

年度报告 - 2016年9月30日 (经审核)

# 摩根亚洲总收益 债券基金



内地香港互认基金系列

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，本经审核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 - 未经审计	1 - 7
投资组合持有变动表 - 未经审计	7
财务状况报表	8
综合收益表	8
可赎回份额持有人应占净资产变动表	9
现金流量表	9
财务报表之附注	10 - 43
独立核数师报告	44
管理人及受托人的责任声明	45
受托人对份额持有人的报告	45
业绩纪录 - 未经审计	45 - 46
经营与管理	46

投资组合

截至二零一六年九月三十日 (未经审计)

(续)

单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比
<b>上市投资 (95.7%)</b>			<b>台湾 (0.2%)</b>		
<b>(I) 可换股 (7.9%)</b>			Siliconware Prec Ind CB0%10/19-RegS	美元 8,250,000	8,716,125 0.2
<b>中国 (2.1%)</b>					310,970,055 7.9
Asia View EB (Yuexiu) 1.5%\$/19-RegS	美元 11,000,000	11,453,292	0.3		
CRR Group CB 0% 05/02/21- RegS	美元 20,000,000	20,874,000	0.6		
Franshion Cap EB(FPC)6.8% Perp-RegS	美元 1,000,000	1,129,672	0.0		
Kunlun Energy CB 1.625% 07/19-RegS	人民币 135,000,000	20,798,650	0.5		
Semiconductor Mfg CB 0% 7/7/22-RegS	美元 25,000,000	28,262,500	0.7		
<b>香港 (1.8%)</b>			<b>(II) 债务证券 (85.9%)</b>		
ASM Pacific Tech CB 2% 03/19-RegS	港元 32,000,000	4,196,692	0.1		
Baosteel Hong Kong CB 0% 12/18-RegS	美元 30,300,000	30,375,750	0.8		
China Overseas Fin CB 0%5/1/23-RegS	美元 17,400,000	18,038,580	0.5		
Shine Power EB(BJ Enter)0%7/19-RegS	港元 134,000,000	17,221,772	0.4		
<b>日本 (2.3%)</b>			<b>澳大利亚 (2.7%)</b>		
Nagoya Railroad CB 0% 11/12/24-RegS	日元 1,300,000,000	14,498,405	0.4		
SBI Hldgs CB 0% 02/11/17- RegS	日元 740,000,000	7,566,028	0.2		
Suzuki Motor CB 0% 31/03/21-RegS	日元 1,690,000,000	18,389,483	0.5		
Takashimaya Co CB 0% 11/12/20	日元 1,600,000,000	16,270,182	0.4		
Teijin Ltd CB 0% 12/12/18- RegS	日元 450,000,000	4,970,375	0.1		
Tohoku Elec Power CB 0% 03/12/20	日元 1,500,000,000	14,968,153	0.4		
Toray Industries CB 0% 30/8/19-RegS	日元 560,000,000	6,642,966	0.2		
Yamaguchi CB FRN 26/03/20- RegS	美元 5,900,000	6,102,367	0.1		
<b>马来西亚 (0.5%)</b>			<b>百慕大 (0.3%)</b>		
Cahaya Capit EB(Tenaga) 0%9/21-RegS	美元 22,100,000	21,840,325	0.5		
<b>新加坡 (1.0%)</b>			China Electronics 4.7% 16/1/17-RegS	人民币 4,800,000	721,719 0.0
CapitaLand Ltd 1.95% 17/10/23-RegS	新加坡元 9,000,000	6,742,306	0.2		
CapitaLand Ltd CB 1.85%19/6/20-RegS	新加坡元 11,750,000	8,434,898	0.2		
CapitaLand Ltd CB 2.8% 8/06/25-RegS	新加坡元 32,250,000	23,477,534	0.6		
			Kunlun Energy 2.875% 13/05/20-RegS	美元 12,200,000	12,604,684 0.3
			<b>开曼群岛 (8.4%)</b>		
			Agile Group 9% 21/05/20- RegS	美元 7,700,000	8,845,375 0.2
			Agile Group 9.875% 20/03/17-RegS	美元 13,800,000	14,235,630 0.4
			Alibaba Group Hldg 3.6% 28/11/24	美元 13,000,000	13,723,710 0.4
			CAR Inc 6% 11/02/21-RegS	美元 7,900,000	8,353,328 0.2
			CAR Inc 6.125% 04/02/20- RegS	美元 14,700,000	15,562,859 0.4
			CCBL Cayman 1 Corp 2.375% 5/19-RegS	美元 6,000,000	6,096,700 0.2
			CCBL Cayman 2.75% 31/05/21-RegS	美元 5,000,000	5,128,583 0.1
			China Overs Fin V 3.95% 15/11/22	美元 3,500,000	3,804,928 0.1
			China Overs Fin VI 5.95% 5/24-RegS	美元 12,000,000	14,564,217 0.4
			CIFI Hldgs Group 7.75% 05/06/20	美元 6,000,000	6,687,133 0.2
			Country Garden 4.75% 28/09/23-RegS	美元 21,000,000	20,620,863 0.5
			Country Garden 7.5% 09/03/20-RegS	美元 4,500,000	4,873,650 0.1
			Country Garden 7.5% 10/01/23-RegS	美元 400,000	435,670 0.0



投资组合 (续)

(续)

截至二零一六年九月三十日 (未经审计)

单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
<b>开曼群岛 (续)</b>			China Const Bk VRN 4.9% 11/24-RegS		
Country Garden 7.875% 27/05/19-RegS	美元 7,200,000	7,854,300	0.2	人民币 9,400,000	1,469,387
ENN Energy Hldgs 3.25% 10/19-RegS	美元 6,000,000	6,188,303	0.2	人民币 20,000,000	3,052,684
ENN Energy Hldgs 6% 13/05/21-RegS	美元 2,000,000	2,325,800	0.1	人民币 19,000,000	2,912,959
Formosa Group 3.375% 22/04/25-RegS	美元 24,550,000	25,464,641	0.6	人民币 9,500,000	1,462,574
FWD Ltd 5% 24/09/24- RegS	美元 16,800,000	18,593,773	0.5	人民币 5,500,000	913,951
Greenland HK Hldgs 3.875%07/19-RegS	美元 34,150,000	34,093,012	0.9	人民币 4,500,000	759,480
Greenland HK Hldgs 4.375% 8/17-RegS	美元 8,300,000	8,405,929	0.2	人民币 9,750,000	9,959,408
Hutch Wham Intl 12 VRN 6% Perp-RegS	美元 1,650,000	1,727,880	0.0	人民币 51,000,000	7,908,184
Hutch Wham Intl 14 3.625%10/24-RegS	美元 6,700,000	7,274,223	0.2	美元 11,800,000	12,019,972
KWG Property 13.25% 22/03/17	美元 400,000	420,145	0.0	美元 12,100,000	12,480,066
KWG Property 8.25% 05/08/19-RegS	美元 10,500,000	11,389,175	0.3	人民币 50,000,000	7,801,837
Lai Fung Hldgs 6.875% 25/04/18-RegS	人民币 5,000,000	764,184	0.0	人民币 148,870,000	22,607,826
Longfor Prop 6.75% 28/05/18-RegS	人民币 4,000,000	631,338	0.0	美元 5,680,000	5,819,330
MCE Finance 5% 15/02/21-RegS	美元 3,200,000	3,260,444	0.1	人民币 25,500,000	3,914,525
New World China 5.375% 6/11/19-RegS	美元 22,700,000	24,657,859	0.6	美元 29,600,000	30,055,758
OVPH Ltd 5.875% Perp- RegS	美元 7,100,000	7,638,150	0.2	<b>香港 (5.5%)</b>	
Semiconductor Mfg 4.125%10/19-RegS	美元 11,600,000	12,316,735	0.3	Bank of East Asia VRN 4.25% 24-RegS	美元 21,200,000
Shimao Property 8.375% 10/22-RegS	美元 17,906,000	20,632,450	0.5	Bank of East Asia VRN 5.5%Perp-RegS	美元 5,000,000
Sinostrong Intl 4% 28/05/18	人民币 27,300,000	4,161,769	0.1	China CITIC Bk 6.875% 24/6/20-RegS	美元 2,000,000
Tencent Hldgs 3.8% 11/02/25-RegS	美元 7,900,000	8,508,519	0.2	China CITIC Bk VRN 3.875% 28/9/22	美元 1,400,000
<b>中国 (5.2%)</b>				China CITIC Bk VRN 6% 05/24-RegS	美元 4,500,000
Bank of China 5% 13/11/24-RegS	美元 31,800,000	35,028,230	0.9	China CITIC Bk VRN 7.25%Perp-RegS	美元 12,200,000
Bank of China NY 3.6% 12/07/18-RegS	人民币 13,000,000	1,963,581	0.1	China Const Bk VRN 4.25% 08/24-RegS	美元 13,100,000
Bank of Comm VRN 5% Perp-RegS	美元 12,155,000	12,637,081	0.3	CITIC Ltd 3.7% 14/06/26- RegS	美元 5,000,000
Beijing Capital (HK) 4.7% 6/17-RegS	人民币 4,000,000	608,838	0.0	CITIC Ltd 6.875% 21/01/18	美元 2,400,000
China Const Bk 3.875% 13/5/25-RegS	美元 28,200,000	29,483,218	0.8	CITIC Ltd VRN 8.625% Perp-RegS	美元 10,600,000
				CRCC Yupeng VRN 3.95% Perp-RegS	美元 16,500,000
				Dah Sing Bank VRN 4.875% 02/22-RegS	新加坡元 1,750,000

投资组合 (续)

(续)

截至二零一六年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
<b>香港 (续)</b>				India Govt Bond 8.27% 09/06/20			
Hero Asia Inv 2.875% 03/10/17-RegS	美元 13,100,000	13,432,285	0.4	印度卢比 752,000,000	12,111,141	0.3	
HNA Group Intl 8% 13/11/17-RegS	人民币 34,200,000	5,310,888	0.1	印度卢比 1,140,000,000	18,691,839	0.5	
ICBCIL Finance 3.25% 17/03/20-RegS	美元 16,000,000	16,503,422	0.4	NTPC Ltd 4.25% 26/02/26-RegS	美元 18,000,000	19,355,975	0.5
ICBCIL Finance 3.625% 19/05/26-RegS	美元 28,000,000	29,357,767	0.8	NTPC Ltd 4.375% 26/11/24-RegS	美元 9,100,000	10,016,288	0.3
MCC Hldgs HK 2.5% 28/08/17-RegS	美元 12,100,000	12,199,724	0.3	Oil India 3.875% 17/04/19-RegS	美元 8,500,000	8,991,324	0.2
Poly Property 4.75% 16/05/18-RegS	美元 9,980,000	10,363,357	0.3	Oil India 5.375% 17/04/24-RegS	美元 2,000,000	2,295,172	0.1
Wheelock Finance 2.75% 2/07/17-RegS	美元 12,700,000	12,894,927	0.3	ONGC Videsh 3.25% 15/07/19-RegS	美元 8,400,000	8,685,273	0.2
Wheelock Finance 3% 19/03/18-RegS	美元 1,600,000	1,627,200	0.0	Power Finance 9.32% 17/09/19	印度卢比 250,000,000	3,959,409	0.1
Wing Lung Bank VRN 3.5% 11/22-RegS	美元 1,000,000	1,023,750	0.0	Power Finance No123A 8.5% 28/11/17	印度卢比 600,000,000	9,766,830	0.3
Zhejiang Prov Energy 2.3% 9/17-RegS	美元 9,600,000	9,630,853	0.3	Reliance Ind 4.125% 28/01/25-RegS	美元 5,000,000	5,271,844	0.1
				Tata Motors 4.625% 30/04/20-RegS	美元 14,900,000	15,877,430	0.4
<b>印度 (10.7%)</b>				<b>印度尼西亚 (11.5%)</b>			
Adani Transmission 4% 03/08/26-RegS	美元 3,100,000	3,148,033	0.1	Indonesia Eximbank NoOB 9% 13/03/18	印尼盾 130,000,000,000	10,155,160	0.3
Axis Bank Dubai 2.875% 1/06/21-RegS	美元 54,400,000	55,753,654	1.4	Indonesia Govt 8.375% 09/26	印尼盾 150,000,000,000	12,630,085	0.3
Bharat Petroleum 4% 08/05/25-RegS	美元 22,240,000	23,584,161	0.6	Indonesia Govt NoFR53 8.25% 15/7/21	印尼盾 680,500,000,000	56,181,862	1.4
Bharti Airtel 4.375% 10/06/25-RegS	美元 15,000,000	15,821,094	0.4	Indonesia Govt NoFR54 9.5% 15/07/31	印尼盾 87,500,000,000	8,133,429	0.2
Export-imp Bk IN 3.125% 07/21-RegS	美元 5,000,000	5,196,316	0.1	Indonesia Govt NoFR69 7.875%15/4/19	印尼盾 484,900,000,000	39,712,780	1.0
Export-imp Bk IN 9.45% 22/01/19	印度卢比 950,000,000	15,845,948	0.4	Indonesia Govt NoFR71 9% 15/03/29	印尼盾 219,000,000,000	19,364,121	0.5
Export-imp Bk IN NoQ17 9.28% 10/18	印度卢比 650,000,000	10,990,802	0.3	Indonesia Govt NoFR73 8.75% 15/5/31	印尼盾 200,000,000,000	17,900,547	0.5
Export-imp Bk IN NoQ20 9.7%21/11/18	印度卢比 250,000,000	4,239,567	0.1	Indonesia Retail 8.5% 15/10/17	印尼盾 504,000,000,000	39,576,060	1.0
Export-imp Bk IN NoQ21 9.63% 11/18	印度卢比 250,000,000	4,224,050	0.1	Indonesia Retail 9% 15/10/18	印尼盾 100,000,000,000	8,063,247	0.2
Housing Dev Fin 9.75% 10/16 SerL-02	印度卢比 750,000,000	12,340,321	0.3	Indosat Tbk NoOB 10% 12/12/17	印尼盾 35,000,000,000	2,769,153	0.1
Housing Dev Fin 9.75% 12/16 SerL-25	印度卢比 500,000,000	8,141,616	0.2	Indosat Tbk NoOB 9.25% 04/06/18	印尼盾 100,000,000,000	7,894,701	0.2
ICICI Bank 4% 24/11/17- RegS	人民币 31,000,000	4,723,066	0.1	Lembaga Pembiayaan 7.25% 05/09/17	印尼盾 90,000,000,000	6,965,328	0.2
ICICI Bank/Dubai 4% 18/03/26-RegS	美元 28,000,000	28,885,204	0.7	Lembaga Pembiayaan 7.95% 25/08/19	印尼盾 90,000,000,000	6,952,915	0.2
India Govt Bond 7.59% 11/01/26	印度卢比 4,000,000,000	63,556,845	1.6	MPM Global Pte 6.75% 19/9/19-RegS	美元 8,800,000	9,259,800	0.2
India Govt Bond 7.8% 11/04/21	印度卢比 2,800,000,000	45,077,870	1.2	Pelabuhan Indonesia 4.25% 5/25-RegS	美元 9,600,000	9,988,187	0.3
India Govt Bond 8.19% 16/01/20	印度卢比 220,000,000	3,497,202	0.1				

投资组合 (续)

(续)

截至二零一六年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
<b>印度尼西亚 (续)</b>							
Pertamina Persero 4.3% 20/5/23-RegS	美元 45,000,000	48,044,126	1.2	Woori Bank VRN 6.208% 02/05/37-RegS	美元 1,500,000	1,568,301	0.0
Pertamina Persero 4.875% 05/22-RegS	美元 8,000,000	8,816,733	0.2	<b>马来西亚 (6.3%)</b>			
Pertamina Persero 5.625% 05/43-RegS	美元 1,800,000	1,939,804	0.0	AmBank M 3.125% 03/07/19-RegS	美元 10,600,000	10,967,172	0.3
Pertamina Persero 6% 03/05/42-RegS	美元 800,000	904,653	0.0	Cagamas Bhd 4.1% 18/11/20	林吉特 15,000,000	3,722,730	0.1
Pertamina Persero 6.45% 30/5/44-RegS	美元 25,000,000	29,636,979	0.8	Cagamas Bhd NoP8 6.35% 08/08/23	林吉特 55,000,000	15,260,416	0.4
Perusahaan Penerb 4.325% 5/25-RegS	美元 6,300,000	6,866,856	0.2	Cagamas Global 3.7% 22/09/17-RegS	人民币 54,400,000	8,148,953	0.2
Perusahaan Penerb 4.35% 09/24-RegS	美元 14,300,000	15,480,286	0.4	Danainfra Nasional 4.41% 24/07/24	林吉特 15,000,000	3,742,676	0.1
Perusahaan Penerb NoSR07 8.25% 3/18	印尼盾 153,000,000,000	12,077,377	0.3	Malayan Banking VRN 3.905 29/10/26	美元 36,000,000	38,227,960	1.0
Rep of Indonesia 4.75% 8/1/26-RegS	美元 50,000,000	56,670,070	1.4	Malaysia Govt Inv No0116 4.39% 7/23	林吉特 155,000,000	39,851,333	1.0
Rep of Indonesia 5.125% 15/1/45-RegS	美元 6,000,000	6,914,517	0.2	Malaysia Govt Inv No0216 3.743%8/21	林吉特 118,500,000	29,360,997	0.7
Rep of Indonesia 5.875% 01/24-RegS	美元 5,000,000	5,973,764	0.2	Malaysia Govt Inv No0613 3.716%3/21	林吉特 42,000,000	10,306,998	0.3
Theta Cap 6.125% 14/11/20-RegS	美元 893,000	938,372	0.0	Malaysian Govt No0315 3.659% 10/20	林吉特 140,000,000	34,978,685	0.9
<b>英属泽西岛 (0.3%)</b>							
West China Cement 6.5% 11/9/19-RegS	美元 12,700,000	13,277,356	0.3	Malaysian Govt No0316 3.9% 30/11/26	林吉特 49,500,000	12,491,433	0.3
<b>韩国 (3.7%)</b>							
Busan Bank 3.625% 25/07/26-RegS	美元 25,700,000	26,058,408	0.7	Malaysian Govt No0411 4.232% 06/31	林吉特 90,000,000	22,787,269	0.6
KEB Hana Bank 4.25% 10/24-RegS	美元 7,500,000	8,257,240	0.2	Putrajaya Hldgs 4.55% 19/09/23	林吉特 20,000,000	4,977,875	0.1
KEB Hana Bank 4.375% 30/09/24-RegS	美元 7,400,000	8,072,079	0.2	RHB Bank 2.503% 10/21- RegS-Old	美元 8,100,000	8,114,256	0.2
KIA Motors 2.625% 21/04/21-RegS	美元 4,300,000	4,486,391	0.1	Telekom Malaysia 4.82% 21/03/24	林吉特 10,000,000	2,522,695	0.1
Korea Land No42 3.5% 27/08/20	韩元 5,000,000,000	5,555,046	0.1	<b>蒙古 (0.0%)</b>			
Korea Try No2106 ILB 1.5% 10/06/21	韩元 6,850,000,000	6,909,566	0.2	Mongolia 7.5% 30/06/18- RegS	人民币 10,000,000	1,407,233	0.0
Korea Try No2306 ILB 1.125% 10/6/23	韩元 7,000,000,000	6,663,940	0.2	<b>荷兰 (1.7%)</b>			
Korea Western Power 2.625%9/19-RegS	美元 10,200,000	10,479,544	0.3	Bharti Airtel 5.125% 11/03/23-RegS	美元 24,000,000	26,219,933	0.7
Shinhan Bank 3.875% 24/03/26-RegS	美元 16,000,000	16,914,936	0.4	Indo Energy Fin II 6.375% 1/23-RegS	美元 6,000,000	4,308,688	0.1
Woori Bank 4.75% 30/04/24-RegS	美元 15,800,000	17,392,223	0.4	Listrindo Capital 4.95% 9/26-RegS	美元 7,400,000	7,438,443	0.2
Woori Bank 5% 10/06/45-RegS	美元 13,000,000	13,765,917	0.4	Royal Capital VRN 5.5% Perp-RegS	美元 6,000,000	6,416,613	0.1
Woori Bank VRN 4.5% Perp-RegS	美元 19,300,000	19,244,030	0.5	Samwardhana Mothers 4.875% 12/21-RegS	美元 21,200,000	22,215,878	0.6

