

上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金
2016 年半年度报告
2016 年 6 月 30 日

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十九日

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	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.....	5
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.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9 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.....	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	31
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	31
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	31
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	39
7.8 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.....	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	39
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	39
7.11 投资组合报告附注.....	39
8 基金份额持有人信息	40

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
8.3 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	40
9 开放式基金份额变动	40
10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8 其他重大事件	42
11 影响投资者决策的其他重要信息	43
12 备查文件目录	43
12.1 备查文件目录	43
12.2 存放地点	43
12.3 查阅方式	43

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金
基金简称	上投摩根全球天然资源混合(QDII)
基金主代码	378546
交易代码	378546
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月26日
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	181,030,460.66 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球范围内从事天然资源的勘探、开发、生产及销售，或是向天然资源行业提供服务的公司的股票，通过积极主动的资产配置和组合管理，在风险可控的前提下以获取长期资产增值。
投资策略	全球天然资源的稀缺与人类对其需求的不断增长的矛盾日益突显，这显示了天然资源具有极大的战略价值，该行业的相关上市公司也具有较好的投资机会。本基金将充分分享全球天然资源行业未来的高增长成果，审慎把握全球天然资源的投资机会，争取为投资者带来长期稳健回报。 总体上本基金将采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。首先通过考察不同国家的发展趋势及不同行业的景气程度，决定地区与板块的基本布局；其次采取自下而上的选股策略，在对股票进行基本面分析的同时，通过深入研究股票的价值与动量特性，选取目标投资对象。在固定收益类投资部分，本基金将综合考虑资产布局的安全性、流动性与收益性，并结合现金管理要求等来制订具体策略。
业绩比较基准	欧洲货币矿产、能源及黄金指数（总回报）
风险收益特征	本基金为混合型投资基金，主要投资于海外市场的天然资源行业的股票，本基金的业绩表现在大多数的情况下与国际大宗商品价格的走势具有较高的相关性。本基金的预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于较高风险和较高预期收益的基金品种。

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	中国银行股份有限公司
信息披露	姓名	胡迪	王永民
	联系电话	021-38794888	010-66594896

负责人	电子邮箱	services@cifm.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-889-4888	95566
传真		021-20628400	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼20楼	北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼20楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		穆矢	田国立

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	JPMorgan Asset Management(UK) Limited	Bank of China (Hongkong)
	中文	摩根资产管理（英国）有限公司	中国银行(香港)有限公司
注册地址		25 Bank Street Canary Wharf London E14 5JP	香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		125 London Wall, London, EC2Y 5AJ	香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上投摩根基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-3,303,713.72
本期利润	11,814,467.46
加权平均基金份额本期利润	0.0956

本期加权平均净值利润率	18.96%
本期基金份额净值增长率	22.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	-80,611,699.82
期末可供分配基金份额利润	-0.4453
期末基金资产净值	100,418,760.84
期末基金份额净值	0.555
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-44.50%

