

上投摩根亚太优势股票型证券投资基金

2013 年半年度报告摘要

2013 年 6 月 30 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：二〇一三年八月二十七日

1 重要提示

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。本半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 2013 年 8 月 26 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	18,831,019,998.41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	胥洪擎	赵会军
	联系电话	021-38794888	010-66105799
	电子邮箱	services@jpmf-sitico.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-4888	95588
传真		021-68881170	010-66105798

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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.51fund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	161,080,885.55
本期利润	-790,466,072.11

加权平均基金份额本期利润	-0.0407
本期基金份额净值增长率	-7.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2013年 6月 30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.4692
期末基金资产净值	10,151,536,498.87
期末基金份额净值	0.539

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	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	-6.42%	1.54%	-6.34%	1.51%	-0.08%	0.03%
过去三个月	-7.39%	1.16%	-9.90%	1.07%	2.51%	0.09%
过去六个月	-7.23%	0.99%	-8.84%	0.91%	1.61%	0.08%
过去一年	6.52%	0.91%	3.75%	0.85%	2.77%	0.06%
过去三年	-2.88%	1.16%	2.93%	1.15%	-5.81%	0.01%
自基金合同生效起至今	-46.10%	1.67%	-36.23%	1.73%	-9.87%	-0.06%

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 2013年 6月 30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 2013 年 6 月 30 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。

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 2013 年 6 月底，公司管理的基金共有二十三只，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、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质股票型证券投资基金、上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金、上投摩根分红添利债券型证券投资基金、上投摩根中证消费服

务领先指数证券投资基金、上投摩根核心优选股票型证券投资基金、上投摩根轮动添利债券型证券投资基金、上投摩根智选 30 股票型证券投资基金和上投摩根成长动力股票型证券投资基金。

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	-	19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	-	8年（金融领域从业经验19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

					资基金基金经理，自2012年3月起同时担任上投摩根全球天然资源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	-	9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、《上投摩根亚太优势股票型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，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相

关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于二级市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于一级市场申购活动，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的交易价差和分配结果监控分析，监察稽核部未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易时间、交易价格、分配结果监控分析，监察稽核部未发现存在异常交易行为。

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形：不适用。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

华尔街有一句流行语是：Sell in May and go away，意思是指投资者应该在 5 月份时卖出手中持股离开市场。

今年这个 5 月魔咒在亚太股市中又再次发威，分析造成这波亚太市场在 5 月下旬后陷入狂风暴雨的因素主要有二。第一个同时也是最重要的因素是市场对于美联储在今年下半年开始缩减 QE 规模的担忧；第二个因素是中国银行间利率的飙升。因此我们看到 5 月下旬至 6 月份全球股债市大幅下跌，其中受创最深的是新兴市场。在外资卖超的影响下，使得摩根史坦利 (MSCI) 新兴市场指数自 5 月中旬起一度下跌逾 13%。

在主要投资的市场中，绩效正贡献来源主要是台湾与泰国股市。台湾市场部分，由于台湾以出口为导向，美国复苏会带动台湾电子、机械等的出口公司基本面受惠。另外台湾保险公司的海外投资占比高，因此受惠美国国债上扬，对提高其投资收益的程度也最大。泰国部分则因国际油价走高，带动塑化相关公司获利好转。而在上半年报告期间，对基金绩效负贡献的主要来源是印度与韩国。其中印度市场在这波外资卖超亚股中受创严重，印度汇率在 6 月下旬一度贬值至历史低点，汇价的下跌使金融股也出现较大的跌幅。韩国部分则与出口股表现不佳有关，受日币贬值影响走势多半不佳。特别是营建股在海外工程项目收帐不顺与利

润率严重低于市场预期情况下, 股价一再破底。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为 -7.23%, 同期业绩比较基准收益率为 -8.84%

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年亚太股市走势, 我们认为随着美国 10年期国债利率回到 2.6%附近后, 市场已相当程度消化了 QE减码的利空。在最近一次美联储会议后, 几位高官先后说目前不是谈 QE 退出好时机可以看成是美联储想让市场恢复平静的努力。另一方面, 中国银行间利率飙升造成市场对金融体系和经济增长的担忧, 也随央行表态与后续在市场注入资金使流动性逐步得到缓解。因此让市场在 5-6月陷入混乱的两大因子已在 6月底后逐步和缓, 未来随着美国经济持续向好, 与中国经济底部信号得到确立, 将对稳定全球与亚太股市走势有很大的帮助。

