0.0350	39,566,506.879	(1,384,828)	
美元 C 类别(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	美元 0.0368	1,644,973.315	(60,535)	
PRC 人民币份额(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	人民币 0.0332	1,653,700.390	(8,701)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	人民币 0.0573	9,725,827.860	(88,319)	
PRC 美元份额(每月派息)	2022年2月28日	2022年3月8日	美元 0.0352	1,615,115.730	(56,852)	
澳元对冲类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	澳元 0.0285	17,181,177.650	(367,713)	
加元对冲类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	加元 0.0329	6,913,334.379	(182,097)	
欧元对冲类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	欧元 0.0247	1,691,630.294	(46,490)	
英镑对冲类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	英镑 0.0351	4,562,806.621	(210,867)	
港元类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	港元 0.0352	213,456,752.438	(959,430)	
纽元对冲类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	纽元 0.0369	5,159,539.075	(132,424)	
人民币对冲类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	人民币 0.0612	154,417,281.152	(1,488,688)	
新加坡元对冲类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	新加坡元 0.0346	814,104.778	(20,813)	
美元类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	美元 0.0350	40,968,152.266	(1,433,885)	
美元 C 类别(每季派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	美元 0.1222	9,515,622.001	(1,162,809)	
美元 C 类别(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	美元 0.0368	1,747,637.786	(64,313)	
PRC 人民币份额(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	人民币 0.0334	1,676,555.190	(8,821)	
PRC 人民币对冲份额(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	人民币 0.0592	9,792,978.500	(91,326)	
PRC 美元份额(每月派息)	2022年3月31日	2022年4月11日	美元 0.0351	1,603,181.650	(56,272)	
澳元对冲类别(每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	澳元 0.0271	18,130,864.663		(344,188)
加元对冲类别(每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	加元 0.0280	8,217,444.236		(172,145)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零二一年	二零二零年
					十月一日至	十月一日至
					二零二二年	二零二一年
					三月三十一日	三月三十一日
					美元	美元
欧元对冲类别(每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	欧元 0.0242	1,448,171.156		(40,855)
英镑对冲类别(每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	英镑 0.0281	3,668,935.473		(132,892)
港元类别(每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	港元 0.0299	157,012,691.849		(605,499)
纽元对冲类别(每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	纽元 0.0282	4,712,611.666		(87,711)
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 0.0524	138,442,834.269		(1,079,412)
新加坡元对冲类别(每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	新加坡元 0.0289	667,206.200		(14,093)
美元类别(每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0300	33,114,715.026		(993,441)
美元 C 类别(每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0312	10,142,601.086		(316,449)
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 0.0300	3,248,728.270		(14,502)
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 0.0507	21,940,601.490		(165,517)
PRC 美元份额(每月派息)	2020年10月30日	2020年11月9日	美元 0.0302	3,303,691.880		(99,771)
澳元对冲类别(每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	澳元 0.0262	18,178,187.874		(352,343)
加元对冲类别(每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	加元 0.0277	8,143,545.335		(173,848)
欧元对冲类别(每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	欧元 0.0236	1,431,590.794		(40,369)
英镑对冲类别(每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	英镑 0.0278	3,606,368.780		(133,793)
港元类别(每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	港元 0.0300	153,550,044.827		(594,330)
纽元对冲类别(每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	纽元 0.0280	4,523,399.746		(89,115)
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 0.0519	135,785,584.270		(1,072,881)
新加坡元对冲类别(每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	新加坡元 0.0288	662,939.258		(14,271)
美元类别(每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0300	32,804,916.454		(984,147)
美元 C 类别(每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0312	10,772,583.813		(336,105)
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 0.0296	3,119,868.550		(14,059)
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 0.0502	19,254,783.000		(147,154)
PRC 美元份额(每月派息)	2020年11月30日	2020年12月8日	美元 0.0302	2,957,904.430		(89,329)
澳元对冲类别(每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	澳元 0.0238	17,648,021.240		(322,788)
加元对冲类别(每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	加元 0.0259	7,833,493.004		(159,028)
欧元对冲类别(每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	欧元 0.0196	1,330,799.135		(32,084)
英镑对冲类别(每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	英镑 0.0244	3,588,262.790		(119,156)
港元类别(每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	港元 0.0300	149,885,150.500		(580,025)