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

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

3.2 基金净值表现

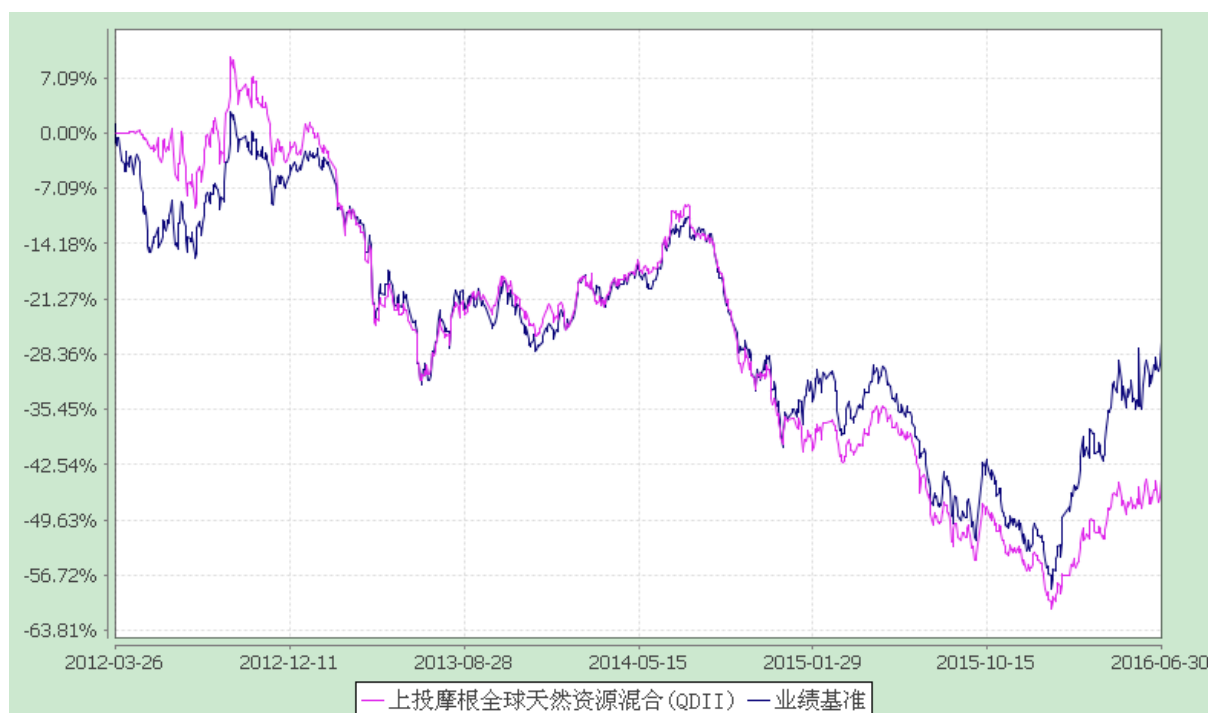
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.71%	1.87%	12.57%	1.84%	-6.86%	0.03%
过去三个月	12.58%	1.57%	22.39%	1.83%	-9.81%	-0.26%
过去六个月	22.52%	1.60%	51.39%	1.95%	-28.87%	-0.35%
过去一年	-5.77%	1.72%	18.91%	2.08%	-24.68%	-0.36%
过去三年	-19.45%	1.26%	5.11%	1.51%	-24.56%	-0.25%
自基金合同生效起至今	-44.50%	1.23%	-26.79%	1.44%	-17.71%	-0.21%

注：本基金的业绩比较基准为：欧洲货币矿产、能源及黄金指数

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

上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2012年3月26日至2016年6月30日)



注：1. 本基金合同生效日为 2012 年 3 月 26 日，图示时间段为 2012 年 3 月 26 日至 2016 年 6 月 30 日。

2. 本基金建仓期自 2012 年 3 月 26 日至 2012 年 9 月 25 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司（2007 年 10 月 8 日更名为“上海国际信托有限公司”）与摩根资产管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。截至 2016 年 6 月底，公司管理的基金共有四十九只，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。

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混合型证券投资基金、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、上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金及上投摩根策略精选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		
张军	本基金基金经理、国际投资部总监	2012-03-26	-	11 年（金融领域从业经验 22 年）	毕业于上海复旦大学。曾担任上海国际信托有限公司国际业务部经理，交易部经理。2004 年 6 月加入上投摩根基金管理有限公司，担任交易总监，2007 年 10 月起任投资经理。2008 年 3 月起担任上投摩根亚太优势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。

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. 张军先生担任本基金首任基金经理的任职日期为本基金基金合同生效之日；

3. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Neil Gregson	董事总经理，全球天然资源团队主管	32 年	男，英国诺丁汉大学矿业工程专业学士学位

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、《上投摩根全球天然资源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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

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

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交

量的 5% 的情形：无。

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

全球天然资源基金上半年净值上涨 22.52%，低于业绩基准表现。

2016 年上半年期间的股票平均持股比例在 85% 左右，较半年前加仓了 15%。较低股票仓位是基金在市场反弹过程中落后的主要原因。

油价在上半年内从 32 美元/桶，涨到 50 美元/桶。期间加拿大艾伯塔省的野火和尼日利亚油田设施遭到武装袭击导致原油供给短暂中断，两个事件导致的短期产量损失预估约 150 万桶/日。同时，尽管 OPEC 组织的限产会议没有结果，投资人仍然对未来可能的限产抱有期望。

油价的上涨，引领其他工业金属的投资偏好，LME 金属指数涨 7.54%。黄金上涨 24.58% 与大宗商品相关的类股表现则有所不同，金矿股连续两个季度涨幅领先，涨幅超过 50%，油气和矿业相关板块涨幅只有 5-6%。本基金实际配置在贵金属板块的比例 18%，低配金矿股仍然是基金表现不如基准的原因之一。

