

**上投摩根亚太优势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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

<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.....	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	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.....	12
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.....	13
<b>5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	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
<b>7 投资组合报告</b> .....	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.....	32
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.....	37
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.....	37
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.....	38
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.....	38
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.....	38
7.11 投资组合报告附注.....	38
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	39

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	39
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 .....	39
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>39</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>40</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	40
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 .....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	40
10.4 基金投资策略的改变 .....	40
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	40
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 .....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	40
10.8 其他重大事件 .....	43
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>43</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>44</b>
12.1 备查文件目录 .....	44
12.2 存放地点 .....	44
12.3 查阅方式 .....	44

## 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	7,935,756,797.89 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 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	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55号
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55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	穆矢	易会满

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》 《中国证券报》 《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cifm.com">http://www.cifm.com</a>
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	-145,747,710.47
本期利润	58,533,675.66
加权平均基金份额本期利润	0.0073
本期加权平均净值利润率	1.34%
本期基金份额净值增长率	1.24%
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	-3,384,820,987.59
期末可供分配基金份额利润	-0.4265
期末基金资产净值	4,550,935,810.30
期末基金份额净值	0.573
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2016 年 6 月 30 日)</b>
基金份额累计净值增长率	-42.70%

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	2.32%	1.26%	2.28%	1.34%	0.04%	-0.08%
过去三个月	2.14%	0.94%	1.95%	1.01%	0.19%	-0.07%
过去六个月	1.24%	1.11%	2.87%	1.14%	-1.63%	-0.03%
过去一年	-6.98%	1.22%	-5.59%	1.25%	-1.39%	-0.03%
过去三年	6.31%	0.93%	2.90%	0.92%	3.41%	0.01%
自基金合同生效起至今	-42.70%	1.45%	-34.39%	1.49%	-8.31%	-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  
 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 2016 年 6 月 30 日)



注：(1) 本基金合同生效日为 2007 年 10 月 22 日，图示时间段为 2007 年 10 月 22 日至 2016 年 6 月 30 日。

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

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司（2007 年 10 月 8 日更名为“上海国际信托有限公司”）与摩根资产管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。截至 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、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	2008-03-08	-	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。
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。
--	--	--	--	--	---

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. 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。

#### 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

回顾过去半年，区域股市中，泰国市场与印度尼西亚市场表现较好，中国与印度市场表现较为落后，东南亚市场普遍都有不错的表现。

美联储于 2013 年十二月开始启动紧缩循环，至今已经超过两年半，大部分亚洲市场货币兑美元持续呈现贬值的状态，但是亚洲货币贬值的趋势到 2015 年底开始稳定下来。2016 年上半年，除了人民币以及印度卢比，大部分亚洲货币兑美元已经开始止跌回升。

当中国的经济开始追求有质量的增长，靠基建投资以及房地产建设的时代已经过去，经济成长增速逐渐下滑，未来还有下调的可能，其他依赖中国需求的亚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，亚洲基础建设银行(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，亚太市场正在转型，未来进一步成长的动能正在逐渐确立。

我们仍然预期，在 2016 年，三个趋势正在发生：首先是亚洲市场仍然将大范围地下调基准存款利率；第二个趋势是人民币的国际化；第三个趋势是，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，未来应该会有不一样的布局，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 2016 年上半年，我们针对美元暂时回落以及新兴经济体回升的中期趋势进行调整，加大各市场商品与资本品板块的配置，这包括了印度尼西亚、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，我们关注了东南亚与印度市场的基建板块；最后因应老龄化的趋势，我们逐步增加配置了印度这个具有人口红利的年轻市场，同时也维持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。

##### 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 1.24%，同期业绩比较基准收益率为 2.87%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对于 2016 年下半年的市场判断如下。全球市场通胀回升的速度可能在短期间高于央行利率上升的速度，经济比较低迷的时间可能拉长，负利率程度可能会恶化，英国在脱离欧盟的公民投票中选择脱欧，可能更加重这个趋势，表现在市场层面，各主要发达市场债券收益率都跌落到历史低位。

值得特别关注的是，石油价格已经出现中期回升的趋势。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。但是，哈萨克、尼日利亚、巴西因为收入降低大砍探勘支出，除非石油价格持续低迷，或者石油输出国组织(OPEC)出现减产保油价的动作失败，否则油价可能已经见底，不易再破新低。石油不再跌，固定收益投资的收益率却大幅下降，可能使股票市场的估值有一定支撑，尤其是对持有实质资产的企业更是如此，所谓的实质资产指的是黄金、土地、房地产、古董、珠宝等等传统上可以保值的物品。

