

上投摩根亚太优势股票型证券投资基金
2011 年年度报告
2011 年 12 月 31 日

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年三月二十六日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	1
1.1	重要提示.....	1
§2	基金简介.....	4
2.1	基金基本情况.....	4
2.2	基金产品说明.....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	境外投资顾问和境外资产托管人.....	5
2.5	信息披露方式.....	5
2.6	其他相关资料.....	5
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.8	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.9	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6	审计报告.....	14
6.1	审计报告基本信息.....	14
6.2	审计报告的基本内容.....	14
§7	年度财务报表.....	15
7.1	资产负债表.....	15
7.2	利润表.....	16
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4	报表附注.....	18
§8	投资组合报告.....	37
8.1	期末基金资产组合情况.....	37
8.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	38
8.3	期末按行业分类的权益投资组合.....	38
8.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	39
8.5	报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
8.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	45
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	46

8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	46
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	46
8.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	46
8.11	投资组合报告附注	46
§9	基金份额持有人信息	47
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	47
§10	开放式基金份额变动	47
§11	重大事件揭示	48
11.1	基金份额持有人大会决议	48
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
11.4	基金投资策略的改变	48
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	48
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
11.8	其他重大事件	50
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 13	备查文件目录	51
13.1	备查文件目录	51
13.2	存放地点	51
13.3	查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根亚太优势股票型证券投资基金
基金简称	上投摩根亚太优势股票(QDII)
基金主代码	377016
交易代码	377016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 10 月 22 日
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	21,406,245,942.25 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于亚太地区证券市场以及在其他证券市场交易的亚太企业，投资市场包括但不限于澳大利亚、韩国、香港、印度及新加坡等区域证券市场（日本除外），分散投资风险并追求基金资产稳定增值。
投资策略	本基金在投资过程中注重各区域市场环境、政经前景分析，并强调公司品质与成长性的结合。首先在亚太地区经济发展格局下，通过自上而下分析，甄别不同国家与地区、行业与板块的投资机会，首先考虑国家与地区的资产配置，决定行业与板块的基本布局，并从中初步筛选出具有国际比较优势的大盘蓝筹公司，同时采取自下而上的选股策略，注重个股成长性指标分析，挖掘拥有更佳成长特性的公司，构建成长型公司股票池。最后通过深入的相对价值评估，形成优化的核心投资组合。在固定收益类投资部分，其资产布局坚持安全性、流动性和收益性为资产配置原则，并结合现金管理、货币市场工具等来制订具体策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：摩根斯坦利综合亚太指数（不含日本）（MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan）。
风险收益特征	本基金为区域性股票型证券投资基金，基金投资风险收益水平高于债券型基金和平衡型基金。由于投资国家与地区市场的分散，风险低于投资单一市场的股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上投摩根基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	洪霞	赵会军
	联系电话	021-38794999	010-66105799
	电子邮箱	xia.hong@jpmf-sitico.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-4888	95588
传真		021-68881170	010-66105798
注册地址		上海市富城路99号20楼	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市富城路99号20楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		陈开元	姜建清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	JF Asset Management Limited	The Bank of New York Mellon Company
	中文	JF 资产管理有限公司	纽约梅隆银行
注册地址		香港中环干诺道中 8 号遮打大厦 21 楼	美国纽约州, 纽约市华尔街 1 号
办公地址		香港中环干诺道中 8 号遮打大厦 21 楼	美国纽约州, 纽约市华尔街 1 号

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》 《中国证券报》 《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.51fund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
注册登记机构	上投摩根基金管理有限公司	上海市富城路99号20楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011 年	2010 年	2009 年
本期已实现收益	-426,763,983.07	1,481,814,165.21	-785,172,105.00
本期利润	-4,051,633,689.15	2,088,619,494.85	6,295,386,031.00
加权平均基金份额本期利润	-0.1824	0.0824	0.2251
本期加权平均净值利润率	-29.25%	13.42%	45.83%
本期基金份额净值增长率	-26.88%	14.00%	58.49%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	-10,578,255,073.08	-7,274,218,961.16	-10,457,482,594.00
期末可供分配基金份额利润	-0.4942	-0.3084	-0.3927
期末基金资产净值	10,827,990,869.17	16,309,260,264.91	16,171,684,000.00
期末基金份额净值	0.506	0.692	0.607
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	-49.40%	-30.80%	-39.30%

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

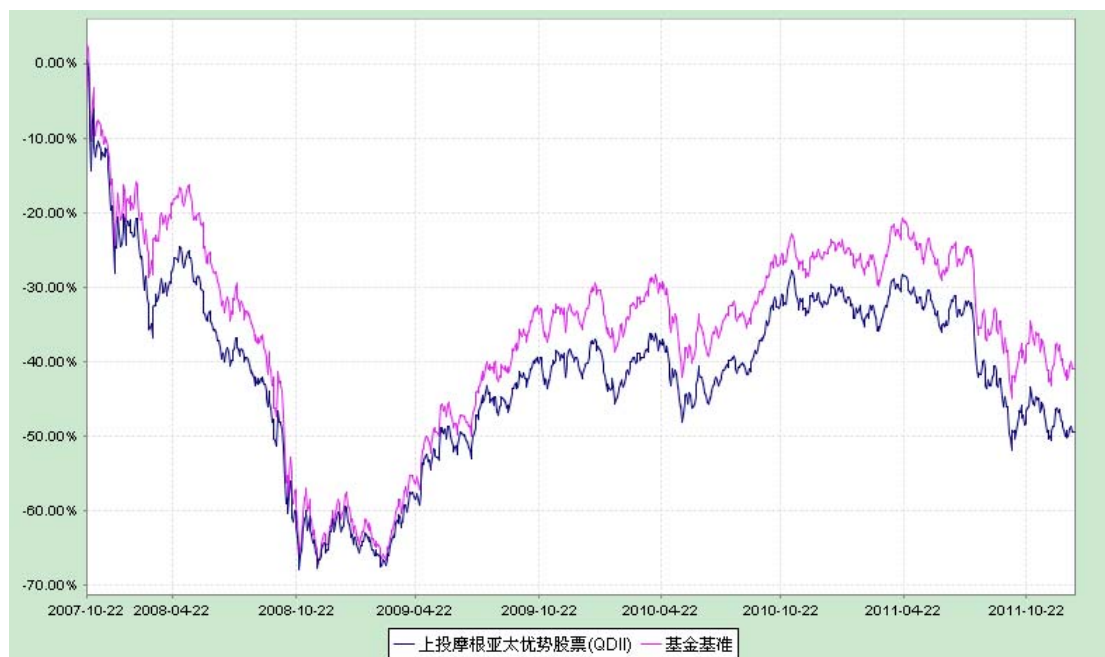
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.02%	1.67%	3.07%	1.74%	-1.05%	-0.07%
过去六个月	-24.36%	1.77%	-20.54%	1.83%	-3.82%	-0.06%
过去一年	-26.88%	1.45%	-21.96%	1.49%	-4.92%	-0.04%
过去三年	32.11%	1.51%	46.40%	1.51%	-14.29%	0.00%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-49.40%	1.86%	-40.90%	1.94%	-8.50%	-0.08%

注：本基金的业绩比较基准为：摩根斯坦利综合亚太指数（不含日本）（MSCI AC Asia

Pacific Index ex Japan)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上投摩根亚太优势股票型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2007 年 10 月 22 日至 2011 年 12 月 31 日)