报告期内油价稳步上升是本基金增加股票投资仓位的主要原因。经过分析，油价受到短期供给紧张刺激上涨，且上方接近 60 美元/桶价格可能引出新增产量，价格持续上升空间受限。

6 月 23 日英国脱欧公投的结果让市场大多数人措手不及，出于对英国脱欧后的负面影响难以估计的担心，避险情绪高涨下，股票资产遭到抛售，天然资源类股在下跌中也不例外，但本基金在那两天下跌中最大回撤 5%，幅度低于大盘指数。基金为应付可能出现的赎回，把股票仓位降到 80%。

英国脱欧公投后的第三天，基金止跌企稳，开始收复前两日的大部分跌幅。经历了此次风险事件的洗礼，更让我们确信我们已处在天然资源投资的中长期周期底部。基金未来的操作将观察海外投资人对中国经济能够转型成功，稳定增长的信心恢复程度或原油供大于求的局面得以确定改善后，本基金将会提高持股仓位，并视时机进行组合调整。

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 22.52%，同期业绩比较基准收益率为 51.39%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，脱欧事件对未来欧盟的格局造成不确定性，成为主要宏观风险事件，但也会延长美联储加息前的观察时间，并且各国央行将更不遗余力地保障市场流动性充裕。总而言之，当前全球资源价格水平回到了前一轮牛市启动初期的水平。“此一时，彼一时”，历史既不会简单重复，同时

对于周期性特征明显的全球资源投资而言，新一轮周期的开始已渐行渐近。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期本基金未实施利润分配。

4.9 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

报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，出现该情况的时间范围为 2016 年 1 月 4 日至 2016 年 3 月 15 日。

基金管理人拟调整本基金运作方式，加大营销力度，提升基金规模，方案已报监管机关。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持

有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	22,122,647.14	9,563,430.65
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	81,677,473.01	21,796,750.75
其中：股票投资		81,677,473.01	21,796,750.75
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,825.32	537.36
应收股利		206,965.28	24,258.29
应收申购款		970,599.75	266,369.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		104,979,510.50	31,651,346.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	1,815,545.35
应付赎回款		4,332,591.58	214,884.75
应付管理人报酬		147,842.77	43,617.89
应付托管费		28,747.23	8,481.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	51,568.08	92,834.97
负债合计		4,560,749.66	2,175,364.22
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	181,030,460.66	65,034,463.70
未分配利润	6.4.7.10	-80,611,699.82	-35,558,481.74
所有者权益合计		100,418,760.84	29,475,981.96
负债和所有者权益总计		104,979,510.50	31,651,346.18

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.555 元，基金份额总额 181,030,460.66 份。

6.2 利润表

会计主体：上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		12,726,574.09	-1,465,405.05
1.利息收入		23,205.83	18,748.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	23,205.83	18,748.87
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,742,613.99	-966,278.22
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,356,491.18	-1,246,395.02
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	34,059.19
股利收益	6.4.7.17	613,877.19	246,057.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.18	15,118,181.18	-371,652.23

填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		263,454.45	-178,761.79
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.19	64,346.62	32,538.32
减: 二、费用		912,106.63	573,527.43
1. 管理人报酬		549,909.49	294,077.32
2. 托管费		106,926.84	57,181.74
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	206,013.94	167,598.58
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	49,256.36	54,669.79
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		11,814,467.46	-2,038,932.48
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		11,814,467.46	-2,038,932.48

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金

本报告期: 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	65,034,463.70	-35,558,481.74	29,475,981.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,814,467.46	11,814,467.46
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)	115,995,996.96	-56,867,685.54	59,128,311.42
其中: 1.基金申购款	218,052,224.38	-106,633,919.68	111,418,304.70
2.基金赎回款	-102,056,227.42	49,766,234.14	-52,289,993.28
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)	181,030,460.66	-80,611,699.82	100,418,760.84
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	38,829,572.57	-14,213,520.62	24,616,051.95

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,038,932.48	-2,038,932.48
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）	19,921,862.00	-7,865,848.26	12,056,013.74
其中：1.基金申购款	65,660,277.60	-25,240,390.41	40,419,887.19
2.基金赎回款	-45,738,415.60	17,374,542.15	-28,363,873.45
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）	58,751,434.57	-24,118,301.36	34,633,133.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：章硕麟，主管会计工作负责人：胡志强，会计机构负责人：张璐

