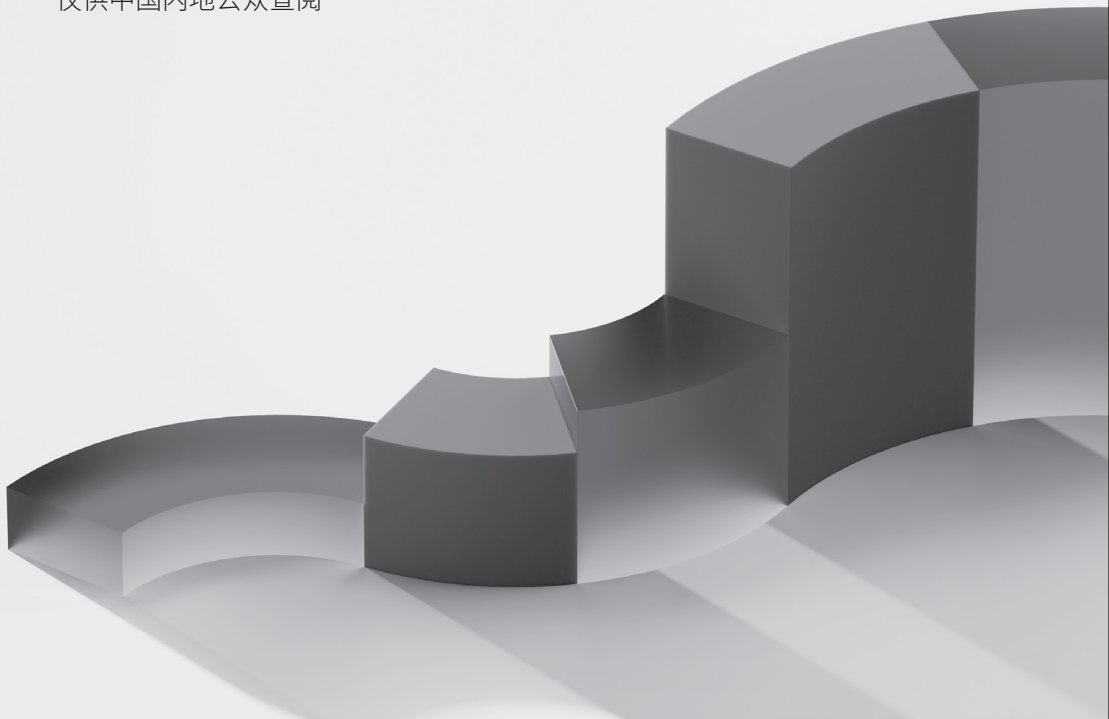


仅供中国内地公众查阅



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 - 6
投资组合持有变动表	7
金融衍生工具详情	8 - 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 - 31

投资组合

(续)

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
上市投资(96.0%)				加拿大 (续)			
(I) 债务证券(80.5%)				Hydro-Quebec 4%			
				15/02/55	加元 300,000	278,160	0.0
澳大利亚 (3.2%)				Hydro-Quebec No19 6.5%			
APT Pipelines Ltd EMTN				15/02/35	加元 1,700,000	1,847,500	0.2
2% 15/07/30-RegS	欧元 1,500,000	1,659,116	0.2	Ontario Prov of 2.6%			
Ausgrid Finance Pty Ltd				2/6/2025	加元 600,000	483,247	0.1
3.85% 01/05/23-RegS	美元 500,000	511,561	0.1	Ontario Prov of 2.7%			
Aust & Nz Banking Group				2/6/2029	加元 1,000,000	794,757	0.1
VRN 22/07/30-RegS	美元 1,500,000	1,453,278	0.2	Ontario Prov of 3.5%			
Australia (Govt of) 1.75%				2/6/2024	加元 3,750,000	3,099,812	0.4
21/06/51-RegS	澳元 19,900,000	10,870,268	1.3	Ontario Teachers 0.5%			
Macquarie Bank Ltd				06/05/25-RegS	欧元 4,009,000	4,431,377	0.5
03/03/36-144A	美元 1,500,000	1,313,826	0.2	Quebec Prov of 2.6%			
Nbn Co Ltd 2.625%				6/7/2025	加元 2,700,000	2,172,307	0.3
05/05/31	美元 4,000,000	3,692,105	0.4	Quebec Prov of 3.75%			
SGSP (Aust) 3.5%				1/9/2024	加元 1,250,000	1,032,307	0.1
07/07/27-RegS	美元 1,200,000	1,201,172	0.1	开曼群岛 (0.7%)			
SGSP (Aust) Stp Cpn 3.3%				Avolon Holdings Fndg Ltd			
9/4/2023	美元 3,000,000	3,065,900	0.4	2.528% 18/11/27	美元 2,500,000	2,237,155	0.3
SGSP Aus 3.25% 29/07/26-				CK Hutchison Capit 17			
RegS	美元 2,000,000	1,991,266	0.2	31/12/49	美元 2,000,000	2,024,097	0.2
Woolworths Group Ltd				Ck Hutchison Finance 16			
EMTN 0.375% 15/11/28-				0.875% 03/10/24-RegS	欧元 1,800,000	2,009,485	0.2
RegS	欧元 826,000	836,022	0.1	中国 (9.7%)			
加拿大 (6.7%)				CCB Life Ins VRN 4.5%			
Bank of Montreal EMTN				21/4/77-RegS	美元 2,500,000	2,548,438	0.3
1% 09/09/26-RegS	英镑 1,043,000	1,287,030	0.2	China (Govt of) 2.8%	人民币		
British Columbia 2.2%				24/03/29	110,000,000	17,335,916	2.1
18/06/30	加元 1,000,000	760,931	0.1	China (Govt of) 2.89%	人民币		
British Columbia 4.3%				18/11/31	104,240,000	16,711,872	2.0
18/06/42	加元 1,000,000	930,415	0.1	China (Govt of) INBK	人民币		
Canada (Govt of) 0.25%				3.02% 27/05/31	165,760,000	26,714,436	3.3
1/3/2026	加元 35,000,000	25,837,194	3.1	China (People'S Republic	人民币		
Canada (Govt of) 0.5%				Of) 2.75% 17/02/32	100,000,000	15,765,000	1.9
1/12/1930	加元 4,000,000	2,741,628	0.3	China Dev Bank 1.25%			
Canada Govt of 0.25%				21/01/23-RegS	英镑 824,000	1,079,472	0.1
1/2/2023	加元 13,000,000	10,289,124	1.2				

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	公允价值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公允价值 美元	占资产 净值 百分比
哥伦比亚 (0.4%)				德国 (续)			
Ecopetrol Sa 6.875%				Deutsche Bank Ag			
29/04/30	美元 3,000,000	3,249,893	0.4	22/12/28-RegS	英镑 500,000	604,254	0.1
				Deutsche Bank Ag Ser			
法国 (5.1%)				Emtn 17/02/27-RegS	欧元 2,100,000	2,215,700	0.2
Arab Republic of Egypt				State of North			
3.875% 16/02/26-				Rhine2.15% 3/19-			
RegS	美元 1,750,000	1,581,905	0.2	RegS	欧元 1,200,000	1,524,847	0.2
BPCE SA VRN 0.5%				Vonovia SE EMTN			
15/09/27-RegS	欧元 1,300,000	1,373,841	0.2	0.375% 16/06/27-			
Dexia Credit 0.75%				RegS	欧元 1,500,000	1,556,134	0.2
07/05/23-RegS	美元 3,016,000	2,978,706	0.4				
Dexia Credit 1%				香港 (0.4%)			
18/10/27-RegS	欧元 1,000,000	1,117,570	0.1	AIA Group Ltd GMTN			
Dexia Credit Local				VRN 31/12/49 Perp-			
1.25% 11/24-RegS	欧元 1,200,000	1,362,083	0.2	RegS	美元 1,850,000	1,753,397	0.2
France (Govt of) 0%				Airport Authority HK			
25/05/32-RegS	欧元 8,800,000	8,879,743	1.1	31/12/49-RegS	美元 1,500,000	1,388,822	0.2
France (Govt of) 0.75%							
25/05/52-RegS	欧元 3,850,000	3,637,454	0.4	匈牙利 (0.6%)			
France OAT 3.5%				Hungary (Govt of) 3.25%	匈牙利福林		
25/04/26	欧元 5,000,000	6,439,871	0.8	22/10/31	2,000,000,000	4,968,420	0.6
France OAT 5.75%							
25/10/32	欧元 7,444,000	12,505,834	1.5	冰岛 (0.2%)			
Societe Generale 4.25%				Iceland Rep of 0.5%			
19/8/26-RegS	美元 2,000,000	1,986,140	0.2	20/12/22-RegS	欧元 1,500,000	1,677,227	0.2
德国 (5.9%)				印度 (0.7%)			
Bundeschatzanweisung				HDFC Bank Ltd VRN			
en 0% 15/02/31-RegS	欧元 1,445,199	1,543,032	0.2	31/12/49 Perp-RegS	美元 1,500,000	1,398,675	0.2
Bundeschatzanweisung				NTPC Ltd 4.75%			
en 0% 15/02/32-RegS	欧元 7,000,000	7,388,740	0.9	03/10/22-RegS	美元 2,350,000	2,426,475	0.3
Bundeschatzanweisung				NTPC Ltd Ser Emtn			
en 0% 15/08/31-RegS	欧元 13,050,000	13,855,774	1.7	2.75% 01/02/27-RegS	欧元 1,500,000	1,670,649	0.2
Bundesrep Deut 0%							
15/05/35-RegS	欧元 15,588,000	16,012,404	1.9				
Bundesrep Deut 0%							
15/08/50-RegS	欧元 4,608,200	4,308,538	0.5				