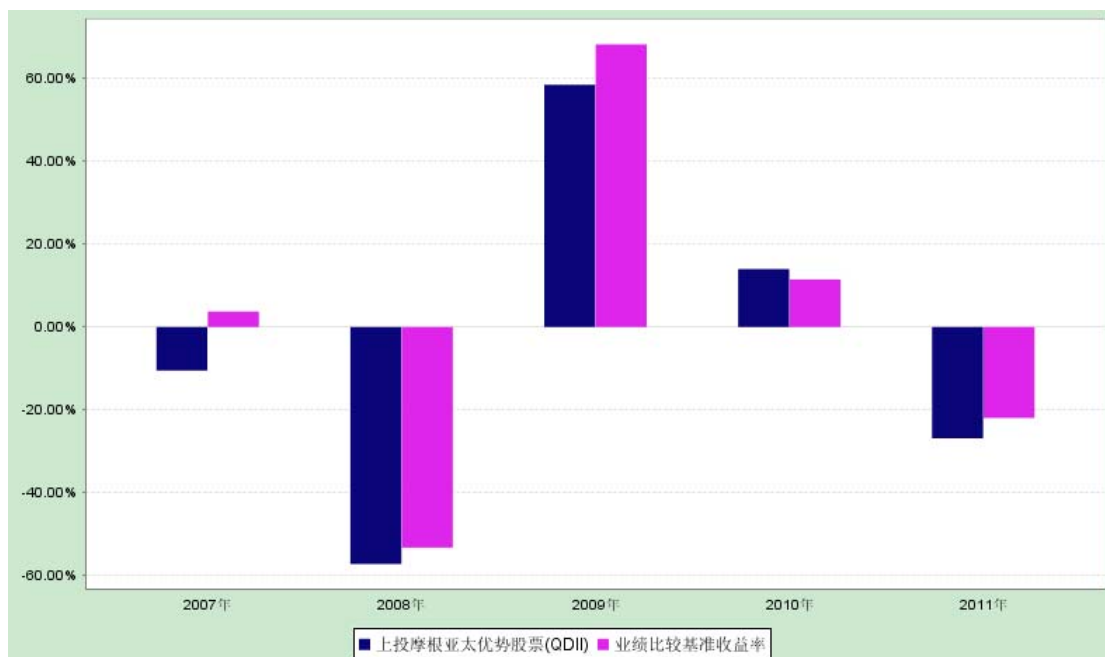


注：(1) 本基金合同生效日为 2007 年 10 月 22 日，图示时间段为 2007 年 10 月 22 日至 2011 年 12 月 31 日。

(2) 本基金建仓期自 2007 年 10 月 22 日至 2008 年 4 月 21 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根亚太优势股票型证券投资基金
自基金合同生效以来每年净值增长率图



注：1. 本基金合同生效日为 2007 年 10 月 22 日，图示时间段为 2007 年 10 月 22 日至 2011 年 12 月 31 日。

2. 合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司（2007 年 10 月 8 日更名为“上海国际信托有限公司”）与摩根资产管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。截至 2011 年 12 月底，公司管理的基金共有十五只，均为开放式基金，分别是：上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根阿尔法股票型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋股票型证券投资基金、上投摩根内需动力股票型证券投资基金、上投摩根亚太优势股票型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘股票型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证

券投资基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金和上投摩根强化回报债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨逸枫	本基金基金经理，投资副总监	2007-10-22	-	18年	台湾新竹清华大学经济学学士，台湾政治大学EMBA财管组硕士。曾就职于台湾南山人寿保险股份有限公司，担任资深投资经理，负责管理公司自有资金在台湾股票市场的投资；1993年加入台湾摩根证券投资信托公司，先后担任JF亚洲基金、JF台湾增长、JF台湾基金的基金经理；2007年7月加入上投摩根基金管理有限公司，任投资副总监，自2007年10月起担任上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金经理。
张军	本基金基金经理	2008-3-8	-	7年（金融领域从业经验18年）	毕业于上海复旦大学。曾担任上海国际信托有限公司国际业务部经理，交易部经理。2004年6月加入上投摩根基金管理有限公司，担任交易总监，2007年10月起任投资经理。2008年3月起担任上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金经理。
郭成东	本基金基金经理助理	2011-9-20	-	8年	毕业于上海对外贸易学院，硕士研究生。曾任天和证券经纪有限公司分析师，路透社中文网财经分析师。2007年加入上投摩根基金管理有限公司，历任市场经理、资深市场经理、投资组合经理。

注：1. 任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 杨逸枫女士担任本基金首任基金经理的任职日期为本基金基金合同生效之日；

3. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
许安庆	JF基金区域投资经理	35年	男，特许公认会计师公会会员
王浩	JF基金区域投资经理兼大中华投资总监	17年	男，美国耶鲁大学荣誉文学士学位，主修经济

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根亚太优势证券投资基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人建立了完善的公平交易制度。确保不同基金在买卖同一证券时，按照时间优先，比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。

4.4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

为更好的贯彻落实公平交易制度指导意见的相关精神，公司于 2009 年委托外部专业机构共同制定了公司投资组合投资风格分类办法，并自 2009 年起对旗下管理的投资组合投资风格的划分情况进行定期审阅。本年度，公司根据上述分类办法组织相关业务部门及外部专业机构共同开展投资组合投资风格的划分工作，并将分类结果作为本年度投资组合定期报告中相关披露内容的依据。

本年度，根据公司内部和外部专业机构的评价结果，本基金管理人旗下无与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金无异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2011 年,对全球经济与金融市场而言都是相当起伏跌宕的一年。在第一季经历了阿拉伯之春的政治动荡,日本大地震造成电子/汽车等产业的供应链紧张。夏天后对欧债危机悬而未决的担忧加上担忧美国经济有二次探底的风险,更让全球风险性资产大幅下跌,在资金撤离的环境中,使得亚洲市场亦大幅下跌。第四季在投资者高度关注欧债危机发展环境中,也让市场低位徘徊。

然而,很多投资机会也在极度悲观的情绪中逐步酝酿。由于欧元区采取短期(EFSF 加 LTRO),中期(银行资本金补充)与长期(财政联盟)政策组合,逐步让银行间拆款利率(资金面)与信用违约互换 CDS(信心面)回稳。这使得 2012 年第一季欧洲各国国债拍卖状况优于市场预期,化解大家对欧洲偿债高峰到来时或有资金短缺危机的担忧。因此只要欧洲政治面没有太大的意外(宜关注希腊与法国等国大选),欧债危机有机会度过最紧张的时间。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 12 月 31 日,上投摩根亚太优势股票型证券投资基金份额净值为 0.506 元,本报告期份额净值增长率为-26.88%,同期业绩比较基准收益率为-21.96%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2012 年的全球宏观经济部份,虽然包含国际货币基金组织(IMF)在内的许多研究机构均在 2011 年年底前对全球 2012 年的经济成长率预估值,但出乎市场意料之外的是,具有领先指针意义的全球制造业活动指数(PMI)在 1 月均出现改善迹象,美国多项经济指标也优于市场预期,让人感觉或许今年经济成长没有去年底预期般悲观。

在亚洲市场部份,去年以来抑制通胀压力一直是各国政府最重要的政策目标,经过近一年来的努力,我们看到包括印度尼西亚,印度,中国等市场的货币政策已逐渐由紧缩走向中性甚至宽松,随着通胀压力的减缓,政府对经济成长的关注度有望在今年提高。

另一方面,进入 2012 年后,我们也看到外资又开始积极回流亚洲市场,除了对去年买超的东盟市场外,外资也开始对韩国,印度等去年卖超的市场回补持股。

然而,我们还是不能轻忽今年存在的投资风险,除了一些不可测的天灾(如极寒,干旱)外,由于 2012 年举行大选或进行领导人交接的市场占全球 GDP 比重达 50%以上,因此政治面变化对经济面的影响值得留意,包括希腊法国部份将影响欧债发展,埃及将影响中东政

