

**上投摩根亚太优势混合型证券投资基金**  
**2015 年年度报告**  
**2015 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：二〇一六年三月三十日

## §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 2016 年 3 月 29 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。

本基金的基金名称自 2015 年 7 月 21 日起由上投摩根亚太优势股票型证券投资基金变更为上投摩根亚太优势混合型证券投资基金。该变更不涉及基金份额持有人权利义务关系的变化，亦不涉及投资目标、投资范围和投资策略的变更，对本基金的投资及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | 5  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6  |
| 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....                      | 6  |
| 2.5 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.6 其他相关资料.....                              | 7  |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 9  |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 9  |
| 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.....             | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 12 |
| 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.....             | 13 |
| 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 14 |
| 4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 15 |
| 4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 15 |
| 4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 16 |
| 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....      | 16 |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 16 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 16 |
| 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.....      | 16 |
| <b>§6 审计报告</b> .....                         | 17 |
| 6.1 管理层对财务报表的责任.....                         | 17 |
| 6.2 注册会计师的责任.....                            | 17 |
| 6.3 审计意见.....                                | 17 |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | 18 |
| 7.1 资产负债表.....                               | 18 |
| 7.2 利润表.....                                 | 19 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 21 |
| 7.4 报表附注.....                                | 22 |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                       | 44 |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 44 |
| 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....              | 45 |
| 8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....                      | 45 |
| 8.4 指数投资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.....   | 46 |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....                   | 49        |
| 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....                | 50        |
| 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 .....    | 51        |
| 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 ..... | 51        |
| 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 ..... | 51        |
| 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 .....   | 51        |
| 8.11 投资组合报告附注 .....                         | 51        |
| <b>§9 基金份额持有人信息</b> .....                   | <b>52</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 52        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 52        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....     | 52        |
| <b>§10 开放式基金份额变动</b> .....                  | <b>52</b> |
| <b>§11 重大事件揭示</b> .....                     | <b>53</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 53        |
| 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 .....      | 53        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 53        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 53        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 53        |
| 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 .....         | 53        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 54        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 57        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....             | <b>57</b> |
| <b>§13 备查文件目录</b> .....                     | <b>58</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 58        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 58        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 58        |

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 上投摩根亚太优势混合型证券投资基金  |
| 基金简称       | 上投摩根亚太优势混合(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 | 8,171,380,093.39 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 | 本基金为区域性混合型证券投资基金，基金投资风险收益水平低于股票型基金，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混合型基金。 |
|--------|---|

### 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<br>负责人 | 姓名   | 胡迪                | 洪渊                  |
|             | 联系电话 | 021-38794888      | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | services@cifm.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 400-889-4888      | 95588               |
| 传真          |      | 021-20628400      | 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       |      | 穆矢                | 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 | <a href="http://www.cifm.com">http://www.cifm.com</a> |
| 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(特殊普通合伙) | 中国·上海市           |
| 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 | 2015 年            | 2014 年            | 2013 年            |
|---------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 本期已实现收益       | 563,294,091.21    | 216,093,424.34    | 41,155,429.63     |
| 本期利润          | 32,098,610.83     | 75,427,293.43     | -86,714,341.75    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0032            | 0.0048            | -0.0046           |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.55%             | 0.83%             | -0.81%            |
| 本期基金份额净值增长率   | -2.58%            | 0.69%             | -0.69%            |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末           | 2014 年末           | 2013 年末           |
| 期末可供分配利润      | -3,550,341,826.79 | -6,189,633,203.44 | -8,210,579,771.95 |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.4345           | -0.4611           | -0.4752           |
| 期末基金资产净值      | 4,621,038,266.60  | 7,802,555,164.24  | 9,975,973,887.95  |
| 期末基金份额净值      | 0.566             | 0.581             | 0.577             |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2015 年末           | 2014 年末           | 2013 年末           |
| 基金份额累计净值增长率   | -43.40%           | -41.90%           | -42.30%           |

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<br>增长率① | 份额净值增长<br>率标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|--------------|-----------------|----------------|-------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 4.43%        | 1.08%           | 6.83%          | 1.22%             | -2.40% | -0.14% |
| 过去六个月          | -8.12%       | 1.33%           | -8.23%         | 1.35%             | 0.11%  | -0.02% |
| 过去一年           | -2.58%       | 1.10%           | -6.58%         | 1.10%             | 4.00%  | 0.00%  |
| 过去三年           | -4.87%       | 0.98%           | -12.10%        | 0.97%             | 7.23%  | 0.01%  |
| 过去五年           | 11.86%       | 0.90%           | 3.78%          | 0.86%             | 8.08%  | 0.04%  |
| 自基金合同生效<br>起至今 | -43.40%      | 1.47%           | -36.22%        | 1.51%             | -7.18% | -0.04% |

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

上投摩根亚太优势混合型证券投资基金  
自基金合同生效以来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 2015 年 12 月 31 日)



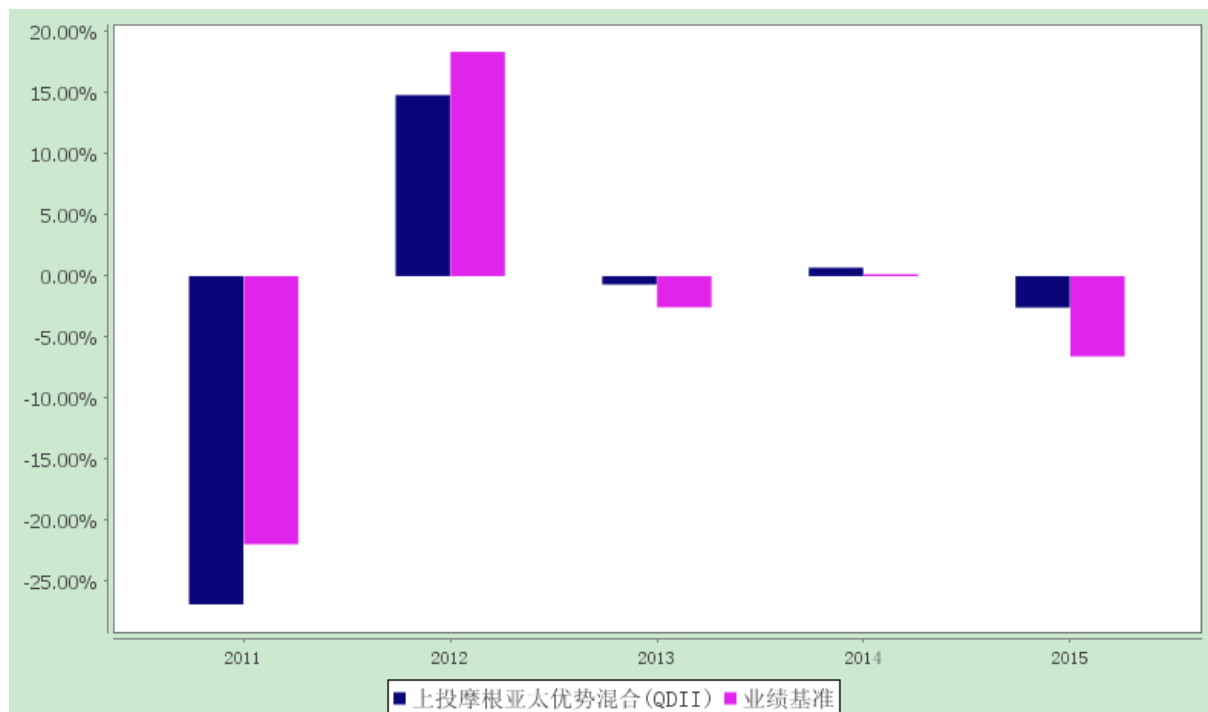
注：1.本基金合同生效日为 2007 年 10 月 22 日，图示时间段为 2007 年 10 月 22 日至 2015 年 12 月 31 日。

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 过去五年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

上投摩根亚太优势混合型证券投资基金  
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 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 2015 年 12 月底，公司管理的基金共有四十七只，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、上投摩根阿尔法混合型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋混合型证券投资基金、上投摩根内需动力混合型证券投资基金、上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘混合型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、上投摩根新兴动力混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金、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、上投摩根核心优选混合型证券投资基金、上投摩根轮动添利债券型证券投资基金、上投摩根智选 30 混合型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、上证 180 高贝塔交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金、上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金、上投摩根红利回报混合型证券投资基金、上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根民生需求股票型证券投资基金、上投摩根优信增利债券型证券投资基金、上投摩根现金管理货币市场基金、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添盈货币市场基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根纯债添利债券型证券投资基金、上投摩根稳进回报混合型证券投资基金、上投摩根安全战略股票型证券投资基金、上投摩根卓越制造股票型证券投资基金、上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置证券投资基金、上投摩根智慧互联股票型证券投资基金、上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根新兴服务股票型证券投资基金、上投摩根医疗健康股票型证券投资基金和上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金。