在板块方面，我们看好亚洲基建行业于 2016 年的结构性的机会。首先，在资金成本较低，以及中国一带一路资金介入的情况下，有机会带动区域成长；第二，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；第三，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。以上这几个投资趋势，将是 2016 年下半年本基金重点关注的方向。

#### 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。

#### 4.8 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**

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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人依法对上投摩根基金管理有限公司编制和披露的上投摩根亚太优势混合型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

**6 半年度财务会计报告（未经审计）****6.1 资产负债表**

会计主体：上投摩根亚太优势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	310,302,033.31	266,890,850.14
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	4,260,835,987.55	4,375,237,446.38
其中：股票投资		4,246,063,432.71	4,363,157,000.88
基金投资		14,772,554.84	12,080,445.50
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	136,358.64	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		16,105,674.96	3,968,458.44
应收利息	6.4.7.5	19,093.02	24,773.26
应收股利		18,017,986.82	745,037.71
应收申购款		355,716.35	62,824.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	36,658,348.88	10,120,736.83
<b>资产总计</b>		<b>4,642,431,199.53</b>	<b>4,657,050,127.05</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		44,279,637.76	6,384,360.71
应付赎回款		7,658,991.53	15,844,054.99
应付管理人报酬		6,571,493.91	7,063,721.84
应付托管费		1,277,790.46	1,373,501.48
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		1,391,230.45	522,910.69
其他负债	6.4.7.8	30,316,245.12	4,823,310.74
<b>负债合计</b>		<b>91,495,389.23</b>	<b>36,011,860.45</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	7,935,756,797.89	8,171,380,093.39
未分配利润	6.4.7.10	-3,384,820,987.59	-3,550,341,826.79
<b>所有者权益合计</b>		<b>4,550,935,810.30</b>	<b>4,621,038,266.60</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>4,642,431,199.53</b>	<b>4,657,050,127.05</b>

## 6.2 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：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
<b>一、收入</b>		<b>119,811,777.60</b>	<b>578,619,452.35</b>
1.利息收入		372,680.14	868,890.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	372,680.14	868,890.92
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）		-91,584,221.21	687,771,251.40
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-137,448,658.38	624,714,562.67
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		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	45,864,437.17	63,056,688.73
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	204,281,386.13	-142,432,892.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		6,734,108.18	32,353,588.79
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	7,824.36	58,614.20
<b>减：二、费用</b>		<b>61,273,482.64</b>	<b>100,842,548.37</b>
1. 管理人报酬		39,082,705.72	62,246,337.24
2. 托管费		7,599,414.93	12,103,454.45
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	14,223,863.43	26,203,808.88
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	367,498.56	288,947.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>58,538,294.96</b>	<b>477,776,903.98</b>
减：所得税费用		4,619.30	5,525,969.97
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>58,533,675.66</b>	<b>472,250,934.01</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根亚太优势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）	8,171,380,093.39	-3,550,341,826.79	4,621,038,266.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	58,533,675.66	58,533,675.66
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）	-235,623,295.50	106,987,163.54	-128,636,131.96
其中：1.基金申购款	26,517,339.59	-12,180,456.73	14,336,882.86
2.基金赎回款	-262,140,635.09	119,167,620.27	-142,973,014.82
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）	7,935,756,797.89	-3,384,820,987.59	4,550,935,810.30
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）	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）	-	472,250,934.01	472,250,934.01
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）	-4,643,344,944.48	1,779,408,690.95	-2,863,936,253.53
其中：1.基金申购款	131,397,639.27	-49,026,663.35	82,370,975.92
2.基金赎回款	-4,774,742,583.75	1,828,435,354.30	-2,946,307,229.45
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）	8,779,407,896.20	-3,368,538,051.48	5,410,869,844.72

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

上投摩根亚太优势股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]第 274 号《关于同意上投摩根亚太优势股票型证券投资基金募集



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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《上投摩根亚太优势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 8 月 26 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根亚太优势混合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 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《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	310,302,033.31
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	310,302,033.31	