局,美国大选前是否有保护主义的形成,而近期伊朗问题导致油价上涨也是另一个可能让全球经济减缓通胀压力再起的变量。

基于上述背景,我们对 2012 年的亚洲市场抱持谨慎乐观的态度,在欧美经济未如原先预期差的情况下,韩国、台湾等出口为主的经济体受惠幅度较大。而香港/中国在连续 2 年表现落后其它市场的情况下,随着宏观经济回稳与通胀压力减轻加上国际资金重新回流,也有机会出现补涨行情。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,本基金管理人在内部监察稽核工作中以“坚守三条底线、保障合规诚信、支持业务发展、提高工作水平”为总体目标,一切从合规运作、保障基金份额持有人利益出发,由独立的监察稽核部门按照工作计划结合实际情况对公司各项业务进行全面的监察稽核工作,保障和促进公司各项业务合法合规运作,推动内部控制机制的完善与优化,保证各项法规和管理制度的落实,发现问题及时提出建议并督促有关部门改进。

在本报告期内,本基金管理人内部监察稽核工作贯穿三条主线:

- 1、注意密切追踪监管法规政策变化和监管新要求,组织员工学习理解监管精神,推动公司各部门完善制度建设和业务流程,防范日常运作中的违规行为发生。
- 2、继续紧抓员工行为、公平交易、利益冲突等方面的日常监控,坚守“三条底线”不动摇;进一步加强内部合规培训,规范员工行为操守,严格防范利益冲突。
- 3、针对风险控制的需求和重点,强化内部审计,提高内部审计工作的水平和效果;按照监管部门的要求,严格推行风险控制自我评估制度,对控制不足的风险点,制订了进一步的控制措施。

报告期内,本基金管理人运用合规监控、专项审计、合规服务等综合的工作方法,不断完善内部控制管理,保证合法合规运作,在本报告期内的监察稽核工作中,未发现基金投资运作存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

公司自成立以来,各项业务运作正常,内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。本基金运作合法合规,保障了基金份额持有人的利益。我们将继续以合规运作和风险管理为核心,提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,保障基金份额持有人的利益。

4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责,根据相关的法律法规规定、基金合同

的约定,制定了内部控制措施,对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制,目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会,并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人以及相关基金经理,所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见,评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员,参加估值委员会会议,参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期本基金未实施利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011 年,本基金托管人在对上投摩根亚太优势股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年,上投摩根亚太优势股票型证券投资基金的管理人——上投摩根基金管理有限公司在上投摩根亚太优势股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,上投摩根亚太优势股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对上投摩根基金管理有限公司编制和披露的上投摩根亚太优势股票型证券投资基金 2011 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2012)第 20329 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	上投摩根亚太优势股票型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的上投摩根亚太优势股票型证券投资基金(以下简称“上投摩根亚太优势基金”)的财务报表,包括2011年12月31日的资产负债表、2011年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是上投摩根亚太优势基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述上投摩根亚太优势基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了上投摩根亚太优势基金2011年12月31日的财务状况以及201

	1年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛竞	王灵
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司	
会计师事务所的地址	中国·上海市	
审计报告日期	2012-03-23	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：上投摩根亚太优势股票型证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,531,437,707.08	646,976,946.14
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	9,299,106,006.76	15,732,508,766.88
其中：股票投资		9,211,775,809.98	15,157,345,815.38
基金投资		87,330,196.78	575,162,951.50
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		43,986,599.76	10,038,036.66
应收利息	7.4.7.5	90,273.62	105,044.45
应收股利		2,905,242.29	3,750,700.75
应收申购款		600,511.19	889,277.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	15,376,090.25	15,946,385.74
资产总计		10,893,502,430.95	16,410,215,158.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		36,710,379.53	5,775,588.80

应付赎回款		8,377,066.09	45,752,542.17
应付管理人报酬		16,893,539.15	24,749,405.85
应付托管费		3,284,854.82	4,812,384.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-235,371.39	-19,253.74
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债	7.4.14(1) (a)	-	19,385,864.20
其他负债	7.4.7.8	481,093.58	498,361.72
负债合计		65,511,561.78	100,954,893.17
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	21,406,245,942.25	23,583,479,226.07
未分配利润	7.4.7.10	-10,578,255,073.08	-7,274,218,961.16
所有者权益合计		10,827,990,869.17	16,309,260,264.91
负债和所有者权益总计		10,893,502,430.95	16,410,215,158.08

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.506 元，基金份额总额 21,406,245,942.25 份。

7.2 利润表

会计主体：上投摩根亚太优势股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2011年1月1日至2011年 12月31日	2010年1月1日至2010年 12月31日
一、收入		-3,671,924,334.28	2,575,788,051.58
1.利息收入		3,713,664.83	4,724,241.34
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,713,664.83	4,724,241.34
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,229,874.12	1,965,190,763.50
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-260,391,102.94	1,659,682,693.61
基金投资收益	7.4.7.13	-6,993,620.84	9,560,068.40
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	6,234,573.85	-2,967,067.31

股利收益	7.4.7.16	276,380,024.05	298,915,068.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-3,624,869,706.08	606,805,329.64
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-66,195,931.24	-1,484,674.30
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	197,764.09	552,391.40
减：二、费用		400,501,343.51	476,032,071.54
1. 管理人报酬		249,387,053.98	280,514,910.56
2. 托管费		48,491,927.13	54,544,565.98
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	101,924,111.83	140,181,262.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	698,250.57	791,332.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,072,425,677.79	2,099,755,980.04
减：所得税费用	7.4.14 (1) (b)	-20,791,988.64	11,136,485.19
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,051,633,689.15	2,088,619,494.85

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根亚太优势股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	23,583,479,226.07	-7,274,218,961.16	16,309,260,264.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,051,633,689.15	-4,051,633,689.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,177,233,283.82	747,597,577.23	-1,429,635,706.59
其中：1.基金申购款	304,805,597.43	-115,438,650.92	189,366,946.51
2.基金赎回款	-2,482,038,881.25	863,036,228.15	-1,619,002,653.10
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	21,406,245,942.25	-10,578,255,073.08	10,827,990,869.17
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	26,629,166,593.83	-10,457,482,593.83	16,171,684,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,088,619,494.85	2,088,619,494.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,045,687,367.76	1,094,644,137.82	-1,951,043,229.94
其中：1.基金申购款	616,387,420.61	-235,993,670.29	380,393,750.32
2.基金赎回款	-3,662,074,788.37	1,330,637,808.11	-2,331,436,980.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	23,583,479,226.07	-7,274,218,961.16	16,309,260,264.91

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：章硕麟，主管会计工作负责人：胡志强，会计机构负责人：张璐

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

上投摩根亚太优势股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]第 274 号《关于同意上投摩根亚太优势股票型证券投资基金募集的批复》核准，由上投摩根基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 29,568,958,773.71 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第 136 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金合同》于 2007 年 10 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 29,572,160,439.53 份基金份额，其中认购资金利息折合 3,201,665.82 份基金份额。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为纽约银行(后合并重组为纽约梅隆银行)，境外投资顾问为 JF 资产管理有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资

于亚太地区证券市场以及在其他证券市场交易的亚太企业。亚太企业主要是指登记注册在亚太地区、在亚太地区证券市场进行交易或其主要业务经营在亚太地区的企业。投资市场为中国证监会允许投资的国家或地区证券市场。本基金投资组合中股票及其它权益类证券市值占基金资产的 60%-100%，现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具市值占基金资产的 0%-40%。股票及其他权益类证券包括中国证监会允许投资的普通股、优先股、存托凭证、公募股票基金等。现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币基金等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品等。本基金的业绩比较基准为：摩根斯坦利综合亚太指数(不含日本)。