在区域配置部分, 我们将采取较为均衡分散的投资策略, 除了略为提高受惠美国复苏明确的台湾股市投资比重外, 也会关注香港 H股的投资机会。中国经济虽然在今年的成长速度较为缓和, 但结构调整产生了一些新的投资亮点。东盟部分则维持目前投资比重。

4.7 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。

4.8 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

本报告期内，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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，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 托管人对本半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2013年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2013年 6月 30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

上投摩根亚太优势股票型证券投资基金 2013 年半年度报告

		2013年 6月 30日	2012年 12月 31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	698,338,071.73	499,155,741.18
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	9,404,781,762.93	11,161,647,046.09
其中：股票投资		9,404,781,762.93	11,011,267,137.40
基金投资		-	150,379,908.69
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		62,131,156.01	-
应收利息	6.4.7.5	57,454.49	72,639.74
应收股利		37,930,890.04	-
应收申购款		424,669.35	404,017.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	5,803,556.58	6,403,314.52
资产总计		10,209,467,561.13	11,667,682,758.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年 6月 30日	上年度末 2012年 12月 31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		16,066,266.56	-
应付赎回款		23,524,438.08	17,325,023.98
应付管理人报酬		15,152,728.07	17,581,567.03
应付托管费		2,946,363.80	3,418,638.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	11,881,429.86
其他负债	6.4.7.8	241,265.75	482,068.61
负债合计		57,931,062.26	50,688,727.53
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	18,831,019,998.41	19,991,921,418.98
未分配利润	6.4.7.10	-8,679,483,499.54	-8,374,927,387.80
所有者权益合计		10,151,536,498.87	11,616,994,031.18

负债和所有者权益总计		10,209,467,561.13	11,667,682,758.71
------------	--	-------------------	-------------------

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.539 元，基金份额总额 18,831,019,998.41 份。

6.2 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		-656,101,653.45	192,945,396.84
1. 利息收入		1,154,435.49	1,460,995.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,154,435.49	1,460,995.23
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)		312,600,249.41	-480,618,727.74
其中：股票投资收益	6.4.7.12	182,849,706.22	-610,337,741.45
基金投资收益	6.4.7.13	4,017,842.92	-8,316,883.35
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	125,732,700.27	138,035,897.06
3. 公允价值变动收益(损失以 - 号填列)	6.4.7.17	-951,546,957.66	681,829,082.37
4. 汇兑收益(损失以 - 号填列)		-18,337,820.58	-9,753,603.99
5. 其他收入(损失以 - 号填列)	6.4.7.18	28,439.89	27,650.97
减：二、费用		146,330,683.80	180,003,677.26
1. 管理人报酬		100,508,284.47	101,378,503.60
2. 托管费		19,543,277.51	19,712,486.79
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	25,896,872.49	58,544,959.65
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	6.4.7.20	382,249.33	367,727.22
三、利润总额(亏损总额以 - 号填列)		-802,432,337.25	12,941,719.58
减：所得税费用		-11,966,265.14	-
四、净利润(净亏损以 - 号填列)		-790,466,072.11	12,941,719.58

6.3 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：2013年 1月 1日至 2013年 6月 30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年 1月 1日至 2013年 6月 30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)	19,991,921,418.98	-8,374,927,387.80	11,616,994,031.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-790,466,072.11	-790,466,072.11
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)	-1,160,901,420.57	485,909,960.37	-674,991,460.20
其中：1 基金申购款	50,350,560.66	-21,196,992.75	29,153,567.91
2 基金赎回款	-1,211,251,981.23	507,106,953.12	-704,145,028.11
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)	18,831,019,998.41	-8,679,483,499.54	10,151,536,498.87
项目	上年度可比期间 2012年 1月 1日至 2012年 6月 30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)	21,406,245,942.25	-10,578,255,073.08	10,827,990,869.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,941,719.58	12,941,719.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净	-659,136,369.81	306,191,926.76	-352,944,443.05

值减少以 - 号填列)			
其中：1 基金申购款	86,058,779.93	-40,319,737.17	45,739,042.76
2 基金赎回款	-745,195,149.74	346,511,663.93	-398,683,485.81
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）	20,747,109,572.44	-10,259,121,426.74	10,487,988,145.70