投资组合(续)

(续)

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
印度尼西亚 (0.5%)				日本 (11.1%)			
Perusahaan>Listrik				Dai-ichi Mutual Life			
1.875% 11/31-RegS	欧元 1,000,000	984,669	0.1	Perp 31/12/49	美元 3,200,000	3,376,944	0.4
Perusahaan>Listrik				Dev Bank of Japan			
Negar 5.45%				0.875% 10/25-			
21/05/28-RegS	美元 1,351,000	1,477,671	0.2	RegS	欧元 400,000	445,243	0.1
Rep of Indonesia 1.45%				Japan (Govt of)			
18/09/26	欧元 1,200,000	1,323,125	0.2	0.005% 01/10/23	日元 2,765,000,000	22,804,955	2.8
				Japan (Govt of)			
爱尔兰 (0.9%)				0.1% 20/12/31	日元 1,500,000,000	12,236,045	1.5
Aercap Ireland				Japan (Govt of)			
Cap/Globa 3%				0.7% 20/12/51	日元 700,000,000	5,483,075	0.7
29/10/28	美元 1,500,000	1,404,496	0.2	Japan (Govt of)			
Bank of Ireland Group				1.9% 20/09/30	日元 640,000,000	6,044,158	0.7
05/06/26-RegS	欧元 1,186,000	1,316,515	0.1	Japan Fin Org			
Glencore Cap Fin DAC				3.375% 27/09/23-			
EMTN 1.125%				RegS	美元 1,000,000	1,014,468	0.1
10/03/28-RegS	欧元 1,500,000	1,564,255	0.2	JGB No1 (40Yr) 2.4%			
Ireland Treasury 1.3%				20/03/48	日元 170,000,000	1,914,293	0.2
15/05/33-RegS	欧元 667,322	766,305	0.1	JGB No10 (40Yr)			
Zurich Finance Ireland				0.9% 20/03/57	日元 617,450,000	5,068,698	0.6
19/04/51-RegS	美元 2,500,000	2,288,060	0.3	JGB No20 (30Yr)			
				2.5% 20/09/35	日元 1,890,400,000	19,926,836	2.4
以色列 (0.3%)				JGB No37 (30Yr)			
Israel Electric				1.9% 20/09/42	日元 308,200,000	3,121,514	0.4
5%12/11/24-				JPN Bank for Intl			
144A/RegS	美元 2,000,000	2,117,091	0.3	2.5% 1/6/2022	美元 1,000,000	1,010,772	0.1
				Nippon Life			
意大利 (5.5%)				Insurance 5%			
Italy (Rep of) 0%				18/10/42-RegS	美元 2,000,000	2,072,118	0.2
01/04/26-RegS	欧元 3,000,000	3,194,338	0.4	Nissan Motor Co			
Italy (Rep of) 0.95%				3.201% 17/09/28-			
01/12/31-RegS	欧元 4,000,000	4,070,708	0.5	RegS	欧元 1,900,000	2,166,998	0.3
Italy Rep of (BTP) 1.45%				Rakuten Group Inc			
15/11/24	欧元 6,000,000	6,836,706	0.8	VRN 31/12/49			
Italy Rep of 0.5%				Perp-RegS	欧元 3,000,000	3,042,240	0.4
01/02/26-Regs	欧元 23,000,000	25,128,290	3.0	Sumitomo Mitsui			
Italy Rep of 2.375%				Finance 2.512%			
17/10/24	美元 6,963,000	6,930,904	0.8	22/01/25-RegS	美元 2,000,000	1,959,769	0.2

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	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
韩国 (0.2%)				新西兰 (0.6%)			
Hanwha Life				Auckland Council			
Insurance				0.125% 09/29-RegS	欧元 3,000,000	3,085,202	0.4
04/02/32-RegS	美元 2,000,000	1,929,048	0.2	Westpac Sec			
				Nz/London 0.1%			
				13/07/27-RegS	欧元 1,500,000	1,550,808	0.2
卢森堡 (0.5%)							
European Fin Stab				波兰 (1.4%)			
0.75% 05/27-RegS	欧元 1,550,000	1,736,832	0.2	Poland (Govt of)	波兰兹罗提		
European Inv Bank				25/04/32	64,999,000	11,715,799	1.4
4.875% 15/02/36	美元 800,000	1,009,133	0.1				
Traton Finance				葡萄牙 (0.4%)			
Luxembrg 0.125%				Obrigacoes			
24/03/25-RegS	欧元 1,200,000	1,289,090	0.2	Tes2.875%10/25-			
				RegS/144A	欧元 2,700,000	3,296,671	0.4
墨西哥 (4.4%)				新加坡 (0.4%)			
Cemex Sab De CV				Singapore Airlines Ltd			
3.875% 11/07/31-				3% 20/07/26-RegS	美元 1,500,000	1,456,588	0.2
RegS	美元 2,000,000	1,845,622	0.2	Singapore Airlines Ltd			
Mexico (Utd States				Ser Emtn 3.375%			
O) 7.75% 29/05/31	墨西哥比索 6,100,000	30,238,969	3.7	19/01/29-RegS	美元 2,000,000	1,928,530	0.2
Petroleos							
Mexicanos 4.75%				西班牙 (0.2%)			
26/02/29-RegS	欧元 2,000,000	2,076,482	0.3	Banco Santander Sa Ser			
Petroleos				Emtn 1.625%			
Mexicanos 6.7%				22/10130-RegS	欧元 1,500,000	1,572,471	0.2
16/02/32	美元 2,000,000	1,941,163	0.2				
摩洛哥 (0.1%)				国际 (0.7%)			
Kingdom of				African Export-Import			
Morocco 2%				BA 2.634% 17/05/26-			
30/09/30-RegS	欧元 1,150,000	1,122,271	0.1	144A	美元 2,000,000	1,886,429	0.2
				Banque Ouest Africaine			
荷兰 (0.4%)				D Ser 2.75% 22/01/33-			
ABN Amro Bank NV				RegS	欧元 2,000,000	2,072,797	0.3
VRN 31/12/49				European Union NGEU			
Perp-RegS	欧元 2,600,000	2,911,942	0.4	0% 04/10/28-RegS	欧元 1,465,000	1,543,461	0.2

投资组合(续)