本财务报表由本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司于 2012 年 3 月 23 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应

收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、基金投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资和基金投资在持有期间应取得的现金股利扣除适用的境内及境外代扣代缴所得税后，于除息日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异

较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

(a) 递延所得税资产和递延所得税负债

递延所得税资产和递延所得税负债根据资产和负债的计税基础与其账面价值的差额(暂时性差异)计算确认。对于按照税法规定能够于以后年度抵减应纳税所得额的可抵扣亏损，确认相应的递延所得税资产。于资产负债表日，递延所得税资产和递延所得税负债按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计量。

递延所得税资产的确认以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异、可抵扣亏损和税款抵

减的应纳税所得额为限。

同时满足下列条件的递延所得税资产和递延所得税负债以抵销后的净额列示：

- 递延所得税资产和递延所得税负债与同一税收征管部门对本基金征收的所得税相关；
- 本基金拥有以净额结算当期所得税资产及当期所得税负债的法定权利。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
活期存款	630,409,006.89	560,881,846.13
定期存款	901,028,700.19	86,095,100.01
其中：存款期限 1-3 个月	901,028,700.19	86,095,100.01
其他存款	-	-
合计	1,531,437,707.08	646,976,946.14

注：1. 于 2011 年 12 月 31 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 124,436,012.27 元(折合人民币 100,880,275.15 元)，美元 146,083,648.23 元(折合人民币 920,458,459.33 元)，新加坡元 95,000.00 元(折合人民币 461,640.00 元)，澳元 2,329,329.95 元(折合人民币 15,046,732.34 元)和新台币 435,481,838.00 元(折合人民币 90,621,470.78 元)，印度卢比 35.04 元(折合人民币 4.16 元)。

于 2010 年 12 月 31 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 22,199,710.59 元(折合人民币 18,890,399.73 元)，美元 15,267,078.07 元(折合人民币 101,109,278.15 元)，新加坡元 47,500.00 元(折合人民币 245,562.82 元)，澳元 108,733.22 元(折合人民币 738,146.19 元)和新台币 149,296,019.00 元(折合人民币 33,911,571.49 元)。

2. 存款期限为定期存款剩余期限。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,232,061,082.57	9,211,775,809.98	-1,020,285,272.59
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	债券合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	98,074,807.63	87,330,196.78	-10,744,610.85
其他	-	-	-
合计	10,330,135,890.20	9,299,106,006.76	-1,031,029,883.44
项目	上年度末 2010 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	12,678,931,094.24	15,157,345,815.38	2,478,414,721.14
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	债券合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	459,737,850.00	575,162,951.50	115,425,101.50
其他	-	-	-
合计	13,138,668,944.24	15,732,508,766.88	2,593,839,822.64

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	87,770.78	104,757.09
应收定期存款利息	2,502.84	287.36
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	90,273.62	105,044.45

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
其他应收款	15,376,090.25	15,946,385.74
待摊费用	-	-
合计	15,376,090.25	15,946,385.74

注：于 2011 年 12 月 31 日，其他应收款余额为应收印度市场投资 2009 和 2010 税务年度退税款。

7.4.7.7 应付交易费用

无余额。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,093.58	18,361.72
预提费用	480,000.00	480,000.00
合计	481,093.58	498,361.72

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	23,583,479,226.07	23,583,479,226.07
本期申购	304,805,597.43	304,805,597.43
本期赎回（以“-”号填列）	-2,482,038,881.25	-2,482,038,881.25
本期末	21,406,245,942.25	21,406,245,942.25

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,804,076,455.06	2,529,857,493.90	-7,274,218,961.16
本期利润	-426,763,983.07	-3,624,869,706.08	-4,051,633,689.15
本期基金份额交易产生的变动数	753,799,055.17	-6,201,477.94	747,597,577.23
其中：基金申购款	-239,299,139.28	123,860,488.36	-115,438,650.92
基金赎回款	993,098,194.45	-130,061,966.30	863,036,228.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,477,041,382.96	-1,101,213,690.12	-10,578,255,073.08

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
活期存款利息收入	3,075,808.69	3,716,056.09
定期存款利息收入	637,432.56	1,007,183.64
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	-
其他	423.58	1,001.61
合计	3,713,664.83	4,724,241.34

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
卖出股票成交总额	20,430,335,968.01	25,652,362,270.61
减：卖出股票成本总额	20,690,727,070.95	23,992,679,577.00
买卖股票差价收入	-260,391,102.94	1,659,682,693.61

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	983,449,870.08	171,067,078.04

减：卖出/赎回基金成本总额	990,443,490.92	161,507,009.64
基金投资收益	-6,993,620.84	9,560,068.40

7.4.7.14 债券投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
卖出权证成交总额	39,228,983.46	8,153,464.58
减：卖出权证成本总额	32,994,409.61	11,120,531.89
买卖权证差价收入	6,234,573.85	-2,967,067.31

注：本报告期内买卖权证成交金额/差价收入皆为行权认购权证成交总额/差价收入

(2010 年度：同)。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——买卖股指期货差价收入

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
股票投资产生的股利收益	273,728,432.21	289,252,611.80
基金投资产生的股利收益	2,651,591.84	9,662,457.00
合计	276,380,024.05	298,915,068.80

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
1.交易性金融资产	-3,624,869,706.08	606,805,329.64
——股票投资	-3,498,699,993.73	542,881,822.14
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-126,169,712.35	63,923,507.50
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-

合计	-3,624,869,706.08	606,805,329.64
----	-------------------	----------------

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
基金赎回费收入	197,764.09	552,391.40
合计	197,764.09	552,391.40

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
交易所市场交易费用	101,924,111.83	140,181,262.44
银行间市场交易费用	-	-
合计	101,924,111.83	140,181,262.44

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
信息披露费	300,000.00	300,000.00
税务顾问费	215,020.79	175,833.80
审计费用	180,000.00	180,000.00
存托凭证分红手续费	-	56,300.56
其他	3,229.78	79,198.20
合计	698,250.57	791,332.56

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上投摩根基金管理有限公司(“上投摩根”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
纽约梅隆银行股份有限公司(The Bank of New York Mellon)	境外资产托管人

York Mellon Company, “纽约梅隆银行”)	
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
摩根资产管理(英国)有限公司	基金管理人的股东
上海国利货币经纪有限公司	基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司
上信资产管理有限公司	基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司
J.P. Morgan Investment Management Limited	基金管理人的股东摩根资产管理(英国)有限公司控制的公司
JF 资产管理有限公司	境外投资顾问
J.P. Morgan Chase & Co.	与境外投资顾问存在控制关系的机构
J.P. Morgan Asset Management Holdings Inc.	与境外投资顾问存在控制关系的机构
J.P. Morgan Asset Management (Asia) Inc.	与境外投资顾问存在控制关系的机构
J.P. Morgan 8CS Investments (GP) Limited	基金管理人的股东摩根资产管理(英国)有限公司控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月 31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月3 1日
当期发生的基金应支付的管理费	249,387,053.98	280,514,910.56
其中：支付销售机构的客户维护费	32,934,728.53	36,694,622.00

注：本基金按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 1.8%的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的管理人报酬，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人上投摩根。其计算公式为：

日管理人报酬=估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 X 1.8% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	48,491,927.13	54,544,565.98

注：本基金按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 0.35%的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的托管费，逐日累计至每月月底，按月支付给基金托管人中国工商银行。其计算公式为：

日托管费 = 估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 X 0.35% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
期初持有的基金份额	-	10,399,032.78
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	10,399,032.78
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2011年1月1日至2011年12月31日		2010年1月1日至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	404,061,688.35	3,050,717.97	492,174,486.52	3,688,492.39
纽约梅隆银行	1,127,376,018.73	662,523.28	154,802,459.62	1,034,747.34