投资组合 (续)

(续)

截至二零一六年九月三十日 (未经审计)

	单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比		单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
<b>新西兰 (2.3%)</b>				Theta Cap 7% 11/04/22-RegS			
New Zealand Govt 2.75% 15/4/37-RegS	纽元 30,000,000	21,722,215	0.5	United Over Bk 3.5% 9/26-RegS	美元 31,010,000	33,818,128	0.9
New Zealand Govt No319 5% 15/03/19	纽元 55,600,000	43,525,796	1.1	United Over Bk VRN 2.88% 08/03/27	美元 12,200,000	12,205,368	0.3
New Zealand Govt No521 6% 15/05/21	纽元 30,000,000	26,214,390	0.7	United Over Bk VRN 3.75% 09/24-RegS	美元 8,000,000	8,322,000	0.2
<b>巴基斯坦 (0.1%)</b>				<b>斯里兰卡 (1.3%)</b>			
Islamic Rep Pakistan 8.25% 9/25-RegS	美元 5,000,000	5,767,646	0.1	Natl Savings Bk 5.15% 10/09/19-RegS	美元 5,500,000	5,575,098	0.2
<b>菲律宾 (0.8%)</b>				Natl Savings Bk 8.875% 18/9/18-RegS	美元 3,200,000	3,465,296	0.1
Philippine Govt No1060 3.625% 09/25	比索 400,000,000	8,406,766	0.2	Rep of Sri Lanka 5.75% 18/01/22-RegS	美元 20,400,000	21,153,978	0.5
Philippine Govt No5-73 3.375% 08/20	比索 400,000,000	8,310,496	0.2	Rep of Sri Lanka 6.125% 3/6/25-RegS	美元 11,500,000	12,025,278	0.3
Philippines Rep of 3.9% 26/11/22	比索 134,000,000	2,819,821	0.1	Rep of Sri Lanka 6.825% 7/26-RegS	美元 5,000,000	5,456,698	0.1
Philippines Rep of 6.25% 14/01/36	比索 467,000,000	11,364,370	0.3	SriLankan Airlines 5.3% 06/19-RegS	美元 4,400,000	4,484,211	0.1
<b>俄罗斯 (0.4%)</b>				<b>国际 (0.2%)</b>			
Russian Feder 4.875% 16/09/23-RegS	美元 16,000,000	17,659,700	0.4	Asian Dev Bank 3.25% 20/07/17	纽元 12,000,000	8,845,747	0.2
<b>新加坡 (6.5%)</b>				<b>泰国 (2.0%)</b>			
Alam Synergy Pte 9% 29/01/19-RegS	美元 15,350,000	16,470,550	0.4	Krung Thai Bk VRN 5.2% 12/24-RegS	美元 26,000,000	27,788,078	0.7
BOC Aviation 3% 30/03/20-RegS	美元 10,700,000	10,976,952	0.3	Thailand Govt 3.625% 16/06/23	泰铢 110,000,000	3,544,783	0.1
BOC Aviation 3.875% 27/04/26-RegS	美元 29,200,000	30,917,731	0.8	Thailand Govt 3.65% 20/06/31	泰铢 120,320,000	3,974,146	0.1
BOC Aviation 3.875% 9/5/19-RegS	美元 10,721,000	11,366,776	0.3	Thailand Govt 3.875% 13/06/19	泰铢 1,020,000,000	31,548,449	0.8
BOC Aviation 4.2% 05/11/18-RegS	人民币 44,000,000	6,747,543	0.2	Thailand Govt IL 1.2% 14/07/21-RegS	泰铢 346,000,000	10,448,565	0.3
CapitaLand Try 4.076% 20/09/22	美元 2,000,000	2,150,591	0.1	<b>美国 (0.7%)</b>			
Cosl Singapore Capl 4.5% 7/25-RegS	美元 5,000,000	5,459,125	0.1	China Merchant 2.375% 14/05/18-RegS	美元 15,000,000	15,221,823	0.4
DBS Group Hldgs VRN 3.6% Perp	美元 16,400,000	16,421,320	0.4	CNOOC Fin (2015) 3.5% 05/05/25	美元 10,000,000	10,375,564	0.2
Housing & Dev 3.008% 26/03/21-RegS	新加坡元 10,000,000	7,731,017	0.2	Reliance Hldgs USA 5.4% 02/22-RegS	美元 3,000,000	3,406,500	0.1
Housing & Dev 3.1% 24/07/24-RegS	新加坡元 4,000,000	3,171,403	0.1	<b>维京群岛 (15.3%)</b>			
OCBC 4.25% 19/06/24-RegS	美元 1,600,000	1,747,907	0.0	Beijing Cap Polar 2.875% 04/18-RegS	美元 17,000,000	17,297,925	0.5
OCBC VRN 4% 15/10/24-RegS	美元 17,400,000	18,549,173	0.5	Bestgain Real Est 4.05% 12/16-RegS	人民币 3,900,000	590,613	0.0
Olam Intl 4.5% 12/04/21-RegS	美元 15,800,000	16,302,045	0.4	Bluestar Fin Hldgs 3.125% 9/19-RegS	美元 11,700,000	11,729,681	0.3
Public Utilities Board 3.52% 10/20	新加坡元 10,000,000	7,975,483	0.2	CCCI Treasure VRN 3.5% Perp-RegS	美元 11,900,000	12,352,861	0.3
RH Intl Singapore 3.5% 2/5/19-RegS	美元 10,600,000	11,113,423	0.3				

投资组合 (续)

截至二零一六年九月三十日 (未经审计)

(续)

单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比	单位数目	公允价值 美元	占资产 净值百 分比		
维京群岛 (续)							
CDBI Treasure I 2.25% 02/8/21-RegS	美元 4,700,000	4,734,486	0.1				
Central Plaza VRN 7.125% Perp-RegS	美元 22,700,000	25,035,877	0.6	SDSC Intl Finance 3.625% 11/19-RegS	美元 12,600,000	13,241,926	0.3
Central Plaza VRN 8.375% Perp-RegS	美元 3,400,000	3,766,338	0.1	Shanghai Electric Grp 3% 8/19-RegS	美元 9,000,000	9,272,400	0.2
Chalco HK Inv VRN 6.25% Perp-RegS	美元 16,100,000	16,796,146	0.4	Sino-Ocean Land 4.45% 04/02/20-RegS	美元 10,000,000	10,523,458	0.3
Chinalco Capital 4% 25/8/21-RegS	美元 8,500,000	8,556,100	0.2	Sino-Ocean Land 6% 30/07/24-RegS	美元 800,000	901,613	0.0
Chinalco Fin 3.625% 11/12/19-RegS	美元 8,675,000	9,100,304	0.2	Sinopec Group 2.75% 03/05/21-RegS	美元 27,800,000	28,881,574	0.7
Dianjian Haixing VRN 4.05%Perp-RegS	美元 17,100,000	18,020,835	0.5	Sinopec Group Over 2.5%28/4/20-RegS	美元 20,300,000	20,917,628	0.5
Double Rosy 3.625% 18/11/19-RegS	美元 22,400,000	23,585,909	0.6	Studio City Fin 8.5% 01/12/20-RegS	美元 10,000,000	10,642,833	0.3
Eastern Creation II 2.625% 20/11/17	美元 9,600,000	9,772,820	0.3	Value Success Intl 4% 21/11/16-RegS	人民币 3,000,000	455,996	0.0
Franshion Brill 5.375% 10/18-RegS	美元 400,000	431,294	0.0	Value Success Intl 4.75% 11/18-RegS	人民币 1,000,000	155,020	0.0
Franshion Brill 5.75% 19/03/19-RegS	美元 23,000,000	24,696,633	0.6	Yunnan Energy Invest 5.5%10/17-RegS	人民币 30,000,000	4,628,318	0.1
Greenland Glb Inv 3.5% 6/09/19-RegS	美元 24,100,000	23,954,931	0.6			3,374,998,240	85.9
HKT Capital No2 3.625% 2/04/25-RegS	美元 10,997,000	11,739,015	0.3			-----	-----
HKT Capital No4 3 14/07/26-RegS	美元 47,800,000	47,719,538	1.2	<b>(III) 集合投资计划 (1.8%)</b>			
HLP Finance 4.45% 16/04/21-RegS	美元 11,000,000	11,984,454	0.3	<b>香港 (0.9%)</b>			
Huarong Fin VRN 2.875% Perp-RegS	美元 14,700,000	14,547,232	0.4	ABF Pan Asia Bond Index Fd	300,000	35,880,000	0.9
Huarong Finance 5.5% 16/01/25-RegS	美元 5,000,000	5,672,792	0.2	<b>跨国性 (0.9%)</b>			
Huarong Finance II 2.056% 2019-RegS	美元 20,600,000	21,007,136	0.5	JPMF-Emerging Markets Local Ccy Debt'X'(acc)- USD*#	1,810,000	33,104,900	0.9
Huarong Finance II 4.625% 6/26-RegS	美元 5,000,000	5,436,299	0.1			68,984,900	1.8
King Power Cap 5.625% 03/11/24-RegS	美元 14,400,000	16,745,400	0.4			-----	-----
LTC GB 2.75% 26/05/2021-RegS	美元 13,400,000	13,788,581	0.4				
Minmetals Bounteous 3.46%07/21-RegS	美元 17,800,000	18,209,499	0.5				
NWD (MTN) 5.25% 26/02/21-RegS	美元 16,725,000	18,356,593	0.5				
NWD Fin (BVI) 5.75% Perp-RegS	美元 13,300,000	13,537,405	0.4				
Proven Honour Cap 4.125% 05/26-RegS	美元 28,000,000	29,939,408	0.8				
Proven Honour Cap 4.125% 19/05/25	美元 12,400,000	13,385,490	0.4				
RKI Overseas Fin 4.7% 06/09/21-RegS	美元 15,500,000	15,517,265	0.4				
RKI Overseas Fin 5% 09/08/19-RegS	美元 31,900,000	32,867,279	0.8				

投资组合 (续)

截至二零一六年九月三十日止期间 (未经审计)

单位数目	公平值 美元	占资产 净值百 分比
<b>(IV) 衍生性产品 (0.1%)</b>		
远期外汇合约 (0.1%)	3,127,072	0.1
期货(-0.0%)		
US 10Yr Note (CBT)		
Fut 12/16 (2,666)	(753,844)	(0.0)
	<u>2,373,228</u>	<u>0.1</u>
	<u>-----</u>	<u>----</u>
<b>总上市投资</b>	<b>3,757,326,423</b>	<b>95.7</b>
<b>其他净资产</b>	<b>167,345,764</b>	<b>4.3</b>
	<u>-----</u>	<u>----</u>
<b>截至二零一六年九月三十日可赎回份额持有人应占净资产</b>	<b>3,924,672,187</b>	<b>100.0</b>
	<u>-----</u>	<u>----</u>
<b>总投资, 按成本</b>	<b>3,658,566,774</b>	
	<u>-----</u>	

\* 由管理人的关联人士发行和管理 (关联人士的定义, 参见附注 8)

# 未获香港认可, 且不可向香港居民提供

投资组合持有变动表

截至二零一六年九月三十日止期间 (未经审计)

	持有占资产净值百分比	
	2016	2015
<b>上市投资</b>		
<b>可换股</b>		
日本	2.3	-
中国	2.1	1.6
香港	1.8	0.4
新加坡	1.0	0.9
马来西亚	0.5	0.3
台湾	0.2	0.3
韩国	-	0.1
<b>债务证券</b>		
维京群岛	15.3	14.8
印度尼西亚	11.5	9.3
印度	10.7	7.0
开曼群岛	8.4	12.6
新加坡	6.5	5.1
马来西亚	6.3	2.7
香港	5.5	8.1
中国	5.2	4.6
韩国	3.7	4.8
澳大利亚	2.7	3.7
新西兰	2.3	1.1
泰国	2.0	1.7
荷兰	1.7	1.8
斯里兰卡	1.3	1.7
菲律宾	0.8	0.6
美国	0.7	0.7
俄罗斯	0.4	-
百慕大	0.3	0.9
英属泽西岛	0.3	0.6
国际	0.2	0.3
巴基斯坦	0.1	0.2
蒙古	0.0	0.3
英国	-	0.5
墨西哥	-	0.4
秘鲁	-	0.1
<b>集合投资计划</b>		
香港	0.9	-
跨国性	0.9	-
<b>衍生性产品</b>		
远期外汇合约	0.1	0.9
期货	(0.0)	(0.0)
	<u>-----</u>	<u>----</u>
<b>总上市投资</b>	<b>95.7</b>	<b>88.1</b>
<b>其他净资产</b>	<b>4.3</b>	<b>11.9</b>
	<u>-----</u>	<u>----</u>
<b>截至二零一六年九月三十日可赎回份额持有人应占净资产</b>	<b>100.0</b>	<b>100.0</b>
	<u>-----</u>	<u>----</u>

财务状况报表

截至二零一六年九月三十日

综合收益表

截至二零一六年九月三十日止年度

	2016 美元	2015 美元	2016 美元	2015 美元
<b>资产</b>				
银行现金	186,118,724	258,463,022		
应收经纪款项	1,828,616	16,425,191		
分配应收款项	50,806,997	17,420,474		
保证金	6,349,757	1,314,345		
衍生性产品 [附注 4(i)(a)]	15,213,340	33,315,219		
投资 [附注 4(i)(a)]	3,754,953,195	1,943,564,543		
利息和其他应收款项	16,418	20,967		
<b>总资产</b>	<u>4,015,287,047</u>	<u>2,270,523,761</u>	<u>215,174,452</u>	<u>(74,958,742)</u>
<b>负债</b>				
应付经纪款项	33,664,838	-	25,964,215	20,307,391
赎回应付款项	26,534,648	12,504,110	667,729	529,185
应付收益分配 [附注 6]	11,599,586	12,622,926		
衍生性产品 [附注 4(i)(a)]	12,840,112	13,484,437		
其他应付款项	5,975,676	2,796,888		
<b>负债 (不包括可赎回份 额持有人应占净资 产)</b>	<u>90,614,860</u>	<u>41,408,361</u>		
<b>可赎回份额持有人应占 净资产 [附注 3]</b>	<u>3,924,672,187</u>	<u>2,229,115,400</u>	<u>28,195,908</u>	<u>21,752,687</u>
由受托人及管理人于二零一七年一月十六日批准 签署人： 汇丰机构信托服务（亚洲）有限公司，受托人				
摩根基金（亚洲）有限公司，管理人				
			<b>净经营利润 / (亏 损)</b>	<u>186,978,544</u>
				<u>(96,711,429)</u>
			<b>财务成本</b>	
			收益分配 [附注 6]	(130,696,805)
			已付利息	(12)
				<u>(130,696,817)</u>
				<u>(136,465,509)</u>
			<b>除税前利润 / (亏 损)</b>	<u>56,281,727</u>
				<u>(233,176,938)</u>
			税项 [附注 7]	(4,909,779)
				<u>(2,343,562)</u>
			<b>可赎回份额持有人应 占净资产及总综合 收益之增加 / (减 少)</b>	<u>51,371,948</u>
				<u>(235,520,500)</u>

可赎回份额持有人应占净资产变动表  
截至二零一六年九月三十日止年度

现金流量表  
截至二零一六年九月三十日止年度

	2016 美元	2015 美元		2016 美元	2015 美元
<b>年初可赎回份额持有人应占净资产</b>	2,229,115,400	902,230,981	<b>经营业务</b>		
分配可赎回份额 [附注 3]	3,635,897,044	3,299,256,945	购入投资及衍生性产品	(2,030,444,680)	(1,936,272,429)
赎回可赎回份额 [附注 3]	(1,991,712,205)	(1,736,852,026)	出售投资及衍生性产品		
<b>净分配</b>	1,644,184,839	1,562,404,919	所得款项	495,461,034	604,989,063
	3,873,300,239	2,464,635,900	已收利息	594,384	502,522
<b>可赎回份额持有人应占净资产及总综合收益之增加 / (减少)</b>	51,371,948	(235,520,500)	已付交易费用	(333,127)	(47,180)
			已付基金注册登记机构费用	(430,518)	(305,587)
<b>年末可赎回份额持有人应占净资产</b>	3,924,672,187	2,229,115,400	已付受托人费用	(634,128)	(500,239)
			已付税项	(3,201,119)	(1,761,637)
			保证金之增加	(5,035,412)	(660,825)
			已付管理费用	(24,616,085)	(19,142,712)
			其他	3,003,557	(396,117)
			<b>经营业务所运用之现金净额</b>	(1,565,636,094)	(1,353,595,141)
			<b>融资活动</b>		
			已付利息	(12)	(5,749)
			分配可赎回份额所得款项	3,602,510,521	3,328,172,744
			赎回可赎回份额付款	(1,977,681,667)	(1,738,812,665)
			已付收益分配	(131,720,145)	(128,378,619)
			<b>融资活动所产生之现金净额</b>	1,493,108,697	1,460,975,711
			<b>现金及现金等价物之 (减少) / 增加</b>	(72,527,397)	107,380,570
			年初现金及现金等价物	258,463,022	152,061,816
			现金及现金等价物之汇兑收益 / (亏损)	183,099	(979,364)
			<b>年末现金及现金等价物</b>	186,118,724	258,463,022
			<b>现金及现金等价物余额分析:</b>		
			银行现金	186,118,724	258,463,022



财务报表之附注

1 本基金

摩根亚洲总收益债券基金（“本基金”）根据二零零四年十一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（“SFC”）认可。

本基金之投资目标为透过一个主要投资于亚洲债券及其他债务证券之主动管理组合，致力提供具竞争力的总回报（包括资本增长及定息收益）。

根据二零一二年二月二十七日的增补信托契约，管理人可决定发行不同类别（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、货币或收益收益分配政策。由于各类别有不同的收费结构，因此每类别应占之资产净值可能不同。

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

2 主要会计政策

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

(a) 财务报表之编制基准

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

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

*于二零一五年十月一日生效的新准则及修订*

没有于二零一五年十月一日初次生效的新订准则或修订对本基金造成了重大影响。

*于二零一五年十月一日生效且未获本基金提早采纳的新准则、修订及诠释*

香港财务报告准则第9号“金融工具”，针对金融资产和金融负债的分类、计量和确认。香港财务报告准则第9号取代香港会计准则第39号“金融工具：确认和计量”中有关分类和计量金融工具的指引。香港财务报告准则第9号确定了三个主要的计量类别：按摊销成本、按公允价值透过其他综合收益以及按公允价值透过损益表计量。此分类基准视乎主体管理金融资产的经营模式，以及金融资产的合同现金流量特点。在权益工具中的投资需要按公允价值透过损益表计量，而由初始不可撤销选项在其他综合收益计量的公允价值变动入账。目前有新的预期信贷损失模型，取代在香港会计准则第39号中使用的减值亏损模型。对于金融负债，就指定为按公允价值透过损益表计量的负债，除了在其他综合收益中确认本身信贷风险的变动外，分类和计量并无任何变动。