截至二零二二年三月三十一日(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
泰国 (0.2%)				美国 (续)			
Kasikornbank 2.375%				Goldman Sachs Group			
06/04/22-RegS	美元 2,000,000	2,023,070	0.2	Inc EMTN VRN			
				16/12/25-RegS	英镑 2,000,000	2,505,946	0.3
土耳其 (0.3%)				Hyundai Capital 3%			
Hyundai Assan				10/02/27-RegS	美元 2,000,000	1,921,714	0.2
Otomotiv 1.625%				Hyundai Capital			
12/07/26-RegS	美元 3,000,000	2,780,223	0.3	America 1.8%			
				10/01/28-RegS	美元 2,000,000	1,776,151	0.2
英国 (3.2%)				Morgan Stanley VRN			
HSBC Holdings Plc				29/10/27	欧元 3,000,000	3,171,106	0.4
24/07/27	英镑 1,000,000	1,257,014	0.2	US Treasury 1.375%			
Imperial Brands Fin				15/11/40	美元 10,000,000	8,242,662	1.0
Plc 3.125%				US Treasury 1.75%			
26/07/24-RegS	美元 2,080,000	2,074,032	0.3	15/08/41	美元 10,000,000	8,696,754	1.1
Standard Chart 4.05%				US Treasury 1.875%			
12/04/26-RegS	美元 2,000,000	2,056,605	0.2	15/02/32	美元 26,100,000	25,127,039	3.0
UK (Gilts) 0.25%				US Treasury 1.875%			
31/07/31-RegS	英镑 2,000,000	2,327,217	0.3	15/11/51	美元 3,500,000	3,100,463	0.4
UK Treasury 0 5/8%				US Treasury 1.875%			
2050 0.625%				28/02/2027	美元 20,000,000	19,504,489	2.4
22/10/50-RegS	英镑 14,200,000	14,027,266	1.7	US Treasury 2%			
UK Treasury 4 1/2%				15/08/51	美元 6,872,500	6,224,888	0.8
2034 4.5% 07/09/34-				US Treasury 2%			
RegS	英镑 2,500,000	4,312,875	0.5	15/11/41	美元 4,000,000	3,654,650	0.4
				US Treasury 2.375%			
美国 (15.4%)				15/02/42	美元 10,000,000	9,676,398	1.2
American Honda				US Treasury 2.875%			
Finance 0.3%				15/08/45	美元 6,000,000	6,290,273	0.8
07/07/28	欧元 1,500,000	1,543,796	0.2	US Treasury 7.625%			
Athene Global				15/02/25	美元 5,000,000	5,764,090	0.7
Funding 1.73%				US Treasury Bill 0%			
02/10/26	美元 2,000,000	1,835,536	0.2	21/07/22	美元 12,500,000	12,474,756	1.5
Edison Intl 4.125%				维京群岛 (0.2%)			
15/03/28	美元 2,000,000	1,992,036	0.2	Cheung Kong Infra Fin			
Fidelity Natl Info 2%				1% 12/24-RegS	欧元 1,330,000	1,471,108	0.2
21/05/30	欧元 1,700,000	1,940,397	0.2				
Goldman Sachs Group							
Inc 21/10/27	美元 2,040,000	1,915,685	0.2			665,401,108	80.5
						-----	-----

投资组合(续)

(续)

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值 百分比
(II) 集体投资计划 (14.2%)				总上市投资	793,143,521	96.0	
卢森堡 (14.2%)				其他净资产	33,498,759	4.0	
JPMF-JPM Global							
Corporate Bond 'X'-				截至二零二二年三月三十一日可			
(dist)-USD*#	1,128,553	117,076,136	14.2	赎回份额持有人应占净资产	826,642,280	100.0	
		117,076,136	14.2				
		-----	-----	总投资, 按成本	837,906,850		
(III) 衍生性产品 (1.3%)							
				* 由管理人的关联人士发行和管理			
远期外汇合约 (0.8%)		6,888,942	0.8	# 在香港未获认可及并非供香港公众投资			
期货 (0.5%)							
Aust 10Y Bond Fut							
15/06/22	(223)	1,037,440	0.1				
Euro-BOBL Future							
08/06/22	(276)	811,311	0.1				
Euro-BTP Future							
08/06/22	(107)	543,162	0.1				
Euro-Bund Future							
08/06/22	39	35,816	0.0				
Euro-Buxl 30Y Bnd							
08/06/22	47	(906,765)	(0.1)				
Jpn 10Y Bond (OSE)							
13/06/22	(13)	(31,143)	(0.0)				
Long Gilt Future							
28/06/22	(187)	270,835	0.0				
US 2Yr Note (CBT)							
30/06/22	(176)	556,398	0.1				
US 5Yr Note (CBT)							
30/06/22	(600)	1,572,063	0.2				
US Ultra Bond CBT							
21/06/22	50	(111,782)	(0.0)				
		10,666,277	1.3				
		-----	-----				

(续)

	持有占资产净值百分比		持有占资产净值百分比		
	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	九月三十日	三月三十一日	九月三十日	
上市投资					
			埃及	-	0.3
			跨国性	-	0.3
债务证券			巴西	-	0.2
			智利	-	0.2
美国	15.4	11.5	科特迪瓦	-	0.2
日本	11.1	11.1	肯尼亚	-	0.2
中国	9.7	10.2	沙特阿拉伯	-	0.2
加拿大	6.7	5.7	百慕大	-	0.1
德国	5.9	7.5	菲律宾	-	0.1
意大利	5.5	6.1			
法国	5.1	2.9	集体投资计划		
墨西哥	4.4	1.5			
澳大利亚	3.2	3.3	卢森堡	14.2	21.2
英国	3.2	2.8			
波兰	1.4	-	衍生性产品		
爱尔兰	0.9	0.6			
印度	0.7	1.0	远期外汇合约	0.8	0.4
国际	0.7	0.6	期货	0.5	0.2
开曼群岛	0.7	0.5			
新西兰	0.6	0.5	总上市投资	96.0	95.4
匈牙利	0.6	0.1			
印度尼西亚	0.5	0.9	其他净资产	4.0	4.6
卢森堡	0.5	0.4			
荷兰	0.4	0.6			
香港	0.4	0.5	可赎回份额持有人应占净资产	100.0	100.0
葡萄牙	0.4	0.5			
哥伦比亚	0.4	0.3			
新加坡	0.4	0.3			
土耳其	0.3	0.3			
以色列	0.3	0.2			
西班牙	0.2	0.4			
维京群岛	0.2	0.4			
冰岛	0.2	0.2			
韩国	0.2	0.2			
泰国	0.2	0.2			
摩洛哥	0.1	0.1			
巴拉圭	-	0.4			

金融衍生工具详情

截至二零二二年三月三十一日(未经审计)

截至二零二二年三月三十一日，本基金持有之金融衍生工具汇总如下：

(a) 远期外汇合约

以下为截至二零二二年三月三十一日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／(亏损) 美元
截至二零二二年三月三十一日				
未平仓合约：				
美元 53,104	离岸人民币 338,540	2022 年 4 月 1 日	渣打银行，伦敦	225
美元 20,562	离岸人民币 131,069	2022 年 4 月 1 日	汇丰银行，伦敦	85
美元 1,114	离岸人民币 7,119	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	法国巴黎银行	7
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 1,097	澳元 1,467	2022 年 4 月 1 日	法国巴黎银行	5
美元 1,104	澳元 1,471	2022 年 4 月 1 日	加拿大皇家银行	1
欧元 63,461,073	美元 71,187,979	2022 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	572,178
欧元 80,907,565	美元 90,512,126	2022 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	482,881
欧元 21,068,992	美元 23,582,036	2022 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	137,684
英镑 22,070,026	美元 29,562,312	2022 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	504,585
匈牙利福林 1,794,044,000	美元 5,436,280	2022 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	2,932
日元 12,463,748,774	美元 107,947,321	2022 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	5,254,485
日元 1,468,463,265	美元 12,740,828	2022 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	641,687
波兰兹罗提 20,783,000	美元 4,990,960	2022 年 4 月 5 日	加拿大皇家银行	4,975
美元 108,035,528	日元 13,175,040,614	2022 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	517,871
美元 28,400,537	英镑 21,661,610	2022 年 4 月 5 日	巴克莱银行，伦敦	119,464
美元 50,628,241	加元 63,371,370	2022 年 4 月 5 日	加拿大皇家银行	107,170
美元 1,306,546	墨西哥比索 27,782,244	2022 年 4 月 5 日	美国道富银行	85,898
美元 12,713,046	波兰兹罗提 53,216,685	2022 年 4 月 5 日	汇丰银行，伦敦	54,002
美元 1,370,353	澳元 1,896,677	2022 年 4 月 5 日	加拿大皇家银行	54,002
美元 11,746,491	澳元 15,710,844	2022 年 4 月 5 日	汇丰银行，伦敦	51,945
美元 1,547,562	加元 1,985,215	2022 年 4 月 5 日	美林国际，伦敦	41,810
美元 2,615,597	欧元 2,382,558	2022 年 4 月 5 日	多伦多道明银行	35,575
美元 5,399,260	匈牙利福林 1,794,044,000	2022 年 4 月 5 日	汇丰银行，伦敦	34,088
美元 1,208,088	澳元 1,648,999	2022 年 4 月 5 日	美国道富银行	30,267
美元 2,079,139	欧元 1,891,386	2022 年 4 月 5 日	多伦多道明银行	25,485
美元 1,739,023	欧元 1,583,039	2022 年 4 月 5 日	渣打银行，伦敦	22,491
美元 2,017,094	欧元 1,828,203	2022 年 4 月 5 日	汇丰银行，伦敦	17,224