#### 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 | 2007-10-22      | 2015-4-10 | 21 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，2007 年 10 月至 2015 年 4 月担任上投摩根亚太优势混合型证券投资基金基金经理。 |
| 张军  | 本基金基金经  | 2008-03-08      | -         | 11 年（金融领域从业 | 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  |

|     |                   |            |           |          |   |
|-----|-------------------|------------|-----------|----------|---|
|     | 理、国际投资部总监         |            |           | 经验 22 年) | 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混合型证券投资基金基金经理，自 2012 年 3 月起同时担任上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金基金经理。   |
| 王邦祺 | 本基金基金经理、国际投资部总监助理 | 2014-12-30 | -         | 15 年     | 台湾大学历史学硕士班，曾任职于香港永丰金证券(亚洲)及香港永丰金资产(亚洲)有限公司，负责管理海外可转债及海外新兴市场固定收益部位。2007 年 9 月加入上投摩根基金管理有限公司，任投资经理，从事 QDII 海外固定收益及海外可转债投资及研究工作。2011 年 1 月起任上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金基金经理，自 2014 年 12 月起担任上投摩根亚太优势混合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  | 2015-5-18 | 12 年     | 上海对外贸易学院国际贸易学硕士，2003 年 5 月至 2006 年 5 月在天和证券经纪有限公司任行业研究员，2006 年 5 月至 2007 年 7 月在路透社中文网任财经分析师。自 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. 杨逸枫女士为本基金首任基金经理，其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         | 39 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 | 21 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、《上投摩根亚太优势混合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。

本报告期内中国证监会上海监管局对公司进行了常规全面现场检查，就公司内部控制提出了相应改进意见并采取责令改正的行政监管措施，公司已经按照要求完成了改进工作。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求，制订了《上投摩根基金管理有限公司公平交易制度》，规范了公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动，同时涵盖了授权、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各个环节，以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

公司执行自上而下的三级授权体系，依次为投资决策委员会、投资总监、经理人，经理人在其授权范围内自主决策，投资决策委员会和投资总监均不得干预其授权范围内的投资活动。公司已建立客观的研究方法，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。对于交易所市场投资活动，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机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易室询价机制，严格防范交易对手风险并抽检价格公允性；对于一级市场申购投资行为，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。

公司制订了《异常交易监控与报告制度》，通过系统和人工相结合的方式对投资交易行为的监控分析，并执行异常交易行为监控分析记录工作机制，确保公平交易可稽核。公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查。

##### 4.4.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行上述公平交易制度和控制方法，开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的收益率差异、以及不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易时机和交易价差等方面的监控分析，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

其中，在同向交易的监控和分析方面，根据法规要求，公司对不同投资组合的同日和临近交易日的同向交易行为进行监控，通过定期抽查前述的同向交易行为，定性分析交易时机、对比不同投

投资组合长期的交易趋势，重点关注任何可能导致不公平交易的情形。对于识别的异常情况，由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理解释。同时，公司根据法规的要求，通过系统模块定期对连续四个季度内不同投资组合在不同时间窗内（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行分析，采用概率统计方法，主要关注不同投资组合之间同向交易价差均值为零的显著性检验，以及同向交易价格占优的交易次数占比分析。

报告期内，通过前述分析方法，未发现不同投资组合之间同向交易价差异常的情况。

#### 4.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，公司未发现存在异常交易行为。

报告期内，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：报告期内，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% 的次数为两次，均发生在纯量化投资组合与主动管理投资组合之间。

### 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

回顾过去一年，亚洲市场表现不一，MSCI 亚洲市场指数下跌 9%。其中印度、菲律宾与韩国市场各跌 6%，算是表现比较强势的市场；MSCI 印度尼西亚、马来西亚以及泰国指数大跌 19%、20% 以及 23%，是表现比较弱势的市场。整体看，亚洲市场比发达市场的表现不佳，主要原因是国际投资人的资金持续流出，亚洲货币兑美元持续贬值，但比同为新兴市场的拉美与东欧好很多。

美联储于 2013 年 12 月开始减少买债，并于 2015 年 12 月正式开启升息循环，市场预期美元持续升值的走势在 2014 年第三季末全面发酵。以 2015 年全年观察，除了新台币、人民币以及印度卢比全年贬值幅度勉强在 5% 以内，其中大部分亚洲市场货币兑美元下跌幅度都不小，东南亚国家货币的跌幅在 8%-18%，相对较为弱势。

中国的经济开始需要追求有质量的增长，GDP 增速 8% 以上的时代已经过去。2015 年的经济成长只有 6.9%，是 29 年来最低，这意谓着靠着卖矿卖油的部分市场已经把日子过完，不论是距离较远的拉美与东欧，或是距离较近的澳洲市场，如果不能跟着有效转型，未来将被投资人长期抛弃。在这个背景下，亚洲市场在全球市场的比重越来越大，相对全球市场也更形重要。此外，亚洲基础设施建设银行(AIIB)准备成立，一带一路政策对于亚洲市场的推动，都将出现更为深远的影响。我们认

为，亚太未来进一步成长的动能已经确立。

#### 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-2.58%，同期业绩比较基准收益率为-6.58%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在 2016 年，我们认为三个趋势持续发生：

首先是亚洲市场大范围地下调实质利率。韩国市场与泰国市场都在 2015 年第二季下调利率至 1.5%，台湾市场早就在 1.625%，中国市场一年存款利率也下调到 1.5%。目前一年基准利率比较高的地方只有印度、印度尼西亚与菲律宾，但是这几个地方，通货膨胀的数字都不高，未来两年内可能都有一定的下调空间，这个趋势将对亚洲各个市场的估值产生必然的支撑。

第二个趋势是人民币的国际化，一带一路的政策走向是催化剂，这是中国资本全面流向世界的开始，未来也将填补因为美国能源自主，所造成的国际美元供应短缺。也许目前国际资本市场尚未完全接受国际化的人民币，外汇市场也在测试中国在经济增速下滑与资本外流周期时如何引导货币市场的稳定。我们判断，在可见的未来，其它亚洲市场受益的程度，因为中国内需的成长与中国资本的大量外流，很可能因此比中国本地还高。表现在市场层面，就是估值相对较低的各个亚洲市场，将受惠于中国资本所带来的流动性，在这之中，香港与东南亚市场都将是受惠者。

第三个趋势是，经济较发达的各个市场纷纷出现老年化的现象，有人口红利的市场越来越少，人口结构比较年轻的印度尼西亚、印度、菲律宾未来将对未来全球市场的成长提供更重要的成长动能。相对的，年纪比较老化的几个市场，包括韩国、台湾以还有不久后的中国，老年需求将是未来市场关注的焦点。

亚太市场的长期投资，基于这三个长期趋势，未来应该会有很不一样的面貌，我们的投资也要逐年进行相应的调整。未来我们将顺着一带一路的脚步积极发掘因为中国资本外流所出现的亚洲投资机会，也会结合国内市场的研究团队，寻找与 A 股市场相应的海外中国企业发展的各种可能。

回顾 2015 年，我们针对美元升值以及美国经济回升的长期趋势进行调整，加大东北亚市场外销板块的配置，这包括了韩国与台湾市场的科技与工业板块。因应人民币国际化的趋势，我们关注了重点市场的金融板块，这包括了中国与东南亚市场各区主要的银行股与保险股。最后因应老年化的趋势，我们超配了印度与印度尼西亚两个具有人口红利的年轻市场，也加强了中国市场医疗板块的配置。此外，我们判断中国资本未来全面进入世界体系，这个进程将随着一带一路战略的推动而逐步前进，因此我们也对东南亚市场可能受惠板块给予较多的关注。

最后，说明一下 2016 年上半年，我们对于几个板块投资想法。第一是石油价格有长期低价化的

风险。伊朗石油重回市场是大事，跟伊拉克与利比亚一样，都是全球重要的产油国。此外，各用油国对于新能源的补贴力度不减反增，除非有主要的产油国如俄罗斯退出市场，否则油价不易出现机会。油价若出现反弹，我们认为幅度不会太高，时间也不会太长。第二，持续性的低油价将带动全球的通缩压力，在借贷需求下滑，但是债券收益率持续创新低的大环境下，全球的金融板块可能出现自 2008 年金融海啸后相对剧烈的结构压力，或许有必要适度减仓，以应对市场的转变。第三，亚太市场的消费升级需求，如化妆品与奢侈品的升级，如高端医疗与保险养老的需要。第四，我们也看好部分新科技发展所开发出的新应用，如电动车、机械人、新能源以及互联网，这会有很多投资机会。以上这四个投资趋势，将是 2016 年上半年本基金重点关注的方向。

#### 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和合规宣传，强化合规意识，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。

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从而对基金份额持有人利益的情形。

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，切实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。

#### **4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。

### **§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混合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，上投摩根亚太优势混合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混合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，上投摩根亚太优势混合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混合型证券投资基金 2015 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

普华永道中天审字(2016)第 21360 号

上投摩根亚太优势混合型证券投资基金全体基金份额持有人：：

我们审计了后附的上投摩根亚太优势混合型证券投资基金(原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 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 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。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)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。

### 6.2 注册会计师的责任

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。

### 6.3 审计意见

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、中国基金业协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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