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上投摩根全球天然资源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”)证监许可[2011]1599号《关于核准上投摩根全球天然资源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》和《上投摩根全球天然资源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，首次募集期间为2012年2月20日至2012年3月21日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币413,075,067.63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(2012)第095号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金基金合同》于2012年3月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为413,194,672.17份基金份额，其中认购资金利息折合119,604.54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，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司，境外投资顾问为摩根资产管理(英国)有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于全球范围内从事天然资源的勘探、开发、生产及销售，或是向天然资源行业提供服务的公司的股票。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%-95%，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5%-40%，并保

持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。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：汇丰矿产、黄金及能源指数(总回报)。

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 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》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) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税，对金融同业往来利息收入免征增值税。
- (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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	22,122,647.14
定期存款	-
其他存款	-
合计	22,122,647.14

注：于 2016 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：美元 904,086.48 元(折合人民币 5,995,178.26 元)，港币 7,924,150.50 元(折合人民币 6,772,533.70 元)，加拿大元 11,992.00(折合人民币 61,231.50 元)，英镑 7,405.32 元(折合人民币 66,064.34 元)，瑞典克朗 618,651.86 元（折合人民币 484,190.90 元），挪威克朗 28,285.00 元（折合人民币 22,414.51 元）。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		75,464,000.56	81,677,473.01	6,213,472.45
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		75,464,000.56	81,677,473.01	6,213,472.45

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,825.32
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	1,825.32

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

无余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	15,764.80
预提费用	35,803.28
合计	51,568.08

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	65,034,463.70	65,034,463.70
本期申购	218,052,224.38	218,052,224.38
本期赎回（以“-”号填列）	-102,056,227.42	-102,056,227.42
本期末	181,030,460.66	181,030,460.66

6.4.7.10 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	-24,142,344.97	-11,416,136.77	-35,558,481.74
本期利润	-3,303,713.72	15,118,181.18	11,814,467.46
本期基金份额交易产生的变动数	-47,995,795.45	-8,871,890.09	-56,867,685.54
其中：基金申购款	-90,346,848.18	-16,287,071.50	-106,633,919.68
基金赎回款	42,351,052.73	7,415,181.41	49,766,234.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-75,441,854.14	-5,169,845.68	-80,611,699.82

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	23,205.83
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	-
合计	23,205.83

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	19,383,088.19
减：卖出股票成本总额	22,739,579.37
买卖股票差价收入	-3,356,491.18

6.4.7.13 基金投资收益

无。

6.4.7.14 债券投资收益

无。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	613,877.19
基金投资产生的股利收益	-
合计	613,877.19

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	15,118,181.18
——股票投资	15,118,181.18
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-

——权证投资	-
3.其他	-
合计	15,118,181.18

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	64,346.62
合计	64,346.62

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。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	206,013.94
银行间市场交易费用	-
合计	206,013.94

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	35,803.28
信息披露费	-
银行费用	11,497.39
其他	1,955.69
合计	49,256.36

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，本基金的基金管理人接到股东上海国际信托有限公司（以下简称“上海信托”）通知，2016 年 3 月 15 日上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”）完成了收购上海信托股权的过户手续，工商变更登记手续已办理完毕，浦发银行成为上海信托控股股东，亦成为我公司关联方。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上投摩根基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	境外资产托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	549,909.49	294,077.32
其中：支付销售机构的客户维护费	155,049.97	83,578.64

注：支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的管理人报酬按前一估值日基金资产净值 1.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一估值日基金资产净值 X 1.8% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	106,926.84	57,181.74

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一估值日基金资产净值 0.35% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一估值日基金资产净值 X 0.35% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 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	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	14,026,199.61	23,205.83	2,834,786.34	18,748.87
中银香港	8,096,447.53	-	2,201,785.24	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管，按适用利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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督和风险评估，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。

6.4.13.2 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银行以及境外次托管行中银香港，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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2015 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短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%。本基金所持证券均在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

于 2016 年 6 月 30 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.2 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。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2016年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	5,995,178.26	6,772,533.70	633,901.25	13,401,613.21
交易性金融资产	24,502,234.19	1,702,622.30	55,472,616.52	81,677,473.01
应收股利	78,033.91	125,322.18	3,609.19	206,965.28
资产合计	30,575,446.36	8,600,478.18	56,110,126.96	95,286,051.50
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-