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 1,276,299	欧元 1,159,723	2022 年 4 月 5 日	汇丰银行, 伦敦	14,173
美元 535,979	英镑 408,416	2022 年 4 月 5 日	加拿大皇家银行	1,747
美元 219,790	欧元 198,709	2022 年 4 月 5 日	加拿大皇家银行	1,322
离岸人民币 487,005,555	美元 76,983,537	2022 年 4 月 6 日	多伦多道明银行	285,485
离岸人民币 50,929,581	美元 8,043,150	2022 年 4 月 6 日	汇丰银行, 伦敦	22,298
离岸人民币 50,000,000	美元 7,892,149	2022 年 4 月 6 日	法国巴黎银行	17,696
美元 101,128	澳元 134,695	2022 年 4 月 6 日	法国巴黎银行	25
美元 1,664	离岸人民币 10,612	2022 年 4 月 6 日	花旗银行, 伦敦	7
美元 35,479	加元 44,321	2022 年 4 月 6 日	美国道富银行	4
美元 31,142	纽元 44,778	2022 年 4 月 6 日	汇丰银行, 伦敦	1
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 1,103	离岸人民币 7,011	2022 年 4 月 7 日	美国道富银行	2
离岸人民币 13,770	美元 2,169	2022 年 4 月 7 日	汇丰银行, 伦敦	0
澳元 326,074	美元 245,047	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	127
澳元 15,645	美元 11,775	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	24
加元 111,515	美元 89,566	2022 年 4 月 21 日	法国巴黎银行	294
离岸人民币 4,660,934	美元 735,003	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	1,681
离岸人民币 4,348,134	美元 685,424	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	1,316
离岸人民币 3,905,575	美元 615,739	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	1,261
离岸人民币 2,170,929	美元 342,626	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1,066
离岸人民币 3,368,156	美元 530,891	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	966
离岸人民币 1,994,730	美元 314,523	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	685
离岸人民币 2,296,753	美元 361,997	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	640
离岸人民币 1,010,098	美元 159,541	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	619
离岸人民币 1,759,906	美元 277,377	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	485
离岸人民币 998,697	美元 157,459	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	330
离岸人民币 700,308	美元 110,413	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	231
离岸人民币 571,609	美元 90,107	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	173
离岸人民币 352,646	美元 55,610	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	127
离岸人民币 626,560	美元 98,702	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	123
离岸人民币 521,373	美元 82,138	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	108
离岸人民币 331,728	美元 52,292	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	100
离岸人民币 295,382	美元 46,569	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	95
离岸人民币 281,516	美元 44,385	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	93
离岸人民币 232,762	美元 36,705	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	84
离岸人民币 256,930	美元 40,497	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	74
离岸人民币 194,080	美元 30,598	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	63
离岸人民币 208,459	美元 32,856	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	58
离岸人民币 154,608	美元 24,378	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	53
离岸人民币 168,095	美元 26,495	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	48
离岸人民币 184,396	美元 29,048	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	36
离岸人民币 100,560	美元 15,856	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	35
离岸人民币 105,555	美元 16,635	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	27
离岸人民币 38,795	美元 6,128	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	24
离岸人民币 58,508	美元 9,226	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	21

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 92,675	美元 14,600	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	19	
离岸人民币 63,726	美元 10,044	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	18	
离岸人民币 67,647	美元 10,660	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	17	
离岸人民币 91,039	美元 14,338	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	15	
离岸人民币 34,945	美元 5,509	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	11	
离岸人民币 35,112	美元 5,535	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	11	
离岸人民币 32,369	美元 5,102	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	10	
离岸人民币 32,297	美元 5,091	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	9	
离岸人民币 19,222	美元 3,031	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	7	
离岸人民币 19,920	美元 3,137	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	3	
离岸人民币 14,009	美元 2,207	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	3	
离岸人民币 6,941	美元 1,095	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	3	
离岸人民币 6,941	美元 1,095	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	3	
离岸人民币 6,967	美元 1,098	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 6,961	美元 1,097	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	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	高盛国际, 伦敦	2	
离岸人民币 6,961	美元 1,097	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	2	
离岸人民币 6,961	美元 1,097	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	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 6,959	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 6,956	美元 1,096	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	1	
离岸人民币 6,956	美元 1,096	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	1	
离岸人民币 6,956	美元 1,096	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	1	
离岸人民币 6,946	美元 1,094	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1	
离岸人民币 6,946	美元 1,094	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	1	
纽元 130,834	美元 91,025	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	48	
纽元 1,589	美元 1,110	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	6	
美元 58,858,303	澳元 79,472,307	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	834,698	
美元 38,029,195	加元 48,359,936	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	684,925	
美元 21,124,709	纽元 30,686,099	2022 年 4 月 21 日	多伦多道明银行	213,176	
美元 358,575	澳元 492,051	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	11,013	
美元 403,685	澳元 546,226	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	6,595	
美元 185,440	纽元 274,146	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	5,190	
美元 278,265	澳元 375,519	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	3,794	
美元 206,557	加元 262,638	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	3,695	
美元 98,898	澳元 136,064	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	3,302	
美元 157,214	加元 200,290	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	3,126	
美元 231,819	加元 293,418	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	3,075	
美元 115,775	纽元 170,916	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	3,073	
美元 102,766	加元 131,351	2022 年 4 月 21 日	渣打银行, 伦敦	2,386	
美元 48,690	纽元 72,222	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	1,530	

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 314,010	离岸人民币 2,005,288	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	1,490	
美元 274,084	离岸人民币 1,751,520	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	1,489	
美元 45,142	加元 57,808	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	1,136	
美元 99,620	纽元 144,872	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	1,118	
美元 507,556	离岸人民币 3,231,677	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	896	
美元 156,069	离岸人民币 997,342	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	847	
美元 129,266	离岸人民币 826,993	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	847	
美元 28,483	加元 36,000	2022 年 4 月 21 日	法国巴黎银行	337	
美元 12,964	澳元 17,678	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	314	
美元 73,720	加元 92,447	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	288	
美元 28,770	离岸人民币 184,339	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	233	
美元 4,654	澳元 6,465	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	202	
美元 32,967	纽元 47,645	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	164	
美元 20,315	离岸人民币 129,823	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	110	
美元 4,197	澳元 5,731	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	108	
美元 15,288	离岸人民币 97,847	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	107	
美元 13,269	离岸人民币 84,797	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	72	
美元 2,832	纽元 4,157	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	58	
美元 1,743	加元 2,242	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	52	
美元 1,125	澳元 1,549	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	39	
美元 47,283	澳元 63,000	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	37	
美元 1,308	澳元 1,784	2022 年 4 月 21 日	渣打银行, 伦敦	32	
美元 40,808	纽元 58,726	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	27	
美元 1,275	澳元 1,718	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	16	
美元 2,678	离岸人民币 17,114	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	15	
美元 3,038	离岸人民币 19,401	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	14	
美元 2,209	离岸人民币 14,118	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	13	
美元 1,885	离岸人民币 12,051	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	11	
美元 1,533	离岸人民币 9,810	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	11	
美元 1,564	离岸人民币 10,000	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	9	
美元 1,215	离岸人民币 7,782	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	9	
美元 2,132	离岸人民币 13,599	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	8	
美元 1,178	离岸人民币 7,534	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	8	
美元 1,662	离岸人民币 10,607	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	7	
美元 1,097	离岸人民币 7,021	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	7	
美元 1,175	离岸人民币 7,505	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	6	
美元 1,143	离岸人民币 7,307	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	6	
美元 1,307	离岸人民币 8,345	2022 年 4 月 21 日	渣打银行, 伦敦	5	
美元 1,237	离岸人民币 7,894	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	5	
美元 971	纽元 1,403	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	5	
美元 1,570	纽元 2,262	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	3	
美元 1,100	离岸人民币 7,007	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	3	
美元 1,270	离岸人民币 8,089	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	2	
美元 1,115	离岸人民币 7,099	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	2	
美元 1,130	离岸人民币 7,190	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	1	