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人纽约梅隆银行保管，按适用利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为区域性股票型证券投资基金，基金投资风险收益水平高于债券型基金和平衡型基金。由于投资国家与地区市场的分散，风险低于投资单一市场的股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监查和风险评估的评估，并负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依据风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行控管，并提出内控建议。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的

限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行以及境外次托管行纽约梅隆银行，与该等银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2010 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产为银行存款及部分应收申购款，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日							
	美元 折合人民币	港元 折合人民币	澳元 折合人民币	新加坡元 折合人民币	韩元 折合人民币	印度卢比 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产								
银行存款	920,458,459.33	100,880,275.15	15,046,732.34	461,640.00	-	4.16	90,621,470.78	1,127,468,581.76
交易性金融资产	139,066,937.10	3,560,609,015.36	1,658,064,871.38	179,992,413.75	1,150,069,495.76	684,493,801.50	1,926,809,471.91	9,299,106,006.76
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	43,986,599.76	43,986,599.76
应收利息	2,502.84	-	-	-	-	-	-	2,502.84
应收股利	-	-	2,905,242.29	-	-	-	-	2,905,242.29
其他资产	-	-	-	-	-	15,376,090.25	-	15,376,090.25
资产合计	1,059,527,899.27	3,661,489,290.51	1,676,016,846.01	180,454,053.75	1,150,069,495.76	699,869,895.91	2,061,417,542.45	10,488,845,023.66
以外币计价的负债								
应付证券清算款	-	5,373,291.32	-	-	2,946,790.80	-	28,390,297.41	36,710,379.53
应交税费	-	-	-	-	-	-235,371.39	-	-235,371.39
负债合计	-	5,373,291.32	-	-	2,946,790.80	-235,371.39	28,390,297.41	36,475,008.14
资产负债表 外汇风险敞口净额	1,059,527,899.27	3,656,115,999.19	1,676,016,846.01	180,454,053.75	1,147,122,704.96	700,105,267.30	2,033,027,245.04	10,452,370,015.52
项目	上年度末 2010年12月31日							
	美元 折合人民币	港元 折合人民币	澳元 折合人民币	新加坡元 折合人民币	韩元 折合人民币	印度卢比 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产								

银行存款	101,109,278.15	18,890,399.73	738,146.19	245,562.82	-	-	33,911,571.49	154,894,958.38
交易性金融资产	575,162,951.50	5,779,831,715.14	2,769,191,918.41	945,318,371.70	2,185,755,402.96	1,548,911,270.30	1,928,337,136.87	15,732,508,766.88
应收证券清算款	-	3,772,925.71	-	-	-	6,265,110.95	-	10,038,036.66
应收利息	287.36	-	-	-	-	-	-	287.36
应收股利	-	-	3,750,700.75	-	-	-	-	3,750,700.75
其他资产	-	-	-	-	-	15,946,385.74	-	15,946,385.74
资产合计	676,272,517.01	5,802,495,040.58	2,773,680,765.35	945,563,934.52	2,185,755,402.96	1,571,122,766.99	1,962,248,708.36	15,917,139,135.77
以外币计价的负债								
应付证券清算款	-	5,775,588.80	-	-	-	-	-	5,775,588.80
应交税费	-	-	-	-	-	-19,253.74	-	-19,253.74
递延所得税负债	-	-	-	-	-	19,385,864.20	-	19,385,864.20
负债合计	-	5,775,588.80	-	-	-	19,366,610.46	-	25,142,199.26
资产负债表								
外汇风险敞口净额	676,272,517.01	5,796,719,451.78	2,773,680,765.35	945,563,934.52	2,185,755,402.96	1,551,756,156.53	1,962,248,708.36	15,891,996,936.51

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
	1.所有外币相对人民币升值 5%	增加约 52,262	增加约 79,460
	2.所有外币相对人民币贬值 5%	下降约 52,262	下降约 79,460

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和衍生工具，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过自上而下分析，甄别不同国家与地区、行业与板块的投资机会，首先考虑国家与地区的资产配置，决定行业与板块的基本布局，并从中初步筛选出具有国际比较优势的大盘蓝筹公司，同时采取自下而上的选股策略，注重个股成长性指标分析，挖掘拥有更佳成长特性的公司，构建成长型公司股票池。最后通过深入的相对价值评估，形成优化的核心投资组合。在固定收益类投资部分，其资产布局坚持安全性、流动性和收益性为资产配置原则，并结合现金管理、货币市场工具等来制订具体策略。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票及其他权益类证券投资比例为基金资产净值的 60%-100%，其它允许投资的金融工具为 0%-40%。此外，

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控, 定期运用多种定量方法对基金进行风险度量, 包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险, 及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	9,211,775,809.98	85.07	15,157,345,815.38	92.94
交易性金融资产-基金投资	87,330,196.78	0.81	575,162,951.50	3.53
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	9,299,106,006.76	85.88	15,732,508,766.88	96.46

注: 上述其他价格敞口按股票发行方和基金管理人主要业务地分析如下:

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
中国内地	2,922,776,230.18	26.99	4,749,264,061.22	29.12
澳大利亚	1,565,355,505.55	14.46	2,660,302,796.27	16.31
韩国	1,150,069,495.76	10.62	2,185,755,403.46	13.40
印度	684,493,801.50	6.32	1,548,911,270.30	9.50
中国香港	637,832,785.18	5.89	1,030,567,653.92	6.32
新加坡	179,992,413.75	1.66	945,318,371.70	5.80
其他市场	2,158,585,774.84	19.94	2,612,389,210.01	16.02
合计	9,299,106,006.76	85.88	15,732,508,766.88	96.46

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位: 人民币万元)	
		本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 41,353	增加约 81,668
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	下降约 41,353	下降约 81,668

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 于 2011 年 12 月 31 日, 本财务报表中列示的递延所得税负债和所得税费用均与本基金的印度市场股票投资相关。本基金投资于印度市场股票而发生的短期资本利得适用于印度资本利得税。

(a) 递延所得税资产

	2011 年 12 月 31 日		2010 年 12 月 31 日	
	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异
未实现资本损失	-	-	2,847,239.21	18,428,732.92

(b) 递延所得税负债

	2011 年 12 月 31 日		2010 年 12 月 31 日	
	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异
未实现资本利得	-	-	22,233,103.41	143,903,581.96

(c) 抵销后的递延所得税资产和递延所得税负债净额列示如下:

	2011 年 12 月 31 日	2010 年 12 月 31 日
递延所得税负债净额	-	19,385,864.20

注: 于 2011 年 12 月 31 日, 本基金未对印度市场股票投资产生的未实现资本损失确认相关的递延所得税资产 10,397,821.48 元。

(d) 所得税费用

项目	本期 2011 年度	上年度可比期间 2010 年度
当期所得税费用	-1,406,124.44	28,102,113.39
递延所得税费用	-19,385,864.20	-16,965,628.20
合计	-20,791,988.64	11,136,485.19

应纳税所得项目及相应的当期所得税费用分析如下:

项目	本期 2011 年度	
	应纳税所得	当期所得税费用
印度市场股票投资	-	-1,406,124.44
项目	上年度可比期间 2010 年度	
	应纳税所得	当期所得税费用
印度市场股票投资	181,890,701.55	28,102,113.39

(2) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具**(i) 金融工具公允价值计量的方法**

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于2011年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为9,299,106,006.76元,无属于第二层级和第三层级的余额(2010年12月31日:第一层级的余额为15,732,508,766.88元,无属于第二层级和第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