该准则于二零一八年一月一日或之后开始的会计期间起生效。容许提早采纳。管理层目前正评估其对本基金财务报告的影响。

没有其他于二零一五年十月一日之后的财政年度生效的准则、诠释或修订预期会对本基金造成重大影响。

(b) 投资及衍生性产品

分类

本基金将其投资及衍生性产品归类为按公允价值透过损益列账的金融资产或负债。此等金融资产和负债为持作买卖用途。持作买卖用途的金融资产和负债主要是为了在短期内出售或购回或获得短期盈利而买入或产生的。

如果金额对于本基金是应收款项，则列作资产；如果金额对于本基金是应付款项，则列作负债。

*确认、取消确认及计量*

投资及衍生性产品之买卖于交易日确认。投资及衍生性产品先以公允价值确认，其后以公允价值列账。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的现金流量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。

*公允价值估计*

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

债务证券的公允价值按包括应计利息的报价计算。

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

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

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

信贷违约的掉期是以庄家逐日盯市制度的报价和估值变化为基础的，如有，将会入账为综合收益表中的未实现收益或亏损。

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

*公允价值级次分层间的转拨*

在公允价值级次分层之间的转拨视为于报告期间开始时已发生。

**(c) 金融工具抵销**

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

**(d) 收入及支出**

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

投资利息收入乃作为投资及衍生性产品净收益/亏损的一部分，在综合收益表确认。

银行现金及短期存款利息收入乃按实际利息法在综合收益表确认。

支出乃按应计基准在综合收益表确认。

**(e) 外币交易**

*功能及呈列货币*

本基金采用美元作为其功能及呈列货币。

*交易及结余*

外币交易按交易日期适用之汇率折算为功能货币。

外币交易和按年终汇率换算外币资产和负债产生的汇兑盈亏在综合收益表确认。

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

**(f) 现金及现金等价物**

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

**(g) 保证金**

为远期和掉期合约交易而存放在经纪处的保证金采用实际利率法以摊销成本列账。

**(h) 应收／应付经纪款项**

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

**(i) 销售份额所得款项及赎回份额支付款项**

每份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并在财务状况报表上分类为金融负债，代表可赎回份额持有人应占净资产。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报表日期入账。

**(j) 应付可赎回份额持有人的收益分配**

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

3 已发行份额数目及可赎回份额持有人应占净资产（每份额）

2016

	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	24,150,892.841	15,771,899.487	93,571.235	259,609,204.830	10,791,750.092
总分配	37,451,581.455	12,392,594.422	955,047.411	483,065,084.953	9,763,621.801
总赎回	(26,973,892.787)	(8,935,653.149)	(375,395.242)	(261,592,657.067)	(10,480,617.330)
年末	<u>34,628,581.509</u>	<u>19,228,840.760</u>	<u>673,223.404</u>	<u>481,081,632.716</u>	<u>10,074,754.563</u>
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净资产	<u>321,280,527</u>	<u>179,196,989</u>	<u>6,555,386</u>	<u>4,722,528,266</u>	<u>92,826,121</u>
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	<u>9.28</u>	<u>9.32</u>	<u>9.74</u>	<u>9.82</u>	<u>9.21</u>
	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额	PRC 人民币 对冲份额 (累计) 份额
已发行份额数目:					
年初	2,814,534.808	651,910,409.424	2,877,139.286	54,291,404.491	-
总分配	1,119,068.535	390,875,479.311	368,591.008	73,488,386.828	391,944,292.740
总赎回	(2,091,090.637)	(503,063,377.430)	(1,011,489.274)	(46,349,026.744)	(45,957,658.630)
年末	<u>1,842,512.706</u>	<u>539,722,511.305</u>	<u>2,234,241.020</u>	<u>81,430,764.575</u>	<u>345,986,634.110</u>
	人民币	人民币	美元	美元	人民币
可赎回份额持有人应占净资产	<u>21,105,857</u>	<u>5,166,107,748</u>	<u>26,539,869</u>	<u>919,519,116</u>	<u>3,763,109,762</u>
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	<u>11.45</u>	<u>9.57</u>	<u>11.88</u>	<u>11.29</u>	<u>10.88</u>

	PRC 人民币对冲 份额 (每月派息) 份额	PRC 美元份额 (累计) 份额	PRC 美元份额 (每月派息) 份额		
已发行份额数目:					
年初	-	-	-		
总分配	86,052,694.750	41,225,432.400	1,935,066.840		
总赎回	(8,552,832.920)	(510,451.310)	(147,009.460)		
年末	<u>77,499,861.830</u>	<u>40,714,981.090</u>	<u>1,788,057.380</u>		
	人民币	美元	美元		
可赎回份额持有人应占净资产	<u>799,689,319</u>	<u>432,075,847</u>	<u>18,403,254</u>		
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	<u>10.32</u>	<u>10.61</u>	<u>10.29</u>		
<b>2015</b>					
	澳元对冲类别 (每月派息) 份额	加元对冲类别 (每月派息) 份额	英镑对冲类别 (每月派息) 份额	港元类别 (每月派息) 份额	纽元对冲类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:					
年初	8,255,983.341	6,312,897.308	-	78,537,687.642	7,744,499.885
总分配	30,862,076.183	17,597,592.645	98,469.221	340,819,155.116	15,457,381.346
总赎回	(14,967,166.683)	(8,138,590.466)	(4,897.986)	(159,747,637.928)	(12,410,131.139)
年末	<u>24,150,892.841</u>	<u>15,771,899.487</u>	<u>93,571.235</u>	<u>259,609,204.830</u>	<u>10,791,750.092</u>
	澳元	加元	英镑	港元	纽元
可赎回份额持有人应占净资产	<u>218,503,411</u>	<u>143,065,587</u>	<u>883,883</u>	<u>2,473,838,161</u>	<u>96,923,455</u>
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	<u>9.05</u>	<u>9.07</u>	<u>9.45</u>	<u>9.53</u>	<u>8.98</u>

	人民币对冲类别 (累计) 份额	人民币对冲类别 (每月派息) 份额	美元类别 (累计) 份额	美元类别 (每月派息) 份额
已发行份额数目:				
年初	672,268,679	215,252,166,678	87,330,101	23,486,601,431
总分配	5,265,686,922	955,720,249,405	3,160,362,005	71,585,755,743
总赎回	(3,123,420,793)	(519,062,006,659)	(370,552,820)	(40,780,952,683)
年末	<u>2,814,534,808</u>	<u>651,910,409,424</u>	<u>2,877,139,286</u>	<u>54,291,404,491</u>
	人民币	人民币	美元	美元
可赎回份额持有人应占净资产	<u>29,073,814</u>	<u>6,075,057,512</u>	<u>31,831,272</u>	<u>595,609,359</u>
可赎回份额持有人应占净资产 (每份额)	<u>10.33</u>	<u>9.32</u>	<u>11.06</u>	<u>10.97</u>

#### 4 财务风险管理

##### (I) 财务风险因素

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

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

##### (a) 市场风险

##### (i) 市场价格风险

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

##### (ii) 利率风险

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

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

	1年以内 美元	1至5年 美元	5年以上 美元	非计息类 美元	总额 美元
2016					
银行现金	186,118,724	-	-	-	186,118,724
保证金	6,349,757	-	-	-	6,349,757
衍生性产品	(753,844)	-	-	-	(753,844)
投资（附注*）	131,111,012	1,692,683,606	1,862,173,677	68,984,900	3,754,953,195
总利率敏感性缺口	<u>322,825,649</u>	<u>1,692,683,606</u>	<u>1,862,173,677</u>	<u>68,984,900</u>	<u>3,946,667,832</u>

	1年以内 美元	1至5年 美元	5年以上 美元	非计息类 美元	总额 美元
<b>2015</b>					
银行现金	258,463,022	-	-	-	258,463,022
保证金	1,314,345	-	-	-	1,314,345
衍生性产品 (362,500)	(362,500)	-	-	-	(362,500)
投资 (附注*)	22,279,239	997,959,769	923,325,535	-	1,943,564,543
总利率敏感性缺口	281,694,106	997,959,769	923,325,535	-	2,202,979,410

注:

\* 投资的票面息率波动范围为年率 0.00% - 13.25% (二零一五年: 年率 0.00% - 13.25%)。

截至九月三十日, 本基金投资及衍生性产品的公允价值如下:

	2016		2015	
	投资之公平值 美元	占资产净值 百分比	投资之公平值 美元	占资产净值 百分比
<b>资产</b>				
上市投资				
可换股	310,970,055	7.9	79,490,451	3.6
债务证券				
- 维京群岛	600,496,905	15.3	329,694,471	14.8
- 印度尼西亚	449,810,912	11.5	206,589,736	9.3
- 印度	420,048,274	10.7	156,729,734	7.0
- 开曼群岛	329,241,275	8.4	280,514,381	12.6
- 新加坡	254,948,405	6.5	113,779,626	5.1
- 马来西亚	245,461,448	6.3	60,791,115	2.7
- 香港	213,961,670	5.5	179,866,639	8.1
- 中国	202,858,889	5.2	101,592,958	4.6
- 其他	658,170,462	16.5	434,515,432	19.4
	3,374,998,240	85.9	1,864,074,092	83.6
集体投资计划	68,984,900	1.8	-	-
衍生性产品				
- 远期外汇合约	15,213,340	0.4	33,315,219	1.5
	3,770,166,535	96.0	1,976,879,762	88.7
<b>负债</b>				
衍生性产品				
- 远期外汇合约	(12,086,268)	(0.3)	(13,121,937)	(0.6)
- 期货	(753,844)	(0.0)	(362,500)	(0.0)
	(12,840,112)	(0.3)	(13,484,437)	(0.6)
总上市投资	3,757,326,423	95.7	1,963,395,325	88.1

衍生性产品合约风险亦请参阅附注 12。

投资管理主要通过本基金的修正久期定期监控本基金的利率风险敏感度。修正久期计量与利率变动相关的债券和可换股价格的敏感度。于二零一六年九月三十日，投资管理人估计本基金的修正久期为 3.98（二零一五年：3.60）。为了披露相关敏感度，采用的利率合理变动百分比为二十五基点，不包括不大可能出现或“最恶劣”情况或“压力测试”下之变动，但不代表投资管理人对本基金未来回报的预测。若利率上升二十五基点，其他变量保持稳定，则将致使本基金的资产净值减少约 39,050,488 美元（二零一五年：20,062,039 美元）。若利率下降二十五基点，则将致使本基金的资产净值增加相同金额。

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

(iii) 汇兑风险

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

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

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

汇兑风险承担净值（附注*）	美元等值	与美元比较之合理变动百分比（附注**）	估计对资产净值的影响 美元
<b>2016</b>			
澳元	300,410,932	+9.0	27,036,984
加元	136,473,947	+2.0	2,729,479
人民币（境内）	20,798,650	-4.7	(977,537)
人民币（境外）	1,473,994,807	-4.6	(67,803,761)
港元	130,513,197	-0.1	(130,513)
印度卢比	172,920,668	-1.4	(2,420,889)
印尼盾	193,726,977	+12.3	23,828,418
日元	7,777,886	+18.3	1,423,353
韩元	18,975,028	+7.6	1,442,102
林吉特	167,820,709	+6.3	10,572,705
纽元	152,575,033	+13.7	20,902,780
比索	30,901,453	-3.6	(1,112,452)
新加坡元	8,867,589	+4.3	381,306
英镑	8,542,169	-14.2	(1,212,988)
泰铢	49,515,943	+4.7	2,327,249
	<u>2,873,814,988</u>		<u>16,986,236</u>



汇兑风险承担净值（附注*）	美元等值	与美元比较之合理变动 百分比（附注**）	估计对资产净值的影响 美元
<b>2015</b>			
澳元	167,265,213	-19.7	(32,951,247)
加元	106,651,167	-16.6	(17,704,094)
人民币（境内）	1,508,834	-3.4	(51,300)
人民币（境外）	965,755,125	-2.9	(28,006,899)
港元	102,437,361	+0.2	204,875
印度卢比	26,456,941	-5.9	(1,560,960)
印尼盾	35,095,358	-16.8	(5,896,020)
韩元	13,827,367	-11.0	(1,521,010)
林吉特	1,868,664	-25.4	(474,641)
纽元	63,884,898	-17.9	(11,435,397)
比索	13,936,658	-4.0	(557,466)
新加坡元	10,126,448	-10.3	(1,043,024)
斯里兰卡卢比	5,324,290	-7.7	(409,970)
英镑	1,338,095	-6.6	(88,314)
泰铢	15,179,205	-10.7	(1,624,175)
	<u>1,530,655,624</u>		<u>(103,119,642)</u>

若外币呈反方向波动，假设影响本基金资产净值的其他变量保持稳定，则将使本基金的资产净值以相同金额呈反向变动。

注:

\* 资产及负债汇兑风险承担净值包括货币及非货币资产及负债。

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

**(b) 信贷风险**

信贷风险指交易对手无法于到期日支付全数金额的风险。

截至九月三十日，在信用评级前本基金的最高信贷风险承担列示如下：

	2016 美元	2015 美元
银行现金	186,118,724	258,463,022
应收经纪款项	1,828,616	16,425,191
分配应收款项	50,806,997	17,420,474
保证金	6,349,757	1,314,345
经纪发行的衍生性产品	15,213,340	33,315,219
投资 - 债务证券	3,374,998,240	1,864,074,092
利息和其他应收款项	16,418	20,967
	<u>3,635,332,092</u>	<u>2,191,033,310</u>

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

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

下表概述截至九月三十日按照信用评级的债务证券。

	2016 占资产净值百分比	2015 占资产净值百分比
标准普尔(AAA)/穆迪(Aaa)/惠誉(AAA)	3.8	2.7
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	3.5	5.7
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	19.5	14.9
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	32.1	29.1
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	8.6	9.3
标准普尔(B)/穆迪(B)/惠誉(B)	3.3	4.6
标准普尔(CCC)/穆迪(Caa)/惠誉(CCC)	0.1	-
未评级	22.9	20.9
	<u>93.8</u>	<u>87.2</u>

截至九月三十日，按照发行机构的信用评级，下表概述上述未评级债务证券。

	2016 占资产净值百分比	2015 占资产净值百分比
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	0.3	0.5
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	1.1	0.7
标准普尔(BBB)/穆迪(Baa)/惠誉(BBB)	5.7	2.9
标准普尔(BB)/穆迪(Ba)/惠誉(BB)	2.0	0.5
未评级	13.8	16.3
	<u>22.9</u>	<u>20.9</u>

截至九月三十日，下表概述本基金存放了金融资产（而非债务证券）的银行/经纪/托管机构的信用评级。

	2016 交易对手风险承担 美元	2015 交易对手风险承担 美元
银行结余		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	186,118,724	258,463,022
存放经纪之保证金及经纪发行的投资及衍生性产品		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	9,320,589	11,906,018
标准普尔(A)/穆迪(A)/惠誉(A)	12,242,508	22,723,546
托管机构的投资余额		
标准普尔(AA)/穆迪(Aa)/惠誉(AA)	<u>3,754,953,195</u>	<u>1,943,564,543</u>

(c) 流动性风险

本基金须面对份额每日赎回的风险，而其大多数投资资产均在活跃市场交易，并可随时出售。管理人亦可将任何一个交易日之赎回份额总数限制为本基金已发行份额之百分之十或更高。

在投资限制和指南的规限下，本基金有能力订立借款安排。

下表概述本基金的金融负债，按九月三十日距离约定到期日的尚余期间分为有关期限组别。下表所载金额乃约定未折现现金流量。

	2016		2015	
	少于1个月 美元	1至12个月 美元	少于1个月 美元	1至12个月 美元
应付经纪款项	33,664,838	-	-	-
赎回应付款项	26,534,648	-	12,504,110	-
应付收益分配	11,599,586	-	12,622,926	-
衍生性产品	10,333,751	2,506,361	12,026,474	1,457,963
其他应付款项	5,975,676	-	2,796,888	-
可赎回份额持有人应占净资产	3,924,672,187	-	2,229,115,400	-
总金融负债	4,012,780,686	2,506,361	2,269,065,798	1,457,963

投资管理主要通过投资预期于一个月内存到期的资产（以偿还所有金融负债）和借入短期银行借款管理本基金的流动性风险。

(d) 受总抵销安排及类似协议规限的对销与金额

截至二零一六年及二零一五年九月三十日，本基金受制于与若干衍生品交易对手的总净额结算协议。该等交易对手持有本基金的所有衍生资产及负债，本基金持有之抵押品及保证金是为了就该等衍生性产品仓位提供抵押而持有。

若发生违约，本基金及其交易对手有权按净额结算该等交易。违约事件可能包括付款或交付失败、违反协议或破产。

下表按金融工具类型概述截至九月三十日本基金受抵销和总净额结算协议及类似协议规限的金融资产及负债。

财务状况表中列示的经确认 金融资产总额 美元	受总抵销安排及类似协议规限的相 关金额		净额 美元
	金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	
<u>2016</u>			
<u>资产</u>			
保证金	6,349,757	-	5,595,913
衍生性产品	15,213,340	(870,026)	14,343,314
按公允价值透过损益列账的金融资产	<u>21,563,097</u>	<u>(870,026)</u>	<u>19,939,227</u>

财务状况表中列示的经确认 金融负债总额 美元	受总抵销安排及类似协议规限的相 关金额		净额 美元
	金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	
<u>负债</u>			
衍生性产品	12,840,112	(870,026)	11,216,242
按公允价值透过损益列账的金融负债	<u>12,840,112</u>	<u>(870,026)</u>	<u>11,216,242</u>

财务状况表中列示的经确认 金融资产总额 美元	受总抵销安排及类似协议规限的相 关金额		净额 美元
	金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	
<u>2015</u>			
<u>资产</u>			
保证金	1,314,345	-	951,845
衍生性产品	33,315,219	(2,795,679)	30,519,540
按公允价值透过损益列账的金融资产	<u>34,629,564</u>	<u>(2,795,679)</u>	<u>31,471,385</u>

财务状况表中列示的经确认 金融负债总额 美元	受总抵销安排及类似协议规限的相 关金额		净额 美元
	金融工具 美元	抵押品及保证金 美元	
<u>负债</u>			
衍生性产品	13,484,437	(2,795,679)	10,326,258
按公允价值透过损益列账的金融负债	<u>13,484,437</u>	<u>(2,795,679)</u>	<u>10,326,258</u>

(II) 资本风险管理

本基金的资本是以可赎回份额持有人应占净资产呈示，本基金的分配和赎回乃由份额持有人决定。本基金会以保障为份额持有人提供回报和长期资本增值为目标。

为了维持资本结构，本基金的政策执行如下：

- 监测分配和赎回活动相对于流动性资产。
- 为了保护份额持有人在特殊情况下的利益，管理人亦可将任何一个交易日之赎回份额总数限制为本基金已发行份额之百分之十或更高。
- 按照宪制性文件，监测基金的投资指南及限制条件，以透过分散投资维持足够的资金流通性。

(III) 公允价值估计

于二零一六年及二零一五年九月三十日，管理人认为资产及负债的账目价值与公允价值相若。

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

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

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

	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总值 美元
总上市投资				
<u>2016</u>				
<u>资产</u>				
可换股	-	310,970,055	-	310,970,055
债务证券	-	3,374,998,240	-	3,374,998,240
集体投资计划	68,984,900	-	-	68,984,900
衍生性产品	-	15,213,340	-	15,213,340
按公允价值透过损益列账的总金融资产	68,984,900	3,701,181,635	-	3,770,166,535
<u>负债</u>				
衍生性产品	(753,844)	(12,086,268)	-	(12,840,112)
按公允价值透过损益列账的总金融负债	(753,844)	(12,086,268)	-	(12,840,112)

	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总值 美元
总上市投资				
<u>2015</u>				
<u>资产</u>				
可换股	-	79,490,451	-	79,490,451
债务证券	-	1,864,074,092	-	1,864,074,092
衍生性产品	-	33,315,219	-	33,315,219
按公允价值透过损益列账的总金融资产	-	1,976,879,762	-	1,976,879,762
<u>负债</u>				
衍生性产品	(362,500)	(13,121,937)	-	(13,484,437)
按公允价值透过损益列账的总融负债	(362,500)	(13,121,937)	-	(13,484,437)