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益／(亏损)
				美元
欧元 172,659,539	美元 192,492,594	2022 年 5 月 4 日	法国巴黎银行	194,933
墨西哥比索 593,282,779	美元 29,622,953	2022 年 5 月 4 日	法国巴黎银行	39,227
美元 1,238,500	波兰兹罗提 5,342,731	2022 年 5 月 4 日	汇丰银行, 伦敦	39,606
美元 1,661,559	欧元 1,511,418	2022 年 5 月 4 日	美林国际, 伦敦	21,767
美元 13,690,287	欧元 12,306,546	2022 年 5 月 4 日	汇丰银行, 伦敦	15,994
美元 954,939	欧元 865,542	2022 年 5 月 4 日	美国道富银行	9,048
美元 31,242,264	日元 3,803,762,187	2022 年 5 月 6 日	美国道富银行	118,689
美元 1,367,777	日元 168,828,129	2022 年 5 月 6 日	加拿大皇家银行	24,164
美元 146,787	澳元 196,025	2022 年 5 月 20 日	美国道富银行	527
美元 95,974	加元 120,274	2022 年 5 月 20 日	加拿大皇家银行	304
美元 52,907	纽元 76,388	2022 年 5 月 20 日	加拿大皇家银行	183
美元 360,081	离岸人民币 2,292,717	2022 年 5 月 20 日	花旗银行, 伦敦	6
美元 26,262	离岸人民币 167,217	2022 年 5 月 20 日	花旗银行, 伦敦	0
美元 3,397	离岸人民币 21,627	2022 年 5 月 20 日	花旗银行, 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
离岸人民币 6,992	美元 1,098	2022 年 5 月 20 日	美林国际, 伦敦	0
离岸人民币 6,992	美元 1,098	2022 年 5 月 20 日	美林国际, 伦敦	0
离岸人民币 6,992	美元 1,098	2022 年 5 月 20 日	美林国际, 伦敦	0
纽元 44,778	美元 31,123	2022 年 5 月 20 日	汇丰银行, 伦敦	3
未实现总收益				11,407,273
澳元 63,000	美元 47,274	2022 年 4 月 1 日	加拿大皇家银行	(36)
离岸人民币 7,894	美元 1,238	2022 年 4 月 1 日	汇丰银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 8,345	美元 1,309	2022 年 4 月 1 日	渣打银行, 伦敦	(6)
离岸人民币 10,000	美元 1,566	2022 年 4 月 1 日	美国道富银行	(9)
离岸人民币 12,051	美元 1,887	2022 年 4 月 1 日	美国道富银行	(11)
离岸人民币 14,118	美元 2,211	2022 年 4 月 1 日	美国道富银行	(13)
纽元 1,403	美元 971	2022 年 4 月 1 日	美林国际, 伦敦	(5)
美元 11,773	澳元 15,645	2022 年 4 月 4 日	美国道富银行	(24)
美元 89,572	加元 111,515	2022 年 4 月 4 日	法国巴黎银行	(293)
澳元 19,256,520	美元 13,863,770	2022 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	(597,376)
加元 65,356,585	美元 51,300,302	2022 年 4 月 5 日	加拿大皇家银行	(1,024,482)
欧元 3,401,533	美元 3,775,978	2022 年 4 月 5 日	汇丰银行, 伦敦	(9,050)
欧元 11,465,002	美元 12,737,814	2022 年 4 月 5 日	渣打银行, 伦敦	(19,775)
欧元 1,398,991	美元 1,525,609	2022 年 4 月 5 日	高盛国际, 伦敦	(31,108)
墨西哥比索 263,663,616	美元 12,933,672	2022 年 4 月 5 日	高盛国际, 伦敦	(281,121)
墨西哥比索 357,401,407	美元 17,452,280	2022 年 4 月 5 日	高盛国际, 伦敦	(460,641)
波兰兹罗提 20,957,500	美元 5,005,430	2022 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	(22,418)
波兰兹罗提 11,476,185	美元 2,698,863	2022 年 4 月 5 日	花旗银行, 伦敦	(54,353)
美元 29,772,928	墨西哥比索 593,282,779	2022 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	(37,658)
美元 1,105,928	日元 128,261,430	2022 年 4 月 5 日	加拿大皇家银行	(49,141)
美元 2,945,613	日元 347,694,470	2022 年 4 月 5 日	美国道富银行	(80,846)
美元 2,442,286	日元 281,215,525	2022 年 4 月 5 日	加拿大皇家银行	(125,261)

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 192,325,287	欧元 172,659,539	2022 年 4 月 5 日	法国巴黎银行	(199,767)
离岸人民币 826,993	美元 129,386	2022 年 4 月 6 日	美国道富银行	(856)
纽元 47,645	美元 32,975	2022 年 4 月 6 日	美林国际, 伦敦	(163)
美元 1,111	纽元 1,589	2022 年 4 月 6 日	汇丰银行, 伦敦	(6)
美元 16,106,179	离岸人民币 102,118,327	2022 年 4 月 6 日	汇丰银行, 伦敦	(23,658)
离岸人民币 10,607	美元 1,663	2022 年 4 月 7 日	花旗银行, 伦敦	(7)
离岸人民币 7,190	美元 1,131	2022 年 4 月 8 日	美国道富银行	(2)
离岸人民币 7,099	美元 1,116	2022 年 4 月 8 日	美国道富银行	(2)
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 1,467	美元 1,101	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(0)
澳元 1,471	美元 1,104	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(1)
澳元 1,471	美元 1,104	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(1)
澳元 1,467	美元 1,097	2022 年 4 月 21 日	法国巴黎银行	(5)
澳元 1,486	美元 1,103	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	(14)
澳元 1,489	美元 1,102	2022 年 4 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(16)
澳元 15,447	美元 11,584	2022 年 4 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(18)
澳元 1,517	美元 1,121	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(18)
澳元 1,503	美元 1,104	2022 年 4 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(25)
澳元 1,497	美元 1,098	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(27)
澳元 1,501	美元 1,091	2022 年 4 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(36)
澳元 1,516	美元 1,101	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(37)
澳元 2,277	美元 1,653	2022 年 4 月 21 日	法国巴黎银行	(57)
澳元 3,109	美元 2,277	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(59)
澳元 193,618	美元 145,312	2022 年 4 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(118)
澳元 13,559	美元 10,021	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	(163)
澳元 11,254	美元 8,243	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(210)
澳元 20,483	美元 15,167	2022 年 4 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(218)
澳元 89,300	美元 66,785	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(290)
澳元 34,957	美元 25,597	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(660)
澳元 328,298	美元 245,604	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	(986)
澳元 72,217	美元 53,066	2022 年 4 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(1,178)
澳元 71,792	美元 52,156	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(1,768)
澳元 128,273	美元 94,468	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(1,880)
澳元 93,366	美元 67,803	2022 年 4 月 21 日	法国巴黎银行	(2,326)
澳元 151,552	美元 111,371	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(2,462)
澳元 137,814	美元 100,842	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(2,673)
澳元 398,164	美元 296,251	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(2,817)
澳元 114,867	美元 82,683	2022 年 4 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(3,595)
澳元 283,888	美元 209,015	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(4,218)
澳元 173,717	美元 126,071	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(4,410)
澳元 260,846	美元 190,971	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(4,955)
澳元 201,699	美元 146,370	2022 年 4 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(5,130)
澳元 212,953	美元 154,482	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(5,470)
澳元 405,341	美元 296,907	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(7,552)