资产负债表外 汇风险敞口净 额	30,575,446.36	8,600,478.18	56,110,126.96	95,286,051.50
项目	上年度末 2015年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	4,395,101.67	1,373,028.08	1,277,422.46	7,045,552.21
交易性金融资 产	6,787,929.12	2,123,152.35	12,885,669.28	21,796,750.75
应收股利	23,785.17	-	473.12	24,258.29
资产合计	11,206,815.96	3,496,180.43	14,163,564.86	28,866,561.25
以外币计价的 负债				
应付证券清算 款	1,348,176.17	-	467,369.18	1,815,545.35
其他负债	40.23	-	-	40.23
负债合计	1,348,216.40	-	467,369.18	1,815,585.58
资产负债表外 汇风险敞口净 额	9,858,599.56	3,496,180.43	13,696,195.68	27,050,975.67

6.4.13.4.2.2 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	1.所有外币相对人民币升值 5%	增加约 476	增加约 135
	2.所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 476	减少约 135

6.4.13.4.3 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，采用“自上而下”的策略，首先通过考察不同国家的发展趋势及不同行业的景气程度，决定地区与板块的基本布局；其次采取自下而上的选股策略，在对股票进行基本面分析的同时，通过深入研究股票的价值与动量特性，选取目标投资对象。在固定收益类投资部分，本基金将综合考虑资产布局的安全性、流动性与收益性，并结合现金管理要求等来制订具体策略。

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它权益类证券市值占基金资产的 60%-95%，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 5%-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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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	81,677,473.01	81.34	21,796,750.75	73.95
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	81,677,473.01	81.34	21,796,750.75	73.95

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(欧洲货币矿产、能源及黄金指数)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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	1. 欧洲货币矿产、黄金及能源指数上升 5%	增加约 382	增加约 115
	2. 欧洲货币矿产、黄金及能源指数下降 5%	减少约 382	减少约 115

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	81,677,473.01	77.80
	其中:普通股	74,983,381.94	71.43
	存托凭证	6,694,091.07	6.38
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,122,647.14	21.07

8	其他各项资产	1,179,390.35	1.12
9	合计	104,979,510.50	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
英国	24,825,344.49	24.72
美国	24,502,234.19	24.40
加拿大	18,877,720.67	18.80
瑞典	5,283,041.82	5.26
澳大利亚	5,169,749.68	5.15
香港	1,702,622.30	1.70
挪威	1,316,759.86	1.31
合计	81,677,473.01	81.34

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

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
金属与采矿	51,938,357.09	51.72
石油、天然气与消费用燃料	28,970,630.84	28.85
化学制品	768,485.08	0.77
合计	81,677,473.01	81.34

注：行业分类标准：MSCI

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

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	Rio Tinto plc	力拓有限 公司	RIO LN	伦敦证 券交易 所	英国	29,236.00	5,983,215.46	5.96
2	BHP Billiton plc	必和必拓 有限公司	BLT LN	伦敦证 券交易 所	英国	59,828.00	5,032,077.62	5.01
3	Lundin Mining	-	LUN CN	多伦多 证券交	加拿大	195,210.00	4,345,821.02	4.33

	Corp			易所				
4	Royal Dutch Shell plc	-	RDSB LN	伦敦证券交易所	英国	20,458.00	3,763,354.34	3.75
5	Glencore plc	嘉能可有限公司	GLEN LN	伦敦证券交易所	英国	242,356.00	3,304,779.59	3.29
6	Boliden AB	-	BOL SS	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	22,260.00	2,836,284.93	2.82
7	Agnico Eagle Mines Ltd	-	AEM CN	多伦多证券交易所	加拿大	7,245.00	2,557,708.52	2.55
8	Anadarko Petroleum Corp	-	APC US	纽约证券交易所	美国	7,000.00	2,471,779.80	2.46
9	Freeport-McMoRan Inc	-	FCX US	纽约证券交易所	美国	33,349.00	2,463,542.92	2.45
10	Lundin Petroleum AB	-	LUPE SS	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	20,473.00	2,446,756.89	2.44
11	Chevron Corp	-	CVX US	纽约证券交易所	美国	3,263.00	2,268,270.19	2.26
12	Parex Resources Inc	-	PXT CN	多伦多证券交易所	加拿大	34,963.00	2,233,311.42	2.22
13	BP plc	-	BP/ LN	伦敦证券交易所	英国	52,440.00	2,049,787.19	2.04
14	Mining & Metallurgical Co Norilsk Nickel	-	MNOD LI	伦敦证券交易所	英国	23,138.00	2,039,120.66	2.03
15	OceanaGold Corp	-	OGC AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	74,467.00	1,878,883.78	1.87
16	Newmont Mining Corp	-	NEM US	纽约证券交易所	美国	7,054.00	1,829,896.08	1.82