注：于 2016 年 6 月 30 日，活期银行存款中包含的外币余额为：港元 99,538,002.34 元(折合人民币 85,072,144.46 元)，美元 4,765,715.09 元(折合人民币 31,602,409.89 元)，印度卢比 2,135,755.13 元(折合人民币 209,832.13 元)，新台币 280,564,968.00 元(折合人民币 57,673,282.35 元)，澳元 99.32 元(折合人民币 490.40 元)，泰铢 100,190,529.12 元(折合人民币 18,906,756.87 元)，印度尼西亚盾 0.26 元(折合人民币 0.00 元)和新加坡元 201,212.99 元(折合人民币 991,369.03 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	3,577,390,962.78	4,246,063,432.71	668,672,469.93
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	14,772,554.84	2,638,720.07
其他	-	-	-
合计	3,589,524,797.55	4,260,835,987.55	671,311,190.00

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	136,358.64	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	136,358.64	-	-

**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	19,093.02
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	19,093.02

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	6,650,894.06
待摊费用	-
其他	30,007,454.82
合计	36,658,348.88

注：于 2016 年 6 月 30 日，其他应收款余额为应收印度市场投资税务年度退税款。

**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	1,464.30
预提费用	202,687.69
应付货币兑换款	30,112,093.13
合计	30,316,245.12

**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	8,171,380,093.39	8,171,380,093.39
本期申购	26,517,339.59	26,517,339.59
本期赎回（以“-”号填列）	-262,140,635.09	-262,140,635.09
本期末	7,935,756,797.89	7,935,756,797.89

**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	-3,321,247,676.49	-229,094,150.30	-3,550,341,826.79
本期利润	-145,747,710.47	204,281,386.13	58,533,675.66
本期基金份额交易产生的变动数	102,596,349.23	4,390,814.31	106,987,163.54
其中：基金申购款	-11,556,559.48	-623,897.25	-12,180,456.73
基金赎回款	114,152,908.71	5,014,711.56	119,167,620.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,364,399,037.73	-20,421,949.86	-3,384,820,987.59

**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
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	372,680.14

**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
减：卖出股票成本总额	2,706,708,875.23
买卖股票差价收入	-137,448,658.38

**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 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.16 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	45,390,975.96
基金投资产生的股利收益	473,461.21
合计	45,864,437.17

**6.4.7.17 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	204,145,027.49
——股票投资	201,452,918.15
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	2,692,109.34
——其他	-
2.衍生工具	136,358.64
——权证投资	136,358.64
3.其他	-
合计	204,281,386.13

**6.4.7.18 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	7,824.36
合计	7,824.36

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。

**6.4.7.19 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	14,223,863.43
银行间市场交易费用	-
合计	14,223,863.43

**6.4.7.20 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	63,451.37
信息披露费	139,236.32
咨询费	160,839.84
其他	3,971.03
合计	367,498.56

**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("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)	境外资产托管人

Mellon Company, "纽约梅隆银行")	
---------------------------	--

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	39,082,705.72	62,246,337.24
其中：支付销售机构的客户维护费	5,035,348.65	8,245,368.87

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

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

###### 6.4.10.2.2 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	7,599,414.93	12,103,454.45

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

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

##### 6.4.10.3 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

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 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	
	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	115,956,352.25	372,680.14	177,988,513.98	868,890.92
纽约梅隆银行	194,345,681.06	-	149,450,771.99	-

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

#### 6.4.10.6 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股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人

各部门的风险控制检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律，法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监查和风险评估，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工商银行以及境外次托管行纽约梅隆银行，与该等银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 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 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、结算备付金等。

##### **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。本基金的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	31,602,409.89	85,072,144.46	77,781,730.78	194,456,285.13
交易性金融资产	220,546,655.10	1,510,620,740.04	2,529,668,592.41	4,260,835,987.55
衍生金融资产	-	-	136,358.64	136,358.64
应收证券清算款	-	-	16,105,674.96	16,105,674.96
应收股利	-	7,977,110.61	10,040,876.21	18,017,986.82
其他资产	7,508,774.46	-	29,149,574.42	36,658,348.88
资产合计	259,657,839.45	1,603,669,995.11	2,662,882,807.42	4,526,210,641.98
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	4,407,441.19	39,872,196.57	44,279,637.76
递延所得税负债	-	-	1,391,230.45	1,391,230.45
其他负债	22,586,044.25	-	7,526,048.88	30,112,093.13
负债合计	22,586,044.25	4,407,441.19	48,789,475.90	75,782,961.34
资产负债表外汇风险敞口净额	237,071,795.20	1,599,262,553.92	2,614,093,331.52	4,450,427,680.64
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	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
资产合计	131,986,273.38	1,919,297,702.82	2,476,189,124.17	4,527,473,100.37
以外币计价的负债				
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	3,887,183.25	-	7,356,790.03	11,243,973.28
资产负债表外汇风险敞口净额	128,099,090.13	1,919,297,702.82	2,468,832,334.14	4,516,229,127.09