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 388,331	美元 283,380	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(8,303)
澳元 331,444	美元 238,456	2022 年 4 月 21 日	多伦多道明银行	(10,498)
澳元 1,508,073	美元 1,090,700	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(42,039)
加元 1,390	美元 1,101	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	(12)
加元 1,395	美元 1,101	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(16)
加元 1,980	美元 1,567	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(18)
加元 1,426	美元 1,123	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(19)
加元 1,409	美元 1,106	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(22)
加元 195,940	美元 156,812	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(46)
加元 18,651	美元 14,725	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	(206)
加元 419,359	美元 335,169	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	(545)
加元 32,688	美元 25,527	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(641)
加元 122,712	美元 97,559	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(677)
加元 202,372	美元 160,783	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	(1,224)
加元 127,257	美元 100,467	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	(1,408)
加元 174,774	美元 137,848	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(2,066)
加元 205,703	美元 162,269	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	(2,405)
加元 157,712	美元 123,501	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	(2,754)
加元 171,930	美元 134,659	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(2,978)
加元 199,480	美元 155,844	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(3,848)
加元 209,493	美元 163,209	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(4,498)
加元 240,774	美元 187,890	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(4,859)
加元 737,340	美元 580,832	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(9,439)
离岸人民币 7,011	美元 1,102	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(1)
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 29,500	美元 4,639	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(2)
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 7,006	美元 1,100	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(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 7,006	美元 1,100	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(3)
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 7,030	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	汇丰银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 7,026	美元 1,101	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 7,026	美元 1,101	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 7,026	美元 1,101	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 7,003	美元 1,097	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(5)
离岸人民币 7,003	美元 1,097	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 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 7,027	美元 1,100	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(6)
离岸人民币 7,027	美元 1,100	2022 年 4 月 21 日	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 10,612	美元 1,663	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(7)
离岸人民币 9,222	美元 1,444	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(7)

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
离岸人民币 7,828	美元 1,225	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行		(7)
离岸人民币 7,119	美元 1,113	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	法国巴黎银行		(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 13,557	美元 2,125	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦		(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	汇丰银行, 伦敦		(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 7,029	美元 1,097	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦		(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 151,926	美元 23,892	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦		(11)
离岸人民币 53,159	美元 8,349	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行		(15)
离岸人民币 230,835	美元 36,301	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦		(17)
离岸人民币 98,645	美元 15,502	2022 年 4 月 21 日	法国巴黎银行		(19)
离岸人民币 25,220	美元 3,942	2022 年 4 月 21 日	法国巴黎银行		(26)
离岸人民币 25,090	美元 3,920	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行		(27)
离岸人民币 31,744	美元 4,962	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦		(32)
离岸人民币 28,486	美元 4,447	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行		(34)
离岸人民币 54,116	美元 8,474	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行		(40)
离岸人民币 42,202	美元 6,597	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦		(42)
离岸人民币 118,377	美元 18,577	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行		(47)
离岸人民币 37,015	美元 5,774	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦		(49)
离岸人民币 79,173	美元 12,398	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦		(59)
离岸人民币 60,796	美元 9,503	2022 年 4 月 21 日	法国巴黎银行		(62)
离岸人民币 131,069	美元 20,538	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦		(83)
离岸人民币 210,324	美元 33,007	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行		(84)
离岸人民币 154,725	美元 24,255	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦		(88)
离岸人民币 99,007	美元 15,458	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行		(119)
离岸人民币 637,435	美元 100,110	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行		(180)
离岸人民币 317,037	美元 49,700	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦		(181)
离岸人民币 194,080	美元 30,337	2022 年 4 月 21 日	法国巴黎银行		(198)
离岸人民币 196,403	美元 30,702	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦		(199)
离岸人民币 338,540	美元 53,041	2022 年 4 月 21 日	渣打银行, 伦敦		(223)
离岸人民币 3,098,798	美元 487,318	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦		(227)
离岸人民币 399,867	美元 62,685	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦		(228)
离岸人民币 337,523	美元 52,865	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行		(239)
离岸人民币 185,396	美元 28,921	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦		(248)
离岸人民币 275,470	美元 43,064	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦		(276)
离岸人民币 404,987	美元 63,431	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行		(287)
离岸人民币 300,341	美元 46,950	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦		(304)
离岸人民币 367,765	美元 57,550	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行		(312)
离岸人民币 271,606	美元 42,392	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦		(341)
离岸人民币 284,136	美元 44,324	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦		(380)
离岸人民币 392,036	美元 61,281	2022 年 4 月 21 日	法国巴黎银行		(399)
离岸人民币 980,716	美元 153,570	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦		(729)

交付合约	折算额	交割日期	交易对手	未实现收益/(亏损)
				美元
离岸人民币 1,053,943	美元 164,874	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(946)
离岸人民币 1,397,650	美元 218,908	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(989)
离岸人民币 897,586	美元 140,095	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(1,125)
离岸人民币 1,723,520	美元 269,283	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(1,885)
离岸人民币 2,783,433	美元 435,428	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(2,500)
离岸人民币 2,178,196	美元 339,973	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(2,731)
离岸人民币 12,440,222	美元 1,953,757	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(3,510)
离岸人民币 3,717,366	美元 581,137	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	(3,730)
离岸人民币 3,807,378	美元 595,178	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	(3,851)
离岸人民币 6,215,714	美元 973,373	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(4,568)
离岸人民币 3,862,185	美元 602,491	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	(5,161)
纽元 171,771	美元 116,197	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	(3,245)
纽元 526,296	美元 363,087	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	(2,878)
纽元 128,558	美元 86,892	2022 年 4 月 21 日	多伦多道明银行	(2,502)
纽元 96,246	美元 64,894	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	(2,031)
纽元 154,273	美元 105,585	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(1,690)
纽元 120,051	美元 82,012	2022 年 4 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(1,467)
纽元 93,525	美元 63,818	2022 年 4 月 21 日	巴克莱银行, 伦敦	(1,216)
纽元 101,325	美元 69,312	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(1,145)
纽元 111,360	美元 76,384	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(1,051)
纽元 129,438	美元 89,269	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	(737)
纽元 124,068	美元 85,869	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	(403)
纽元 18,882	美元 12,775	2022 年 4 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(356)
纽元 36,522	美元 25,179	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	(217)
纽元 24,449	美元 16,845	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	(156)
纽元 5,189	美元 3,547	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(61)
纽元 3,352	美元 2,281	2022 年 4 月 21 日	渣打银行, 伦敦	(50)
纽元 1,630	美元 1,106	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	(28)
纽元 1,594	美元 1,100	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	(9)
纽元 1,595	美元 1,104	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	(5)
美元 1,117	离岸人民币 7,092	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(1)
美元 1,552	离岸人民币 9,852	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(2)
美元 1,324	离岸人民币 8,399	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(2)
美元 1,298	离岸人民币 8,233	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(2)
美元 1,260	离岸人民币 7,997	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(2)
美元 1,251	离岸人民币 7,939	2022 年 4 月 21 日	加拿大皇家银行	(2)
美元 1,126	离岸人民币 7,148	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(2)
美元 1,800	离岸人民币 11,423	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(3)
美元 1,685	离岸人民币 10,694	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(3)
美元 1,591	离岸人民币 10,093	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(3)
美元 1,530	离岸人民币 9,706	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	(3)
美元 1,481	离岸人民币 9,397	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(3)
美元 2,201	离岸人民币 13,964	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	(4)
美元 1,357	离岸人民币 8,601	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(4)
美元 1,273	离岸人民币 8,067	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(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	
美元 1,555	离岸人民币 9,852	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(5)	
美元 113,615	澳元 151,253	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(6)	
美元 6,610	离岸人民币 41,941	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(11)	
美元 3,641	离岸人民币 23,069	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(12)	
美元 16,617	离岸人民币 105,501	2022 年 4 月 21 日	美国道富银行	(18)	
美元 8,719	离岸人民币 55,299	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(19)	
美元 30,379	离岸人民币 192,886	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	(31)	
美元 26,043	离岸人民币 165,301	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(36)	
美元 31,806	离岸人民币 201,813	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(54)	
美元 33,452	离岸人民币 212,271	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(55)	
美元 34,410	离岸人民币 218,351	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(56)	
美元 17,184	离岸人民币 108,866	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(56)	
美元 16,617	离岸人民币 105,199	2022 年 4 月 21 日	美林国际, 伦敦	(65)	
美元 53,174	离岸人民币 337,414	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(87)	
美元 43,082	离岸人民币 273,241	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(92)	
美元 45,282	离岸人民币 287,193	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(97)	
美元 395,301	离岸人民币 2,509,928	2022 年 4 月 21 日	汇丰银行, 伦敦	(405)	
美元 536,706	离岸人民币 3,405,434	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(916)	
美元 691,587	离岸人民币 4,388,480	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(1,131)	
美元 568,678	离岸人民币 3,606,735	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(1,217)	
美元 623,328	离岸人民币 3,953,485	2022 年 4 月 21 日	花旗银行, 伦敦	(1,312)	
美元 1,391,519	离岸人民币 8,825,217	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(3,015)	
美元 7,235,622	离岸人民币 45,889,367	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(15,677)	
美元 11,184,775	离岸人民币 70,935,466	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(24,233)	
美元 146,075,433	离岸人民币 926,431,579	2022 年 4 月 21 日	高盛国际, 伦敦	(316,493)	
匈牙利福林 1,794,044,000	美元 5,377,201	2022 年 5 月 4 日	汇丰银行, 伦敦	(33,854)	
澳元 15,710,844	美元 11,750,576	2022 年 5 月 4 日	汇丰银行, 伦敦	(52,180)	
波兰兹罗提 53,216,685	美元 12,677,594	2022 年 5 月 4 日	汇丰银行, 伦敦	(53,080)	
加元 63,371,370	美元 50,620,275	2022 年 5 月 4 日	加拿大皇家银行	(107,745)	
英镑 21,661,610	美元 28,395,414	2022 年 5 月 4 日	巴克莱银行, 伦敦	(119,821)	
离岸人民币 7,809,741	美元 1,226,045	2022 年 5 月 5 日	汇丰银行, 伦敦	(1,576)	
离岸人民币 485,816,809	美元 76,332,642	2022 年 5 月 5 日	高盛国际, 伦敦	(33,417)	
日元 13,175,040,614	美元 108,099,261	2022 年 5 月 6 日	法国巴黎银行	(525,257)	
澳元 1,462	美元 1,098	2022 年 5 月 20 日	美国道富银行	(0)	
澳元 134,695	美元 101,195	2022 年 5 月 20 日	法国巴黎银行	(30)	
加元 1,369	美元 1,096	2022 年 5 月 20 日	美国道富银行	(0)	
加元 44,321	美元 35,474	2022 年 5 月 20 日	美国道富银行	(4)	
美元 2,163	离岸人民币 13,770	2022 年 5 月 20 日	汇丰银行, 伦敦	(0)	
未实现总亏损				(4,518,331)	
未实现净收益				6,888,942	