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

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

被分类为第三层次的投资，由于其交易次数疏落，故此有显著的不可观察输入值。

在截至二零一六年及二零一五年九月三十日止年度，各个层级之间并无转拨。

下表概述本基金截至九月三十日的资产及负债（按类别）未按公允价值级次计量公允价值但披露了其公允价值：

	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总值 美元
<u>2016</u>				
<u>资产</u>				
银行现金	186,118,724	-	-	186,118,724
应收经纪款项	-	1,828,616	-	1,828,616
分配应收款项	-	50,806,997	-	50,806,997
保证金	6,349,757	-	-	6,349,757
利息和其他应收款项	-	16,418	-	16,418
总资产	192,468,481	52,652,031	-	245,120,512
<u>负债</u>				
应付经纪款项	-	33,664,838	-	33,664,838
赎回应付款项	-	26,534,648	-	26,534,648
应付收益分配	-	11,599,586	-	11,599,586
其他应付款项	-	5,975,676	-	5,975,676
可赎回份额持有人应占净资产	3,924,672,187	-	-	3,924,672,187
总负债	3,924,672,187	77,774,748	-	4,002,446,935

	第一层次 美元	第二层次 美元	第三层次 美元	总值 美元
<b>2015</b>				
<b>资产</b>				
银行现金	258,463,022	-	-	258,463,022
应收经纪款项	-	16,425,191	-	16,425,191
分配应收款项	-	17,420,474	-	17,420,474
保证金	1,314,345	-	-	1,314,345
利息和其他应收款项	-	20,967	-	20,967
总资产	<u>259,777,367</u>	<u>33,866,632</u>	-	<u>293,643,999</u>
<b>负债</b>				
赎回应付款项	-	12,504,110	-	12,504,110
应付收益分配	-	12,622,926	-	12,622,926
其他应付款项	-	2,796,888	-	2,796,888
可赎回份额持有人应占净资产	2,229,115,400	-	-	2,229,115,400
总负债	<u>2,229,115,400</u>	<u>27,923,924</u>	-	<u>2,257,039,324</u>

银行现金、短期存款及保证金包括现金、银行存款及其他短期投资。

应收经纪款项及其他应收款项包括应付本基金的交易结算及其他责任清偿之合同金额。应付经纪款项及其他应付款项包括本基金结算交易及清偿费用之合同金额及责任。

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报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报表入账。根据本基金的信托契约条款，计算可赎回份额持有人应占净资产的赎回金额（“信托契约NAV”）。该等份额在活跃市场交易。故此，第一层次视为可赎回份额持有人应占净资产（或“资产净值”或“净资产”或“NAV”）的适当类别。

## 5 投资及衍生性产品净收益／（亏损）

	2016 美元	2015 美元
投资和衍生性产品价值的未实现损益的变化	148,733,032	(43,311,003)
投资和衍生性产品的销售的实现收益／（亏损）	61,953,007	(30,935,528)
	<u>210,686,039</u>	<u>(74,246,531)</u>

6 收益分配

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

	2016 美元	2015 美元
净经营利润 / (亏损)	186,978,544	(96,711,429)
调整：		
投资及衍生性产品净(收益) / 亏损	(210,686,039)	74,246,531
利息收入包括于投资及衍生性产品净收益 / (亏损) (票面利率)	107,604,380	86,112,655
汇兑净(收益) / 亏损	(3,760,532)	1,274,835
交易成本	334,525	44,120
已付利息	(12)	(5,749)
税项	(4,909,779)	(2,343,562)
资本利得税	1,516,440	316,051
可收益分配金额	77,077,527	62,933,452

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	美元	美元
澳元对冲类别 (每月派息)	2015 年 10 月 30 日	2015 年 11 月 9 日	澳元 0.0486	26,840,078.252	(930,644)	
加元对冲类别 (每月派息)	2015 年 10 月 30 日	2015 年 11 月 9 日	加元 0.0350	15,723,534.392	(420,624)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2015 年 10 月 30 日	2015 年 11 月 9 日	英镑 0.0361	95,671.350	(5,334)	
港元类别 (每月派息)	2015 年 10 月 30 日	2015 年 11 月 9 日	港币 0.0347	269,359,708.456	(1,206,021)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2015 年 10 月 30 日	2015 年 11 月 9 日	纽元 0.0541	11,305,834.876	(413,839)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2015 年 10 月 30 日	2015 年 11 月 9 日	人民币 0.0650	641,902,557.016	(6,598,975)	
美元类别 (每月派息)	2015 年 10 月 30 日	2015 年 11 月 9 日	美元 0.0400	56,664,884.781	(2,266,595)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2015 年 11 月 30 日	2015 年 12 月 8 日	澳元 0.0483	26,495,033.317	(927,278)	
加元对冲类别 (每月派息)	2015 年 11 月 30 日	2015 年 12 月 8 日	加元 0.0349	15,514,852.048	(406,615)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2015 年 11 月 30 日	2015 年 12 月 8 日	英镑 0.0362	82,708.699	(4,507)	
港元类别 (每月派息)	2015 年 11 月 30 日	2015 年 12 月 8 日	港币 0.0347	273,194,912.785	(1,222,900)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2015 年 11 月 30 日	2015 年 12 月 8 日	纽元 0.0535	10,603,883.081	(373,827)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2015 年 11 月 30 日	2015 年 12 月 8 日	人民币 0.0610	650,362,116.817	(6,174,116)	
美元类别 (每月派息)	2015 年 11 月 30 日	2015 年 12 月 8 日	美元 0.0400	55,318,474.035	(2,212,739)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2015 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 11 日	澳元 0.0479	26,336,317.872	(917,811)	
加元对冲类别 (每月派息)	2015 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 11 日	加元 0.0331	15,023,545.331	(357,987)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2015 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 11 日	英镑 0.0330	98,296.913	(4,781)	
港元类别 (每月派息)	2015 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 11 日	港币 0.0347	271,240,027.831	(1,214,432)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2015 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 11 日	纽元 0.0520	10,104,262.131	(359,704)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2015 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 11 日	人民币 0.0730	620,930,012.709	(6,900,325)	
美元类别 (每月派息)	2015 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 11 日	美元 0.0400	54,825,057.972	(2,193,002)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 11 日	澳元 0.0469	25,363,107.229	(841,414)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 11 日	加元 0.0324	15,194,708.421	(349,837)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 11 日	英镑 0.0337	337,458.127	(16,132)	
港元类别 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 11 日	港币 0.0347	287,344,259.506	(1,281,130)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 11 日	纽元 0.0503	9,302,888.025	(302,754)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 11 日	人民币 0.0986	517,806,528.297	(7,741,287)	
美元类别 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 11 日	美元 0.0400	56,417,500.315	(2,256,700)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 15 日	人民币 0.1063	1,897,453.890	(30,583)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2016 年 1 月 29 日	2016 年 2 月 15 日	美元 0.0365	200.000	(7)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	澳元 0.0460	25,613,412.880	(841,542)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	加元 0.0330	14,946,499.642	(364,118)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	英镑 0.0343	352,555.659	(16,852)	
港元类别 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	港币 0.0347	288,418,151.953	(1,287,026)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	纽元 0.0494	8,762,445.980	(285,410)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	人民币 0.0759	488,497,028.163	(5,659,044)	
美元类别 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	美元 0.0400	52,444,866.385	(2,097,795)	
PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	人民币 0.0818	8,493,681.230	(106,045)	
PRC 美元份额 (每月派息)	2016 年 2 月 29 日	2016 年 3 月 8 日	美元 0.0365	200.730	(7)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016 年 3 月 31 日	2016 年 4 月 11 日	澳元 0.0464	25,729,574.016	(918,371)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016 年 3 月 31 日	2016 年 4 月 11 日	加元 0.0330	14,655,199.579	(373,900)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2016 年 3 月 31 日	2016 年 4 月 11 日	英镑 0.0333	146,123.807	(6,994)	
港元类别 (每月派息)	2016 年 3 月 31 日	2016 年 4 月 11 日	港币 0.0347	297,837,091.869	(1,332,416)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2016 年 3 月 31 日	2016 年 4 月 11 日	纽元 0.0494	8,941,434.726	(306,677)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2016 年 3 月 31 日	2016 年 4 月 11 日	人民币 0.0574	484,042,762.396	(4,302,336)	



收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2016 美元	2015 美元
美元类别 (每月派息)	2016年3月31日	2016年4月11日	美元 0.0400	58,427,124.078	(2,337,085)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2016年3月31日	2016年4月11日	人民币 0.0618	31,214,890.980	(298,716)	
PRC美元份额 (每月派息)	2016年3月31日	2016年4月11日	美元 0.0365	201,460	(7)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	澳元 0.0459	27,666,793.813	(969,129)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	加元 0.0328	14,614,023.946	(382,676)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	英镑 0.0336	185,490.796	(9,130)	
港元类别 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	港元 0.0347	321,383,292.523	(1,437,632)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	纽元 0.0478	9,233,609.863	(308,626)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	人民币 0.0467	507,652,290.675	(3,655,046)	
美元类别 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	美元 0.0400	60,433,007.282	(2,417,320)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	人民币 0.0503	47,609,445.470	(369,208)	
PRC美元份额 (每月派息)	2016年4月29日	2016年5月10日	美元 0.0365	202,180	(7)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	澳元 0.0446	31,753,119.856	(1,025,958)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	加元 0.0331	15,411,488.615	(389,970)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	英镑 0.0337	253,236.051	(12,421)	
港元类别 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	港元 0.0347	337,579,926.353	(1,507,955)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	纽元 0.0482	9,093,915.654	(296,550)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	人民币 0.0472	531,679,365.823	(3,810,685)	
美元类别 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	美元 0.0400	62,288,818.294	(2,491,553)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	人民币 0.0508	61,313,748.300	(472,969)	
PRC美元份额 (每月派息)	2016年5月31日	2016年6月8日	美元 0.0365	712,542.400	(26,008)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	澳元 0.0436	33,852,154.353	(1,098,995)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	加元 0.0329	15,968,937.719	(404,541)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	英镑 0.0319	483,524.126	(20,619)	
港元类别 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	港元 0.0347	352,729,402.638	(1,577,699)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	纽元 0.0475	9,003,412.962	(304,581)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	人民币 0.0442	543,100,377.906	(3,601,170)	
美元类别 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	美元 0.0400	65,791,999.265	(2,631,680)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	人民币 0.0476	68,789,130.390	(491,211)	
PRC美元份额 (每月派息)	2016年6月30日	2016年7月11日	美元 0.0365	1,127,554.310	(41,156)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	澳元 0.0437	33,850,826.324	(1,124,328)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	加元 0.0325	16,849,016.526	(419,917)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	英镑 0.0313	544,020.569	(22,608)	
港元类别 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	港元 0.0347	403,411,642.440	(1,803,927)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	纽元 0.0474	9,390,935.536	(321,028)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	人民币 0.0459	538,678,573.936	(3,725,352)	
美元类别 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	美元 0.0400	71,332,819.881	(2,853,313)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	人民币 0.0494	74,859,841.670	(557,187)	
PRC美元份额 (每月派息)	2016年7月29日	2016年8月8日	美元 0.0365	1,460,263.910	(53,300)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	澳元 0.0377	34,098,354.334	(966,123)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	加元 0.0275	17,697,151.694	(370,925)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	英镑 0.0254	606,108.509	(20,163)	
港元类别 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	港元 0.0304	455,146,962.623	(1,783,797)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	纽元 0.0421	9,858,584.724	(301,116)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	人民币 0.0397	549,228,107.951	(3,257,834)	
美元类别 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	美元 0.0350	78,017,997.378	(2,730,630)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	人民币 0.0428	79,543,329.780	(508,667)	
PRC美元份额 (每月派息)	2016年8月31日	2016年9月8日	美元 0.0319	1,763,882.090	(56,268)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	澳元 0.0362	34,716,450.198	(961,717)	
加元对冲类别 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	加元 0.0276	19,144,280.657	(402,041)	
英镑对冲类别 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	英镑 0.0237	673,223.404	(20,726)	
港元类别 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	港元 0.0304	479,425,502.700	(1,879,142)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	纽元 0.0406	10,088,824.294	(297,866)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	人民币 0.0550	540,004,699.232	(4,450,510)	
美元类别 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	美元 0.0350	81,230,893.837	(2,843,081)	
PRC人民币对冲份额 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	人民币 0.0592	77,495,866.050	(687,464)	
PRC美元份额 (每月派息)	2016年9月30日	2016年10月11日	美元 0.0319	1,788,057.380	(57,039)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2014年10月31日	2014年11月10日	澳元 0.0571	10,899,218.783	(547,041)	
加元对冲类别 (每月派息)	2014年10月31日	2014年11月10日	加元 0.0430	7,452,151.829	(284,219)	
港元类别 (每月派息)	2014年10月31日	2014年11月10日	港元 0.0369	103,724,462.800	(493,531)	
纽元对冲类别 (每月派息)	2014年10月31日	2014年11月10日	纽元 0.0652	8,442,478.846	(428,195)	
人民币对冲类别 (每月派息)	2014年10月31日	2014年11月10日	人民币 0.0613	269,502,749.333	(2,696,435)	
美元类别 (每月派息)	2014年10月31日	2014年11月10日	美元 0.0425	25,783,027.441	(1,095,779)	
澳元对冲类别 (每月派息)	2014年11月28日	2014年12月8日	澳元 0.0563	13,730,714.496	(659,789)	
加元对冲类别 (每月派息)	2014年11月28日	2014年12月8日	加元 0.0421	9,319,920.892	(344,108)	

收益分配类别	到期日	支付日	比率	金额	2016 美元	2015 美元
英镑对冲类别 (每月派息)	2014年11月28日	2014年12月8日	英镑 0.0391	12,743.662		(780)
港元类别 (每月派息)	2014年11月28日	2014年12月8日	港元 0.0369	140,662,260.091		(669,302)
纽元对冲类别 (每月派息)	2014年11月28日	2014年12月8日	纽元 0.0639	9,449,446.030		(473,998)
人民币对冲类别 (每月派息)	2014年11月28日	2014年12月8日	人民币 0.0632	382,948,213.617		(3,929,523)
美元类别 (每月派息)	2014年11月28日	2014年12月8日	美元 0.0425	35,044,857.628		(1,489,407)
澳元对冲类别 (每月派息)	2014年12月31日	2015年1月9日	澳元 0.0570	15,789,847.780		(736,533)
加元对冲类别 (每月派息)	2014年12月31日	2015年1月9日	加元 0.0421	10,435,539.487		(379,310)
英镑对冲类别 (每月派息)	2014年12月31日	2015年1月9日	英镑 0.0384	12,793.689		(766)
港元类别 (每月派息)	2014年12月31日	2015年1月9日	港元 0.0369	143,389,300.559		(682,291)
纽元对冲类别 (每月派息)	2014年12月31日	2015年1月9日	纽元 0.0657	9,864,830.682		(506,570)
人民币对冲类别 (每月派息)	2014年12月31日	2015年1月9日	人民币 0.0727	463,315,467.569		(5,417,108)
美元类别 (每月派息)	2014年12月31日	2015年1月9日	美元 0.0425	37,857,909.726		(1,608,961)
澳元对冲类别 (每月派息)	2015年1月30日	2015年2月9日	澳元 0.0573	19,009,260.638		(848,238)
加元对冲类别 (每月派息)	2015年1月30日	2015年2月9日	加元 0.0416	11,408,501.688		(374,300)
英镑对冲类别 (每月派息)	2015年1月30日	2015年2月9日	英镑 0.0389	14,007.910		(818)
港元类别 (每月派息)	2015年1月30日	2015年2月9日	港元 0.0369	171,447,899.907		(815,961)
纽元对冲类别 (每月派息)	2015年1月30日	2015年2月9日	纽元 0.0651	10,064,506.549		(475,544)
人民币对冲类别 (每月派息)	2015年1月30日	2015年2月9日	人民币 0.0714	570,705,961.328		(6,484,212)
美元类别 (每月派息)	2015年1月30日	2015年2月9日	美元 0.0425	42,609,388.171		(1,810,899)
澳元对冲类别 (每月派息)	2015年2月27日	2015年3月9日	澳元 0.0522	21,360,786.537		(872,792)
加元对冲类别 (每月派息)	2015年2月27日	2015年3月9日	加元 0.0394	13,425,618.575		(423,633)
英镑对冲类别 (每月派息)	2015年2月27日	2015年3月9日	英镑 0.0386	29,053.383		(1,733)
港元类别 (每月派息)	2015年2月27日	2015年3月9日	港元 0.0369	190,610,524.943		(906,914)
纽元对冲类别 (每月派息)	2015年2月27日	2015年3月9日	纽元 0.0615	10,962,357.685		(510,190)
人民币对冲类别 (每月派息)	2015年2月27日	2015年3月9日	人民币 0.0758	646,559,035.265		(7,795,382)
美元类别 (每月派息)	2015年2月27日	2015年3月9日	美元 0.0425	46,185,838.444		(1,962,898)
澳元对冲类别 (每月派息)	2015年3月31日	2015年4月13日	澳元 0.0536	22,235,056.566		(914,160)
加元对冲类别 (每月派息)	2015年3月31日	2015年4月13日	加元 0.0396	16,417,288.971		(513,324)
英镑对冲类别 (每月派息)	2015年3月31日	2015年4月13日	英镑 0.0386	35,962.399		(2,061)
港元类别 (每月派息)	2015年3月31日	2015年4月13日	港元 0.0369	212,260,160.977		(1,010,235)
纽元对冲类别 (每月派息)	2015年3月31日	2015年4月13日	纽元 0.0643	10,716,913.929		(516,754)
人民币对冲类别 (每月派息)	2015年3月31日	2015年4月13日	人民币 0.0751	722,991,363.788		(8,749,762)
美元类别 (每月派息)	2015年3月31日	2015年4月13日	美元 0.0425	46,693,441.496		(1,984,471)
澳元对冲类别 (每月派息)	2015年4月30日	2015年5月11日	澳元 0.0524	22,550,151.350		(932,009)
加元对冲类别 (每月派息)	2015年4月30日	2015年5月11日	加元 0.0392	16,921,528.150		(547,636)
英镑对冲类别 (每月派息)	2015年4月30日	2015年5月11日	英镑 0.0386	45,996.714		(2,728)
港元类别 (每月派息)	2015年4月30日	2015年5月11日	港元 0.0369	207,430,007.307		(987,488)
纽元对冲类别 (每月派息)	2015年4月30日	2015年5月11日	纽元 0.0638	10,198,295.376		(495,373)
人民币对冲类别 (每月派息)	2015年4月30日	2015年5月11日	人民币 0.0707	769,771,741.847		(8,762,899)
美元类别 (每月派息)	2015年4月30日	2015年5月11日	美元 0.0425	52,544,263.029		(2,233,131)
澳元对冲类别 (每月派息)	2015年5月29日	2015年6月8日	澳元 0.0514	23,721,454.319		(933,300)
加元对冲类别 (每月派息)	2015年5月29日	2015年6月8日	加元 0.0395	16,949,619.134		(536,359)
英镑对冲类别 (每月派息)	2015年5月29日	2015年6月8日	英镑 0.0390	51,934.431		(3,091)
港元类别 (每月派息)	2015年5月29日	2015年6月8日	港元 0.0369	205,936,855.829		(980,329)
纽元对冲类别 (每月派息)	2015年5月29日	2015年6月8日	纽元 0.0639	9,931,283.286		(451,156)
人民币对冲类别 (每月派息)	2015年5月29日	2015年6月8日	人民币 0.0598	828,794,563.107		(7,990,571)
美元类别 (每月派息)	2015年5月29日	2015年6月8日	美元 0.0425	52,177,881.512		(2,217,560)
澳元对冲类别 (每月派息)	2015年6月30日	2015年7月9日	澳元 0.0507	23,233,342.843		(905,357)
加元对冲类别 (每月派息)	2015年6月30日	2015年7月9日	加元 0.0399	16,109,795.192		(514,863)
英镑对冲类别 (每月派息)	2015年6月30日	2015年7月9日	英镑 0.0386	51,986.501		(3,156)
港元类别 (每月派息)	2015年6月30日	2015年7月9日	港元 0.0369	193,951,543.000		(923,156)
纽元对冲类别 (每月派息)	2015年6月30日	2015年7月9日	纽元 0.0618	10,318,173.302		(431,252)
人民币对冲类别 (每月派息)	2015年6月30日	2015年7月9日	人民币 0.0571	840,746,573.860		(7,736,578)
美元类别 (每月派息)	2015年6月30日	2015年7月9日	美元 0.0425	50,329,238.225		(2,138,993)
澳元对冲类别 (每月派息)	2015年7月31日	2015年8月10日	澳元 0.0517	23,360,055.981		(886,885)
加元对冲类别 (每月派息)	2015年7月31日	2015年8月10日	加元 0.0386	15,944,545.618		(473,085)
英镑对冲类别 (每月派息)	2015年7月31日	2015年8月10日	英镑 0.0387	47,140.524		(2,847)
港元类别 (每月派息)	2015年7月31日	2015年8月10日	港元 0.0369	188,792,696.971		(898,630)
纽元对冲类别 (每月派息)	2015年7月31日	2015年8月10日	纽元 0.0606	9,782,581.360		(393,813)
人民币对冲类别 (每月派息)	2015年7月31日	2015年8月10日	人民币 0.0599	787,050,856.494		(7,581,854)
美元类别 (每月派息)	2015年7月31日	2015年8月10日	美元 0.0425	51,291,728.060		(2,179,899)
澳元对冲类别 (每月派息)	2015年8月31日	2015年9月9日	澳元 0.0509	23,307,942.156		(841,080)
加元对冲类别 (每月派息)	2015年8月31日	2015年9月9日	加元 0.0370	16,349,975.899		(454,678)
英镑对冲类别 (每月派息)	2015年8月31日	2015年9月9日	英镑 0.0387	51,832.529		(3,085)
港元类别 (每月派息)	2015年8月31日	2015年9月9日	港元 0.0369	235,575,036.224		(1,121,634)