陈玲曹阳

中国·上海市

2016 年 3 月 29 日

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：上投摩根亚太优势混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         | -                       | -                        |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 266,890,850.14          | 493,756,853.72           |
| 结算备付金      |         | -                       | -                        |
| 存出保证金      |         | -                       | -                        |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 4,375,237,446.38        | 7,366,993,101.49         |
| 其中：股票投资    |         | 4,363,157,000.88        | 7,366,993,101.49         |
| 基金投资       |         | 12,080,445.50           | -                        |
| 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    |         | 3,968,458.44            | 33,735,528.66            |
| 应收利息       | 7.4.7.5 | 24,773.26               | 65,761.81                |
| 应收股利       |         | 745,037.71              | 2,705,304.42             |
| 应收申购款      |         | 62,824.29               | 295,491.05               |
| 递延所得税资产    |         | -                       | -                        |
| 其他资产       | 7.4.7.6 | 10,120,736.83           | 5,590.44                 |

|            |              |                         |                          |
|------------|--------------|-------------------------|--------------------------|
| 资产总计       |              | <b>4,657,050,127.05</b> | <b>7,897,557,631.59</b>  |
| 负债和所有者权益   | 附注号          | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 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    |              | 6,384,360.71            | 21,057,414.62            |
| 应付赎回款      |              | 15,844,054.99           | 57,978,737.96            |
| 应付管理人报酬    |              | 7,063,721.84            | 12,959,414.06            |
| 应付托管费      |              | 1,373,501.48            | 2,519,886.07             |
| 应付销售服务费    |              | -                       | -                        |
| 应付交易费用     | 7.4.7.7      | -                       | -                        |
| 应交税费       |              | -                       | -                        |
| 应付利息       |              | -                       | -                        |
| 应付利润       |              | -                       | -                        |
| 递延所得税负债    | 7.4.14(1)(a) | 522,910.69              | -                        |
| 其他负债       | 7.4.7.8      | 4,823,310.74            | 487,014.64               |
| 负债合计       |              | <b>36,011,860.45</b>    | <b>95,002,467.35</b>     |
| 所有者权益:     |              | -                       | -                        |
| 实收基金       | 7.4.7.9      | 8,171,380,093.39        | 13,422,752,840.68        |
| 未分配利润      | 7.4.7.10     | -3,550,341,826.79       | -5,620,197,676.44        |
| 所有者权益合计    |              | <b>4,621,038,266.60</b> | <b>7,802,555,164.24</b>  |
| 负债和所有者权益总计 |              | <b>4,657,050,127.05</b> | <b>7,897,557,631.59</b>  |

注: 报告截止日 2015 年 12 月 31 日, 基金份额净值 0.566 元, 基金份额总额 8,171,380,093.39 份。

## 7.2 利润表

会计主体: 上投摩根亚太优势混合型证券投资基金

本报告期: 2015 年 1 月 1 日至 2015 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                             |
|-----------------------|----------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|                       |          | 2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 1 月 1 日至<br>2014 年 12 月 31 日 |
| <b>一、收入</b>           |          | <b>199,417,493.28</b>               | <b>306,866,505.22</b>               |
| 1.利息收入                |          | 1,182,433.32                        | 2,412,620.67                        |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11 | 1,182,433.32                        | 1,997,397.99                        |
| 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                |          | -                                   | 415,222.68                          |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 683,439,025.96                      | 447,188,321.33                      |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.12 | 586,105,367.09                      | 262,825,673.33                      |
| 基金投资收益                | 7.4.7.13 | -98,517.40                          | -                                   |
| 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 | -                                   | -                                   |
| 股利收益                  | 7.4.7.16 | 97,432,176.27                       | 184,362,648.00                      |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | -531,195,480.38                     | -140,666,130.91                     |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | 45,914,823.51                       | -2,101,781.80                       |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.18 | 76,690.87                           | 33,475.93                           |
| <b>减：二、费用</b>         |          | <b>166,079,535.78</b>               | <b>236,744,652.13</b>               |
| 1. 管理人报酬              |          | 105,636,349.94                      | 164,035,068.71                      |
| 2. 托管费                |          | 20,540,401.40                       | 31,895,707.83                       |
| 3. 销售服务费              |          | -                                   | -                                   |
| 4. 交易费用               | 7.4.7.19 | 39,175,703.16                       | 40,151,767.20                       |
| 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 | 727,081.28                          | 662,108.39                          |

|                     |              |                      |                      |
|---------------------|--------------|----------------------|----------------------|
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |              | <b>33,337,957.50</b> | <b>70,121,853.09</b> |
| 减：所得税费用             | 7.4.14(1)(d) | 1,239,346.67         | -5,305,440.34        |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |              | <b>32,098,610.83</b> | <b>75,427,293.43</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根亚太优势混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 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）                        | 13,422,752,840.68                           | -5,620,197,676.44 | 7,802,555,164.24  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 32,098,610.83     | 32,098,610.83     |
| 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）      | -5,251,372,747.29                           | 2,037,757,238.82  | -3,213,615,508.47 |
| 其中：1.基金申购款                             | 157,778,900.86                              | -60,345,033.22    | 97,433,867.64     |
| 2.基金赎回款                                | -5,409,151,648.15                           | 2,098,102,272.04  | -3,311,049,376.11 |
| 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）                        | 8,171,380,093.39                            | -3,550,341,826.79 | 4,621,038,266.60  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 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）                        | 17,279,479,756.91                           | -7,303,505,868.96 | 9,975,973,887.95  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 75,427,293.43     | 75,427,293.43     |
| 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）      | -3,856,726,916.23                           | 1,607,880,899.09  | -2,248,846,017.14 |

|  |                   |                   |                   |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|
| 其中：1.基金申购款                             | 62,893,555.25     | -26,550,207.66    | 36,343,347.59     |
| 2.基金赎回款                                | -3,919,620,471.48 | 1,634,431,106.75  | -2,285,189,364.73 |
| 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)                        | 13,422,752,840.68 | -5,620,197,676.44 | 7,802,555,164.24  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 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

上投摩根亚太优势混合型证券投资基金(原名为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 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》, 上投摩根亚太优势股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 21 日公告后更名为上投摩根亚太优势混合型证券投资基金。

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《上投摩根亚太优势混合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 2016 年 3 月 29 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根亚太优势混合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、中国基金业协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 2015 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、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，包括银行存款和其他各类应收款项等。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其他各类应付款项等。

### 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，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。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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 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。上述申购分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加。

#### **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**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

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；处置时其处置价格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为正数，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，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，即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，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.14其他重要的会计政策和会计估计**

##### **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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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，在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

(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              | 上年度末             |
|------|------------------|------------------|
|      | 2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 12 月 31 日 |
| 活期存款 | 266,890,850.14   | 493,756,853.72   |
| 定期存款 | -                | -                |
| 其他存款 | -                | -                |
| 合计   | 266,890,850.14   | 493,756,853.72   |

注：货币资金中包括以下外币余额：

于 2015 年 12 月 31 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 126,155,806.29 元(折合人民币 105,690,811.39 元)，美元 1,644,658.39 元(折合人民币 10,679,753.72 元)，泰国铢 0.05 元(折合人民币 0.01 元)，澳元 99.32 元(折合人民币 469.23 元)，印度卢比 58,131,162.12 元(折合人民币 5,705,893.46 元)，马来西亚林吉特 297,217.00 元(折合人民币 449,518.65 元)，印尼卢比 0.26 元(折合人民币 0.00 元)和新台币 75,243,053.00 元(折合人民币 14,874,974.55 元)。

于 2014 年 12 月 31 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 118,353,374.61 元(折合人民币 93,365,426.63 元)，美元 4,249,948.92 元(折合人民币 26,005,437.44 元)，泰国铢 0.05 元(折合人民币 0.01 元)，澳元 99.32 元(折合人民币 497.34 元)，印度卢比 2,135,755.17 元(折合人民币 207,036.89 元)和新台币 537,388,780.00 元(折合人民币 104,052,969.58 元)。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末              |      |        |
|----|------------------|------|--------|
|    | 2015 年 12 月 31 日 |      |        |
|    | 成本               | 公允价值 | 公允价值变动 |
|    |                  |      |        |

|        |                  |                  |                  |                |
|--------|------------------|------------------|------------------|----------------|
| 股票     |                  | 3,895,937,449.10 | 4,363,157,000.88 | 467,219,551.78 |
| 债券     | 交易所市场            | -                | -                | -              |
|        | 银行间市场            | -                | -                | -              |
|        | 合计               | -                | -                | -              |
| 资产支持证券 |                  | -                | -                | -              |
| 基金     |                  | 12,133,834.77    | 12,080,445.50    | -53,389.27     |
| 其他     |                  | -                | -                | -              |
| 合计     |                  | 3,908,071,283.87 | 4,375,237,446.38 | 467,166,162.51 |
| 项目     | 上年度末             |                  |                  |                |
|        | 2014 年 12 月 31 日 |                  |                  |                |
|        |                  | 成本               | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票     |                  | 6,368,631,458.60 | 7,366,993,101.49 | 998,361,642.89 |
| 债券     | 交易所市场            | -                | -                | -              |
|        | 银行间市场            | -                | -                | -              |
|        | 合计               | -                | -                | -              |
| 资产支持证券 |                  | -                | -                | -              |
| 基金     |                  | -                | -                | -              |
| 其他     |                  | -                | -                | -              |
| 合计     |                  | 6,368,631,458.60 | 7,366,993,101.49 | 998,361,642.89 |

#### 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              | 上年度末             |
|----|------------------|------------------|
|    | 2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 12 月 31 日 |
|    |                  |                  |

|            |           |           |
|------------|-----------|-----------|
| 应收活期存款利息   | 24,773.26 | 65,761.81 |
| 应收定期存款利息   | -         | -         |
| 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         | 24,773.26 | 65,761.81 |

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目      | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|---------|-------------------------|--------------------------|
| 其他应收款   | 5,780,246.79            | 5,590.44                 |
| 待摊费用    | -                       | -                        |
| 应收货币兑换款 | 4,340,490.04            | -                        |
| 合计      | 10,120,736.83           | 5,590.44                 |