#### 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
	所有外币相对人民币升值 5%	增加约 22,252	增加约 22,581
	所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 22,252	减少约 22,581

#### 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，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。

#### 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	4,246,063,432.71	93.30	4,363,157,000.88	94.42
交易性金融资产—基金投资	14,772,554.84	0.32	12,080,445.50	0.26
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	136,358.64	0.00	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,260,972,346.19	93.63	4,375,237,446.38	94.68

#### 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(附注 6.4.1)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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	增加约 20,934	增加约 20,795
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	减少约 20,934	减少约 20,795

#### 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	4,246,063,432.71	91.46
	其中: 普通股	3,799,962,717.21	81.85
	存托凭证	446,100,715.50	9.61
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	14,772,554.84	0.32
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	136,358.64	0.00
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	136,358.64	0.00
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	310,302,033.31	6.68
8	其他各项资产	71,156,820.03	1.53
9	合计	4,642,431,199.53	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（%）
中国香港	1,510,620,740.04	33.19
韩国	816,080,600.94	17.93
中国台湾	629,364,769.73	13.83
印度	390,412,206.00	8.58
印度尼西亚	251,431,400.09	5.52
泰国	225,554,060.40	4.96
美国	220,546,655.10	4.85
新加坡	86,404,491.65	1.90
菲律宾	67,506,227.04	1.48
马来西亚	48,142,281.72	1.06
合计	4,246,063,432.71	93.30

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（%）
互联网软件与服务	562,427,110.74	12.36
商业银行	392,186,240.27	8.62
半导体产品与设备	324,458,036.49	7.13
保险	317,570,159.24	6.98
建筑与工程	256,736,097.76	5.64
综合电信业务	226,470,262.51	4.98
石油、天然气与消费用燃料	190,266,365.44	4.18

电脑与外围设备	183,448,860.17	4.03
化学制品	159,871,879.11	3.51
无线电信业务	125,583,531.49	2.76
个人用品	108,398,545.62	2.38
互联网与售货目录零售	107,143,282.75	2.35
汽车零配件	103,465,971.59	2.27
房地产管理和开发	96,331,571.49	2.12
建筑材料	92,856,772.77	2.04
食品	87,905,077.84	1.93
酒店、餐馆与休闲	86,112,463.55	1.89
工业集团企业	80,464,125.06	1.77
食品与主要用品零售	75,227,471.39	1.65
机械制造	72,883,615.04	1.60
电力公用事业	70,733,551.52	1.55
纺织品、服装与奢侈品	55,120,855.59	1.21
制药	54,963,400.37	1.21
水公用事业	49,489,803.10	1.09
媒体	48,540,142.20	1.07
烟草	47,149,826.79	1.04
综合金融服务	45,314,506.99	1.00
公路与铁路	42,347,120.79	0.93
电子设备、仪器和元件	38,138,804.42	0.84
商业服务与商业用品	37,305,357.46	0.82
汽车	35,646,721.37	0.78
医疗保健提供商与服务	31,387,521.06	0.69
金属与采矿	24,083,916.86	0.53
独立电力生产商与能源贸易商	16,034,463.87	0.35
合计	4,246,063,432.71	93.30

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	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	中国香港	2,983,400.00	449,023,738.39	9.87
2	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	-	2330 TT	台湾证券交易所	中国台湾	9,216,000.00	307,848,511.05	6.76
3	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	5,180,000.00	205,200,284.31	4.51