17	Goldcorp Inc	-	G CN	多伦多证券交易所	加拿大	14,334.00	1,809,252.38	1.80
18	Pioneer Natural Resources Co	-	PXD US	纽约证券交易所	美国	1,772.00	1,776,791.05	1.77
19	Total SA	-	TOT US	纽约证券交易所	美国	5,538.00	1,766,404.47	1.76
20	EOG Resources Inc	-	EOG US	纽约证券交易所	美国	3,139.00	1,736,415.40	1.73
21	Occidental Petroleum Corp	-	OXY US	纽约证券交易所	美国	3,413.00	1,710,095.50	1.70
22	Norsk Hydro AS	-	NHY NO	奥斯陆证券交易所	挪威	54,803.00	1,316,759.86	1.31
23	Fortescue Metals Group Ltd	-	FMG AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	71,113.00	1,228,944.31	1.22
24	Silver Wheaton Corp	-	SLW CN	多伦多证券交易所	加拿大	7,580.00	1,176,979.54	1.17
25	Franco-Nevada Corp	-	FNV US	纽约证券交易所	美国	2,321.00	1,170,640.62	1.17
26	Petra Diamonds Ltd	-	PDL LN	伦敦证券交易所	英国	109,704.00	1,135,281.94	1.13
27	Stillwater Mining Co	-	SWC US	纽约证券交易所	美国	13,512.00	1,062,665.18	1.06
28	Randgold Resources Ltd	-	GOLD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,359.00	1,009,682.16	1.01
29	Highland Gold Mining Ltd	-	HGM LN	伦敦证券交易所	英国	104,868.00	982,325.82	0.98
30	Zijin Mining Group Co	-	2899 HK	香港证券交易所	香港	422,000.00	934,137.22	0.93

	Ltd							
31	Columbia Pipeline Group Inc	-	CPGX US	纽约证券交易所	美国	5,444.00	920,195.44	0.92
32	Seven Generations Energy Ltd	-	VII CN	多伦多证券交易所	加拿大	7,241.00	911,748.18	0.91
33	First Quantum Minerals Ltd	-	FM CN	多伦多证券交易所	加拿大	18,380.00	851,208.75	0.85
34	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd	-	338 HK	香港证券交易所	香港	254,000.00	768,485.08	0.77
35	Amerisur Resources PLC	-	AMER LN	伦敦证券交易所	英国	324,282.00	766,640.91	0.76
36	Dundee Precious Metals Inc	-	DPM CN	多伦多证券交易所	加拿大	47,272.00	743,426.40	0.74
37	Pretium Resources Inc	-	PVG US	纽约证券交易所	美国	9,817.00	729,103.09	0.73
38	Acacia Mining PLC	-	ACA LN	伦敦证券交易所	英国	14,780.00	594,799.42	0.59
39	Kinross Gold Corp	-	K CN	多伦多证券交易所	加拿大	16,484.00	533,623.75	0.53
40	Nostrum Oil & Gas LP	-	NOG LN	伦敦证券交易所	英国	17,954.00	486,920.52	0.48
41	Marathon Petroleum Corp	-	MPC US	纽约证券交易所	美国	1,882.00	473,737.70	0.47
42	Doray Minerals Ltd	-	DRM AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	89,717.00	471,780.01	0.47
43	Valero Energy Corp	-	VLO US	纽约证券交易所	美国	1,327.00	448,779.72	0.45