注：于 2015 年 12 月 31 日，其他应收款余额为应收印度市场投资税务年度退税款。

#### 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<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | 1,608.86                | 2,014.64                 |
| 预提费用        | 485,000.00              | 485,000.00               |
| 应付货币兑换款     | 4,336,701.88            | -                        |

|    |              |            |
|----|--------------|------------|
| 合计 | 4,823,310.74 | 487,014.64 |
|----|--------------|------------|

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                               |                   |
|---------------|----------------------------------|-------------------|
|               | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |                   |
|               | 基金份额（份）                          | 账面金额              |
| 上年度末          | 13,422,752,840.68                | 13,422,752,840.68 |
| 本期申购          | 157,778,900.86                   | 157,778,900.86    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -5,409,151,648.15                | -5,409,151,648.15 |
| 本期末           | 8,171,380,093.39                 | 8,171,380,093.39  |

注：申购含转换入份额。

**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           | -6,189,633,203.44 | 569,435,527.00  | -5,620,197,676.44 |
| 本期利润           | 563,294,091.21    | -531,195,480.38 | 32,098,610.83     |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,305,091,435.74  | -267,334,196.92 | 2,037,757,238.82  |
| 其中：基金申购款       | -69,378,903.85    | 9,033,870.63    | -60,345,033.22    |
| 基金赎回款          | 2,374,470,339.59  | -276,368,067.55 | 2,098,102,272.04  |
| 本期已分配利润        | -                 | -               | -                 |
| 本期末            | -3,321,247,676.49 | -229,094,150.30 | -3,550,341,826.79 |

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目       | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|----------|----------------------------------|----------------------------------|
|          | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |
| 活期存款利息收入 | 1,182,433.32                     | 1,997,268.65                     |

|           |              |              |
|-----------|--------------|--------------|
| 定期存款利息收入  | -            | -            |
| 其他存款利息收入  | -            | -            |
| 结算备付金利息收入 | -            | -            |
| 其他        | -            | 129.34       |
| 合计        | 1,182,433.32 | 1,997,397.99 |

**7.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

| 项目         | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|------------|----------------------------------|----------------------------------|
|            | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |
| 卖出股票成交总额   | 8,168,878,556.69                 | 8,138,991,474.54                 |
| 减：卖出股票成本总额 | 7,582,773,189.60                 | 7,876,165,801.21                 |
| 买卖股票差价收入   | 586,105,367.09                   | 262,825,673.33                   |

**7.4.7.13 基金投资收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|---------------|----------------------------------|----------------------------------|
|               | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |
| 卖出/赎回基金成交总额   | 7,199,583.71                     | -                                |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 7,298,101.11                     | -                                |
| 基金投资收益        | -98,517.40                       | -                                |

**7.4.7.14 债券投资收益**

无。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

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               |
|-------------|-----------------------|-----------------------|
|             | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年1月1日至2014年12月31日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 96,844,000.92         | 184,362,648.00        |
| 基金投资产生的股利收益 | 588,175.35            | -                     |
| 合计          | 97,432,176.27         | 184,362,648.00        |

## 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               |
|------------|-----------------------|-----------------------|
|            | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年1月1日至2014年12月31日 |
| 1.交易性金融资产  | -531,195,480.38       | -140,666,130.91       |
| ——股票投资     | -531,142,091.11       | -140,666,130.91       |
| ——债券投资     | -                     | -                     |
| ——资产支持证券投资 | -                     | -                     |
| ——基金投资     | -53,389.27            | -                     |
| ——其他       | -                     | -                     |
| 2.衍生工具     | -                     | -                     |
| ——权证投资     | -                     | -                     |
| 3.其他       | -                     | -                     |
| 合计         | -531,195,480.38       | -140,666,130.91       |

## 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               |
|---------|-----------------------|-----------------------|
|         | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年1月1日至2014年12月31日 |
| 基金赎回费收入 | 76,690.87             | 33,475.93             |
| 印花税返还   | -                     | -                     |
| 其他      | -                     | -                     |
| 配股手续费   | -                     | -                     |
| 新股手续费返还 | -                     | -                     |
| 转换费收入   | -                     | -                     |
| 合计      | 76,690.87             | 33,475.93             |

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               |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
|           | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年1月1日至2014年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 39,175,703.16         | 40,151,767.20         |
| 银行间市场交易费用 | -                     | -                     |
| 合计        | 39,175,703.16         | 40,151,767.20         |

#### 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               |
|-------|-----------------------|-----------------------|
|       | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年1月1日至2014年12月31日 |
| 审计费用  | 185,000.00            | 185,000.00            |
| 信息披露费 | 300,000.00            | 300,000.00            |
| 税务顾问费 | 209,752.78            | 131,541.06            |
| 其他    | 32,328.50             | 45,567.33             |
| 合计    | 727,081.28            | 662,108.39            |

#### 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 Company, “纽约梅隆银行”) | 境外资产托管人             |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| 上海国际信托有限公司(“上海信托”)                         | 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                    | 上年度可比期间               |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
|                 | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年1月1日至2014年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 105,636,349.94        | 164,035,068.71        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 12,043,020.56         | 21,767,046.33         |

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                    | 上年度可比期间               |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
|                | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年1月1日至2014年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 20,540,401.40         | 31,895,707.83         |

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：

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

#### 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

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               |              |
|--------|-----------------------|--------------|-----------------------|--------------|
|        | 2015年1月1日至2015年12月31日 |              | 2014年1月1日至2014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 | 129,597,520.14        | 1,182,433.32 | 270,223,284.31        | 1,997,268.65 |
| 纽约梅隆银行 | 137,293,330.00        | -            | 223,533,569.41        | -            |
| 合计     | 266,890,850.14        | 1,182,433.32 | 493,756,853.72        | 1,997,268.65 |

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

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2015 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

本基金为区域性混合型证券投资基金，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，定期或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，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管控，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，因而与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 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2014 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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、组合在短时间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。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

#### 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                   |                         |                         |                         |
|-----------------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
|                 | 2015年12月31日           |                         |                         |                         |
|                 | 美元<br>折合人民币           | 港币<br>折合人民币             | 其他币种<br>折合人民币           | 合计                      |
| <b>以外币计价的资产</b> |                       |                         |                         |                         |
| 银行存款            | 10,679,753.72         | 105,690,811.39          | 21,030,855.90           | 137,401,421.01          |
| 交易性金融资产         | 120,857,257.35        | 1,813,606,891.43        | 2,440,773,297.60        | 4,375,237,446.38        |
| 应收证券清算款         | -                     | -                       | 3,968,458.44            | 3,968,458.44            |
| 应收股利            | -                     | -                       | 745,037.71              | 745,037.71              |
| 其他资产            | 449,262.31            | -                       | 9,671,474.52            | 10,120,736.83           |
| <b>资产合计</b>     | <b>131,986,273.38</b> | <b>1,919,297,702.82</b> | <b>2,476,189,124.17</b> | <b>4,527,473,100.37</b> |
| <b>以外币计价的负债</b> |                       |                         |                         |                         |
| 应付证券清算款         | -                     | -                       | 6,384,360.71            | 6,384,360.71            |
| 递延所得税负债         | -                     | -                       | 522,910.69              | 522,910.69              |
| 其他负债            | 3,887,183.25          | -                       | 449,518.63              | 4,336,701.88            |

|               |                       |                         |                         |                         |
|---------------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 负债合计          | <b>3,887,183.25</b>   | -                       | <b>7,356,790.03</b>     | <b>11,243,973.28</b>    |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | <b>128,099,090.13</b> | <b>1,919,297,702.82</b> | <b>2,468,832,334.14</b> | <b>4,516,229,127.09</b> |
| 项目            | 上年度末                  |                         |                         |                         |
|               | 2014年12月31日           |                         |                         |                         |
|               | 美元<br>折合人民币           | 港币<br>折合人民币             | 其他币种<br>折合人民币           | 合计                      |
| 以外币计价的资产      |                       |                         |                         |                         |
| 银行存款          | 26,005,437.44         | 93,365,426.63           | 104,260,503.82          | 223,631,367.89          |
| 交易性金融资产       | 663,426,754.07        | 2,769,917,270.90        | 3,933,649,076.52        | 7,366,993,101.49        |
| 应收证券清算款       | 7,840,603.17          | 18,079,587.74           | 7,815,337.75            | 33,735,528.66           |
| 应收股利          | 963,566.27            | 1,630,427.41            | 111,310.74              | 2,705,304.42            |
| 其他资产          | -                     | -                       | 5,590.44                | 5,590.44                |
| 资产合计          | <b>698,236,360.95</b> | <b>2,882,992,712.68</b> | <b>4,045,841,819.27</b> | <b>7,627,070,892.90</b> |
| 以外币计价的负债      |                       |                         |                         |                         |
| 应付证券清算款       | 11,772,910.54         | 1,315,434.83            | 7,969,069.25            | 21,057,414.62           |
| 负债合计          | <b>11,772,910.54</b>  | <b>1,315,434.83</b>     | <b>7,969,069.25</b>     | <b>21,057,414.62</b>    |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | <b>686,463,450.41</b> | <b>2,881,677,277.85</b> | <b>4,037,872,750.02</b> | <b>7,606,013,478.28</b> |

#### 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<br>2015年12月31日           | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|    | 所有外币相对人民币升值5%    | 增加约22,581                    | 增加约38,030           |
|    | 所有外币相对人民币贬值5%    | 减少约22,581                    | 减少约38,030           |