4	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	155,870,764.39	3.43
5	Lotte Chemical Corp	-	011170 KS	韩国证券交易所	韩国	75,000.00	122,192,316.68	2.68
6	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	3,850,000.00	112,369,874.93	2.47
7	LG Uplus Corp	-	032640 KS	韩国证券交易所	韩国	1,700,000.00	106,677,202.74	2.34
8	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	纽约证券交易所	美国	162,381.00	85,636,383.94	1.88
9	Larsen & Toubro Ltd	-	LT IN	印度国家证券交易所	印度	550,000.00	80,864,877.97	1.78
10	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	1,113,500.00	80,464,125.06	1.77
11	Reliance Industries Ltd	-	RIL IN	印度国家证券交易所	印度	840,000.00	79,981,733.19	1.76
12	China Mobile Ltd	-	941 HK	香港证券交易所	中国香港	1,020,000.00	77,281,825.41	1.70
13	Hyundai Heavy Industries Co Ltd	现代重工集团	009540 KS	韩国证券交易所	韩国	120,000.00	72,883,615.04	1.60
14	Ultratech Cement Ltd	-	UTCEN IN	印度国家证券交易所	印度	200,000.00	67,024,292.75	1.47
15	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	812,300.00	63,074,236.16	1.39
16	Sino Thai Engineering & Construction Public Co Ltd	-	STEC-R TB	泰国证券交易所	泰国	13,436,100.00	60,344,897.49	1.33
17	Nutribiotech	-	222040 KS	韩国证券交易所	韩国	140,000.00	59,320,123.96	1.30
18	China Construction Bank Corp	中国建设银行	939 HK	香港证券交易所	中国香港	12,728,000.00	55,696,587.57	1.22
19	MGM China Holdings Ltd	-	2282 HK	香港证券交易所	中国香港	6,420,000.00	55,199,032.89	1.21
20	PT Telekomunikasi Indonesia Tbk	-	TLKM IJ	印度尼西亚证券交易所	印度尼西亚	27,008,100.00	53,949,103.38	1.19
21	Samsung Engineering Co Ltd	-	028050 KS	韩国证券交易所	韩国	900,000.00	53,108,321.38	1.17
22	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	12,426,000.00	49,489,803.10	1.09
23	Cosmax Inc	-	192820 KS	韩国证券交易所	韩国	50,000.00	49,078,421.66	1.08
24	YG Entertainment Inc	-	122870 KS	韩国证券交易所	韩国	210,000.00	48,540,142.20	1.07
25	Advanced Information Service Public Co Ltd	-	ADVANC-R TB	泰国证券交易所	泰国	1,620,000.00	48,301,706.08	1.06
26	Bharti Infratel Ltd	-	BHIN IN	印度国家证券交易所	印度	1,400,000.00	47,460,312.37	1.04
27	KT & G Corp	-	033780 KS	韩国证券交易所	韩国	60,000.00	47,149,826.79	1.04
28	Motherson Sumi Systems Ltd	-	MSS IN	印度国家证券交易所	印度	1,600,000.00	45,602,456.35	1.00