44	Orocobre Ltd	-	ORE AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	17,785.00	420,634.16	0.42
45	Tullow Oil plc	-	TLW LN	伦敦证券交易所	英国	17,913.00	419,009.94	0.42
46	TransCanada Corp	-	TRP CN	多伦多证券交易所	加拿大	1,368.00	408,345.90	0.41
47	Alumina Ltd	-	AWC AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	60,238.00	385,172.68	0.38
48	Fission Uranium Corp	-	FCU CN	多伦多证券交易所	加拿大	105,967.00	373,338.70	0.37
49	Lucara Diamond Corp	-	LUC CN	多伦多证券交易所	加拿大	20,763.00	368,937.36	0.37
50	Whitecap Resources Inc	-	WCP CN	多伦多证券交易所	加拿大	7,277.00	367,106.95	0.37
51	Cabot Oil & Gas Corp	-	COG US	纽约证券交易所	美国	2,136.00	364,587.62	0.36
52	Osisko Mining Inc	-	OSK CN	多伦多证券交易所	加拿大	29,352.00	337,212.37	0.34
53	Dacian Gold Ltd	-	DCN AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	22,948.00	328,592.77	0.33
54	MAG Silver Corp	-	MAG CN	多伦多证券交易所	加拿大	3,926.00	326,553.74	0.33
55	Sarama Resources Ltd	-	SWA CN	TSX Venture Exchange	加拿大	234,126.00	274,954.46	0.27
56	Avenir Ltd	-	AEV AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	286,849.00	269,105.21	0.27
57	InterOil Corp	-	IOC US	纽约证券交易所	美国	869.00	259,313.08	0.26
58	Nevsun Resources	-	NSU CN	多伦多证券交	加拿大	11,992.00	232,067.39	0.23

	Ltd			易所				
59	Firestone Diamonds plc	-	FDI LN	伦敦证券交易所	英国	80,444.00	222,473.67	0.22
60	Trevali Mining Corp	-	TV CN	多伦多证券交易所	加拿大	69,212.00	197,903.15	0.20
61	Belo Sun Mining Corp	-	BSX CN	多伦多证券交易所	加拿大	44,036.00	195,618.71	0.19
62	Africa Oil Corp	-	AOI CN	多伦多证券交易所	加拿大	19,803.00	190,095.63	0.19
63	Western Areas NL	-	WSAAU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	17,581.00	186,636.76	0.19
64	Kennady Diamonds Inc	-	KDI CN	TSX Venture Exchange	加拿大	7,768.00	170,553.63	0.17
65	NexGen Energy Ltd	-	NXE CN	TSX Venture Exchange	加拿大	10,334.00	140,356.77	0.14
66	Denison Mines Corp	-	DML CN	多伦多证券交易所	加拿大	32,195.00	116,715.91	0.12
67	President Energy PLC	-	PPC LN	伦敦证券交易所	英国	140,619.00	84,678.07	0.08
68	BNK Petroleum Inc	-	BKX CN	多伦多证券交易所	加拿大	10,049.00	14,880.04	0.01
69	California Resources Corp	-	CRC US	纽约证券交易所	美国	15.00	1,213.51	0.00

注：1. 所用证券代码采用 Ticker 代码。

2. 所属国家（地区）列示证券挂牌的证券交易所所在国家（地区）。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例
----	----------	------	----------	-------------

				(%)
1	Rio Tinto plc	RIO LN	5,242,308.37	17.79
2	BHP Billiton plc	BLT LN	4,548,753.99	15.43
3	Lundin Mining Corp	LUN CN	3,418,908.17	11.60
4	Glencore plc	GLEN LN	2,922,225.52	9.91
5	Royal Dutch Shell plc	RDSB LN	2,321,017.32	7.87
6	Boliden AB	BOL SS	2,235,201.77	7.58
7	CNOOC Ltd	883 HK	2,030,121.91	6.89
8	BP plc	BP/ LN	1,942,543.06	6.59
9	Pioneer Natural Resources Co	PXD US	1,908,549.65	6.47
10	Mining & Metallurgical Co Norilsk Nickel	MNOD LI	1,805,284.22	6.12
11	Freeport-McMoRan Inc	FCX US	1,793,295.55	6.08
12	Chevron Corp	CVX US	1,740,667.57	5.91
13	Anadarko Petroleum Corp	APC US	1,571,133.13	5.33
14	Lundin Petroleum AB	LUPE SS	1,537,498.90	5.22
15	Parex Resources Inc	PXT CN	1,511,080.97	5.13
16	Norsk Hydro AS	NHY NO	1,462,844.99	4.96
17	Agnico Eagle Mines Ltd	AEM CN	1,310,579.77	4.45
18	China Guangdong Nuclear Power Co Ltd	1816 HK	1,306,898.84	4.43
19	OceanaGold Corp	OGC AU	1,218,501.08	4.13
20	Goldcorp Inc	G CN	1,196,777.44	4.06
21	Huaneng Renewables Corp Ltd	958 HK	1,168,535.41	3.96
22	Total SA	TOT US	1,162,947.08	3.95
23	Occidental Petroleum Corp	OXY US	1,145,475.43	3.89
24	Fortescue Metals Group Ltd	FMG AU	1,081,967.02	3.67
25	EOG Resources Inc	EOG US	1,075,297.26	3.65
26	Newmont Mining Corp	NEM US	972,478.74	3.30
27	Zijin Mining Group Co Ltd	2899 HK	870,412.80	2.95
28	Franco-Nevada Corp	FNV US	854,790.95	2.90
29	Columbia Pipeline Group Inc	CPGX US	787,332.68	2.67
30	First Quantum Minerals Ltd	FM CN	786,051.95	2.67
31	Petra Diamonds Ltd	PDL LN	643,289.79	2.18
32	Stillwater Mining Co	SWC US	607,731.60	2.06
33	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd	2208 HK	592,973.10	2.01