#### 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<br>2015 年 12 月 31 日 |               | 上年度末<br>2014 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 | 4,363,157,000.88        | 94.42         | 7,366,993,101.49         | 94.42         |
| 交易性金融资产—基金投资 | 12,080,445.50           | 0.26          | -                        | -             |
| 衍生金融资产—权证投资  | -                       | -             | -                        | -             |
| 其他           | -                       | -             | -                        | -             |
| <b>合计</b>    | <b>4,375,237,446.38</b> | <b>94.68</b>  | <b>7,366,993,101.49</b>  | <b>94.42</b>  |

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：

| 项目   | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |               | 上年度末<br>2014 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 | 1,484,089,058.33        | 32.12         | 2,248,118,206.16         | 28.81         |

|      |                  |       |                  |       |
|------|------------------|-------|------------------|-------|
| 韩国   | 796,966,110.11   | 17.25 | 1,343,580,369.18 | 17.22 |
| 印度   | 420,367,277.99   | 9.10  | 1,103,664,868.23 | 14.14 |
| 中国香港 | 436,451,446.77   | 9.44  | 708,320,734.14   | 9.08  |
| 新加坡  | 99,598,357.57    | 2.15  | 264,247,521.21   | 3.39  |
| 澳大利亚 | -                | -     | -                | -     |
| 其他市场 | 1,137,765,195.61 | 24.62 | 1,699,061,402.57 | 21.78 |
| 合计   | 4,375,237,446.38 | 94.68 | 7,366,993,101.49 | 94.42 |

#### 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<br>2015年12月31日           | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|    | 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%          | 增加约 20,795                   | 增加约 39,013          |
|    | 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%          | 减少约 20,795                   | 减少约 39,013          |

#### 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 2015 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

|         | 2015 年 12 月 31 日 |          | 2014 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 | -                | -        | -                | -        |

##### (b) 递延所得税负债

|         | 2015 年 12 月 31 日 |              | 2014 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 | 522,910.69       | 3,021,906.42 | -                | -        |

(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:

|           | 2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 12 月 31 日 |
|-----------|------------------|------------------|
| 递延所得税负债净额 | 522,910.69       | -                |

##### (d) 所得税费用

| 项目        | 本期<br>2015 年度       | 上年度可比期间<br>2014 年度   |
|-----------|---------------------|----------------------|
| 当期所得税费用   | 811,328.74          | -5,305,440.34        |
| 递延所得税费用   | 428,017.93          | -                    |
| <b>合计</b> | <b>1,239,346.67</b> | <b>-5,305,440.34</b> |

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<br>2015 年度      |               |
|----------|--------------------|---------------|
|          | 应纳税所得              | 当期所得税费用       |
| 印度市场股票投资 | 4,995,678.61       | 811,328.74    |
|          | 上年度可比期间<br>2014 年度 |               |
|          | 应纳税所得              | 当期所得税费用       |
| 印度市场股票投资 | -                  | -5,305,440.34 |

## (2) 公允价值

### (a) 金融工具公允价值的计量方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

#### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 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次的余额为 4,375,237,446.38 元，无属于第二层次和第三层次的余额 (2014 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 7,366,993,101.49 元，无属于第二层次和第三层次的余额)。

#### (ii) 公允价值所属各层次间的重大变动

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次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额及本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 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。

(3) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §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    | 4,363,157,000.88 | 93.69         |
|    | 其中: 普通股 | 4,053,993,743.57 | 87.05         |
|    | 存托凭证    | 309,163,257.31   | 6.64          |
|    | 优先股     | -                | -             |
|    | 房地产信托凭证 | -                | -             |
| 2  | 基金投资    | 12,080,445.50    | 0.26          |
| 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      | 266,890,850.14   | 5.73   |
| 8 | 其他各项资产            | 14,921,830.53    | 0.32   |
| 9 | 合计                | 4,657,050,127.05 | 100.00 |

## 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   | 1,813,606,891.43 | 39.25        |
| 韩国     | 796,966,110.11   | 17.25        |
| 中国台湾   | 664,803,015.72   | 14.39        |
| 印度     | 420,367,277.99   | 9.10         |
| 泰国     | 188,305,999.96   | 4.07         |
| 印度尼西亚  | 162,771,807.70   | 3.52         |
| 美国     | 110,916,205.11   | 2.40         |
| 新加坡    | 109,539,409.81   | 2.37         |
| 菲律宾    | 64,366,659.99    | 1.39         |
| 马来西亚   | 31,513,623.06    | 0.68         |
| 合计     | 4,363,157,000.88 | 94.42        |

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 | 606,998,660.86 | 13.14        |

|               |                  |       |
|---------------|------------------|-------|
| 互联网软件与服务      | 429,578,893.05   | 9.30  |
| 保险            | 379,243,586.27   | 8.21  |
| 半导体产品与设备      | 338,103,852.83   | 7.32  |
| 电脑与外围设备       | 257,365,861.31   | 5.57  |
| 制药            | 173,636,328.74   | 3.76  |
| 石油、天然气与消费用燃料  | 156,187,542.74   | 3.38  |
| 房地产管理和开发      | 153,075,463.16   | 3.31  |
| 综合金融服务        | 141,802,930.84   | 3.07  |
| 食品            | 129,981,144.26   | 2.81  |
| 建筑与工程         | 122,152,468.31   | 2.64  |
| 工业集团企业        | 112,616,649.61   | 2.44  |
| 化学制品          | 101,138,006.93   | 2.19  |
| 烟草            | 92,595,618.12    | 2.00  |
| 个人用品          | 91,709,535.65    | 1.98  |
| 机械制造          | 87,522,795.98    | 1.89  |
| 金属与采矿         | 82,987,161.33    | 1.80  |
| 电子设备、仪器和元件    | 80,078,775.91    | 1.73  |
| 水公用事业         | 75,379,339.28    | 1.63  |
| 互助储蓄银行与抵押贷款   | 74,426,410.22    | 1.61  |
| 互联网与售货目录零售    | 69,670,593.71    | 1.51  |
| 建筑材料          | 68,231,571.03    | 1.48  |
| 电力公用事业        | 68,169,795.69    | 1.48  |
| 信息技术服务        | 59,797,559.43    | 1.29  |
| 纺织品、服装与奢侈品    | 59,607,491.11    | 1.29  |
| 综合电信业务        | 53,534,896.00    | 1.16  |
| 公路与铁路         | 51,418,915.06    | 1.11  |
| 交通基本设施        | 46,015,867.38    | 1.00  |
| 医疗保健提供商与服务    | 40,295,446.30    | 0.87  |
| 商业服务与商业用品     | 39,677,093.24    | 0.86  |
| 无线电信业务        | 39,291,882.00    | 0.85  |
| 航空航天与国防       | 19,225,543.00    | 0.42  |
| 燃气公用事业        | 15,339,039.35    | 0.33  |
| 海运            | 15,098,014.59    | 0.33  |
| 酒店、餐馆与休闲      | 14,608,931.17    | 0.32  |
| 食品与主要用品零售     | 10,447,466.12    | 0.23  |
| 独立电力生产商与能源贸易商 | 6,145,870.30     | 0.13  |
| 合计            | 4,363,157,000.88 | 94.42 |