收益分配类别	到期日	支付日	比率	份额	2016 美元	2015 美元
纽元对冲类别（每月派息）	2015年8月31日	2015年9月9日	纽元 0.0589	10,199,916.961		(380,441)
人民币对冲类别（每月派息）	2015年8月31日	2015年9月9日	人民币 0.0677	687,601,049.122		(7,222,353)
美元类别（每月派息）	2015年8月31日	2015年9月9日	美元 0.0425	52,970,305.544		(2,251,238)
澳元对冲类别（每月派息）	2015年9月30日	2015年10月9日	澳元 0.0501	24,137,365.586		(849,218)
加元对冲类别（每月派息）	2015年9月30日	2015年10月9日	加元 0.0360	15,766,833.311		(423,365)
英镑对冲类别（每月派息）	2015年9月30日	2015年10月9日	英镑 0.0380	93,571.235		(5,386)
港元类别（每月派息）	2015年9月30日	2015年10月9日	港元 0.0369	256,751,968.799		(1,222,463)
纽元对冲类别（每月派息）	2015年9月30日	2015年10月9日	纽元 0.0563	10,705,105.565		(385,546)
人民币对冲类别（每月派息）	2015年9月30日	2015年10月9日	人民币 0.0725	652,674,844.717		(7,433,946)
美元类别（每月派息）	2015年9月30日	2015年10月9日	美元 0.0425	54,188,285.013		(2,303,002)
可赎回份额持有人之总收益分配					(130,696,805)	(136,459,760)

一旦该金额不足以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。

## 7 税项

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

截至二零一六年及二零一五年九月三十日止年度，已就收到的若干利息收入及引致的资本收益缴付海外预提税。

## 8 与受托人及其关联人以及管理人及其关联人士之交易

以下是本基金与受托人及其关联人以及管理人及其关联人士之间于年度内订立之重大关联方交易摘要。基金的关联人士是根据香港证券及期货事务监察委员会所颁布的单位信托及互惠基金守则（“证监会守则”）中的定义。所有交易均为按一般商业条款下进行的正常业务流程。

(a) 以下为与管理人及其关联人士之投资交易：

公司名称	投资买卖总价值 美元	支付佣金 美元	占本基金本年度支付之 总佣金百分	平均佣金率百 分比
<u>2016</u>				
摩根资产管理(欧洲)有限公司	33,184,100	-	-	-
J.P. Morgan Securities plc London	37,598,293	-	-	-
<u>2015</u>				
JPMorgan Chase Bank - South Branch	10,200,441	-	-	-
J.P. Morgan Securities plc London	50,042,370	-	-	-

截至二零一六年九月三十日止年度，本基金与管理人及其关联人士签订远期外汇合同(二零一五年：无)。

(b) 与管理人及其关联人士之年末结余：

	2016 美元	2015 美元
银行现金	21,188,234	15,679,283
应收款项	1,716	1,267
应付款项	(25,834,745)	(1,928,209)

于二零一六年九月三十日，本基金的投资结余 33,104,900 美元（二零一五年：无）为管理人及其关联人士发行和管理的集体投资计划的投资。

本年度内，存放于管理人的关联人士银行现金的利息收入为 31,598 美元（二零一五年：25,701 美元）。

- (c) 本基金可能利用受托人及其关联人以及管理人及其关联人士的券商、托管人、代理人及银行服务。本基金可能收取存款利息，并为该等服务支付利息费用、交易成本、托管费用及银行费用。所有该等交易均于正常业务过程中按一般商业条款订立。
- (d) 截至二零一六年九月三十日止年度，扣除支付给有关机构的佣金后，管理人取得本基金销售及赎回收益为 1,584,516 美元（二零一五年：1,369,057 美元）。
- (e) 支付给摩根基金（亚洲）有限公司之管理费为每年本基金资产净值的 1%。此管理费于每个交易日累计，并于每月月底支付。  
此外，如果本基金的资产净值超过 500 万美元但低于 2,000 万美元，则管理人就每次评估收取估值费用 40 美元；如果本基金的资产净值超过 2,000 万美元，则管理人就每次评估收取估值费用 70 美元。
- (f) 本基金允许管理人及其关联人士认购/申购及赎回本基金份额。所有交易均为按一般商业条款下进行的正常业务流程。
- (g) 有关支付给受托人的费用，请参阅附注 9。
- (h) 摩根基金（亚洲）有限公司，即登记代理人及管理人，根据本基金份额持有人的数量及发生交易的数量收取注册费。与受托人商定的收费比率为本基金资产净值的年率介乎 0.015% 至 0.5% 不等。基金注册登记机构费用于每季季末支付。

## 9 受托人费用

受托人费用按本基金资产净值的首 4,000 万美元，以本基金资产净值的年率百分之零点点六计算；资产净值介乎 4,000 万美元至 7,000 万美元，按年率百分之零点点四计算；超过 7,000 万美元时，按年率百分之零点点二五计算。受托人费用于每个交易日累计，并于每月月底支付。

## 10 借款

截至二零一六年及二零一五年九月三十日止年度，本基金从香港上海汇丰银行有限公司（受托人的关联方）借入无抵押短期借款。所有银行借款的久期均在 7 天内。所有交易均为按一般商业条款下进行的正常业务流程。

## 11 非金钱收益/佣金共享安排

投资管理人与经纪签署非金钱收益/佣金共享安排，用以支持投资决策的产品和服务。投资管理人并不直接支付这些服务，但会代表本基金与经纪约定金额。基金将负责支付佣金。

提供的产品和服务对本基金的益处必须明显，可包括研究和咨询服务、经济政治分析、投资组合分析（包括估值和业绩考评）、市场分析、市场分析、数据与行情服务、相关电脑软硬件支持、结算和托管服务及投资相关的出版物。

## 12 衍生性产品

- (a) 以下为截至九月三十日未平仓之远期外汇合约：

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益/（亏损） 美元
<u>2016</u>			
未平仓合约：			
人民币 10,337,491	美元 1,551,517	2016 年 10 月 11 日	2,458
人民币 13,583,899	美元 2,036,519	2016 年 10 月 11 日	990
人民币 11,682,766	美元 1,751,056	2016 年 10 月 11 日	409
人民币 7,299	美元 1,094	2016 年 10 月 11 日	1
人民币 16,262	美元 2,438	2016 年 10 月 11 日	1

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 387,180,711	人民币 2,587,241,788	2016年10月11日	513,982
美元 387,397,217	人民币 2,587,242,000	2016年10月11日	297,509
美元 20,261,263	人民币 135,405,980	2016年10月11日	29,141
美元 4,259,541	人民币 28,543,953	2016年10月11日	17,731
美元 3,767,697	人民币 25,256,907	2016年10月11日	17,016
美元 2,713,566	人民币 18,208,209	2016年10月11日	14,910
美元 2,515,488	人民币 16,871,817	2016年10月11日	12,731
美元 2,124,399	人民币 14,246,217	2016年10月11日	10,378
美元 2,774,822	人民币 18,583,536	2016年10月11日	9,896
美元 1,929,504	人民币 12,930,843	2016年10月11日	8,165
美元 2,428,034	人民币 16,255,856	2016年10月11日	7,884
美元 2,553,584	人民币 17,083,339	2016年10月11日	6,332
美元 2,777,876	人民币 18,575,011	2016年10月11日	5,565
美元 1,522,353	人民币 10,194,241	2016年10月11日	5,240
美元 2,403,068	人民币 16,068,355	2016年10月11日	4,753
美元 1,873,342	人民币 12,529,778	2016年10月11日	4,228
美元 996,584	人民币 6,675,088	2016年10月11日	3,669
美元 2,098,373	人民币 14,021,097	2016年10月11日	2,670
美元 2,429,388	人民币 16,229,379	2016年10月11日	2,563
美元 1,420,052	人民币 9,493,674	2016年10月11日	2,562
美元 1,309,348	人民币 8,753,348	2016年10月11日	2,330
美元 3,113,171	人民币 20,786,852	2016年10月11日	1,711
美元 429,572	人民币 2,876,201	2016年10月11日	1,423
美元 1,176,241	人民币 7,854,407	2016年10月11日	731
美元 23,758	人民币 159,350	2016年10月11日	120
美元 9,926	人民币 66,578	2016年10月11日	51
美元 9,963	人民币 66,706	2016年10月11日	32
美元 7,643	人民币 51,184	2016年10月11日	27
美元 11,139	人民币 74,487	2016年10月11日	22
美元 4,166	人民币 27,938	2016年10月11日	20
美元 4,060	人民币 27,218	2016年10月11日	18
美元 9,540	人民币 63,749	2016年10月11日	13
美元 5,551	人民币 37,118	2016年10月11日	11
美元 5,547	人民币 37,085	2016年10月11日	10
美元 5,214	人民币 34,860	2016年10月11日	9
美元 1,295	人民币 8,696	2016年10月11日	8
美元 4,312	人民币 28,829	2016年10月11日	8
美元 1,377	人民币 9,220	2016年10月11日	4
美元 1,592	人民币 10,637	2016年10月11日	2
澳元 2,970,655	美元 2,282,533	2016年10月17日	9,684
澳元 1,432,496	美元 1,098,524	2016年10月17日	2,521
澳元 915,524	美元 702,003	2016年10月17日	1,535
澳元 4,515	美元 3,467	2016年10月17日	13
澳元 4,097	美元 3,141	2016年10月17日	7
加元 635,921	美元 495,354	2016年10月17日	11,433
加元 720,218	美元 559,018	2016年10月17日	10,948
加元 728,159	美元 563,187	2016年10月17日	9,075
加元 789,577	美元 606,215	2016年10月17日	5,365
加元 372,150	美元 288,460	2016年10月17日	5,263
加元 321,030	美元 248,859	2016年10月17日	4,562
加元 518,647	美元 398,533	2016年10月17日	3,854
加元 703,018	美元 536,885	2016年10月17日	1,904
加元 240,219	美元 184,517	2016年10月17日	1,716
加元 51,864	美元 40,133	2016年10月17日	666
加元 43,883	美元 33,911	2016年10月17日	517
加元 241,802	美元 184,356	2016年10月17日	350
加元 249,704	美元 190,197	2016年10月17日	178
加元 25,196	美元 19,345	2016年10月17日	172
加元 22,521	美元 17,217	2016年10月17日	79
加元 674,769	美元 513,538	2016年10月17日	54
加元 1,422	美元 1,107	2016年10月17日	26
加元 1,419	美元 1,100	2016年10月17日	20
加元 514,534	美元 391,567	2016年10月17日	18
加元 1,415	美元 1,094	2016年10月17日	17
加元 18,907	美元 14,404	2016年10月17日	16

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
加元 1,433	美元 1,096	2016年10月17日	5
加元 19,375	美元 14,745	2016年10月17日	1
加元 1,432	美元 1,091	2016年10月17日	1
英镑 102,786	美元 136,977	2016年10月17日	3,418
英镑 78,068	美元 102,282	2016年10月17日	841
英镑 24,046	美元 31,816	2016年10月17日	571
英镑 44,376	美元 58,190	2016年10月17日	528
英镑 19,749	美元 26,083	2016年10月17日	421
英镑 11,890	美元 15,834	2016年10月17日	384
英镑 13,613	美元 17,854	2016年10月17日	165
英镑 2,820	美元 3,698	2016年10月17日	33
英镑 840	美元 1,118	2016年10月17日	27
英镑 834	美元 1,100	2016年10月17日	16
英镑 841	美元 1,099	2016年10月17日	6
纽元 3,128,092	美元 2,323,416	2016年10月17日	49,919
纽元 632,635	美元 470,718	2016年10月17日	10,919
纽元 514,799	美元 377,779	2016年10月17日	3,623
纽元 957,129	美元 698,054	2016年10月17日	2,412
纽元 431,426	美元 315,374	2016年10月17日	1,813
纽元 510,966	美元 372,764	2016年10月17日	1,394
纽元 343,996	美元 251,123	2016年10月17日	1,107
纽元 145,560	美元 106,343	2016年10月17日	551
纽元 269,120	美元 196,138	2016年10月17日	542
纽元 161,848	美元 117,953	2016年10月17日	322
纽元 71,705	美元 52,412	2016年10月17日	296
纽元 17,213	美元 12,732	2016年10月17日	221
纽元 505,253	美元 367,356	2016年10月17日	137
纽元 16,071	美元 11,742	2016年10月17日	62
纽元 171,751	美元 124,885	2016年10月17日	57
纽元 1,485	美元 1,105	2016年10月17日	26
纽元 1,476	美元 1,096	2016年10月17日	24
纽元 3,372	美元 2,475	2016年10月17日	24
纽元 24,877	美元 18,103	2016年10月17日	23
纽元 1,505	美元 1,113	2016年10月17日	19
纽元 2,739	美元 2,007	2016年10月17日	17
纽元 2,696	美元 1,971	2016年10月17日	11
纽元 1,506	美元 1,104	2016年10月17日	9
纽元 1,503	美元 1,098	2016年10月17日	5
纽元 1,509	美元 1,100	2016年10月17日	3
美元 239,810,028	澳元 317,961,878	2016年10月17日	3,463,284
美元 558,972,689	人民币 3,744,558,045	2016年10月17日	1,909,743
美元 64,455,620	纽元 89,299,066	2016年10月17日	447,188
美元 124,229,615	人民币 832,172,697	2016年10月17日	418,216
美元 2,527,307	澳元 3,371,393	2016年10月17日	52,156
美元 1,758,645	澳元 2,344,158	2016年10月17日	34,877
美元 1,937,018	澳元 2,564,113	2016年10月17日	24,790
美元 3,431,888	澳元 4,515,541	2016年10月17日	22,957
美元 1,175,916	澳元 1,565,775	2016年10月17日	22,063
美元 1,444,111	澳元 1,915,132	2016年10月17日	21,161
美元 1,208,856	澳元 1,603,762	2016年10月17日	18,185
美元 2,791,403	加元 3,691,344	2016年10月17日	17,622
美元 1,886,606	纽元 2,618,733	2016年10月17日	16,698
美元 851,095	澳元 1,133,616	2016年10月17日	16,238
美元 1,791,873	澳元 2,357,600	2016年10月17日	11,929
美元 836,766	澳元 1,108,560	2016年10月17日	11,395
美元 2,208,630	人民币 14,820,444	2016年10月17日	11,266
美元 745,629	澳元 986,138	2016年10月17日	8,867
美元 910,481	澳元 1,201,557	2016年10月17日	8,831
美元 5,836,579	人民币 39,017,328	2016年10月17日	7,666
美元 1,628,108	人民币 10,916,941	2016年10月17日	7,098
美元 2,551,541	人民币 17,081,250	2016年10月17日	6,991
美元 299,099	澳元 399,534	2016年10月17日	6,586
美元 6,806,772	人民币 45,483,871	2016年10月17日	6,069
美元 1,665,133	澳元 2,183,783	2016年10月17日	5,681
美元 963,318	人民币 6,469,068	2016年10月17日	5,659

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 2,014,347	人民币 13,479,904	2016年10月17日	4,753
美元 2,211,657	人民币 14,795,540	2016年10月17日	4,507
美元 1,214,466	人民币 8,137,641	2016年10月17日	4,439
美元 1,050,207	人民币 7,039,856	2016年10月17日	4,265
美元 1,148,422	人民币 7,693,024	2016年10月17日	3,886
美元 891,339	人民币 5,974,942	2016年10月17日	3,624
美元 734,263	人民币 4,925,151	2016年10月17日	3,456
美元 876,535	美元 1,210,620	2016年10月17日	3,346
美元 967,123	人民币 6,478,892	2016年10月17日	3,324
美元 507,314	人民币 3,408,984	2016年10月17日	3,304
美元 751,975	人民币 5,039,057	2016年10月17日	2,806
美元 2,056,660	人民币 13,749,129	2016年10月17日	2,765
美元 212,631	澳元 280,867	2016年10月17日	2,261
美元 1,240,822	澳元 1,624,626	2016年10月17日	2,180
美元 1,052,756	加元 1,386,220	2016年10月17日	2,125
美元 683,597	人民币 4,575,736	2016年10月17日	1,784
美元 840,627	人民币 5,622,524	2016年10月17日	1,548
美元 545,948	人民币 3,654,843	2016年10月17日	1,496
美元 309,678	加元 408,581	2016年10月17日	1,243
美元 328,787	加元 433,668	2016年10月17日	1,224
美元 660,174	加元 869,076	2016年10月17日	1,173
美元 1,044,072	美元 1,438,135	2016年10月17日	1,165
美元 484,429	人民币 3,241,646	2016年10月17日	1,124
美元 801,989	人民币 5,360,945	2016年10月17日	1,005
美元 809,437	澳元 1,059,211	2016年10月17日	965
美元 211,063	人民币 1,413,939	2016年10月17日	725
美元 152,471	人民币 1,022,060	2016年10月17日	619
美元 445,861	人民币 2,980,658	2016年10月17日	600
美元 570,575	人民币 3,813,263	2016年10月17日	598
美元 117,738	美元 162,755	2016年10月17日	552
美元 421,341	澳元 551,309	2016年10月17日	465
美元 1,247,829	美元 1,717,490	2016年10月17日	443
美元 742,176	澳元 970,510	2016年10月17日	361
美元 327,459	美元 451,029	2016年10月17日	348
美元 275,799	英镑 212,514	2016年10月17日	342
美元 69,101	人民币 463,500	2016年10月17日	325
美元 42,149	英镑 32,521	2016年10月17日	110
美元 77,435	人民币 517,653	2016年10月17日	102
美元 110,863	人民币 740,800	2016年10月17日	99
美元 33,319	人民币 222,897	2016年10月17日	68
美元 3,338	澳元 4,428	2016年10月17日	50
美元 33,899	人民币 226,603	2016年10月17日	42
美元 10,748	人民币 72,000	2016年10月17日	36
美元 5,850	人民币 39,291	2016年10月17日	35
美元 1,741	澳元 2,318	2016年10月17日	33
美元 7,491	人民币 50,200	2016年10月17日	28
美元 4,557	人民币 30,600	2016年10月17日	27
美元 3,849	人民币 25,830	2016年10月17日	20
美元 13,188	英镑 10,163	2016年10月17日	17
美元 3,348	人民币 22,465	2016年10月17日	17
美元 4,492	人民币 30,100	2016年10月17日	16
美元 3,087	人民币 20,700	2016年10月17日	13
美元 3,061	人民币 20,519	2016年10月17日	12
美元 263,050	加元 345,687	2016年10月17日	10
美元 2,724	人民币 18,253	2016年10月17日	10
美元 1,369	人民币 9,200	2016年10月17日	9
美元 3,288	人民币 22,000	2016年10月17日	8
美元 2,988	人民币 20,000	2016年10月17日	8
美元 1,243	人民币 8,336	2016年10月17日	6
美元 5,985	人民币 40,000	2016年10月17日	6
美元 2,612	人民币 17,471	2016年10月17日	5
美元 1,663	人民币 11,120	2016年10月17日	3
美元 1,211	人民币 8,101	2016年10月17日	2
美元 521	人民币 3,484	2016年10月17日	1
新加坡元 68,125,000	美元 50,000,000	2016年10月19日	29,340