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：章硕麟，主管会计工作负责人：胡志强，会计机构负责人：张璐

6.4 报表附注

6.4.1 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业务经营在亚太地区的公司。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 2013 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 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 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年上半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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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 Company, 纽约梅隆银行)	境外资产托管人

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年 1月 1日至 2013年 6月 30日	2012年 1月 1日至 2012年 6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	100,508,284.47	101,378,503.60
其中：支付销售机构的客户维护费	13,297,421.15	13,374,866.20

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年 1月 1日至 2013年 6月 30日	2012年 1月 1日至 2012年 6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	19,543,277.51	19,712,486.79

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 (含回购) 交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

无。

6.4.8.5 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	
	2013年 1月 1日至 2013年 6月 30日		2012年 1月 1日至 2012年 6月 30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	276,107,096.44	1,154,321.73	290,432,305.82	1,230,698.27
纽约梅隆银行	422,230,975.29	-	262,481,974.76	230,296.96

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2013年 6月 30日）本基金持有的流通受限证券

无。

7 投资组合报告

7.1 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	9,404,781,762.93	92.12
	其中：普通股	8,132,671,625.70	79.66
	存托凭证	1,272,110,137.23	12.46
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
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	698,338,071.73	6.84
8	其他各项资产	106,347,726.47	1.04
9	合计	10,209,467,561.13	100.00

注：截至 2013 年 6 月 30 日，上投摩根亚太优势股票型证券投资基金资产净值为 10,151,536,498.87 元，基金份额净值为 0.539 元，累计基金份额净值为 0.539 元。

7.2 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	3,851,307,190.08	37.94
韩国	1,775,503,286.94	17.49
印度	1,063,417,133.60	10.48
中国台湾	673,841,968.90	6.64
泰国	621,633,679.47	6.12
美国	536,525,165.15	5.29
新加坡	428,031,916.57	4.22
印度尼西亚	292,538,255.39	2.88
卢森堡	113,951,292.61	1.12
马来西亚	48,031,874.22	0.47
合计	9,404,781,762.93	92.64

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。

7.3 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	1,870,713,807.45	18.43
半导体产品与设备	1,269,531,616.83	12.51
房地产管理和开发	858,607,118.30	8.46
汽车	633,507,619.24	6.24
保险	495,634,010.11	4.88
建筑材料	411,827,461.39	4.06
石油、天然气与消费用燃料	330,325,252.67	3.25
互联网软件与服务	312,023,243.72	3.07
互助储蓄银行与抵押贷款	270,599,202.62	2.67
酒店、餐馆与休闲	262,131,445.99	2.58
多元化零售	231,852,891.35	2.28
金属与采矿	224,021,213.25	2.21
食品	188,631,704.65	1.86

燃气公用事业	165,108,883.99	1.63
通信设备	159,948,116.20	1.58
电子设备、仪器和元件	158,197,184.22	1.56
纺织品、服装与奢侈品	154,418,740.87	1.52
机械制造	141,147,877.22	1.39
工业集团企业	138,920,925.00	1.37
能源设备与服务	137,268,096.24	1.35
建筑与工程	133,230,994.55	1.31
海运	130,917,684.18	1.29
综合金融服务	118,376,752.12	1.17
电脑与外围设备	105,969,848.58	1.04
汽车零部件	95,502,265.32	0.94
化学制品	94,737,743.39	0.93
综合电信业务	63,865,502.22	0.63
航空公司	60,850,047.60	0.60
无线电信业务	60,825,063.16	0.60
电气设备	42,757,539.77	0.42
资本市场	42,594,149.15	0.42
贸易公司与经销商	40,737,761.58	0.40
合计	9,404,781,762.93	92.64

注：行业分类标准：MSCI

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

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	Samsung Electronics Co Ltd	三星电子有限公司	005930 KS	韩国证券交易所	韩国	78,975	573,395,316.44	5.65
2	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	-	TSM US	纽约证券交易所	美国	3,817,512	432,118,628.70	4.26
3	China Construction Bank Corp	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港交易所	中国香港	84,724,150	370,503,749.02	3.65