注：行业分类标准：MSCI

#### 8.4 指数投资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  | Tencent Holdings Ltd                               | 腾讯控股有限公司           | 700 HK    | 香港证券交易所   | 中国香港     | 3,148,500.00  | 402,256,925.33 | 8.70          |
| 2  | 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     | 5,141,500.00  | 185,220,172.41 | 4.01          |
| 3  | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd          | -                  | 2330 TT   | 台湾证券交易所   | 中国台湾     | 5,819,000.00  | 164,503,149.52 | 3.56          |
|    |  |                    | TSM US    | 纽约证券交易所   | 美国       | 94,251.00     | 13,923,643.68  | 0.30          |
| 4  | 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     | 4,538,800.00  | 177,197,239.27 | 3.83          |
| 5  | Samsung Electronics Co Ltd                         | 三星电子有限公司           | 005930 KS | 韩国证券交易所   | 韩国       | 19,000.00     | 132,580,089.58 | 2.87          |
| 6  | Catcher Technology Co Ltd                          | -                  | 2474 TT   | 台湾证券交易所   | 中国台湾     | 2,287,000.00  | 124,785,771.73 | 2.70          |
| 7  | KB Financial Group Inc                             | -                  | 105560 KS | 韩国证券交易所   | 韩国       | 600,000.00    | 110,151,127.05 | 2.38          |
| 8  | Lotte Chemical Corp                                | -                  | 011170 KS | 韩国证券交易所   | 韩国       | 75,000.00     | 101,138,006.93 | 2.19          |
| 9  | CK Hutchison Holdings Ltd                          | 长江和记实业有限公司         | 1 HK      | 香港证券交易所   | 中国香港     | 1,105,000.00  | 96,833,125.74  | 2.10          |
| 10 | KT & G Corp  | -                  | 033780 KS | 韩国证券交易所   | 韩国       | 160,000.00    | 92,595,618.12  | 2.00          |
| 11 | Advanced Semiconductor Engineering Inc             | 日月光半导体制造股份有限公司     | 2311 TT   | 台湾证券交易所   | 中国台湾     | 12,297,000.00 | 92,378,858.65  | 2.00          |
| 12 | Cosmax Inc   | -                  | 192820 KS | 韩国证券交易所   | 韩国       | 90,000.00     | 91,709,535.65  | 1.98          |
| 13 | Hyundai Heavy Industries Co Ltd                    | 现代重工集团             | 009540 KS | 韩国证券交易所   | 韩国       | 180,000.00    | 87,522,795.98  | 1.89          |
| 14 | China Merchants Bank Co Ltd                        | 中国招商银行             | 3968 HK   | 香港证券交易所   | 中国香港     | 5,493,500.00  | 84,222,903.07  | 1.82          |
| 15 | Hyundai Steel Co                                   | -                  | 004020 KS | 韩国证券交易所   | 韩国       | 300,000.00    | 82,987,161.33  | 1.80          |
| 16 | Beijing Enterprises Water Group Ltd                | 北控水务集团有限公司         | 371 HK    | 香港证券交易所   | 中国香港     | 16,570,000.00 | 75,379,339.28  | 1.63          |
| 17 | Housing Development Finance Corp Ltd               | -                  | HDFC IN   | 印度国家证券交易所 | 印度       | 600,000.00    | 74,426,410.22  | 1.61          |
| 18 | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd                 | 香港交易及结算所有限公司       | 388 HK    | 香港证券交易所   | 中国香港     | 438,005.00    | 72,839,938.04  | 1.58          |
| 19 | Fubon Financial Holding Co Ltd                     | -                  | 2881 TT   | 台湾证券交易所   | 中国台湾     | 7,752,000.00  | 68,962,992.80  | 1.49          |
| 20 | Ultratech Cement Ltd                               | -                  | UTCEN IN  | 印度国家证券交易所 | 印度       | 250,000.00    | 68,231,571.03  | 1.48          |
| 21 | Sino Biopharmaceutical Ltd                         | -                  | 1177 HK   | 香港证券交易所   | 中国香港     | 11,478,000.00 | 67,889,234.21  | 1.47          |
| 22 | Reliance Industries Ltd                            | -                  | RIL IN    | 印度国家证券交易所 | 印度       | 680,000.00    | 67,720,229.94  | 1.47          |
| 23 | Orion Corp   | -                  | 001800 KS | 韩国证券交易所   | 韩国       | 10,000.00     | 64,573,260.00  | 1.40          |
| 24 | Tata Consultancy Services Ltd                      | -                  | TCS IN    | 印度国家证券交易所 | 印度       | 250,000.00    | 59,797,559.43  | 1.29          |
| 25 | HDFC Bank Ltd                                      | -                  | HDFCB IN  | 印度国家证券交易所 | 印度       | 450,000.00    | 58,755,877.25  | 1.27          |
| 26 | E Sun Financial Holding Co Ltd                     | -                  | 2884 TT   | 台湾证券交易所   | 中国台湾     | 14,727,103.00 | 55,753,986.35  | 1.21          |
| 27 | DBS Group Holdings Ltd                             | 星展集团控股有限公司         | DBS SP    | 新加坡证券交易所  | 新加坡      | 723,000.00    | 55,233,797.66  | 1.20          |
| 28 | China Unicom (Hong Kong) Ltd                       | 中国联通 (香港) 股份有限公司   | 762 HK    | 香港证券交易所   | 中国香港     | 6,762,000.00  | 53,534,896.00  | 1.16          |
| 29 | China Vanke Co Ltd                                 | -                  | 2202 HK   | 香港证券交易所   | 中国香港     | 2,750,000.00  | 52,759,195.50  | 1.14          |
| 30 | China Auto Rental Inc                              | 神州租车有限公司           | 699 HK    | 香港证券交易所   | 中国香港     | 4,780,000.00  | 51,418,915.06  | 1.11          |
| 31 | PTT Public Co Ltd                                  | -                  | PTT-R TB  | 泰国证券交易所   | 泰国       | 1,166,000.00  | 51,339,590.80  | 1.11          |
| 32 | CSPC Pharmaceutical Group Ltd                      | 石药集团有限公司           | 1093 HK   | 香港证券交易所   | 中国香港     | 7,498,000.00  | 49,750,861.57  | 1.08          |
| 33 | Sino Thai Engineering & Construction Public Co Ltd | -                  | STEC-R TB | 泰国证券交易所   | 泰国       | 10,800,000.00 | 48,722,300.97  | 1.05          |

|    |  |                   |            |            |       |               |               |      |
|----|--|-------------------|------------|------------|-------|---------------|---------------|------|
| 34 | Airports of Thailand Public Co Ltd     | -                 | AOT-R TB   | 泰国证券交易所    | 泰国    | 737,000.00    | 46,015,867.38 | 1.00 |
| 35 | Kasikornbank Public Co Ltd             | -                 | KBANK-R TB | 泰国证券交易所    | 泰国    | 1,554,900.00  | 42,228,240.81 | 0.91 |
| 36 | MediaTek Inc                           | -                 | 2454 TT    | 台湾证券交易所    | 中国台湾  | 846,000.00    | 41,811,928.04 | 0.90 |
| 37 | 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  | 15,300,000.00 | 40,633,167.78 | 0.88 |
| 38 | China Everbright Intl Ltd              | 中国光大集团            | 257 HK     | 香港证券交易所    | 中国香港  | 4,755,000.00  | 39,677,093.24 | 0.86 |
| 39 | JD.com Inc                             | -                 | JD US      | 纳斯达克股票交易所  | 美国    | 188,004.00    | 39,389,846.82 | 0.85 |
| 40 | China Mobile Ltd                       | -                 | 941 HK     | 香港证券交易所    | 中国香港  | 536,000.00    | 39,291,882.00 | 0.85 |
| 41 | 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  | 9,469,400.00  | 37,127,722.00 | 0.80 |
| 42 | PT Wijaya Karya Tbk                    | -                 | WIKA IJ    | 印度尼西亚证券交易所 | 印度尼西亚 | 29,695,500.00 | 36,929,491.83 | 0.80 |
| 43 | PT Bank Central Asia Tbk               | -                 | BBCA IJ    | 印度尼西亚证券交易所 | 印度尼西亚 | 5,869,500.00  | 36,773,207.35 | 0.80 |
| 44 | Tata Power Co Ltd                      | -                 | TPWR IN    | 印度国家证券交易所  | 印度    | 5,500,000.00  | 36,656,172.63 | 0.79 |
| 45 | Pou Chen Corp                          | -                 | 9904 TT    | 台湾证券交易所    | 中国台湾  | 4,287,000.00  | 36,527,552.72 | 0.79 |
| 46 | China Machinery Engineering Corp       | 中国机械工程有限公司        | 1829 HK    | 香港证券交易所    | 中国香港  | 7,657,000.00  | 36,500,675.51 | 0.79 |
| 47 | Lupin Ltd                              | -                 | LPC IN     | 印度国家证券交易所  | 印度    | 200,000.00    | 36,067,239.61 | 0.78 |
| 48 | Tingyi (Cayman Islands) Holdings Corp  | -                 | 322 HK     | 香港证券交易所    | 中国香港  | 3,822,000.00  | 35,414,066.47 | 0.77 |
| 49 | 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  | 77,000.00     | 34,554,642.56 | 0.75 |
| 50 | AU Optronics Corp                      | -                 | 2409 TT    | 台湾证券交易所    | 中国台湾  | 17,193,000.00 | 33,071,532.95 | 0.72 |
| 51 | Tenaga Nasional Bhd                    | -                 | TNB MK     | 吉隆坡证券交易所   | 马来西亚  | 1,564,300.00  | 31,513,623.06 | 0.68 |
| 52 | Vipshop Holdings Ltd                   | -                 | VIPS US    | 纽约证券交易所    | 美国    | 305,381.00    | 30,280,746.89 | 0.66 |
| 53 | Golden Agri-Resources Ltd              | -                 | GGR SP     | 新加坡证券交易所   | 新加坡   | 19,272,700.00 | 29,993,817.79 | 0.65 |
| 54 | PT Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk   | -                 | BBRI IJ    | 印度尼西亚证券交易所 | 印度尼西亚 | 5,480,000.00  | 29,492,767.68 | 0.64 |
| 55 | PT Bank Tabungan Negara Persero Tbk    | -                 | BBTN IJ    | 印度尼西亚证券交易所 | 印度尼西亚 | 47,628,600.00 | 29,054,696.75 | 0.63 |
| 56 | 58.com Inc                             | -                 | WUBA US    | 纽约证券交易所    | 美国    | 63,789.00     | 27,321,967.72 | 0.59 |
| 57 | Metropolitan Bank & Trust Co           | -                 | MBT PM     | 菲律宾证券交易所   | 菲律宾   | 2,304,278.00  | 25,598,263.73 | 0.55 |
| 58 | Hua Hong Semiconductor Ltd             | 华虹半导体有限公司         | 1347 HK    | 香港证券交易所    | 中国香港  | 4,040,000.00  | 25,486,272.94 | 0.55 |
| 59 | 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  | 1,344,000.00  | 25,447,064.83 | 0.55 |
| 60 | SM Prime Holdings Inc                  | -                 | SMPH PM    | 菲律宾证券交易所   | 菲律宾   | 8,383,600.00  | 25,105,567.23 | 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  | 1,245,500.00  | 24,729,883.26 | 0.54 |
| 62 | Yue Yuen Industrial (Holdings) Ltd     | -                 | 551 HK     | 香港证券交易所    | 中国香港  | 1,045,500.00  | 23,079,938.39 | 0.50 |
| 63 | PT Mitra Keluarga Karyasehat Tbk       | -                 | MIKA IJ    | 印度尼西亚证券交易所 | 印度尼西亚 | 19,090,900.00 | 21,583,228.42 | 0.47 |
| 64 | China Medical System Holdings Ltd      | -                 | 867 HK     | 香港证券交易所    | 中国香港  | 2,083,000.00  | 19,928,993.35 | 0.43 |
| 65 | AviChina Industry & Technology Co Ltd  | 中国航空科技工业股份有限公司    | 2357 HK    | 香港证券交易所    | 中国香港  | 3,762,000.00  | 19,225,543.00 | 0.42 |
| 66 | Apollo Hospitals Enterprise Ltd        | -                 | APHS IN    | 印度国家证券交易所  | 印度    | 130,000.00    | 18,712,217.88 | 0.40 |
| 67 | China Pacific Insurance (Group) Co Ltd | 中国太平洋保险(集团)股份有限公司 | 2601 HK    | 香港证券交易所    | 中国香港  | 629,600.00    | 16,826,174.59 | 0.36 |
| 68 | Fosun Intl Ltd                         | -                 | 656 HK     | 香港证券交易所    | 中国香港  | 1,557,000.00  | 15,783,523.87 | 0.34 |
| 69 | Hanjin Shipping Co Ltd                 | -                 | 117930 KS  | 韩国证券交易所    | 韩国    | 750,000.00    | 15,098,014.59 | 0.33 |
| 70 | United Overseas Bank Ltd               | -                 | UOB SP     | 新加坡证券交易所   | 新加坡   | 160,100.00    | 14,370,742.12 | 0.31 |
| 71 | Ayala Land Inc                         | -                 | ALI PM     | 菲律宾证券交易所   | 菲律宾   | 2,873,900.00  | 13,662,829.03 | 0.30 |
| 72 | Zhen Ding Technology Holding Ltd       | -                 | 4958 TT    | 台湾证券交易所    | 中国台湾  | 831,000.00    | 12,452,600.40 | 0.27 |
| 73 | BGF Retail Co Ltd                      | -                 | 027410 KS  | 韩国证券交易所    | 韩国    | 11,000.00     | 10,447,466.12 | 0.23 |
| 74 | MGM China Holdings Ltd                 | -                 | 2282 HK    | 香港证券交易所    | 中国香港  | 1,235,600.00  | 10,041,061.39 | 0.22 |
| 75 | Hongkong Land Holdings Ltd             | -                 | HKL SP     | 新加坡证券交易所   | 新加坡   | 218,700.00    | 9,941,052.24  | 0.22 |