(b) 期货

以下为截至二零二二年三月三十一日之未平仓期货合约：

	标的资产	交易对手	未实现收益／ (亏损) 美元
<u>截至二零二二年三月三十一日</u>			
Aust10YBondFuture15/06/2022	澳大利亚 10 年期债券	花旗集团全球市场公司伦敦分行	1,037,440
Euro-BOBLFuture08/06/2022	由德意志联邦共和国、意大利共和国、法兰西共和国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 5 年期债务工具	花旗集团全球市场公司伦敦分行	811,311
Euro-BTPFuture08/06/2022	由德意志联邦共和国、意大利共和国、法兰西共和国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 10 年期债务工具	花旗集团全球市场公司伦敦分行	543,162
Euro-BundFuture08/06/2022	由德意志联邦共和国、意大利共和国、法兰西共和国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 10 年期债务工具	花旗集团全球市场公司伦敦分行	35,816
LongGiltFuture28/06/2022	10 年期英国国债	花旗集团全球市场公司伦敦分行	270,835
US2YrNote(CBT)30/06/2022	2 年期美国国债	花旗集团全球市场公司伦敦分行	556,398
US5YrNote(CBT)30/06/2022	5 年期美国国债	花旗集团全球市场公司伦敦分行	1,572,063
		未实现总收益	4,827,025

Euro-BUXL30YBond08/06/2022	由德意志联邦共和国、意大利共和国、法兰西共和国、西班牙王国或瑞士联邦发行的 30 年期债务工具	花旗集团全球市场公司伦敦分行	(906,765)
JPN10YBond(OSE)13/06/2022	10 年期日本政府债券	花旗集团全球市场公司伦敦分行	(31,143)
USUltraBondCBT21/06/2022	30 年期美国国债	花旗集团全球市场公司伦敦分行	(111,782)
		未实现总亏损	(1,049,690)
		未实现净收益	3,777,335
			=====

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	57,254,435	25,540,063
应收经纪款项	-	29,944,500
分配应收款项	1,477,157	5,646,183
保证金	1,534,870	2,645,936
衍生性产品	16,234,298	14,618,790
投资	782,477,244	1,060,494,015
利息及其他应收款项	57,483	6,352,206
总资产	859,035,487	1,145,241,693

负债

透支经纪款项	3,357,947	1,924,175
应付经纪款项	18,646,886	-
赎回应付款项	1,883,310	12,606,932
应付收益分配[附注 6]	2,584,675	3,548,275
衍生性产品	5,568,021	7,383,741
其他应付款项	352,368	915,220

总负债(不含可赎回份额持有人

应占净资产)	32,393,207	26,378,343
--------	------------	------------

可赎回份额持有人应占净资产

[附注 3]	826,642,280	1,118,863,350
--------	-------------	---------------

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	二零二一年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元
收入		
投资及衍生性产品净(亏损)/		
收益[附注 4]	(21,319,903)	23,206,498
存款利息	4,434	6,746
汇兑净(亏损)/收益	(534,232)	1,449,542
其他收益	67	128
	(21,849,634)	24,662,914
支出		
管理费用[附注 5(a)]	3,899,025	6,480,946
托管费用及银行费用		
[附注 5(a)]	146,676	182,229
受托人费用[附注 5(b)]	87,668	145,389
交易成本[附注 5(a)]	50,239	39,050
基金注册登记机构费用		
[附注 5(a)]	36,645	69,912
核数师酬金	28,753	13,213
法律及专业费用	3,014	30,492
印刷及出版支出	1,022	15,016
其他经营费用	8,064	3,493
	4,261,106	6,979,740

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)

	二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元
净经营(亏损)/利润	(26,110,740)	17,683,174
财务成本		
收益分配[附注 6]	(16,201,154)	(29,552,018)
利息费用	-	(17)
	(16,201,154)	(29,552,035)
除税前亏损	(42,311,894)	(11,868,861)
税项	(49,039)	(11,764)
可赎回份额持有人应占净资产 及总综合收益之减少	(42,360,933)	(11,880,625)

可赎回份额持有人应占净资产变动表

截至二零二二年三月三十一日止期间(未经审计)

	二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元
期初可赎回份额持有人应占净资产	1,118,863,350	1,547,093,393
分配可赎回份额[附注 3]	124,720,048	642,030,234
赎回可赎回份额[附注 3]	(374,580,185)	(715,594,691)
净赎回	(249,860,137)	(73,564,457)
	869,003,213	1,473,528,936
可赎回份额持有人应占净资产 及总综合收益之减少	(42,360,933)	(11,880,625)
期末可赎回份额持有人应占净资产	826,642,280	1,461,648,311

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增加	31,412,253	24,931,180
购入投资及衍生性产品	(454,296,154)	(992,783,158)	期初现金及现金等价物	25,540,063	28,639,507
出售投资及衍生性产品所得款项	756,261,180	1,115,741,686	现金及现金等价物之汇兑收益	302,119	185,099
已收股息	5,979,339	-			
透支经纪款项之增加	1,433,772	2,642,469	期末现金及现金等价物	57,254,435	53,755,786
保证金之减少／(增加)	1,111,066	(5,072,046)			
已收利息	4,447	11,326			
已付税项	(49,039)	(11,764)	现金及现金等价物余额分析：		
已付交易成本	(51,013)	(40,588)			
已付基金注册登记机构费用	(79,963)	(136,042)	银行现金	57,254,435	53,755,786
已付受托人费用	(91,729)	(143,251)			
已付管理费用	(4,075,296)	(6,388,874)			
其他	(1,154,870)	809,980			
经营业务所产生之现金净额	304,991,740	114,629,738			
	-----	-----			
融资活动					
已付利息	-	(17)			
分配可赎回份额所得款项	128,889,074	662,081,561			
赎回可赎回份额付款	(385,303,807)	(721,724,461)			
已付收益分配	(17,164,754)	(30,055,641)			
融资活动所运用之现金净额	(273,579,487)	(89,698,558)			
	-----	-----			