交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 775,613,301	人民币 5,206,885,991	2016年11月9日	3,085,740
美元 3,076,913	人民币 20,648,305	2016年11月9日	11,075
美元 3,439,622	人民币 23,034,737	2016年11月9日	5,247
美元 1,364,959	人民币 9,156,704	2016年11月9日	4,440
美元 1,080,467	人民币 7,250,703	2016年11月9日	3,887
美元 900,768	人民币 6,041,890	2016年11月9日	2,806
美元 1,079,623	人民币 7,235,146	2016年11月9日	2,403
美元 1,027,507	人民币 6,880,434	2016年11月9日	1,469
美元 78,343	人民币 524,645	2016年11月9日	118
美元 24,451	人民币 164,003	2016年11月9日	76
美元 1,666,211	人民币 11,141,761	2016年11月9日	47
美元 9,940	人民币 66,706	2016年11月9日	36
美元 5,521	人民币 37,085	2016年11月9日	25
美元 14,190	人民币 95,031	2016年11月9日	22
美元 7,467	人民币 50,000	2016年11月9日	11
美元 12,928	人民币 86,500	2016年11月9日	8
美元 1,517	人民币 10,165	2016年11月9日	3
美元 4,485	人民币 30,000	2016年11月9日	2
澳元 174,727	美元 133,899	2016年11月17日	302
澳元 45,036	美元 34,443	2016年11月17日	8
加元 27,610	美元 21,082	2016年11月17日	67
加元 49,478	美元 37,669	2016年11月17日	9
人民币 43,218	美元 6,461	2016年11月17日	1
纽元 154,881	美元 112,727	2016年11月17日	284
纽元 6,078	美元 4,417	2016年11月17日	4
纽元 149,688	美元 108,675	2016年11月17日	2
美元 560,184,028	人民币 3,760,239,211	2016年11月17日	1,880,893
美元 244,915,038	澳元 321,884,768	2016年11月17日	1,199,074
美元 120,108,253	人民币 806,227,487	2016年11月17日	403,280
美元 132,713,431	加元 174,583,059	2016年11月17日	170,556
美元 1,617,054	加元 2,143,268	2016年11月17日	14,291
美元 998,993	加元 1,324,145	2016年11月17日	8,878
美元 2,545,817	人民币 17,081,250	2016年11月17日	7,415
美元 1,645,098	人民币 11,038,544	2016年11月17日	4,896
美元 683,970	人民币 4,591,470	2016年11月17日	2,344
美元 1,146,924	人民币 7,687,464	2016年11月17日	2,162
美元 882,028	人民币 5,914,097	2016年11月17日	1,984
美元 544,724	人民币 3,654,843	2016年11月17日	1,587
美元 352,010	人民币 2,361,974	2016年11月17日	1,048
美元 112,895	纽元 156,145	2016年11月17日	467
美元 717,313	澳元 938,527	2016年11月17日	285
美元 680,734	澳元 890,525	2016年11月17日	162
美元 85,310	英镑 65,667	2016年11月17日	76
美元 594,413	人民币 3,976,914	2016年11月17日	34
美元 572,813	人民币 3,832,399	2016年11月17日	33
美元 6,115	人民币 41,000	2016年11月17日	14
美元 2,979	人民币 20,000	2016年11月17日	10
美元 4,625	人民币 31,000	2016年11月17日	9
美元 5,531	人民币 37,008	2016年11月17日	1
美元 7,279	人民币 48,699	2016年11月17日	0
林吉特 80,813,900	美元 19,900,000	2016年11月30日	362,273
林吉特 81,576,070	美元 19,900,000	2016年11月30日	178,009
美元 14,852,220	印度卢比 1,000,000,000	2016年11月30日	35,692
		未实现总收益	15,213,340
人民币 7,336	美元 1,097	2016年10月11日	(3)
人民币 20,234	美元 3,028	2016年10月11日	(4)
人民币 7,360	美元 1,098	2016年10月11日	(5)
人民币 7,364	美元 1,098	2016年10月11日	(6)
人民币 7,357	美元 1,097	2016年10月11日	(6)
人民币 23,041	美元 3,446	2016年10月11日	(7)
人民币 12,118	美元 1,809	2016年10月11日	(7)



交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
人民币 29,345	美元 4,388	2016 年 10 月 11 日	(10)
人民币 57,900	美元 8,665	2016 年 10 月 11 日	(12)
人民币 17,917	美元 2,673	2016 年 10 月 11 日	(12)
人民币 37,085	美元 5,539	2016 年 10 月 11 日	(18)
人民币 66,706	美元 9,969	2016 年 10 月 11 日	(27)
人民币 61,636	美元 9,190	2016 年 10 月 11 日	(46)
人民币 83,077	美元 12,389	2016 年 10 月 11 日	(60)
人民币 162,512	美元 24,290	2016 年 10 月 11 日	(62)
人民币 112,512	美元 16,789	2016 年 10 月 11 日	(71)
人民币 6,454,996	美元 966,244	2016 年 10 月 11 日	(1,029)
人民币 10,940,711	美元 1,637,007	2016 年 10 月 11 日	(2,444)
人民币 15,434,684	美元 2,309,994	2016 年 10 月 11 日	(2,873)
人民币 7,250,703	美元 1,083,583	2016 年 10 月 11 日	(2,925)
人民币 16,226,386	美元 2,428,245	2016 年 10 月 11 日	(3,257)
人民币 11,658,378	美元 1,743,583	2016 年 10 月 11 日	(3,410)
人民币 13,260,743	美元 1,982,748	2016 年 10 月 11 日	(4,356)
人民币 5,489,773	美元 817,428	2016 年 10 月 11 日	(5,208)
人民币 27,682,433	美元 4,142,681	2016 年 10 月 11 日	(5,494)
人民币 9,030,692	美元 1,347,657	2016 年 10 月 11 日	(5,580)
人民币 19,571,705	美元 2,927,017	2016 年 10 月 11 日	(5,776)
人民币 6,610,097	美元 984,058	2016 年 10 月 11 日	(6,456)
人民币 9,058,797	美元 1,350,322	2016 年 10 月 11 日	(7,126)
人民币 12,509,427	美元 1,866,594	2016 年 10 月 11 日	(7,927)
人民币 20,648,305	美元 3,085,961	2016 年 10 月 11 日	(8,159)
人民币 15,668,123	美元 2,339,466	2016 年 10 月 11 日	(8,381)
人民币 27,620,498	美元 4,128,396	2016 年 10 月 11 日	(10,498)
人民币 17,146,538	美元 2,556,807	2016 年 10 月 11 日	(12,578)
人民币 22,277,663	美元 3,324,222	2016 年 10 月 11 日	(14,056)
人民币 27,161,963	美元 4,055,471	2016 年 10 月 11 日	(14,713)
人民币 30,712,690	美元 4,587,414	2016 年 10 月 11 日	(14,841)
人民币 21,072,662	美元 3,142,582	2016 年 10 月 11 日	(15,128)
人民币 21,645,847	美元 3,227,070	2016 年 10 月 11 日	(16,531)
人民币 27,051,929	美元 4,035,313	2016 年 10 月 11 日	(18,382)
人民币 28,072,061	美元 4,185,631	2016 年 10 月 11 日	(20,930)
人民币 5,206,885,991	美元 777,640,442	2016 年 10 月 11 日	(2,604,409)
美元 4,008	人民币 26,741	2016 年 10 月 11 日	(1)
美元 1,793	人民币 11,950	2016 年 10 月 11 日	(3)
美元 1,528,240	人民币 10,193,055	2016 年 10 月 11 日	(824)
美元 4,291,998	人民币 28,633,388	2016 年 10 月 11 日	(1,323)
美元 1,799,321	人民币 11,988,351	2016 年 10 月 11 日	(2,883)
澳元 1,453	美元 1,110	2016 年 10 月 17 日	(1)
澳元 1,442	美元 1,102	2016 年 10 月 17 日	(2)
澳元 3,750	美元 2,859	2016 年 10 月 17 日	(10)
澳元 1,456	美元 1,103	2016 年 10 月 17 日	(11)
澳元 1,455	美元 1,099	2016 年 10 月 17 日	(15)
澳元 1,454	美元 1,091	2016 年 10 月 17 日	(22)
澳元 3,164	美元 2,392	2016 年 10 月 17 日	(28)
澳元 19,733	美元 14,794	2016 年 10 月 17 日	(303)
澳元 1,052,548	美元 804,851	2016 年 10 月 17 日	(454)
澳元 26,269	美元 19,602	2016 年 10 月 17 日	(497)
澳元 68,622	美元 51,845	2016 年 10 月 17 日	(658)
澳元 40,663	美元 30,445	2016 年 10 月 17 日	(666)
澳元 35,593	美元 26,556	2016 年 10 月 17 日	(676)
澳元 1,161,982	美元 888,096	2016 年 10 月 17 日	(937)
澳元 496,796	美元 377,605	2016 年 10 月 17 日	(2,494)
澳元 1,314,074	美元 1,001,863	2016 年 10 月 17 日	(3,535)
澳元 3,605,857	美元 2,754,156	2016 年 10 月 17 日	(4,685)
澳元 1,041,857	美元 791,948	2016 年 10 月 17 日	(5,177)
澳元 535,203	美元 403,473	2016 年 10 月 17 日	(6,011)
澳元 667,040	美元 503,572	2016 年 10 月 17 日	(6,780)
澳元 1,055,672	美元 799,824	2016 年 10 月 17 日	(7,871)
澳元 846,360	美元 639,406	2016 年 10 月 17 日	(8,144)
澳元 1,110,139	美元 839,476	2016 年 10 月 17 日	(9,892)
澳元 1,928,529	美元 1,461,422	2016 年 10 月 17 日	(14,096)
澳元 1,056,577	美元 793,262	2016 年 10 月 17 日	(15,125)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
澳元 1,017,211	美元 762,831	2016年10月17日	(15,437)
澳元 1,274,393	美元 957,156	2016年10月17日	(17,882)
澳元 2,093,243	美元 1,578,478	2016年10月17日	(23,062)
澳元 2,100,819	美元 1,583,538	2016年10月17日	(23,799)
澳元 6,312,292	美元 4,736,019	2016年10月17日	(93,515)
澳元 321,884,768	美元 245,086,603	2016年10月17日	(1,187,433)
加元 1,454	美元 1,102	2016年10月17日	(4)
加元 1,451	美元 1,097	2016年10月17日	(7)
加元 10,141	美元 7,708	2016年10月17日	(9)
加元 3,311	美元 2,510	2016年10月17日	(10)
加元 5,241	美元 3,974	2016年10月17日	(15)
加元 160,283	美元 121,734	2016年10月17日	(238)
加元 87,843	美元 66,582	2016年10月17日	(264)
加元 668,667	美元 508,328	2016年10月17日	(512)
加元 205,999	美元 156,140	2016年10月17日	(620)
加元 154,402	美元 116,762	2016年10月17日	(735)
加元 319,406	美元 242,170	2016年10月17日	(890)
加元 174,583,059	美元 132,686,087	2016年10月17日	(167,622)
人民币 7,346	美元 1,099	2016年10月17日	(1)
人民币 9,799	美元 1,466	2016年10月17日	(2)
人民币 7,361	美元 1,100	2016年10月17日	(2)
人民币 7,346	美元 1,099	2016年10月17日	(2)
人民币 10,083	美元 1,507	2016年10月17日	(3)
人民币 18,544	美元 2,774	2016年10月17日	(3)
人民币 7,336	美元 1,096	2016年10月17日	(3)
人民币 7,350	美元 1,098	2016年10月17日	(3)
人民币 7,366	美元 1,099	2016年10月17日	(4)
人民币 10,904	美元 1,629	2016年10月17日	(4)
人民币 7,366	美元 1,099	2016年10月17日	(4)
人民币 7,360	美元 1,098	2016年10月17日	(5)
人民币 7,332	美元 1,094	2016年10月17日	(5)
人民币 11,018	美元 1,643	2016年10月17日	(7)
人民币 20,784	美元 3,106	2016年10月17日	(7)
人民币 10,858	美元 1,620	2016年10月17日	(7)
人民币 71,694	美元 10,720	2016年10月17日	(19)
人民币 293,972	美元 43,967	2016年10月17日	(66)
人民币 410,323	美元 61,323	2016年10月17日	(138)
人民币 174,942	美元 26,035	2016年10月17日	(169)
人民币 872,838	美元 130,559	2016年10月17日	(180)
人民币 657,645	美元 98,321	2016年10月17日	(185)
人民币 1,438,982	美元 215,328	2016年10月17日	(211)
人民币 876,418	美元 130,956	2016年10月17日	(319)
人民币 625,166	美元 93,259	2016年10月17日	(382)
人民币 1,069,084	美元 159,733	2016年10月17日	(400)
人民币 1,312,834	美元 195,974	2016年10月17日	(670)
人民币 1,040,872	美元 155,215	2016年10月17日	(693)
人民币 2,698,103	美元 403,205	2016年10月17日	(932)
人民币 1,309,933	美元 195,211	2016年10月17日	(999)
人民币 1,666,882	美元 248,475	2016年10月17日	(1,200)
人民币 5,917,678	美元 885,164	2016年10月17日	(1,220)
人民币 3,654,843	美元 546,217	2016年10月17日	(1,226)
人民币 5,483,443	美元 820,115	2016年10月17日	(1,227)
人民币 8,698,976	美元 1,301,708	2016年10月17日	(1,275)
人民币 2,641,577	美元 394,078	2016年10月17日	(1,593)
人民币 2,867,546	美元 427,919	2016年10月17日	(1,599)
人民币 2,869,859	美元 428,155	2016年10月17日	(1,709)
人民币 11,348,569	美元 1,697,848	2016年10月17日	(2,007)
人民币 2,742,005	美元 408,210	2016年10月17日	(2,504)
人民币 3,294,389	美元 490,927	2016年10月17日	(2,526)
人民币 8,213,143	美元 1,227,456	2016年10月17日	(2,756)
人民币 10,117,823	美元 1,512,667	2016年10月17日	(2,839)
人民币 4,971,523	美元 741,189	2016年10月17日	(3,474)
人民币 10,631,856	美元 1,588,634	2016年10月17日	(3,868)
人民币 11,715,603	美元 1,750,782	2016年10月17日	(4,049)
人民币 7,600,473	美元 1,133,802	2016年10月17日	(4,641)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
人民币 9,100,134	美元 1,358,426	2016年10月17日	(4,645)
人民币 12,413,708	美元 1,854,749	2016年10月17日	(4,649)
人民币 4,941,692	美元 735,433	2016年10月17日	(4,762)
人民币 6,873,423	美元 1,024,737	2016年10月17日	(4,804)
人民币 9,496,861	美元 1,417,201	2016年10月17日	(5,294)
人民币 17,081,250	美元 2,552,797	2016年10月17日	(5,731)
人民币 8,675,156	美元 1,293,637	2016年10月17日	(5,778)
人民币 8,579,111	美元 1,278,851	2016年10月17日	(6,178)
人民币 10,969,121	美元 1,636,317	2016年10月17日	(6,701)
人民币 11,898,762	美元 1,775,179	2016年10月17日	(7,086)
人民币 12,126,201	美元 1,809,021	2016年10月17日	(7,312)
人民币 10,008,236	美元 1,489,953	2016年10月17日	(9,139)
人民币 14,284,495	美元 2,128,726	2016年10月17日	(10,889)
人民币 15,206,508	美元 2,266,059	2016年10月17日	(11,660)
人民币 806,227,487	美元 120,404,218	2016年10月17日	(357,216)
人民币 3,760,239,211	美元 561,564,409	2016年10月17日	(1,666,054)
英镑 1,680	美元 2,178	2016年10月17日	(5)
纽元 12,879	美元 9,359	2016年10月17日	(1)
纽元 3,038	美元 2,206	2016年10月17日	(2)
纽元 1,503	美元 1,087	2016年10月17日	(5)
纽元 569,205	美元 413,308	2016年10月17日	(390)
纽元 190,710	美元 138,099	2016年10月17日	(509)
纽元 160,977	美元 116,462	2016年10月17日	(536)
纽元 145,645	美元 104,950	2016年10月17日	(905)
美元 121,583	纽元 167,264	2016年10月17日	(16)
美元 110,933	纽元 152,555	2016年10月17日	(57)
美元 2,295	英镑 1,722	2016年10月17日	(57)
美元 68,988	纽元 94,823	2016年10月17日	(71)
美元 11,781	纽元 16,077	2016年10月17日	(97)
美元 13,937	英镑 10,631	2016年10月17日	(123)
美元 70,313	纽元 96,502	2016年10月17日	(175)
美元 81,389	纽元 111,569	2016年10月17日	(300)
美元 76,108	加元 99,559	2016年10月17日	(346)
美元 200,462	加元 262,938	2016年10月17日	(372)
美元 74,899	纽元 102,470	2016年10月17日	(424)
美元 14,323	英镑 10,657	2016年10月17日	(475)
美元 207,049	纽元 284,195	2016年10月17日	(496)
美元 92,526	纽元 126,604	2016年10月17日	(510)
美元 34,424	英镑 26,100	2016年10月17日	(510)
美元 115,181	纽元 157,763	2016年10月17日	(519)
美元 137,226	纽元 187,863	2016年10月17日	(687)
美元 29,336	英镑 22,019	2016年10月17日	(725)
美元 414,304	澳元 540,504	2016年10月17日	(764)
美元 149,207	纽元 204,109	2016年10月17日	(861)
美元 981,373	加元 1,288,327	2016年10月17日	(986)
美元 66,548	英镑 50,414	2016年10月17日	(1,040)
美元 154,946	英镑 118,262	2016年10月17日	(1,276)
美元 86,191	加元 111,445	2016年10月17日	(1,384)
美元 184,664	纽元 251,642	2016年10月17日	(1,772)
美元 108,287	纽元 146,487	2016年10月17日	(1,822)
美元 554,974	纽元 760,944	2016年10月17日	(1,921)
美元 879,145	澳元 1,146,450	2016年10月17日	(1,997)
美元 117,314	纽元 158,116	2016年10月17日	(2,397)
美元 535,474	加元 700,312	2016年10月17日	(2,553)
美元 130,042	英镑 98,039	2016年10月17日	(2,649)
美元 305,611	英镑 233,133	2016年10月17日	(2,677)
美元 882,863	澳元 1,150,393	2016年10月17日	(2,698)
美元 690,500	加元 903,778	2016年10月17日	(2,745)
美元 1,296,795	澳元 1,691,321	2016年10月17日	(2,766)
美元 174,815	纽元 236,401	2016年10月17日	(3,000)
美元 129,930	纽元 174,640	2016年10月17日	(3,003)
美元 205,551	加元 266,000	2016年10月17日	(3,131)
美元 359,262	加元 467,909	2016年10月17日	(3,194)
美元 346,831	加元 451,298	2016年10月17日	(3,403)
美元 398,499	加元 518,810	2016年10月17日	(3,696)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 235,948	加元 303,984	2016年10月17日	(4,622)
美元 1,422,652	澳元 1,853,226	2016年10月17日	(4,750)
美元 237,967	纽元 320,689	2016年10月17日	(4,893)
美元 219,449	加元 281,677	2016年10月17日	(5,099)
美元 438,389	加元 565,394	2016年10月17日	(8,136)
美元 367,196	加元 471,433	2016年10月17日	(8,445)
美元 455,016	加元 586,800	2016年10月17日	(8,474)
美元 2,083,560	加元 2,725,567	2016年10月17日	(9,465)
美元 458,525	英镑 344,491	2016年10月17日	(10,890)
美元 618,577	加元 797,949	2016年10月17日	(11,354)
美元 785,395	加元 1,014,972	2016年10月17日	(13,024)
美元 7,393,801	英镑 5,645,511	2016年10月17日	(58,007)
美元 125,953,218	加元 164,147,146	2016年10月17日	(1,040,881)
澳元 39,800,000	美元 29,774,380	2016年10月19日	(672,620)
人民币 163,675,000	美元 24,321,654	2016年10月19日	(191,234)
人民币 442,926,000	美元 65,808,781	2016年10月19日	(526,305)
日元 2,547,687,500	美元 25,000,000	2016年10月19日	(174,255)
日元 5,095,875,000	美元 50,000,000	2016年10月19日	(353,451)
纽元 25,000,000	美元 17,647,250	2016年10月19日	(522,750)
美元 15,334,000	澳元 20,000,000	2016年10月19日	(34,011)
人民币 14,636	美元 2,185	2016年11月9日	(4)
人民币 23,504	美元 3,509	2016年11月9日	(6)
人民币 15,772	美元 2,352	2016年11月9日	(7)
人民币 59,562	美元 8,878	2016年11月9日	(29)
人民币 5,582,632	美元 834,827	2016年11月9日	(59)
人民币 2,836,803	美元 424,096	2016年11月9日	(149)
人民币 1,398,669	美元 208,659	2016年11月9日	(513)
人民币 2,113,037	美元 315,240	2016年11月9日	(766)
人民币 2,876,201	美元 428,216	2016年11月9日	(1,922)
人民币 14,361,315	美元 2,144,171	2016年11月9日	(3,572)
人民币 14,299,414	美元 2,133,873	2016年11月9日	(4,613)
人民币 9,857,235	美元 1,469,128	2016年11月9日	(5,028)
人民币 11,324,583	美元 1,688,488	2016年11月9日	(5,110)
澳元 1,435	美元 1,097	2016年11月17日	(0)
澳元 343,040	美元 262,212	2016年11月17日	(77)
澳元 1,715,939	美元 1,311,714	2016年11月17日	(293)
加元 17,570	美元 13,256	2016年11月17日	(117)
加元 320,544	美元 241,813	2016年11月17日	(2,169)
人民币 7,358	美元 1,100	2016年11月17日	(0)
人民币 7,339	美元 1,097	2016年11月17日	(0)
人民币 43,218	美元 6,459	2016年11月17日	(1)
人民币 7,349	美元 1,097	2016年11月17日	(2)
人民币 7,343	美元 1,094	2016年11月17日	(4)
人民币 20,141	美元 3,000	2016年11月17日	(10)
人民币 201,476	美元 30,047	2016年11月17日	(69)
人民币 8,278,107	美元 1,237,198	2016年11月17日	(168)
人民币 884,996	美元 132,095	2016年11月17日	(189)
人民币 8,820,629	美元 1,318,182	2016年11月17日	(278)
人民币 1,053,108	美元 157,089	2016年11月17日	(323)
人民币 1,021,985	美元 152,410	2016年11月17日	(350)
人民币 2,133,453	美元 318,367	2016年11月17日	(530)
人民币 1,602,175	美元 238,650	2016年11月17日	(834)
人民币 6,296,799	美元 939,278	2016年11月17日	(1,934)
人民币 6,802,468	美元 1,014,464	2016年11月17日	(2,333)
人民币 4,512,805	美元 672,201	2016年11月17日	(2,349)
英镑 848	美元 1,102	2016年11月17日	(0)
英镑 848	美元 1,102	2016年11月17日	(0)
纽元 91,081	美元 65,854	2016年11月17日	(270)
美元 300,020	澳元 392,317	2016年11月17日	(54)
美元 636,205	加元 835,761	2016年11月17日	(65)
美元 146,784	纽元 201,694	2016年11月17日	(355)
美元 1,319,616	纽元 1,816,080	2016年11月17日	(1,144)
美元 943,080	澳元 1,230,693	2016年11月17日	(2,094)
美元 1,144,615	加元 1,498,994	2016年11月17日	(3,654)
印尼盾 336,875,000,000	美元 25,000,000	2016年11月30日	(732,972)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
印度卢比 1,539,452,500	美元 22,900,000	2016年11月30日	(18,751)
印度卢比 2,016,268,000	美元 29,800,000	2016年11月30日	(217,389)
美元 15,515,152	林吉特 64,000,000	2016年11月30日	(42,394)
美元 11,663,224	林吉特 48,000,000	2016年11月30日	(58,662)
印尼盾 618,274,200,000	美元 46,746,877	2016年12月2日	(468,886)
韩元 14,791,400,000	美元 13,385,519	2016年12月2日	(32,542)
美元 19,230,769	印尼盾 250,000,000,000	2016年12月2日	(139,477)
		未实现总亏损	(12,086,268)
		未实现净收益	3,127,072