|    |                                     |              |           |            |       |               |              |      |
|----|-------------------------------------|--------------|-----------|------------|-------|---------------|--------------|------|
| 76 | Swire Properties Ltd                | -            | 1972 HK   | 香港证券交易所    | 中国香港  | 522,800.00    | 9,811,007.00 | 0.21 |
| 77 | PT Summarecon Agung Tbk             | -            | SMRA IJ   | 印度尼西亚证券交易所 | 印度尼西亚 | 11,500,000.00 | 8,938,415.67 | 0.19 |
| 78 | Korea Gas Corp                      | -            | 036460 KS | 韩国证券交易所    | 韩国    | 40,000.00     | 8,163,034.76 | 0.18 |
| 79 | Cheung Kong Property Holdings Ltd   | 长江实业地产有限公司   | 1113 HK   | 香港证券交易所    | 中国香港  | 175,500.00    | 7,410,331.66 | 0.16 |
| 80 | China Resources Gas Group Ltd       | 华润燃气(集团)有限公司 | 1193 HK   | 香港证券交易所    | 中国香港  | 370,000.00    | 7,176,004.59 | 0.16 |
| 81 | China Longyuan Power Group Corp Ltd | 龙源电力集团股份有限公司 | 916 HK    | 香港证券交易所    | 中国香港  | 1,254,000.00  | 6,145,870.30 | 0.13 |
| 82 | Galaxy Entertainment Group Ltd      | -            | 27 HK     | 香港证券交易所    | 中国香港  | 223,000.00    | 4,567,869.78 | 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 报告期内权益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<br>资产净值比例（%） |
|----|---|-----------|----------------|--------------------|
| 1  | Taiwan Semiconductor Manufacturing<br>Co Ltd      | 2330 TT   | 166,544,319.22 | 2.13               |
|    |   | TSM US    | 36,841,136.50  | 0.47               |
| 2  | Ping An Insurance (Group) Company of<br>China Ltd | 2318 HK   | 180,109,127.51 | 2.31               |
| 3  | Tata Consultancy Services Ltd                     | TCS IN    | 144,780,356.29 | 1.86               |
| 4  | Catcher Technology Co Ltd                         | 2474 TT   | 143,621,551.76 | 1.84               |
| 5  | KT & G Corp                                       | 033780 KS | 138,737,012.40 | 1.78               |
| 6  | Korea Electric Power Corp                         | 015760 KS | 134,900,923.46 | 1.73               |
| 7  | Housing Development Finance Corp Ltd              | HDFC IN   | 124,902,827.10 | 1.60               |
| 8  | Korea Gas Corp                                    | 036460 KS | 115,834,003.76 | 1.48               |
| 9  | SK Hynix Inc                                      | 000660 KS | 108,615,019.90 | 1.39               |
| 10 | Hyundai Heavy Industries Co Ltd                   | 009540 KS | 97,483,445.80  | 1.25               |
| 11 | Fubon Financial Holding Co Ltd                    | 2881 TT   | 95,249,557.79  | 1.22               |
| 12 | Samsung Electronics Co Ltd                        | 005930 KS | 94,683,560.89  | 1.21               |
| 13 | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd                | 388 HK    | 91,373,419.42  | 1.17               |
| 14 | Cosmax Inc  | 192820 KS | 89,268,596.61  | 1.14               |
| 15 | Hongkong Land Holdings Ltd                        | HKL SP    | 85,560,712.21  | 1.10               |
| 16 | KB Financial Group Inc                            | 105560 KS | 85,413,715.27  | 1.09               |
| 17 | Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd             | 338 HK    | 85,326,645.95  | 1.09               |
| 18 | Hyundai Steel Co                                  | 004020 KS | 85,098,737.03  | 1.09               |
| 19 | KCC Corp  | 002380 KS | 83,981,628.42  | 1.08               |
| 20 | Ambuja Cements Ltd                                | ACEM IN   | 78,163,460.66  | 1.00               |

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  | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd  | 2330 TT   | 4,770,101.62   | 0.06           |
|    |  | TSM US    | 400,518,644.28 | 5.13           |
| 2  | Samsung Electronics Co Ltd                 | 005930 KS | 391,313,754.03 | 5.02           |
| 3  | Axis Bank Ltd                              | AXSB IN   | 318,737,548.91 | 4.09           |
| 4  | Ambuja Cements Ltd                         | ACEM IN   | 221,776,896.75 | 2.84           |
| 5  | Agricultural Bank of China Ltd             | 1288 HK   | 219,963,473.72 | 2.82           |
| 6  | HDFC Bank Ltd                              | HDFCB IN  | 216,582,610.39 | 2.78           |
| 7  | Mahindra & Mahindra Ltd                    | MM IN     | 193,060,341.23 | 2.47           |
| 8  | China Minsheng Banking Corp Ltd            | 1988 HK   | 179,163,634.40 | 2.30           |
| 9  | KB Financial Group Inc                     | 105560 KS | 172,601,764.44 | 2.21           |
| 10 | China Pacific Insurance (Group) Co Ltd     | 2601 HK   | 147,434,611.29 | 1.89           |
| 11 | Korea Electric Power Corp                  | 015760 KS | 145,336,028.67 | 1.86           |
| 12 | Lotte Chemical Corp                        | 011170 KS | 144,755,392.55 | 1.86           |
| 13 | AAC Technologies Holdings Inc              | 2018 HK   | 139,973,313.77 | 1.79           |
| 14 | SK Hynix Inc                               | 000660 KS | 136,630,629.82 | 1.75           |
| 15 | AIA Group Ltd                              | 1299 HK   | 133,069,518.50 | 1.71           |
| 16 | China Vanke Co Ltd                         | 2202 HK   | 117,754,180.28 | 1.51           |
| 17 | Infosys Ltd                                | INFO IN   | 116,885,953.98 | 1.50           |
| 18 | DBS Group Holdings Ltd                     | DBS SP    | 109,301,168.46 | 1.40           |
| 19 | Mahindra & Mahindra Financial Services Ltd | MMFS IN   | 101,974,361.74 | 1.31           |
| 20 | Orion Corp                                 | 001800 KS | 98,963,930.30  | 1.27           |

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

单位：人民币元

|            |                  |
|------------|------------------|
| 买入成本（成交）总额 | 5,129,511,115.98 |
| 卖出收入（成交）总额 | 8,176,078,140.40 |

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  | Digital Telecommunications Infrastructure Fund | 上市基金 | 封闭式  | SCB Asset Management Company Limited | 12,080,445.50 | 0.26         |

**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 期末其他各项资产构成**

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 | 3,968,458.44 |
| 3  | 应收股利    | 745,037.71   |
| 4  | 应收利息    | 24,773.26    |
| 5  | 应收申购款   | 62,824.29    |
| 6  | 其他应收款   | 5,780,246.79 |
| 7  | 待摊费用    | -            |

|   |    |               |
|---|----|---------------|
| 8 | 其他 | 4,340,490.04  |
| 9 | 合计 | 14,921,830.53 |

#### 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<br>(户) | 户均持有的<br>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 |
| 666,951      | 12,251.84     | 73,128,313.96 | 0.89%  | 8,098,251,779.43 | 99.11% |

#### 9.2 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 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 349,187.54 | 0.0043%  |

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

### §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                    | 13,422,752,840.68 |
| 本报告期基金总申购份额                     | 157,778,900.86    |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 5,409,151,648.15  |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -                 |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 8,171,380,093.39  |