§ 8 投资组合报告**8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	9,211,775,809.98	84.56
	其中:普通股	8,675,531,008.77	79.64
	存托凭证	536,244,801.21	4.92
2	基金投资	87,330,196.78	0.80
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-

	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,531,437,707.08	14.06
8	其他各项资产	62,958,717.11	0.58
9	合计	10,893,502,430.95	100.00

注：截至 2011 年 12 月 31 日，上投摩根亚太优势股票型证券投资基金资产净值为 10,827,990,869.17 元，基金份额净值为 0.506 元，累计基金份额净值为 0.506 元。

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	3,560,609,015.36	32.88
澳大利亚	1,658,064,871.38	15.31
韩国	1,150,069,495.76	10.62
印度	684,493,801.50	6.32
印度尼西亚	557,024,493.40	5.14
英国	449,477,127.21	4.15
中国台湾	397,558,127.95	3.67
泰国	391,798,695.06	3.62
新加坡	179,992,413.75	1.66
马来西亚	130,951,028.29	1.21
美国	51,736,740.32	0.48
合计	9,211,775,809.98	85.07

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定，ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
商业银行	2,154,613,722.30	19.90
石油、天然气与消费用燃料	650,802,500.56	6.01
金属与采矿	493,329,829.42	4.56
半导体产品与设备	489,632,526.17	4.52

房地产管理和开发	393,981,772.80	3.64
食品	354,404,298.70	3.27
建筑材料	330,611,215.78	3.05
机械制造	291,443,566.79	2.69
多元化零售	288,745,912.40	2.67
建筑与工程	279,231,842.21	2.58
汽车零配件	275,121,682.44	2.54
保险	261,136,725.36	2.41
化学制品	235,207,487.35	2.17
互联网软件与服务	231,751,509.46	2.14
汽车	218,902,334.34	2.02
综合电信业务	209,365,843.38	1.93
烟草	200,666,541.64	1.85
工业集团企业	180,743,906.77	1.67
综合金融服务	152,239,615.70	1.41
酒店、餐馆与休闲	145,836,223.08	1.35
商业服务与商业用品	138,753,983.98	1.28
交通基本设施	127,061,958.33	1.17
信息技术服务	114,933,434.91	1.06
互助储蓄银行与抵押贷款	108,311,883.70	1.00
生物科技	103,354,922.89	0.95
贸易公司与经销商	102,850,798.39	0.95
电力公用事业	96,852,119.84	0.89
媒体	92,709,365.83	0.86
公路与铁路	88,562,230.17	0.82
电子设备、仪器和元件	78,061,323.43	0.72
食品与主要用品零售	76,224,255.63	0.70
能源设备与服务	66,328,021.76	0.61
纺织品、服装与奢侈品	63,178,714.40	0.58
制药	50,550,351.05	0.47
无线电信业务	33,671,370.53	0.31
容器与包装	32,602,018.49	0.30
合计	9,211,775,809.98	85.07

注：行业分类标准：MSCI

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例
----	----------	----------	------	--------	----------	-------	------	-----------

								(%)
1	Agricultural Bank of China Ltd	中国农业银行股份有限公司	1288 HK	香港证券交易所	中国香港	198,679,000	537,970,678.11	4.97
2	China Construction Bank Corp	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港证券交易所	中国香港	103,721,150	455,750,110.78	4.21
3	Samsung Electronics Co Ltd	三星电子有限公司	005930 KS	韩国证券交易所	韩国	61,826	357,772,475.00	3.30
4	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	澳大利亚新西兰银行集团	ANZ AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	2,200,000	291,758,027.95	2.69
5	National Australia Bank Ltd	澳大利亚国家银行有限公司	NAB AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	1,900,000	286,706,556.10	2.65
6	BHP Billiton plc	必和必拓有限公司	BLT LN	伦敦证券交易所	英国	1,300,000	237,035,877.11	2.19
7	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	中国香港	1,831,300	231,751,509.46	2.14
8	PT Astra International Tbk	-	ASII IJ	印度尼西亚证券交易所	印度尼西亚	4,257,000	218,902,334.34	2.02
9	PT United Tractors Tbk	-	UNTR IJ	印度尼西亚证券交易所	印度尼西亚	11,619,060	212,748,563.74	1.96
10	Rio Tinto plc	力拓有限公司	RIO LN	伦敦证券交易所	英国	700,000	212,441,250.10	1.96
11	Charoen Pokphand Foods Public Co Ltd	-	CPF-R TB	泰国证券交易所	泰国	30,495,200	200,978,059.86	1.86
12	Intime Department Store (Group) Co Ltd	银泰百货(集团)有限公司	1833 HK	香港证券交易所	中国香港	28,610,500	184,396,532.19	1.70
13	China Petroleum & Chemical Corp	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港证券交易所	中国香港	27,720,000	183,601,174.68	1.70
14	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	4,089,500	169,746,311.68	1.57
15	Anhui Conch Cement Co Ltd	安徽海螺水泥股份有限公司	914 HK	香港证券交易所	中国香港	8,497,000	158,780,337.60	1.47
16	China Telecom Corp Ltd	中国电信集团公司	728 HK	香港证券交易所	中国香港	43,990,000	157,629,103.06	1.46
17	Infrastructure Development Finance Co Ltd	-	IDFC IN	印度证券交易所	印度	14,000,000	152,239,615.70	1.41
18	China National Building Material Co Ltd	中国建材股份有限公司	3323 HK	香港证券交易所	中国香港	20,258,000	144,852,276.50	1.34
19	Samsung	-	028050 KS	韩国证券交	韩国	126,497	139,413,677.88	1.29

	Engineering Co Ltd			易所				
20	Brambles Ltd	-	BXB AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	3,000,000	138,753,983.98	1.28
21	China Resources Land Ltd	华润置地有限公司	1109 HK	香港证券交易所	中国香港	13,322,000	134,785,814.60	1.24
22	ITC Ltd	-	ITC IN	印度证券交易所	印度	5,500,000	131,363,175.53	1.21
23	Petronas Chemicals Group Bhd	-	PCHEM MK	马来西亚证券交易所	马来西亚	10,626,100	130,951,028.29	1.21
24	Transurban Group	-	TCL AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	3,500,000	127,061,958.33	1.17
25	CNOOC Ltd	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港证券交易所	中国香港	11,528,000	126,915,279.57	1.17
26	Hyundai Mobis	-	012330 KS	韩国证券交易所	韩国	78,325	125,093,102.29	1.16
27	Yanzhou Coal Mining Co Ltd	兖州煤业股份有限公司	1171 HK	香港证券交易所	中国香港	8,940,000	120,166,169.64	1.11
28	Infosys Ltd	印孚瑟斯技术有限公司	INFO IN	印度证券交易所	印度	350,000	114,933,434.91	1.06
29	Commonwealth Bank of Australia	澳大利亚联邦银行	CBA AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	350,000	111,280,953.54	1.03
30	Housing Development Finance Corp Ltd	-	HDFC IN	印度证券交易所	印度	1,400,000	108,311,883.70	1.00
31	Parkson Retail Group Ltd	百盛商业集团有限公司	3368 HK	香港证券交易所	中国香港	13,520,500	104,349,380.21	0.96
32	Tingyi (Cayman Islands) Holdings Corp	康师傅控股有限公司	322 HK	香港证券交易所	中国香港	5,454,000	104,348,764.08	0.96
33	CSL Ltd	-	CSL AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	500,000	103,354,922.89	0.95
34	Samsung C&T Corp	三星 C&T 公司	000830 KS	韩国证券交易所	韩国	276,128	102,850,798.39	0.95
35	KB Financial Group Inc	KB 金融集团	105560 KS	韩国证券交易所	韩国	510,865	101,429,172.60	0.94
36	Mando Corp	-	060980 KS	韩国证券交易所	韩国	86,641	97,620,445.37	0.90
37	Keppel Corp Ltd	吉宝企业有限公司	KEP SP	新加坡证券交易所	新加坡	2,143,300	96,860,283.37	0.89
38	Power Assets Holdings Ltd	电能实业有限公司	6 HK	香港证券交易所	中国香港	2,079,500	96,852,119.84	0.89
39	Krung Thai Bank Public Co Ltd	-	KTB-R TB	泰国证券交易所	泰国	32,358,300	96,288,670.25	0.89