4	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港交易所	中国香港	1,287,700	312,023,243.72	3.07
5	AIA Group Ltd	友邦保险控股有限公司	1299 HK	香港交易所	中国香港	11,556,000	302,382,009.62	2.98
6	Housing Development Finance Corp Ltd	-	HDFC IN	印度国家证券交易所	印度	2,960,636	270,599,202.62	2.67
7	HDFC Bank Ltd	-	HDFCB IN	印度国家证券交易所	印度	3,818,627	265,818,828.02	2.62
8	Hyundai Motor Co Ltd	现代汽车	005380 KS	韩国证券交易所	韩国	206,980	252,514,847.84	2.49
9	POSCO	韩国浦项钢铁公司	005490 KS	韩国证券交易所	韩国	138,718	224,021,213.25	2.21
10	KB Financial Group Inc	-	105560 KS	韩国证券交易所	韩国	1,095,135	202,630,938.52	2.00

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）。

3. 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益投资明细，应阅读登载于本基金管理人网站（www.51fund.com）的半年度报告正文。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 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	Hyundai Motor Co Ltd	005380 KS	261,064,846.63	2.25

2	China Petroleum & Chemical Corp	386 HK	249,812,997.82	2.15
3	KIA Motors Corp	000270 KS	146,446,660.47	1.26
4	Sands China Ltd	1928 HK	139,482,185.51	1.20
5	Want Want China Holdings Ltd	151 HK	132,113,316.22	1.14
6	Samsung Electronics Co Ltd	005930 KS	125,228,012.82	1.08
7	China Life Insurance Co Ltd	2823 TT	116,143,271.96	1.00
8	KB Financial Group Inc	105560 KS	107,995,335.54	0.93
9	TMB Bank Public Co Ltd	TMB-R TB	98,156,994.33	0.84
10	PTT Exploration & Production Public Co Ltd	PTTEP-R TB	90,878,516.74	0.78
11	China Minsheng Banking Corp Ltd	1988 HK	80,593,695.68	0.69
12	AIA Group Ltd	1299 HK	79,406,601.96	0.68
13	Samsung Engineering Co Ltd	028050 KS	78,716,521.09	0.68
14	Hutchison Whampoa Ltd	13 HK	78,231,873.44	0.67
15	PTT Public Co Ltd	PTT-R TB	78,155,360.21	0.67
16	Largan Precision Co Ltd	3008 TT	77,706,602.62	0.67
17	Hyundai Heavy Industries Co Ltd	009540 KS	76,887,268.67	0.66
18	POSCO	005490 KS	75,592,902.61	0.65
19	Mando Corp	060980 KS	74,745,019.40	0.64
20	Global Logistics Properties Ltd	GLP SP	65,965,119.08	0.57

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。

7.5.2 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	Hyundai Mobis	012330 KS	246,150,148.15	2.12
2	KIA Motors Corp	000270 KS	208,079,539.80	1.79

3	PT Astra International Tbk	ASII IJ	200,183,640.31	1.72
4	CNOOC Ltd	883 HK	188,629,022.86	1.62
5	China Mobile Ltd	941 HK	164,480,992.56	1.42
6	Krung Thai Bank Public Co Ltd	KTB-R TB	151,845,454.11	1.31
7	Hutchison Whampoa Ltd	13 HK	147,743,117.39	1.27
8	Belle Intl Holdings Ltd	1880 HK	136,370,512.43	1.17
9	Shinhan Financial Group Co Ltd	055550 KS	132,940,277.95	1.14
10	Cheung Kong (Holdings) Ltd	1 HK	124,776,877.79	1.07
11	Samsung C&T Corp	000830 KS	117,506,767.87	1.01
12	Jardine Matheson Holdings Ltd	JM SP	112,443,891.52	0.97
13	Hyundai Motor Co Ltd	005380 KS	105,384,468.09	0.91
14	China National Building Material Co Ltd	3323 HK	105,298,156.73	0.91
15	PetroChina Co Ltd	857 HK	103,405,208.35	0.89
16	Hyundai Heavy Industries Co Ltd	009540 KS	99,219,780.37	0.85
17	China Shenhua Energy Co Ltd	1088 HK	95,621,560.31	0.82
18	New China Life Insurance Co Ltd	1336 HK	93,416,288.89	0.80
19	Anhui Conch Cement Co Ltd	914 HK	89,413,535.34	0.77
20	China Oilfield Services Ltd	2883 HK	83,131,540.81	0.72

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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	3,935,757,708.06
卖出收入（成交）总额	4,779,896,461.73