## §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：

本公司于 2015 年 1 月 17 日发布公告：因个人原因，冯刚先生自 2015 年 1 月 15 日起不再担任本公司副总经理。

本公司于 2015 年 12 月 2 日发布公告：因个人原因，陈星德先生自 2015 年 11 月 30 日起不再担任本公司副总经理。

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 185,000 元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 9 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

## 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称                                | 交易单元数量 | 股票交易             |              | 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 | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 |    |
| UBS LTD                             | 1      | 1,605,979,560.34 | 12.14%       | 2,864,719.89 | 12.34%     | -  |
| Citigroup Global Mkts Ltd           | 1      | 1,308,861,426.03 | 9.90%        | 2,386,033.08 | 10.28%     | -  |
| Nomura International                | 1      | 1,279,811,715.71 | 9.68%        | 2,110,642.16 | 9.09%      | -  |
| Macquarie Securities Ltd            | 1      | 1,215,187,628.13 | 9.19%        | 2,110,319.69 | 9.09%      | -  |
| Morgan Stanley Co Intl plc          | 1      | 1,015,491,447.74 | 7.68%        | 1,694,341.06 | 7.30%      | -  |
| Credit Suisse Ltd                   | 1      | 992,978,670.77   | 7.51%        | 1,761,718.93 | 7.59%      | -  |
| China Intl Capital Corp HK Secs Ltd | 1      | 899,394,155.63   | 6.80%        | 1,727,191.36 | 7.44%      | -  |
| CLSA Limited                        | 1      | 735,680,514.61   | 5.56%        | 1,296,838.77 | 5.59%      | -  |
| Merrill Lynch                       | 1      | 711,606,878.53   | 5.38%        | 1,204,343.95 | 5.19%      | -  |
| JP Morgan Secs Ltd                  | 1      | 579,827,929.37   | 4.38%        | 1,021,783.02 | 4.40%      | -  |
| Instinet Ltd                        | 1      | 565,993,247.35   | 4.28%        | 1,020,536.26 | 4.40%      | -  |
| HSBC Securities                     | 1      | 398,952,411.40   | 3.02%        | 698,167.04   | 3.01%      | -  |
| Goldman Sachs                       | 1      | 384,605,631.33   | 2.91%        | 659,769.47   | 2.84%      | -  |
| China Merchants Securities (HK)     | 1      | 293,163,755.73   | 2.22%        | 513,036.59   | 2.21%      | -  |
| BOCI Securities Ltd                 | 1      | 225,160,627.12   | 1.70%        | 394,031.10   | 1.70%      | -  |
| Masterlink Securities Corp          | 1      | 200,553,253.25   | 1.52%        | 350,968.56   | 1.51%      | -  |
| BNP Paribas Securities              | 1      | 155,969,886.98   | 1.18%        | 272,947.30   | 1.18%      | -  |
| Samsung Securities Company limited  | 1      | 130,065,341.24   | 0.98%        | 195,097.43   | 0.84%      | -  |
| Yuanta Securities Co Ltd            | 1      | 112,736,182.39   | 0.85%        | 197,288.36   | 0.85%      | -  |
| SinoPac Securities Corporation      | 1      | 111,689,039.61   | 0.84%        | 195,454.44   | 0.84%      | -  |
| Haitong Intl Secs Co Ltd            | 1      | 103,908,452.88   | 0.79%        | 181,839.80   | 0.78%      | -  |
| China Everbright Secs (HK) Ltd      | 1      | 75,539,737.11    | 0.57%        | 132,194.53   | 0.57%      | -  |
| DSP Merrill Lynch Ltd               | 1      | 55,612,257.40    | 0.42%        | 111,224.51   | 0.48%      | -  |
| Credit Agricole Securities (Taiwan) | 1      | 31,783,544.03    | 0.24%        | 55,621.19    | 0.24%      | -  |
| Deutsche Bank AG London             | 1      | 17,724,217.87    | 0.13%        | 31,017.38    | 0.13%      | -  |
| CCB International Securities Ltd    | 1      | 9,438,951.37     | 0.07%        | 16,518.16    | 0.07%      | -  |
| Fubon Securities Company Limited    | 1      | 6,958,587.88     | 0.05%        | 12,177.64    | 0.05%      | -  |

|                                     |   |                   |         |               |         |   |
|-------------------------------------|---|-------------------|---------|---------------|---------|---|
| Cathay Securities Corporation       | 1 | -                 | -       | -             | -       | - |
| CIMB Securities (Singapore) Pte Ltd | 1 | -                 | -       | -             | -       | - |
| CITIC Securities Brokerage (HK) Ltd | 1 | -                 | -       | -             | -       | - |
| Daiwa Capital Markets               | 1 | -                 | -       | -             | -       | - |
| ICBC International Securities Ltd   | 1 | -                 | -       | -             | -       | - |
| KDB Daewoo Securities               | 1 | -                 | -       | -             | -       | - |
| Korea Investment & Securities (KIS) | 1 | -                 | -       | -             | -       | - |
| 第一金证券股份有限公司                         | 1 | -                 | -       | -             | -       | - |
| Total                               | - | 13,224,675,051.81 | 100.00% | 23,215,821.65 | 100.00% | - |

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：

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. 2015 年度新增 Fubon Securities Company Limited 1 个席位，无注销席位。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 回购交易 |              | 权证交易 |              | 基金交易 |              |
|------|------|--------------|------|--------------|------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
|      |      |              |      |              |      |              |      |              |

|                                     |   |   |   |   |   |   |               |         |
|-------------------------------------|---|---|---|---|---|---|---------------|---------|
| UBS LTD                             | - | - | - | - | - | - | 21,697,917.80 | 81.47%  |
| Citigroup Global Mkts Ltd           | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Nomura International                | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Macquarie Securities Ltd            | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Morgan Stanley Co Intl plc          | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Credit Suisse Ltd                   | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| China Intl Capital Corp HK Secs Ltd | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| CLSA Limited                        | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Merrill Lynch                       | - | - | - | - | - | - | 4,933,601.79  | 18.53%  |
| JP Morgan Secs Ltd                  | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Instinet Ltd                        | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| HSBC Securities                     | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Goldman Sachs                       | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| China Merchants Securities (HK)     | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| BOCI Securities Ltd                 | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Masterlink Securities Corp          | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| BNP Paribas Securities              | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Samsung Securities Company limited  | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Yuanta Securities Co Ltd            | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| SinoPac Securities Corporation      | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Haitong Intl Secs Co Ltd            | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| China Everbright Secs (HK) Ltd      | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| DSP Merrill Lynch Ltd               | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Credit Agricole Securities (Taiwan) | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Deutsche Bank AG London             | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| CCB International Securities Ltd    | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Fubon Securities Company Limited    | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Cathay Securities Corporation       | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| CIMB Securities (Singapore) Pte Ltd | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| CITIC Securities Brokerage (HK) Ltd | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Daiwa Capital Markets               | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| ICBC International Securities Ltd   | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| KDB Daewoo Securities               | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Korea Investment & Securities (KIS) | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| 第一金证券股份有限公司                         | - | - | - | - | - | - | -             | -       |
| Total                               | - | - | - | - | - | - | 26,631,519.59 | 100.00% |



## 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高级管理人员变更的公告                   | 基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券时报》和《中国证券报》 | 2015 年 1 月 17 日  |
| 2.  | 上投摩根亚太优势股票型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告   | 同上                               | 2015 年 3 月 31 日  |
| 3.  | 上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金经理变更公告                   | 同上                               | 2015 年 4 月 11 日  |
| 4.  | 上投摩根基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告               | 同上                               | 2015 年 4 月 21 日  |
| 5.  | 上投摩根基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告 | 同上                               | 2015 年 4 月 24 日  |
| 6.  | 上投摩根基金管理有限公司关于设立子公司的公告                      | 同上                               | 2015 年 4 月 24 日  |
| 7.  | 上投摩根亚太优势股票型证券投资基金暂停申购、赎回、转换转入、定期定额投资的公告     | 同上                               | 2015 年 5 月 20 日  |
| 8.  | 上投摩根亚太优势股票型证券投资基金暂停申购、赎回、转换转入、定期定额投资的公告     | 同上                               | 2015 年 6 月 27 日  |
| 9.  | 关于公司、高管及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告                   | 同上                               | 2015 年 7 月 8 日   |
| 10. | 上投摩根基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告 | 同上                               | 2015 年 7 月 10 日  |
| 11. | 上投摩根基金管理有限公司关于旗下十二只基金变更基金名称的公告              | 同上                               | 2015 年 7 月 21 日  |
| 12. | 上投摩根亚太优势混合型证券投资基金暂停申购、赎回、转换转入及定期定额投资业务的公告   | 同上                               | 2015 年 9 月 23 日  |
| 13. | 上投摩根亚太优势混合型证券投资基金暂停申购、赎回、转换转入及定期定额投资业务的公告   | 同上                               | 2015 年 10 月 17 日 |
| 14. | 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                               | 2015 年 12 月 2 日  |
| 15. | 上投摩根亚太优势混合型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告   | 同上                               | 2015 年 12 月 22 日 |
| 16. | 上投摩根基金管理有限公司关于因指数熔断旗下基金开放时间调整的公告            | 同上                               | 2015 年 12 月 31 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混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《上投摩根亚太优势混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《上投摩根亚太优势混合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.cifm.com](http://www.cifm.com)

上投摩根基金管理有限公司

二〇一六年三月三十日