40	PT Bank Negara Indonesia Tbk	-	BBNI IJ	印度尼西亚证券交易所	印度尼西亚	35,935,500	94,890,407.45	0.88
41	News Corp Inc	-	NWS AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	800,000	92,709,365.83	0.86
42	Wynn Macau Ltd	永利澳门有限公司	1128 HK	香港证券交易所	中国香港	5,115,600	80,870,729.94	0.75
43	Boart Longyear Ltd	-	BLY AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	4,500,000	80,810,630.33	0.75
44	Hyundai Heavy Industries Co Ltd	现代重工集团	009540 KS	韩国证券交易所	韩国	55,984	78,695,003.05	0.73
45	Hana Financial Group Inc	韩亚金融集团	086790 KS	韩国证券交易所	韩国	400,590	77,891,455.07	0.72
46	Asciano Ltd	-	AIO AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	2,666,666	77,516,172.79	0.72
47	Wesfarmers Ltd	-	WES AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	400,000	76,224,255.63	0.70
48	China Overseas Land & Investment Ltd	中国海外发展有限公司	688 HK	香港证券交易所	中国香港	7,070,000	74,396,804.02	0.69
49	KT & G Corp	-	033780 KS	韩国证券交易所	韩国	155,661	69,303,366.11	0.64
50	Wharf (Holdings) Ltd	九龙仓(集团)有限公司	4 HK	香港证券交易所	中国香港	2,387,100	67,926,291.15	0.63
51	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	台湾积体电路制造股份有限公司	2330 TT	台湾证券交易所	中国台湾	4,230,000	66,722,242.18	0.62
52	WorleyParsons Ltd	-	WOR AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	400,000	66,328,021.76	0.61
53	MediaTek Inc	联发科技股份有限公司	2454 TT	台湾证券交易所	中国台湾	1,128,000	65,137,808.99	0.60
54	Sands China Ltd	金沙中国有限公司	1928 HK	香港证券交易所	中国香港	3,650,800	64,965,493.14	0.60
55	Cheung Kong (Holdings) Ltd	长江实业(集团)有限公司	1 HK	香港证券交易所	中国香港	852,000	63,822,195.36	0.59
56	Prada SpA	普拉达公司	1913 HK	香港证券交易所	中国香港	2,217,100	63,178,714.40	0.58
57	PTT Global Chemical Public Co Ltd	-	PTTGC-R TB	泰国证券交易所	泰国	4,995,778	60,860,594.42	0.56
58	Origin Energy Ltd	-	ORG AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	700,000	60,320,516.87	0.56
59	Larsen & Toubro Ltd	-	LT IN	印度证券交	印度	500,000	59,007,534.00	0.54

				易所				
60	AIA Group Ltd	友邦保险控股有限公司	1299 HK	香港证券交易所	中国香港	2,953,000	58,054,429.68	0.54
61	BOC Hong Kong (Holdings) Ltd	中银香港(控股)有限公司	2388 HK	香港证券交易所	中国香港	3,881,000	57,892,411.28	0.53
62	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	鸿海精密工业股份有限公司	2317 TT	台湾证券交易所	中国台湾	3,180,000	54,858,346.05	0.51
63	Hang Lung Properties Ltd	恒隆集团有限公司	101 HK	香港证券交易所	中国香港	2,961,000	53,050,667.67	0.49
64	Fraser & Neave Ltd	-	FNN SP	新加坡证券交易所	新加坡	1,748,000	52,663,890.68	0.49
65	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	正新橡胶工业股份有限公司	2105 TT	台湾证券交易所	中国台湾	3,845,000	52,408,134.78	0.48
66	Chunghwa Telecom Co Ltd	中华电信股份有限公司	CHT US	纽约证券交易所	美国	246,725	51,736,740.32	0.48
67	DR Reddy's Laboratories Ltd	-	DRRD IN	印度证券交易所	印度	270,000	50,550,351.05	0.47
68	Standard Foods Corp	佳格食品股份有限公司	1227 TT	台湾证券交易所	中国台湾	2,563,500	49,077,474.76	0.45
69	Oil Search Ltd	-	OSH AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	1,100,000	44,410,318.43	0.41
70	Aurora Oil & Gas Ltd	-	AUT AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	2,000,000	43,796,648.57	0.40
71	Formosa Chemicals & Fibre Corp	-	1326 TT	台湾证券交易所	中国台湾	2,610,000	43,395,864.64	0.40
72	Mega Financial Holding Co Ltd	兆丰金融控股股份有限公司	2886 TT	台湾证券交易所	中国台湾	10,171,320	42,755,279.17	0.39
73	Reliance Industries Ltd	-	RIL IN	印度证券交易所	印度	500,000	41,109,204.93	0.38
74	Advanced Information Service Public Co Ltd	-	ADVANC-R TB	泰国证券交易所	泰国	1,200,000	33,671,370.53	0.31
75	New China Life Insurance Co Ltd	新华人寿保险股份有限公司	1336 HK	香港证券交易所	中国香港	1,600,000	33,335,984.00	0.31
76	Amcor Ltd	-	AMC AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	700,000	32,602,018.49	0.30
77	Hutchison Whampoa Ltd	和记黄埔有限公司	13 HK	香港证券交易所	中国香港	592,000	31,219,732.72	0.29
78	PT Indo Tambangraya Megah Tbk	-	ITMG IJ	印度尼西亚证券交易所	印度尼西亚	1,135,000	30,483,187.87	0.28
79	Midas Holdings Ltd	-	MIDAS SP	新加坡证券交易所	新加坡	19,000,000	30,468,239.70	0.28

80	ACC Ltd	-	ACC IN	印度证券交易所	印度	200,000	26,978,601.68	0.25
81	Largan Precision Co Ltd	大立光电股份有限公司	3008 TT	台湾证券交易所	中国台湾	197,000	23,202,977.38	0.21
82	Newcrest Mining Ltd	-	NCM AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	70,000	13,384,462.51	0.12
83	QR National Ltd	-	QRN AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	500,000	11,046,057.38	0.10

注：1. 所用证券代码采用 Ticker 代码。

2. 所属国家（地区）列示证券挂牌的证券交易所所在国家（地区）。

8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Commonwealth Bank of Australia	CBA AU	565,547,207.86	3.47
2	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	554,653,244.58	3.40
3	Anhui Conch Cement Co Ltd	914 HK	471,019,068.66	2.89
4	BHP Billiton plc	BLT LN	465,433,713.69	2.85
5	China National Building Material Co Ltd	3323 HK	451,124,146.16	2.77
6	Rio Tinto plc	RIO LN	417,247,174.38	2.56
7	KB Financial Group Inc	105560 KS	356,634,038.68	2.19
8	Hyundai Heavy Industries Co Ltd	009540 KS	340,154,937.01	2.09
9	Hana Financial Group Inc	086790 KS	338,097,154.93	2.07
10	National Australia Bank Ltd	NAB AU	330,243,582.60	2.02
11	Genting Singapore plc	GENS SP	319,031,393.47	1.96
12	China Construction Bank Corp	939 HK	317,734,530.55	1.95
13	China Petroleum & Chemical Corp	386 HK	313,591,963.45	1.92
14	OCI Co Ltd	010060 KS	286,817,005.79	1.76
15	Aluminum Corp of China Ltd	2600 HK	275,195,995.37	1.69
16	PT Astra International Tbk	ASII IJ	272,683,266.98	1.67
17	Sands China Ltd	1928 HK	270,243,772.32	1.66
18	Yanzhou Coal Mining Co Ltd	1171 HK	262,128,868.38	1.61
19	Samsung Electronics Co Ltd	005930 KS	261,338,078.42	1.60
20	Krung Thai Bank Public Co Ltd	KTB-R TB	259,607,211.65	1.59