29	Tata Power Co Ltd	-	TPWR IN	印度国家证券交易所	印度	6,300,000.00	45,400,558.19	1.00
30	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	香港交易及结算有限公司	388 HK	香港证券交易所	中国香港	282,622.00	45,314,506.99	1.00
31	Uni-President Enterprises Corp	-	1216 TT	台湾证券交易所	中国台湾	3,400,000.00	44,380,671.43	0.98
32	CNOOC Ltd	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港证券交易所	中国香港	5,363,000.00	44,094,185.92	0.97
33	PT Bank Negara Indonesia (Persero) Tbk	-	BBNI IJ	印度尼西亚证券交易所	印度尼西亚	16,278,900.00	42,484,990.47	0.93
34	CP ALL Public Co Ltd	-	CPALL-R TB	泰国证券交易所	泰国	4,396,500.00	41,690,155.30	0.92
35	Ctrip.com Intl Ltd	-	CTRP US	纳斯达克股票交易所	美国	148,378.00	40,537,676.77	0.89
36	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	2,496,000.00	38,611,939.39	0.85
37	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	63,000.00	38,138,804.42	0.84
38	JD.com Inc	-	JD US	纳斯达克股票交易所	美国	270,505.00	38,081,795.60	0.84
39	Kumho Petro Chemical Co Ltd	-	011780 KS	韩国证券交易所	韩国	110,000.00	37,679,562.43	0.83
40	S-1 Corp	-	012750 KS	韩国证券交易所	韩国	60,000.00	37,305,357.46	0.82
41	PT Astra International Tbk	-	ASII IJ	印度尼西亚证券交易所	印度尼西亚	9,598,000.00	35,646,721.37	0.78
42	President Chain Store Corp	-	2912 TT	台湾证券交易所	中国台湾	650,000.00	33,537,316.09	0.74
43	Eclat Textile Co Ltd	-	1476 TT	台湾证券交易所	中国台湾	507,000.00	32,360,169.66	0.71
44	SM Prime Holdings Inc	-	SMPH PM	菲律宾证券交易所	菲律宾	8,383,600.00	32,258,841.87	0.71
45	PT Mitra Keluarga Karyasehat Tbk	-	MIKA IJ	印度尼西亚证券交易所	印度尼西亚	22,741,400.00	31,387,521.06	0.69
46	PT Bank Central Asia Tbk	-	BBCA IJ	印度尼西亚证券交易所	印度尼西亚	4,456,500.00	29,803,567.66	0.65
47	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	1,484,000.00	29,425,262.50	0.65
48	PT Waskita Karya Persero Tbk	-	WSKT IJ	印度尼西亚证券交易所	印度尼西亚	22,920,000.00	29,333,367.27	0.64
49	Luye Pharma Group Ltd	-	2186 HK	香港证券交易所	中国香港	7,142,000.00	28,994,252.42	0.64
50	Vipshop Holdings Ltd	-	VIPS US	纽约证券交易所	美国	385,090.00	28,523,810.38	0.63
51	58.com Inc	-	WUBA US	纽约证券交易所	美国	91,247.00	27,766,988.41	0.61
52	Ennoconn Corp	-	6414 TT	台湾证券交易所	中国台湾	312,000.00	27,578,095.78	0.61
53	Siam Commercial Bank Public Co Ltd	-	SCB-R TB	泰国证券交易所	泰国	1,022,800.00	26,828,468.95	0.59

54	KB Financial Group Inc	-	105560 KS	韩国证券交易所	韩国	140,000.00	26,274,946.21	0.58
55	China Medical System Holdings Ltd	-	867 HK	香港证券交易所	中国香港	2,575,000.00	25,969,147.95	0.57
56	Taiwan Cement Corp	-	1101 TT	台湾证券交易所	中国台湾	3,921,000.00	25,832,480.02	0.57
57	E Sun Financial Holding Co Ltd	-	2884 TT	台湾证券交易所	中国台湾	6,606,103.00	25,801,215.59	0.57
58	PTT Public Co Ltd	-	PTT-R TB	泰国证券交易所	泰国	432,900.00	25,569,503.36	0.56
59	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	615,500.00	25,460,790.23	0.56
60	Tenaga Nasional Bhd	-	TNB MK	吉隆坡证券交易所	马来西亚	1,092,300.00	25,332,993.33	0.56
61	Hiroca Holdings Ltd	-	1338 TT	台湾证券交易所	中国台湾	1,069,000.00	25,050,925.91	0.55
62	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	5,688,000.00	24,452,655.69	0.54
63	Guangshen Railway Co Ltd	广深铁路股份有限公司	525 HK	香港证券交易所	中国香港	7,664,000.00	24,104,702.44	0.53
64	Zijin Mining Group Co Ltd	紫金矿业集团股份有限公司	2899 HK	香港证券交易所	中国香港	10,880,000.00	24,083,916.86	0.53
65	HDFC Bank Ltd	-	HDFCB IN	印度国家证券交易所	印度	180,000.00	24,077,975.18	0.53
66	Metropolitan Bank & Trust Co	-	MBT PM	菲律宾证券交易所	菲律宾	1,883,958.00	23,991,364.51	0.53
67	Golden Agri-Resources Ltd	-	GGR SP	新加坡证券交易所	新加坡	13,529,200.00	23,330,255.49	0.51
68	Thai Oil Public Co Ltd	-	TOP-R TB	泰国证券交易所	泰国	2,015,400.00	22,819,329.22	0.50
69	Public Bank Bhd	-	PBK MK	吉隆坡证券交易所	马来西亚	714,800.00	22,809,288.39	0.50
70	Pou Chen Corp	-	9904 TT	台湾证券交易所	中国台湾	2,572,000.00	22,760,685.93	0.50
71	CTBC Financial Holding Co Ltd	-	2891 TT	台湾证券交易所	中国台湾	6,328,000.00	21,918,337.08	0.48
72	PT Astra Agro Lestari Tbk	-	AALI IJ	印度尼西亚证券交易所	印度尼西亚	2,737,166.00	20,194,150.92	0.44
73	Galaxy Entertainment Group Ltd	-	27 HK	香港证券交易所	中国香港	1,000,000.00	19,657,410.00	0.43
74	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	2,682,000.00	18,383,644.02	0.40
75	MTR Corp Ltd	-	66 HK	香港证券交易所	中国香港	544,500.00	18,242,418.35	0.40
76	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	3,719,400.00	17,801,613.75	0.39
77	Hota Industrial Manufacturing Co Ltd	-	1536 TT	台湾证券交易所	中国台湾	572,000.00	17,637,154.28	0.39
78	Huaneng Renewables Corp Ltd	华能新能源股份有限公司	958 HK	香港证券交易所	中国香港	7,300,000.00	16,034,463.87	0.35
79	Nexteer Automotive Group Ltd	-	1316 HK	香港证券交易所	中国香港	2,515,000.00	15,175,435.05	0.33