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。

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。

(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	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	10,589,900.120	6,601,970.711	184,986,181.051	3,479,860.601	815,348.308
总分配	513,829.560	563,757.505	14,023,913.913	251,690.873	25,965.402
总赎回	(2,952,283.619)	(2,182,178.421)	(53,569,765.153)	(547,793.834)	(209,814.058)
期末	8,151,446.061	4,983,549.795	145,440,329.811	3,183,757.640	631,499.652

	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	108,144,383.054	44,880,967.357	745,451.394	8,246,314.840	8,690,294.310
总分配	21,820,940.566	4,890,643.313	221,455.409	1,480,488.650	196,430.920
总赎回	(33,095,033.462)	(17,310,000.149)	(484,563.835)	(2,311,850.610)	(595,988.690)
期末	96,870,290.158	32,461,610.521	482,342.968	7,414,952.880	8,290,736.540

	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	5,298,889.960	9,545,469.220	3,129,173.160	3,009,914.170
总分配	164,816.180	229,923.920	38,397.270	77,938.320
总赎回	(1,855,663.040)	(2,932,753.570)	(907,481.660)	(798,317.640)
期末	3,608,043.100	6,842,639.570	2,260,088.770	2,289,534.850

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	13,356,546.445	9,581,512.706	257,812,302.021	3,803,107.801	993,896.934

	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	119,153,751.186	60,222,838.086	645,438.762	10,124,824.480	10,215,696.640

	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	8,334,814.320	11,807,638.620	3,965,086.940	3,866,260.850

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	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	75,441,380	46,215,480	1,365,525,352	29,496,983	8,486,512
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.25	9.27	9.39	9.26	13.44
	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	884,762,188	301,690,723	10,125,552	73,983,783	74,405,990
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.13	9.29	20.99	9.98	8.97
	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	40,236,321	64,888,477	23,868,421	21,775,636	
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	11.15	9.48	10.56	9.51	

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	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	103,503,535	64,649,781	1,822,410,378	34,047,082	11,241,640
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.77	9.79	9.85	9.78	13.79
	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	1,043,345,225	440,323,336	16,518,894	86,921,823	83,732,936
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	9.65	9.81	22.16	10.54	9.64
	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	60,642,379	95,607,461	34,354,133	30,226,878	
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	11.44	10.02	10.98	10.04	

4 投资及衍生性产品净(亏损)/收益

	二零二一年 十月一日至 二零二二年 三月三十一日 美元	二零二零年 十月一日至 二零二一年 三月三十一日 美元
投资及衍生性产品价值未实现收益/亏损之变动	(51,497,359)	(21,378,904)
投资及衍生性产品销售之实现收益	30,177,456	44,585,402
	<u>(21,319,903)</u>	<u>23,206,498</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	3,899,025	6,480,946
托管费用及银行费用	115,352	146,030
基金注册登记机构费用	36,645	69,912
交易成本	9,064	2,530
	<u>3,960,086</u>	<u>6,700,418</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，东亚银行(信托)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	87,668	145,389
	<u>87,668</u>	<u>145,389</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
澳元对冲类别(每月派息)	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	澳元 0.0236	9,988,641.378	(177,966)	
加元对冲类别(每月派息)	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	加元 0.0253	6,263,523.647	(128,475)	
港元类别(每月派息)	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	港元 0.0251	178,989,157.630	(577,659)	
纽元对冲类别(每月派息)	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	纽元 0.0272	3,495,178.233	(68,568)	
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 0.0500	107,225,595.676	(839,149)	
美元类别(每月派息)	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	美元 0.0250	43,752,607.919	(1,093,815)	
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 0.0243	8,734,749.010	(33,222)	
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 0.0519	8,743,501.200	(71,027)	
PRC 美元份额(每月派息)	2021 年 10 月 29 日	2021 年 11 月 8 日	美元 0.0256	2,954,119.550	(75,625)	
澳元对冲类别(每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	澳元 0.0237	9,652,133.061	(162,782)	
加元对冲类别(每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	加元 0.0252	6,322,358.613	(124,544)	
港元类别(每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	港元 0.0251	173,361,866.500	(557,898)	
纽元对冲类别(每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	纽元 0.0289	3,423,509.860	(67,215)	
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 0.0458	102,522,145.321	(734,638)	
美元类别(每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	美元 0.0250	41,190,542.280	(1,029,764)	
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 0.0243	8,618,006.750	(32,765)	
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 0.0476	8,336,279.640	(62,083)	
PRC 美元份额(每月派息)	2021 年 11 月 30 日	2021 年 12 月 8 日	美元 0.0256	2,808,055.020	(71,886)	
澳元对冲类别(每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	澳元 0.0216	9,638,012.084	(151,004)	
加元对冲类别(每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	加元 0.0227	6,122,855.925	(108,691)	
港元类别(每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	港元 0.0252	167,942,032.078	(542,554)	
纽元对冲类别(每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	纽元 0.0287	3,345,359.890	(65,648)	
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 0.0465	101,688,055.236	(741,649)	
美元类别(每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	美元 0.0250	38,575,684.576	(964,392)	
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 0.0243	8,534,140.710	(32,527)	
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 0.0483	8,042,992.580	(60,931)	
PRC 美元份额(每月派息)	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 10 日	美元 0.0256	2,600,760.080	(66,579)	
澳元对冲类别(每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	澳元 0.0240	8,713,596.158	(146,273)	
加元对冲类别(每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	加元 0.0251	5,406,090.855	(106,238)	
港元类别(每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	港元 0.0251	156,054,494.112	(502,585)	
纽元对冲类别(每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	纽元 0.0289	3,267,497.471	(61,918)	
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 0.0418	98,461,449.507	(646,536)	
美元类别(每月派息)	2022 年 1 月 31 日	2022 年 2 月 11 日	美元 0.0250	35,208,544.752	(880,214)	
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 0.0241	8,395,053.750	(31,763)	
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 0.0434	7,420,993.950	(50,562)	
PRC 美元份额(每月派息)	2022 年 1 月 28 日	2022 年 2 月 11 日	美元 0.0256	2,485,273.690	(63,623)	
澳元对冲类别(每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	澳元 0.0239	8,419,839.946	(145,422)	
加元对冲类别(每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	加元 0.0255	5,112,169.626	(102,328)	
港元类别(每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	港元 0.0251	149,501,901.537	(480,538)	
纽元对冲类别(每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	纽元 0.0294	3,242,494.407	(64,238)	

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
					二零二一年	二零二一年
					三月三十一日	三月三十一日
					美元	美元
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 0.0439	99,092,160.926	(688,903)	
美元类别(每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	美元 0.0250	34,244,571.886	(856,114)	
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 0.0241	8,334,679.310	(31,833)	
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 0.0455	7,307,924.140	(52,696)	
PRC 美元份额(每月派息)	2022 年 2 月 28 日	2022 年 3 月 8 日	美元 0.0256	2,407,779.500	(61,639)	
澳元对冲类别(每月派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	澳元 0.0215	8,166,179.708	(131,846)	
加元对冲类别(每月派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	加元 0.0246	4,988,470.765	(98,248)	
港元类别(每月派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	港元 0.0252	145,534,041.287	(468,302)	
纽元对冲类别(每月派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	纽元 0.0290	3,188,683.507	(64,319)	
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 0.0464	96,871,283.464	(708,059)	
美元类别(每月派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	美元 0.0250	32,485,734.424	(812,143)	
美元类别(每半年派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	美元 0.3308	482,348.806	(159,561)	
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 0.0242	8,290,734.310	(31,605)	
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 0.0482	6,842,637.460	(51,955)	
PRC 美元份额(每月派息)	2022 年 3 月 31 日	2022 年 4 月 11 日	美元 0.0256	2,290,496.190	(58,637)	
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		(351,860)
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)

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
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)
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)
可赎回份额持有人之总收益分配					(16,201,154)	(29,552,018)