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	China Construction Bank Corp	939 HK	607,678,601.13	3.73
2	KB Financial Group Inc	105560 KS	549,109,707.49	3.37
3	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd	2318 HK	499,368,604.12	3.06
4	Yanzhou Coal Mining Co Ltd	1171 HK	477,821,672.83	2.93
5	BHP Billiton Ltd	BHP AU	472,210,230.89	2.90
6	Siam Cement Public Co Ltd	SCC-R TB	461,562,735.46	2.83
7	Hyundai Heavy Industries Co Ltd	009540 KS	438,165,001.25	2.69
8	Commonwealth Bank of Australia	CBA AU	437,038,552.96	2.68
9	CNOOC Ltd	883 HK	435,165,711.72	2.67
10	Samsung Electronics Co Ltd	005930 KS	329,598,638.71	2.02
11	OCI Co Ltd	010060 KS	299,446,589.78	1.84
12	Keppel Corp Ltd	KEP SP	297,752,833.17	1.83
13	Rio Tinto Ltd	RIO AU	290,586,979.23	1.78
14	Petronas Chemicals Group Bhd	PCHEM MK	285,227,430.18	1.75
15	Genting Singapore plc	GENS SP	283,463,816.70	1.74
16	Advanced Semiconductor Engineering Inc	2311 TT	280,580,143.25	1.72
17	China National Building Material Co Ltd	3323 HK	268,959,535.22	1.65
18	Samsung Engineering Co Ltd	028050 KS	268,264,977.27	1.64
19	Agile Property Holdings Ltd	3383 HK	266,447,066.46	1.63
20	Zijin Mining Group Co Ltd	2899 HK	258,715,635.67	1.59

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

金额单位：人民币元

买入成本（成交）总额	18,237,622,485.40
卖出收入（成交）总额	20,430,335,968.01

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	iShares MSCI Taiwan Webs Index Units	ETF	ETF	I shares Inc.	87,330,196.78	0.81

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.11.3 其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	43,986,599.76
3	应收股利	2,905,242.29
4	应收利息	90,273.62
5	应收申购款	600,511.19
6	其他应收款	15,376,090.25
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	62,958,717.11

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
1,475,573	14,507.07	213,809,615.82	1.00%	21,192,436,326.43	99.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	372,699.54	0.0017%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2007年10月22日)基金份额总额	29,572,160,439.53
本报告期期初基金份额总额	23,583,479,226.07
本报告期基金总申购份额	304,805,597.43
减：本报告期基金总赎回份额	2,482,038,881.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	21,406,245,942.25

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

2011 年 1 月 29 日基金管理人发布《上投摩根基金管理有限公司关于聘任高级管理人员的公告》，经本公司董事会审议通过，决定聘任经晓云女士、冯刚先生为本公司副总经理。

2011 年 10 月 29 日基金管理人发布《上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经本公司董事会审议通过，同意童威先生辞去本公司副总经理职务。

基金托管人：

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。报告年度应支付给聘任普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 180,000 元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 5 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人、托管人未受稽查或处罚，亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		基金交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Goldman Sachs Securities Ltd	1	2,340,774,845.00	6.06%			3,168,910.17	5.12%	-
JP Morgan Secs Ltd	1	1,386,679,998.44	3.59%			2,573,506.07	4.16%	-
CIMB Securities Ltd	1	263,754,532.38	0.68%			479,299.29	0.77%	-
Macquarie Securities Ltd	1	880,361,229.82	2.28%			1,610,434.25	2.60%	-
Citigroup Global Mkts Ltd	1	2,722,243,053.87	7.05%	91,633,155.84	5.68%	4,035,415.60	6.52%	-
Merrill Lynch	1	5,076,907,525.12	13.14%	350,360,062.55	21.73%	8,058,373.68	13.01%	-
CLSA Ltd	1	2,331,877,846.17	6.03%			4,187,624.46	6.76%	-
Morgan Stanley Ltd	1	3,939,999,252.58	10.20%	370,571,068.86	22.98%	6,175,977.73	9.97%	-
Credit Suisse Ltd	1	4,800,943,681.54	12.42%	122,771,348.55	7.62%	7,256,131.56	11.72%	-
Samsung Securities Co Ltd	1	719,568,168.35	1.86%			1,259,243.58	2.03%	-
UBS Securities Ltd	1	6,530,581,232.10	16.90%	390,066,932.48	24.19%	9,985,769.94	16.13%	-
HSBC Hongkong	1	204,063,830.17	0.53%			357,111.78	0.58%	-
Deutsche Bank AG London	1	591,258,894.85	1.53%	286,827,750.37	17.79%	761,636.11	1.23%	-
China Intl Capital Corp Secs Ltd	1	581,006,844.39	1.50%			1,016,761.99	1.64%	-
Sinopac Securities Co Ltd	1	1,130,671,641.61	2.93%			1,978,665.15	3.20%	-
Yuanta Securities Co Ltd	1	966,543,343.74	2.50%			1,691,451.52	2.73%	-
CCB International Securities Ltd	1	891,386,049.71	2.31%			1,559,925.61	2.52%	-
Nomura intl Ltd	1	2,769,566,259.31	7.17%			4,872,486.04	7.87%	-
BNP Paribas	1	69,458,647.18	0.18%			121,552.64	0.20%	-
Masterlink Securities Corp	1	442,672,347.41	1.15%			774,676.61	1.25%	-
Enam Securities Ltd	1	-	-			-	-	-
China Merchants Securities(HK) Co Ltd	1	-	-			-	-	-
Haitong International Securities Company Ltd	1	-	-			-	-	-
PINGAN of China Securities (Hong Kong)	1							

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 交易单元的选择标准：

1) 资本金雄厚,信誉良好。

- 2) 财务状况良好,经营行为规范。
- 3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需
要,并能为本基金提供全面的信息服
务。
- 5) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金
提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 交易单元的选择程序:

1) 本基金管理人定期召开会议,组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候
选券商进行评估,确定选用交易单元的券商。

2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。

4. 2011 年度新增 China Merchants Securities(HK) Co Ltd、Haitong International
Securities Company Ltd、Masterlink Securities Corporation、PINGAN of China Securities
(Hong Kong)共计 4 个席位,无注销席位。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1.	上投摩根基金管理有限公司关于聘任高级管理人员的公告	基金管理人公司网站、 《上海证券报》、《证券 时报》和《中国证券报》	2011 年 1 月 29 日
2.	上投摩根亚太优势股票型证券投资基金节假日暂停交易的公告	同上	2011 年 4 月 21 日
3.	上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金暂停申购、赎回、定期定额投资的公告	同上	2011 年 5 月 9 日
4.	上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2011 年 10 月 29 日
5.	上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金暂停申购、赎回、定期定额投资的公告	同上	2011 年 12 月 23 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准上投摩根亚太优势股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金托管协议》；
- 4、《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照。

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

网址：www.51fund.com

上投摩根基金管理有限公司

二〇一二年三月二十六日