80	Jollibee Food Corp	-	JFC PM	菲律宾证券交易所	菲律宾	330,000.00	11,256,020.66	0.25
81	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	1,635,000.00	10,089,122.95	0.22
82	PT Pembangunan Perumahan Persero Tbk	-	PTPP IJ	印度尼西亚证券交易所	印度尼西亚	4,410,000.00	8,631,977.96	0.19
83	MediaTek Inc	-	2454 TT	台湾证券交易所	中国台湾	130,000.00	6,520,402.49	0.14

## 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	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2330 TT	101,311,908.05	2.19
2	LG Uplus Corp	032640 KS	94,246,058.17	2.04
3	Alibaba Group Holding Ltd	BABA US	78,629,338.96	1.70
4	Larsen & Toubro Ltd	LT IN	66,329,725.69	1.44
5	Samsung Engineering Co Ltd	028050 KS	61,590,156.31	1.33
6	S-1 Corp	012750 KS	59,024,422.03	1.28
7	Daelim Industrial Co Ltd	000210 KS	51,962,872.82	1.12
8	NutriBiotech	222040 KS	51,527,243.00	1.12
9	Bharti Infratel Ltd	BHIN IN	51,137,013.45	1.11
10	YG Entertainment Inc	122870 KS	50,991,416.16	1.10
11	China Construction Bank Corp	939 HK	49,644,399.13	1.07
12	Advanced Information Service Public Co Ltd	ADVANC-R TB	48,916,506.89	1.06
13	PT Waskita Karya Persero Tbk	WSKT IJ	46,373,445.13	1.00
14	PT Telekomunikasi Indonesia Tbk	TLKM IJ	44,817,943.91	0.97
15	Motherson Sumi Systems Ltd	MSS IN	44,810,109.38	0.97
16	Galaxy Entertainment Group Ltd	27 HK	43,738,877.42	0.95
17	Ctrip.com Intl Ltd	CTRP US	43,365,733.16	0.94
18	Largan Precision Co Ltd	3008 TT	41,276,406.23	0.89
19	MGM China Holdings Ltd	2282 HK	41,052,503.03	0.89
20	CNOOC Ltd	883 HK	40,630,427.91	0.88

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	占期初基金
----	----------	------	--------	-------

			金额	资产净值比例 (%)
1	Catcher Technology Co Ltd	2474 TT	110,423,968.09	2.39
2	Hyundai Steel Co	004020 KS	93,117,838.09	2.02
3	Advanced Semiconductor Engineering Inc	2311 TT	83,969,470.84	1.82
4	KT & G Corp	033780 KS	79,876,846.85	1.73
5	KB Financial Group Inc	105560 KS	75,411,108.73	1.63
6	China Merchants Bank Co Ltd	3968 HK	72,590,137.33	1.57
7	Housing Development Finance Corp Ltd	HDFC IN	65,498,028.05	1.42
8	Sino Biopharmaceutical Ltd	1177 HK	63,445,674.77	1.37
9	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd	2318 HK	61,879,394.88	1.34
10	Fubon Financial Holding Co Ltd	2881 TT	60,158,201.80	1.30
11	Tata Consultancy Services Ltd	TCS IN	58,963,025.43	1.28
12	Orion Corp	001800 KS	56,649,533.08	1.23
13	Airports of Thailand Public Co Ltd	AOT-R TB	51,502,026.98	1.11
14	Daelim Industrial Co Ltd	000210 KS	48,447,290.98	1.05
15	BGF Retail Co Ltd	027410 KS	48,443,160.46	1.05
16	Kasikornbank Public Co Ltd	KBANK-R TB	47,710,339.91	1.03
17	Apollo Hospitals Enterprise Ltd	APHS IN	44,736,377.50	0.97
18	PT Bank Tabungan Negara Persero Tbk	BBTN IJ	44,638,844.75	0.97
19	PT Wijaya Karya Tbk	WIKA IJ	44,444,491.46	0.96
20	China Vanke Co Ltd	2202 HK	44,227,203.59	0.96