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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

7.9 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。

7.10 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

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	62,131,156.01
3	应收股利	37,930,890.04
4	应收利息	57,454.49
5	应收申购款	424,669.35
6	其他应收款	5,803,556.58
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	106,347,726.47

7.11.4 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。

7.11.5 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。

7.11.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

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。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
1,327,931	14,180.72	181,886,425.69	0.97%	18,649,133,572.72	99.03%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	256,322.78	0.0014%

注：期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份（含），该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

9 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
本报告期初基金份额总额	19,991,921,418.98
本报告期基金总申购份额	50,350,560.66
减：本报告期基金总赎回份额	1,211,251,981.23
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	18,831,019,998.41

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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：

2013年 2月 8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》，经上投摩根基金管理有限公司董事会审议通过，决定聘任陈星德先生为公司副总经理且陈星德先生不再担任公司督察长一职、聘任刘万方先生为公司督察长。

2013年 4月 19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》，经上投摩根基金管理有限公司董事会审议通过，决定聘任张军先生为公司副总经理。

基金托管人：

无。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 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。

10.7 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	
BNP Paribas	1	19,965,856.70	0.23%	-	-	34,940.17	0.22%	-
BOCI Securities Ltd	1	100,331,176.47	1.15%	-	-	175,579.56	1.09%	-
CCBInternational Securities Ltd	1	40,517,196.93	0.46%	-	-	70,905.10	0.44%	-
China Everbright Securities Ltd	1	52,838,087.23	0.61%	-	-	92,466.65	0.58%	-
China Intl Capital Corp Secs Ltd	1	890,217,211.24	10.21%	-	-	1,534,240.28	9.57%	-
China Merchants Securities Ltd	1	69,759,046.66	0.80%	-	-	122,078.34	0.76%	-
CIMB Securities Ltd	1	22,572,087.14	0.26%	-	-	135,457.10	0.84%	-
Citigroup Global Mkts Ltd	1	398,654,825.00	4.57%	-	-	703,240.33	4.38%	-
CLSA Ltd	1	284,261,754.68	3.26%	-	-	464,596.62	2.90%	-
Credit Suisse Ltd	1	622,604,119.73	7.14%	-	-	1,027,817.61	6.41%	-
Deutsche Bank AG London	1	139,022,196.24	1.60%	-	-	243,288.84	1.52%	-
Goldman Sachs Securities Ltd	1	506,497,137.54	5.81%	81,554,555.57	54.73%	1,383,900.41	8.63%	-
HSBC Hongkong	1	204,349,398.48	2.34%	-	-	357,611.48	2.23%	-
ICBC International Securities Ltd	1	75,208,855.62	0.86%	-	-	131,615.48	0.82%	-
Instinet Ltd	1	242,569,020.58	2.78%	-	-	453,434.97	2.83%	-
JP Morgan Secs Ltd	1	338,965,623.91	3.89%	-	-	588,104.86	3.67%	-
Macquarie Securities Ltd	1	460,334,562.96	5.28%	-	-	820,344.66	5.12%	-

Masterlink Securities Corp	1	110,327,354.28	1.27%	-	-	193,073.20	1.20%	-
Merrill Lynch	1	1,168,144,338.64	13.40%	33,477,546.60	22.47%	2,058,796.85	12.84%	-
Morgan Stanley Ltd	1	1,125,658,693.77	12.92%	33,986,215.42	22.81%	2,254,395.14	14.06%	-
Nomura intl Ltd	1	593,689,649.33	6.81%	-	-	1,060,465.46	6.61%	-
Samsung Securities Co Ltd	1	189,068,859.51	2.17%	-	-	330,870.21	2.06%	-
Sinopac Securities Co Ltd	1	28,732,192.80	0.33%	-	-	50,280.80	0.31%	-
UBS Securities Ltd	1	997,389,562.69	11.44%	-	-	1,691,042.12	10.54%	-
Yuanta Securities Co Ltd	1	33,975,361.65	0.39%	-	-	59,457.08	0.37%	-
CITIC Securities Ltd	1	-	-	-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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,并能为本基金提供全面的信息服。
- 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。

3. 交易单元的选择程序：

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。

4. 2013 年上半年度新增 CITIC Securities Ltd 共计 1 个席位,无注销席位。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一三年八月二十七日