2015

未平仓合约:

美元 270,934,395	人民币 1,757,009,554	2015年10月9日	5,094,984
美元 270,936,135	人民币 1,757,010,000	2015年10月9日	5,093,314
美元 270,975,165	人民币 1,756,984,000	2015年10月9日	5,050,200
美元 271,038,202	人民币 1,757,001,000	2015年10月9日	4,989,832
美元 6,512,927	人民币 42,228,580	2015年10月9日	121,259
美元 3,706,362	人民币 24,302,106	2015年10月9日	111,543
美元 3,429,756	人民币 22,257,588	2015年10月9日	66,952
美元 3,245,405	人民币 21,046,705	2015年10月9日	61,070
美元 1,965,047	人民币 12,875,982	2015年10月9日	57,793
美元 2,035,935	人民币 13,203,009	2015年10月9日	38,281
美元 1,496,380	人民币 9,723,850	2015年10月9日	31,255
美元 1,212,142	人民币 7,913,859	2015年10月9日	31,139
美元 1,616,762	人民币 10,488,741	2015年10月9日	31,039
美元 1,249,010	人民币 8,096,111	2015年10月9日	22,903
美元 2,627,103	人民币 16,861,468	2015年10月9日	21,864
美元 1,070,158	人民币 6,934,130	2015年10月9日	19,207
美元 2,183,330	人民币 14,015,405	2015年10月9日	18,516
美元 859,576	人民币 5,564,836	2015年10月9日	14,669
美元 1,695,725	人民币 10,878,583	2015年10月9日	13,320
美元 522,669	人民币 3,405,634	2015年10月9日	12,363
美元 899,992	人民币 5,805,221	2015年10月9日	12,018
美元 568,496	人民币 3,689,280	2015年10月9日	11,096
美元 677,722	人民币 4,383,547	2015年10月9日	10,941
美元 994,821	人民币 6,395,475	2015年10月9日	9,920
美元 1,147,592	人民币 7,362,855	2015年10月9日	9,126
美元 570,393	人民币 3,685,261	2015年10月9日	8,569
美元 1,057,324	人民币 6,783,798	2015年10月9日	8,423
美元 394,818	人民币 2,562,686	2015年10月9日	7,784
美元 199,495	人民币 1,307,190	2015年10月9日	5,867
美元 615,080	人民币 3,949,337	2015年10月9日	5,368
美元 1,155,249	人民币 7,387,630	2015年10月9日	5,361
美元 39,076	人民币 256,318	2015年10月9日	1,192
美元 80,367	人民币 518,393	2015年10月9日	1,073
美元 19,180	人民币 124,387	2015年10月9日	361
美元 12,265	人民币 79,595	2015年10月9日	239
美元 15,478	人民币 100,000	2015年10月9日	233
美元 8,684	人民币 56,356	2015年10月9日	170
美元 14,895	人民币 95,567	2015年10月9日	119
美元 7,437	人民币 48,048	2015年10月9日	112
美元 1,346	人民币 8,828	2015年10月9日	41
澳元 29,640,246	美元 21,898,213	2015年10月15日	1,099,653
澳元 15,000,000	美元 11,007,450	2015年10月15日	481,950
人民币 152,395,200	美元 24,000,000	2015年10月15日	78,735
林吉特 62,653,500	美元 16,200,000	2015年10月15日	1,943,720
纽元 41,689,297	美元 27,648,341	2015年10月15日	1,004,712
纽元 9,000,000	美元 5,971,230	2015年10月15日	219,330
新加坡元 18,843,000	美元 13,829,420	2015年10月15日	583,023

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
新加坡元 17,214,850	美元 12,567,877	2015年10月15日	466,050
新加坡元 6,783,000	美元 4,976,303	2015年10月15日	207,938
澳元 221,021,404	美元 155,279,913	2015年10月16日	189,194
澳元 528,777	美元 381,756	2015年10月16日	10,714
澳元 607,604	美元 433,491	2015年10月16日	7,136
澳元 497,004	美元 354,795	2015年10月16日	6,047
澳元 471,050	美元 335,920	2015年10月16日	5,385
澳元 310,305	美元 222,847	2015年10月16日	5,105
澳元 768,228	美元 543,800	2015年10月16日	4,735
澳元 1,021,823	美元 720,671	2015年10月16日	3,658
澳元 249,872	美元 178,102	2015年10月16日	2,767
澳元 402,089	美元 284,587	2015年10月16日	2,441
澳元 180,044	美元 128,476	2015年10月16日	2,139
澳元 444,069	美元 313,021	2015年10月16日	1,418
澳元 69,710	美元 49,671	2015年10月16日	755
澳元 17,937	美元 12,635	2015年10月16日	49
澳元 2,301	美元 1,640	2015年10月16日	25
澳元 709,303	美元 497,742	2015年10月16日	24
澳元 1,558	美元 1,112	2015年10月16日	19
澳元 1,540	美元 1,099	2015年10月16日	18
澳元 1,539	美元 1,089	2015年10月16日	9
加元 4,669,266	美元 3,525,910	2015年10月16日	43,463
加元 1,541,481	美元 1,158,340	2015年10月16日	8,667
加元 1,038,206	美元 782,385	2015年10月16日	8,067
加元 424,684	美元 324,228	2015年10月16日	7,489
加元 731,935	美元 552,061	2015年10月16日	6,167
加元 347,442	美元 263,487	2015年10月16日	4,357
加元 351,435	美元 266,433	2015年10月16日	4,324
加元 626,028	美元 470,869	2015年10月16日	3,962
加元 313,832	美元 237,694	2015年10月16日	3,631
加元 570,778	美元 428,996	2015年10月16日	3,297
加元 347,843	美元 262,584	2015年10月16日	3,155
加元 343,998	美元 259,426	2015年10月16日	2,865
加元 235,336	美元 177,978	2015年10月16日	2,458
加元 246,985	美元 186,263	2015年10月16日	2,055
加元 85,150	美元 64,062	2015年10月16日	555
加元 58,903	美元 44,439	2015年10月16日	507
加元 9,805	美元 7,372	2015年10月16日	59
加元 6,510	美元 4,899	2015年10月16日	44
加元 1,849	美元 1,395	2015年10月16日	16
加元 1,457	美元 1,102	2015年10月16日	15
加元 1,458	美元 1,099	2015年10月16日	11
加元 1,826	美元 1,372	2015年10月16日	10
加元 1,455	美元 1,093	2015年10月16日	8
加元 1,462	美元 1,095	2015年10月16日	5
英镑 2,073	美元 3,172	2015年10月16日	32
英镑 1,089	美元 1,678	2015年10月16日	29
英镑 708	美元 1,089	2015年10月16日	16
英镑 1,516	美元 2,313	2015年10月16日	16
英镑 2,496	美元 3,791	2015年10月16日	10
英镑 1,050	美元 1,599	2015年10月16日	8
英镑 2,840	美元 4,310	2015年10月16日	7
纽元 204,797	美元 132,027	2015年10月16日	1,162
纽元 157,870	美元 101,740	2015年10月16日	861
纽元 161,952	美元 104,168	2015年10月16日	681
纽元 413,087	美元 264,633	2015年10月16日	670
纽元 1,704	美元 1,098	2015年10月16日	9
纽元 1,739	美元 1,114	2015年10月16日	3
美元 58,915,485	纽元 93,298,295	2015年10月16日	702,895
美元 149,941,007	澳元 214,586,468	2015年10月16日	634,815
美元 1,028,091	纽元 1,642,746	2015年10月16日	21,647
美元 662,394	澳元 957,600	2015年10月16日	9,561
美元 589,099	纽元 932,546	2015年10月16日	6,806
美元 280,921	纽元 445,760	2015年10月16日	3,924
美元 1,307,066	澳元 1,867,738	2015年10月16日	3,529

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
美元 455,158	纽元 716,907	2015年10月16日	2,949
美元 153,550	纽元 244,357	2015年10月16日	2,597
美元 163,018	澳元 235,790	2015年10月16日	2,438
美元 427,015	澳元 611,696	2015年10月16日	2,214
美元 173,218	纽元 274,495	2015年10月16日	2,187
美元 1,385,387	纽元 2,170,898	2015年10月16日	1,819
美元 92,664	纽元 147,652	2015年10月16日	1,688
美元 130,031	纽元 205,827	2015年10月16日	1,494
美元 337,810	澳元 483,289	2015年10月16日	1,315
美元 146,793	纽元 231,488	2015年10月16日	1,129
美元 66,514	纽元 105,620	2015年10月16日	978
美元 173,616	纽元 273,194	2015年10月16日	956
美元 27,143	纽元 43,272	2015年10月16日	509
美元 44,613	纽元 70,573	2015年10月16日	484
美元 1,709,107	澳元 2,436,274	2015年10月16日	427
美元 23,170	纽元 36,790	2015年10月16日	340
美元 73,240	澳元 104,490	2015年10月16日	80
美元 33,370	澳元 47,602	2015年10月16日	32
人民币 12,351,033	美元 1,936,858	2015年11月17日	6,617
人民币 58,475	美元 9,170	2015年11月17日	31
美元 481,908,234	人民币 3,098,189,000	2015年11月17日	2,294,141
美元 482,171,143	人民币 3,098,189,230	2015年11月17日	2,029,887
美元 6,246,451	人民币 40,332,095	2015年11月17日	57,018
美元 1,911,740	人民币 12,382,400	2015年11月17日	23,526
美元 4,762,718	人民币 30,620,780	2015年11月17日	22,871
美元 1,910,603	人民币 12,328,383	2015年11月17日	16,183
美元 2,235,246	人民币 14,392,402	2015年11月17日	14,098
美元 1,399,680	人民币 9,005,300	2015年11月17日	7,725
美元 25,466	人民币 164,405	2015年11月17日	229
美元 15,926	人民币 101,967	2015年11月17日	10
澳元 615,511	美元 431,588	2015年11月19日	485
澳元 3,013	美元 2,111	2015年11月19日	1
加元 416,029	美元 310,595	2015年11月19日	356
加元 3,022	美元 2,254	2015年11月19日	0
纽元 1,726	美元 1,101	2015年11月19日	0
美元 84,064	澳元 120,234	2015年11月19日	148
美元 30,980	纽元 48,783	2015年11月19日	115
美元 26,686	加元 35,798	2015年11月19日	9
		未实现总收益	33,315,219
人民币 19,476,329	美元 2,963,081	2015年10月9日	(96,685)
人民币 21,740,540	美元 3,385,908	2015年10月9日	(29,570)
人民币 25,170,438	美元 3,919,585	2015年10月9日	(34,736)
人民币 31,705,303	美元 4,942,139	2015年10月9日	(38,821)
人民币 23,753,607	美元 3,692,087	2015年10月9日	(39,648)
人民币 31,017,122	美元 4,829,214	2015年10月9日	(43,632)
人民币 15,268,647	美元 2,352,352	2015年10月9日	(46,380)
人民币 16,098,188	美元 2,481,963	2015年10月9日	(47,091)
人民币 18,566,016	美元 2,863,098	2015年10月9日	(53,656)
人民币 15,884,859	美元 2,436,795	2015年10月9日	(58,744)
人民币 26,510,778	美元 4,097,303	2015年10月9日	(67,588)
人民币 7,042	美元 1,097	2015年10月9日	(9)
人民币 30,620,780	美元 4,781,771	2015年10月9日	(28,808)
人民币 45,342,655	美元 7,029,542	2015年10月9日	(93,870)
人民币 26,723,823	美元 4,136,226	2015年10月9日	(62,135)
人民币 49,303,167	美元 7,606,753	2015年10月9日	(138,863)
人民币 44,499,792	美元 6,847,966	2015年10月9日	(143,031)
人民币 64,810,788	美元 9,999,844	2015年10月9日	(182,047)
人民币 41,220,595	美元 6,286,119	2015年10月9日	(189,710)
人民币 48,376,248	美元 7,409,647	2015年10月9日	(190,348)
人民币 50,699,494	美元 7,774,251	2015年10月9日	(190,730)
人民币 47,589,346	美元 7,262,771	2015年10月9日	(213,600)
人民币 81,772,537	美元 12,605,368	2015年10月9日	(241,243)