纽元对冲类别(每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	纽元 0.0269	4,327,775.733		(83,861)
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 0.0527	134,317,479.700		(1,088,318)
新加坡元对冲类别(每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	新加坡元 0.0289	670,744.269		(14,655)
美元类别(每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0300	31,002,691.630		(930,081)
美元 C 类别(每季派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.1038	972,273.489		(100,922)
美元 C 类别(每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0312	11,217,718.590		(349,993)
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 0.0294	3,061,758.030		(13,840)
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 0.0510	17,167,688.390		(134,615)
PRC 美元份额(每月派息)	2020年12月31日	2021年1月11日	美元 0.0302	2,423,718.730		(73,196)
澳元对冲类别(每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	澳元 0.0254	17,654,301.191		(343,915)
加元对冲类别(每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	加元 0.0274	8,027,996.922		(171,782)
欧元对冲类别(每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	欧元 0.0218	1,604,385.409		(42,399)
英镑对冲类别(每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	英镑 0.0268	3,899,423.311		(143,380)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	二零二一年	二零二零年
					十月一日至	十月一日至
					二零二二年	二零二一年
					三月三十一日	三月三十一日
					美元	美元
港元类别(每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	港元 0.0309	158,086,930.089		(630,052)
纽元对冲类别(每月派息)	2021年1月29日	2021年2月9日	纽元 0.0275	4,479,419.801		(88,212)
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 0.0529	140,928,247.916		(1,151,385)
新加坡元对冲类别(每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	新加坡元 0.0300	885,825.193		(19,993)
美元类别(每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0310	31,953,681.669		(990,564)
美元 C 类别(每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0323	11,430,041.680		(369,190)
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 0.0300	2,495,597.930		(11,563)
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 0.0513	12,528,610.260		(99,263)
PRC 美元份额(每月派息)	2021年1月29日	2021年2月8日	美元 0.0312	1,935,597.120		(60,391)
澳元对冲类别(每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	澳元 0.0271	16,777,212.437		(361,798)
加元对冲类别(每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	加元 0.0289	8,092,320.726		(186,848)
欧元对冲类别(每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	欧元 0.0244	1,645,791.402		(49,088)
英镑对冲类别(每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	英镑 0.0292	4,082,717.117		(168,481)
港元类别(每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	港元 0.0309	163,576,622.364		(651,851)
纽元对冲类别(每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	纽元 0.0292	4,263,504.170		(92,605)
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 0.0554	140,825,770.339		(1,207,346)
新加坡元对冲类别(每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	新加坡元 0.0302	963,996.629		(22,043)
美元类别(每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0310	33,301,097.103		(1,032,334)
美元 C 类别(每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0323	11,611,261.651		(375,044)
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 0.0300	2,252,172.940		(10,456)
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 0.0536	12,209,374.600		(101,274)
PRC 美元份额(每月派息)	2021年2月26日	2021年3月8日	美元 0.0312	1,781,672.260		(55,588)
澳元对冲类别(每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	澳元 0.0272	16,677,125.909		(345,498)
加元对冲类别(每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	加元 0.0287	8,159,278.541		(186,316)
欧元对冲类别(每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	欧元 0.0234	1,917,454.900		(52,734)
英镑对冲类别(每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	英镑 0.0288	4,216,663.798		(167,551)
港元类别(每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	港元 0.0310	168,406,366.110		(671,507)
纽元对冲类别(每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	纽元 0.0295	4,577,870.688		(94,580)
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 0.0570	146,428,971.124		(1,272,092)
新加坡元对冲类别(每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	新加坡元 0.0312	1,035,498.012		(24,045)
美元类别(每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0310	34,219,177.614		(1,060,794)
美元 C 类别(每季派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.1074	1,012,678.898		(108,762)
美元 C 类别(每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0323	11,965,379.936		(386,482)
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 0.0302	2,187,354.360		(10,068)
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 0.0552	11,250,640.290		(94,653)
PRC 美元份额(每月派息)	2021年3月31日	2021年4月13日	美元 0.0312	1,747,983.370		(54,537)
可赎回份额持有人之总收益分配					(30,124,649)	(25,077,245)