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

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	CNOOC Ltd	883 HK	2,111,028.20	7.16
2	Huaneng Renewables Corp Ltd	958 HK	1,676,547.34	5.69
3	China Guangdong Nuclear Power Co Ltd	1816 HK	1,321,379.13	4.48
4	Alcoa Inc	AA US	1,045,990.67	3.55
5	First Quantum Minerals Ltd	FM CN	949,478.46	3.22
6	Xinjiang Goldwind Science & Technology Co Ltd	2208 HK	915,949.88	3.11
7	Beijing Enterprises Water Group Ltd	371 HK	803,289.58	2.73
8	Barrick Gold Corp	ABX US	686,133.01	2.33
9	Alumina Ltd	AWC AU	570,276.45	1.93
10	Rio Tinto plc	RIO LN	516,815.95	1.75
11	Franco-Nevada Corp	FNV US	512,317.34	1.74
12	Goldcorp Inc	G CN	504,598.27	1.71
13	BHP Billiton plc	BLT LN	452,004.15	1.53
14	Glencore plc	GLEN LN	439,703.60	1.49
15	Gran Tierra Energy Inc	GTE CN	438,334.62	1.49
16	Lundin Mining Corp	LUN CN	427,829.72	1.45
17	Freeport-McMoRan Inc	FCX US	408,498.12	1.39
18	Royal Dutch Shell plc	RDSB LN	407,109.73	1.38
19	Agnico Eagle Mines Ltd	AEM CN	403,232.71	1.37
20	EOG Resources Inc	EOG US	299,414.52	1.02

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

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	67,889,960.16
卖出收入（成交）总额	19,383,088.19

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

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

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

7.11.3 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	应收股利	206,965.28
4	应收利息	1,825.32
5	应收申购款	970,599.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,179,390.35

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

因四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
8,722	20,755.61	0.00	0.00%	181,030,460.66	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,752,077.86	0.9678%

8.3 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 研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年3月26日)基金份额总额	413,194,672.17
本报告期期初基金份额总额	65,034,463.70
本报告期基金总申购份额	218,052,224.38
减：本报告期基金总赎回份额	102,056,227.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	181,030,460.66

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

本公司于 2016 年 2 月 3 日发布公告：因届龄退休，陈开元先生自 2016 年 2 月 2 日起不再担任本公司董事长，由穆矢先生继任该职务。

基金托管人：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
Citigroup Global Mkts Ltd	1	63,821,934.24	73.13%	83,344.39	74.81%	-
Morgan Stanley Ltd	1	9,310,724.99	10.67%	10,677.27	9.58%	-
Credit Suisse Ltd	1	6,756,044.37	7.74%	11,823.08	10.61%	-

UBS Securities Ltd	1	4,716,520.51	5.40%	1,886.60	1.69%	-
Goldman Sachs Securities Ltd	1	2,667,824.17	3.06%	3,678.62	3.30%	-
Merrill Lynch	1	-	-	-	-	-
Macquarie Secs (Australia) Ltd	1	-	-	-	-	-
Bell Potter Securities Ltd	1	-	-	-	-	-
Deutsche Bank AG London	1	-	-	-	-	-
Euroz Securities Limited	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 交易单元的选择标准：

1) 资本金雄厚,信誉良好。

2) 财务状况良好,经营行为规范。

3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。

4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

5) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 交易单元的选择程序：

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. 2016 年上半年无新增席位，无注销席位。

10.8 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	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券时报》和《中国证券报》	2016年1月9日
2.	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	2016年2月3日

3.	上投摩根全球天然资源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	2016年3月22日
----	---	----	------------

11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《上投摩根全球天然资源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。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

12.3 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

上投摩根基金管理有限公司

二〇一六年八月二十九日