交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
人民币 87,566,613	美元 13,502,475	2015 年 10 月 9 日	(254,397)
人民币 124,760,582	美元 19,012,005	2015 年 10 月 9 日	(588,105)
人民币 3,098,189,230	美元 483,868,732	2015 年 10 月 9 日	(2,862,331)
人民币 3,098,189,000	美元 483,766,849	2015 年 10 月 9 日	(2,964,177)
人民币 30,160,521	美元 4,647,559	2015 年 10 月 9 日	(90,713)
人民币 7,121	美元 1,099	2015 年 10 月 9 日	(21)
人民币 7,111	美元 1,108	2015 年 10 月 9 日	(9)
人民币 31,197,396	美元 4,815,296	2015 年 10 月 9 日	(85,870)
人民币 7,038	美元 1,094	2015 年 10 月 9 日	(12)
人民币 10,743,687	美元 1,663,558	2015 年 10 月 9 日	(24,295)
人民币 7,092	美元 1,093	2015 年 10 月 9 日	(21)
人民币 7,144	美元 1,094	2015 年 10 月 9 日	(28)
人民币 11,891	美元 1,840	2015 年 10 月 9 日	(28)
人民币 12,659	美元 1,957	2015 年 10 月 9 日	(32)
人民币 25,078	美元 3,905	2015 年 10 月 9 日	(35)
人民币 48,880	美元 7,487	2015 年 10 月 9 日	(192)
人民币 86,965	美元 13,423	2015 年 10 月 9 日	(239)
人民币 101,677	美元 15,698	2015 年 10 月 9 日	(275)
人民币 97,922	美元 15,101	2015 年 10 月 9 日	(283)
人民币 79,887	美元 12,255	2015 年 10 月 9 日	(295)
人民币 445,922	美元 68,760	2015 年 10 月 9 日	(1,295)
人民币 7,044	美元 1,097	2015 年 10 月 9 日	(10)
人民币 18,579,470	美元 2,894,954	2015 年 10 月 9 日	(23,913)
人民币 24,249,098	美元 3,790,817	2015 年 10 月 9 日	(18,760)
人民币 4,360,506	美元 671,798	2015 年 10 月 9 日	(13,245)
人民币 2,916,963	美元 447,287	2015 年 10 月 9 日	(10,974)
人民币 101,829	美元 15,615	2015 年 10 月 9 日	(383)
人民币 472,820	美元 72,859	2015 年 10 月 9 日	(1,422)
人民币 231,346	美元 35,280	2015 年 10 月 9 日	(1,065)
人民币 148,730	美元 22,698	2015 年 10 月 9 日	(668)
人民币 129,280	美元 19,668	2015 年 10 月 9 日	(642)
人民币 144,363	美元 22,274	2015 年 10 月 9 日	(405)
人民币 85,074	美元 12,964	2015 年 10 月 9 日	(401)
人民币 3,062,880	美元 472,148	2015 年 10 月 9 日	(9,036)
澳元 278,071	美元 194,184	2015 年 10 月 16 日	(938)
澳元 2,875,531	美元 1,988,039	2015 年 10 月 16 日	(29,722)
澳元 1,236,038	美元 865,563	2015 年 10 月 16 日	(1,764)
澳元 19,815	美元 13,856	2015 年 10 月 16 日	(48)
澳元 3,410	美元 2,386	2015 年 10 月 16 日	(6)
澳元 4,641	美元 3,253	2015 年 10 月 16 日	(3)
澳元 6,244	美元 4,320	2015 年 10 月 16 日	(62)
澳元 275,281	美元 190,442	2015 年 10 月 16 日	(2,722)
纽元 1,715	美元 1,080	2015 年 10 月 16 日	(16)
纽元 102,492	美元 64,791	2015 年 10 月 16 日	(702)
纽元 117,362	美元 74,511	2015 年 10 月 16 日	(483)
纽元 29,818	美元 18,631	2015 年 10 月 16 日	(423)
纽元 32,279	美元 20,282	2015 年 10 月 16 日	(345)
纽元 13,967	美元 8,765	2015 年 10 月 16 日	(160)
纽元 22,184	美元 14,023	2015 年 10 月 16 日	(153)
纽元 4,790	美元 2,993	2015 年 10 月 16 日	(67)
纽元 67,691	美元 43,201	2015 年 10 月 16 日	(54)
纽元 1,736	美元 1,091	2015 年 10 月 16 日	(18)
纽元 1,715	美元 1,080	2015 年 10 月 16 日	(16)
纽元 1,701	美元 1,075	2015 年 10 月 16 日	(12)
纽元 1,756	美元 1,114	2015 年 10 月 16 日	(9)
纽元 1,746	美元 1,110	2015 年 10 月 16 日	(6)
纽元 321,733	美元 204,469	2015 年 10 月 16 日	(1,118)
纽元 1,718	美元 1,075	2015 年 10 月 16 日	(23)
纽元 194,159	美元 122,715	2015 年 10 月 16 日	(1,353)
纽元 164,036	美元 102,914	2015 年 10 月 16 日	(1,905)
纽元 176,573	美元 110,156	2015 年 10 月 16 日	(2,675)
纽元 608,175	美元 384,697	2015 年 10 月 16 日	(3,927)
纽元 328,525	美元 205,836	2015 年 10 月 16 日	(4,091)
纽元 451,616	美元 282,628	2015 年 10 月 16 日	(5,954)
纽元 105,775	美元 66,759	2015 年 10 月 16 日	(831)



交付合约	折算额	交割日期	未实现收益 / (亏损) 美元
纽元 97,091	美元 61,167	2015年10月16日	(874)
美元 528,032	澳元 739,744	2015年10月16日	(8,961)
美元 222,957	澳元 312,536	2015年10月16日	(3,654)
美元 244,638	澳元 343,344	2015年10月16日	(3,717)
美元 535,191	澳元 756,107	2015年10月16日	(4,635)
美元 1,642,688	澳元 2,331,736	2015年10月16日	(6,514)
美元 256,805	澳元 355,675	2015年10月16日	(7,233)
美元 147,300	澳元 206,756	2015年10月16日	(2,221)
美元 562,302	澳元 788,992	2015年10月16日	(8,673)
美元 298,046	澳元 415,129	2015年10月16日	(6,755)
美元 1,986,847	澳元 2,818,607	2015年10月16日	(9,038)
美元 593,502	澳元 834,066	2015年10月16日	(8,245)
美元 541,541	澳元 771,545	2015年10月16日	(147)
美元 785,759	加元 1,040,832	2015年10月16日	(9,483)
美元 5,078	加元 6,705	2015年10月16日	(77)
美元 5,803	加元 7,700	2015年10月16日	(60)
美元 505,326	加元 670,249	2015年10月16日	(5,439)
美元 342,508	加元 452,011	2015年10月16日	(5,388)
美元 50,674	加元 67,037	2015年10月16日	(676)
美元 66,430	加元 88,623	2015年10月16日	(332)
美元 5,696	加元 7,513	2015年10月16日	(93)
美元 797,061	加元 1,064,006	2015年10月16日	(3,501)
美元 437,686	加元 579,889	2015年10月16日	(5,191)
美元 127,705	加元 168,393	2015年10月16日	(2,114)
美元 181,232	加元 240,510	2015年10月16日	(1,855)
美元 135,466	加元 179,690	2015年10月16日	(1,449)
美元 120,437	加元 159,637	2015年10月16日	(1,376)
美元 113,472,439	加元 150,380,462	2015年10月16日	(1,315,271)
美元 78,632	加元 103,836	2015年10月16日	(1,188)
美元 90,852	加元 120,351	2015年10月16日	(1,091)
美元 131,790	加元 175,299	2015年10月16日	(1,048)
美元 29,650	加元 38,836	2015年10月16日	(685)
美元 666,922	加元 884,242	2015年10月16日	(7,434)
美元 2,029	英镑 1,329	2015年10月16日	(16)
美元 2,135	英镑 1,388	2015年10月16日	(33)
美元 5,300	英镑 3,420	2015年10月16日	(120)
美元 756,993	英镑 495,970	2015年10月16日	(5,747)
美元 521,520	英镑 341,132	2015年10月16日	(4,808)
美元 92,872	英镑 60,511	2015年10月16日	(1,216)
美元 81,443	纽元 126,622	2015年10月16日	(532)
美元 89,882	纽元 139,802	2015年10月16日	(549)
美元 57,129	纽元 89,173	2015年10月16日	(148)
人民币 62,555,000	美元 9,731,491	2015年10月19日	(82,135)
人民币 249,672,000	美元 38,829,842	2015年10月19日	(338,694)
印尼盾 433,225,000,000	美元 28,899,006	2015年10月30日	(357,014)
印尼盾 675,800,000,000	美元 45,080,382	2015年10月30日	(556,917)
人民币 17,406,759	美元 2,719,900	2015年11月17日	(459)
人民币 31,603,628	美元 4,904,547	2015年11月17日	(34,523)
人民币 13,918,320	美元 2,154,754	2015年11月17日	(20,425)
人民币 16,861,468	美元 2,616,344	2015年11月17日	(18,796)
人民币 6,785,716	美元 1,051,083	2015年11月17日	(9,401)
人民币 5,241,707	美元 814,186	2015年11月17日	(4,997)
人民币 7,276,645	美元 1,136,492	2015年11月17日	(714)
人民币 27,198,832	美元 4,197,422	2015年11月17日	(53,259)
人民币 205,005	美元 31,728	2015年11月17日	(310)
人民币 102,893	美元 15,968	2015年11月17日	(112)
人民币 7,044	美元 1,091	2015年11月17日	(10)
人民币 82,277	美元 12,856	2015年11月17日	(2)
人民币 1,512,791	美元 234,769	2015年11月17日	(1,653)
美元 1,565,339	人民币 9,982,878	2015年11月17日	(5,225)
澳元 5,447	美元 3,808	2015年11月19日	(7)
澳元 705,045	美元 492,520	2015年11月19日	(1,294)
加元 1,471	美元 1,096	2015年11月19日	(1)
加元 462,387	美元 344,675	2015年11月19日	(132)
英镑 2,485	美元 3,762	2015年11月19日	(2)

交付合约	折算额	交割日期	未实现收益／（亏损） 美元
英镑 1,869	美元 2,831	2015 年 11 月 19 日	(0)
纽元 271,250	美元 172,745	2015 年 11 月 19 日	(150)
纽元 301,016	美元 191,036	2015 年 11 月 19 日	(832)
纽元 9,024	美元 5,729	2015 年 11 月 19 日	(23)
美元 87,143	澳元 124,401	2015 年 11 月 19 日	(12)
美元 155,001,426	澳元 221,021,404	2015 年 11 月 19 日	(198,558)
美元 35,714	加元 47,891	2015 年 11 月 19 日	(1)
美元 505,237	纽元 792,373	2015 年 11 月 19 日	(179)
印度卢比 3,960,492,000	美元 59,195,313	2015 年 12 月 4 日	(624,525)
韩元 14,791,400,000	美元 12,385,203	2015 年 12 月 4 日	(51,695)
林吉特 91,387,500	美元 20,693,227	2015 年 12 月 4 日	(68,166)
		未实现总亏损	(13,121,937)
		未实现净收益	20,193,282

(b) 以下为截至九月三十日之未平仓期货合约：

	合约数多头／（空头）	合约金额 美元	交割日期	未实现收益／（亏损） 美元
<u>2016</u>				
US 10 Years Note (CBT)	(2,666)	(348,825,406)	2016 年 12 月	(753,844)
<u>2015</u>				
US 5 Years Note (CBT)	(400)	(47,843,750)	2015 年 12 月	(362,500)

## 独立核数师报告

致摩根亚洲总收益债券基金（“本基金”）份额持有人

### 财务报表的报告

本核数师（以下简称“我们”）已审计刊载于第八页至第四十三页的本基金财务报表，此财务报表包括于二零一六年九月三十日的财务状况报表、截至二零一六年九月三十日止年度的综合收益表、可赎回份额持有人应占净资产变动表及现金流量表，以及主要会计政策概要及其他附注解释资料。

### 管理层就财务报表须承担的责任

本基金受托人及管理人（“管理层”）须负责根据香港会计师公会颁布的香港财务报告准则编制财务报表，以令财务报表作出真实而公平的反映，并负责确保财务报表已遵照二零零四年十一月三十日订立的信托契约（经修订）（“信托契约”）的相关披露条文，以及香港证券及期货事务监察委员会所颁布的单位信托及互惠基金守则（“证监会守则”）附录 E 而妥为编制，及落实其认为编制财务报表所必要的内部控制，以使财务报表不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述。

### 核数师的责任

我们的责任是根据我们的审计对该等财务报表作出意见，并向份额持有人（作为整体）报告，除此之外本报告别无其他目的。我们不会就本报告的内容向任何其他人士负上或承担任何责任。

我们已根据香港会计师公会颁布的香港审计准则进行审核。该等准则要求本核数师遵守道德规范，并规划及执行审计，以合理确定财务报表是否存在任何重大错误陈述。我们也需要评估该基金的财务报表在所有重大方面是否已按照信托契约的相关披露条文及证监会守则而妥为编制。

审计涉及执行程序以获取有关财务报表所载金额及披露资料的审计凭证。所选定的程序取决于核数师的判断，包括评估由于欺诈或错误而导致财务报表存在重大错误陈述的风险。在评估该等风险时，核数师考虑与本基金编制财务报表以作出真实而公平的反映相关的内部控制，以设计适当的审计程序，但目的并非对本基金内部控制的有效性发表意见。审计亦包括评价管理层所采用会计政策的合适性及作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的整体列报方式。

我们相信，我们所获得的审计凭证能充足和适当地为我们的审计意见提供基础。

### 意见

我们认为，该等财务报表已根据香港财务报告准则真实而公平地反映本基金于二零一六年九月三十日的财政状况及截至该日止年度的财务交易及现金流量。

## 有关其他法律及监管规定的报告

我们认为，财务报表已在所有重大方面根据信托契约的相关披露条文及证监会守则所载有关披露规定而妥为编制。

罗兵咸永道会计师事务所  
执业会计师  
香港

二零一七年一月十六日

**管理人及受托人的责任声明**

**管理人的责任**

基金管理人必遵照香港证券及期货事务监察委员会所颁布的单位信托及互惠基金守则信托契约编制各年度会计期间的财务报表, 该等财务报表真实而公平地反映基金于该期末的财务状况及截至该日止年度的财务交易。编制该等财务报表时, 管理人务必:

- 选择并贯彻地应用适当的会计政策;
- 作出审慎和合理的判断; 及
- 按持续运营的基准编制财务报表, 除非该假设不恰当。

管理人亦必遵照信托契约, 采取合理措施预防和检测舞弊及其他不法行为。

**受托人的责任**

基金受托人务必:

- 确保管理人遵照信托契约管理本基金且确保投资及借款能力符合要求;
- 确保充分的会计记录及其他以往记录;
- (在合理可行的情况下) 保护本基金的财产及附带权利; 及
- 就每一个会计年度, 若管理人未按照信托契约管理本基金, 则须向份额持有人报告。

**受托人对份额持有人的报告**

本受托人谨确认管理人于截至二零一六年九月三十日止财政年度在各个重要方面均依照二零零四年十一月三十日所订立之信托契约(经修订)之条款管理本基金。

汇丰机构信托服务(亚洲)有限公司, 受托人  
二零一七年一月十六日

**业绩记录 - 未经审计**

**资产净值**

财务期结算日	本基金资产净值	每份额资产净值
30/9/16 - 澳元对冲类别(每月派息) - 加元对冲类别(每月派息) - 英镑对冲类别(每月派息) - 港元类别(每月派息) - 纽元对冲类别(每月派息) - 人民币对冲类别(累计) - 人民币对冲类别(每月派息) - 美元类别(累计) - 美元类别(每月派息) - *PRC人民币对冲份额(累计) - *PRC人民币对冲份额(每月派息) - *PRC美元份额(累计) - PRC美元份额(每月派息)	澳元 321,280,527 加元 179,196,989 英镑 6,555,386 港元 4,722,528,266 纽元 92,826,121 人民币 21,105,857 人民币 5,166,107,748 美元 26,539,869 美元 919,519,116 人民币 3,763,109,762 人民币 799,689,319 美元 432,075,847 美元 18,403,254	澳元 9.28 加元 9.32 英镑 9.74 港元 9.82 纽元 9.21 人民币 11.45 人民币 9.57 美元 11.88 美元 11.29 人民币 10.88 人民币 10.32 美元 10.61 美元 10.29
30/9/15 - 澳元对冲类别(每月派息) - 加元对冲类别(每月派息) - 英镑对冲类别(每月派息) - 港元类别(每月派息) - 纽元对冲类别(每月派息) - 人民币对冲类别(累计) - 人民币对冲类别(每月派息) - 美元类别(累计) - 美元类别(每月派息)	澳元 218,503,411 加元 143,065,587 英镑 883,883 港元 2,473,838,161 纽元 96,923,455 人民币 29,073,814 人民币 6,075,057,512 美元 31,831,272 美元 595,609,359	澳元 9.05 加元 9.07 英镑 9.45 港元 9.53 纽元 8.98 人民币 10.33 人民币 9.32 美元 11.06 美元 10.97
30/9/14 - 澳元对冲类别(每月派息) - 加元对冲类别(每月派息) - 港元类别(每月派息) - 纽元对冲类别(每月派息) - 人民币对冲类别(累计) - 人民币对冲类别(每月派息) - 美元类别(累计) - 美元类别(每月派息)	澳元 79,006,453 加元 60,487,633 港元 791,899,246 纽元 73,664,113 人民币 6,794,659 人民币 2,133,648,572 美元 975,798 美元 272,105,827	澳元 9.57 加元 9.58 港元 10.08 纽元 9.51 人民币 10.11 人民币 9.91 美元 11.17 美元 11.59

最高卖出价/最低买入价

财务期结算日

	最高卖出价	最低买入价
30/9/16		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.65	澳元 9.01
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.68	加元 9.03
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.11	英镑 9.41
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.20	港元 9.53
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.5E	纽元 8.94
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 11.82	人民币 10.36
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 9.95	人民币 9.26
- 美元类别 (累计)	美元 12.29	美元 11.09
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.73	美元 10.93
- PRC 人民币对冲份额 (累计)	人民币 11.00	人民币 10.02
- PRC 人民币对冲份额 (每月派息)	人民币 10.53	人民币 10.00
- PRC 美元份额 (累计)	美元 10.77	美元 9.96
- PRC 美元份额 (每月派息)	美元 10.49	美元 9.96
30/9/15		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 9.97	澳元 9.05
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 9.95	加元 9.07
- 英镑对冲类别 (每月派息)	英镑 10.35	英镑 9.45
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.46	港元 9.53
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 9.90	纽元 8.98
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 10.92	人民币 10.12
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.32	人民币 9.32
- 美元类别 (累计)	美元 11.83	美元 11.06
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.04	美元 10.97
30/9/14		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.05	澳元 9.41
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.06	加元 9.42
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.54	港元 9.89
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.00	纽元 9.36
- 人民币对冲类别 (累计)	人民币 10.49	人民币 10.01
- 人民币对冲类别 (每月派息)	人民币 10.41	人民币 9.91
- 美元类别 (累计)	美元 11.61	美元 10.53
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.13	美元 11.36
30/9/13		
- 澳元对冲类别 (每月派息)	澳元 10.46	澳元 9.29
- 加元对冲类别 (每月派息)	加元 10.46	加元 9.29
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.94	港元 9.73
- 纽元对冲类别 (每月派息)	纽元 10.42	纽元 9.24
- 美元类别 (累计)	美元 11.40	美元 10.28
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.58	美元 11.19
30/9/12		
- 港元类别 (每月派息)	港元 10.68	港元 9.91
- 美元类别 (累计)	美元 10.87	美元 9.97
- 美元类别 (每月派息)	美元 12.29	美元 10.48
30/9/11		
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.96	美元 10.68
30/9/10		
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.78	美元 10.45
30/9/09		
- 美元类别 (每月派息)	美元 10.82	美元 7.98
30/9/08		
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.52	美元 9.75
30/9/07		
- 美元类别 (每月派息)	美元 11.32	美元 9.82

经营与管理

管理人及服务提供者

摩根基金(亚洲)有限公司  
香港  
中环干诺道中 8 号  
遮打大厦 21 楼

投资管理人

JF 资产管理有限公司  
香港  
中环干诺道中 8 号  
遮打大厦 21 楼

助理管理人

JPMorgan Asset Management  
(UK) Limited  
60 Victoria Embankment  
London  
EC4Y 0JP  
United Kingdom

管理人董事

于二零一七年一月十六日  
David James MUNDY  
Eddy Tai Che WONG  
Edwin Tsun Kay CHAN  
Michael Irving FALCON  
Qionghui WANG  
Rachel Selah FARRELL

受托人

汇丰机构信托服务  
(亚洲)有限公司  
香港  
中环皇后大道中 1 号

基金注册登记机构

HSBC Trustee (Cayman) Limited  
P.O.Box 484  
HSBC House  
68 West Bay Road  
Grand Cayman KY1-1106  
Cayman Islands

核数师

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



0914