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

买入成本（成交）总额	2,384,693,636.68
卖出收入（成交）总额	2,569,260,216.85

“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**

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	权证	Ennoconn Corp	136,358.64	0.00

**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**

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	14,772,554.84	0.32

**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	16,105,674.96
3	应收股利	18,017,986.82
4	应收利息	19,093.02
5	应收申购款	355,716.35
6	其他应收款	6,650,894.06
7	待摊费用	-
8	其他	30,007,454.82
9	合计	71,156,820.03

**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
649,856	12,211.56	72,229,112.03	0.91%	7,863,527,685.86	99.09%

**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	349,187.54	0.0044%

**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	10~50
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（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	8,171,380,093.39
本报告期基金总申购份额	26,517,339.59
减：本报告期基金总赎回份额	262,140,635.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,935,756,797.89

## 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	767,023,617.09	15.48%	1,314,587.66	15.20%	-
Credit Suisse Ltd	1	528,879,615.79	10.68%	945,552.76	10.93%	-
Macquarie Securities Ltd	1	441,496,243.68	8.91%	786,733.37	9.10%	-
UBS LTD	1	401,103,352.18	8.10%	694,740.60	8.03%	-
Morgan Stanley Co Intl plc	1	318,487,568.81	6.43%	546,898.92	6.32%	-
Instinet Ltd	1	283,579,896.00	5.72%	539,950.50	6.24%	-
Nomura International	1	334,308,827.06	6.75%	529,660.53	6.12%	-
CLSA Limited	1	299,044,982.67	6.04%	522,550.10	6.04%	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	1	225,855,838.68	4.56%	395,247.71	4.57%	-



HSBC Securities	1	210,809,087.52	4.26%	368,915.89	4.27%	-
JP Morgan Secs Ltd	1	189,301,713.73	3.82%	332,349.06	3.84%	-
Haitong Intl Secs Co Ltd	1	185,679,024.36	3.75%	324,938.31	3.76%	-
Credit Agricole Securities (Taiwan)	1	147,904,489.76	2.99%	258,832.44	2.99%	-
BNP Paribas Securities	1	146,948,407.23	2.97%	257,159.73	2.97%	-
Goldman Sachs	1	145,899,281.88	2.95%	240,174.36	2.78%	-
Merrill Lynch	1	116,331,274.32	2.35%	222,070.10	2.57%	-
BOCI Securities Ltd	1	83,504,868.75	1.69%	146,133.53	1.69%	-
China Merchants Securities (HK)	1	55,066,439.21	1.11%	96,366.28	1.11%	-
China Everbright Secs (HK) Ltd	1	46,253,395.97	0.93%	80,943.43	0.94%	-
CCB International Securities Ltd	1	22,185,888.69	0.45%	38,825.30	0.45%	-
Samsung Securities Company limited	1	4,290,040.15	0.09%	6,435.01	0.07%	-
Cathay Securities Corporation	1	-	-	-	-	-
CIMB Securities (Singapore) Pte Ltd	1	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Ltd	1	-	-	-	-	-
Daiwa Capital Markets	1	-	-	-	-	-
Deutsche Bank AG London	1	-	-	-	-	-
DSP Merrill Lynch Ltd	1	-	-	-	-	-
Fubon Securities Company Limited	1	-	-	-	-	-
ICBC International Securities Ltd	1	-	-	-	-	-
KDB Daewoo Securities	1	-	-	-	-	-
Korea Investment & Securities (KIS)	1	-	-	-	-	-
Masterlink Securities Corp	1	-	-	-	-	-
SinoPac Securities Corporation	1	-	-	-	-	-
Yuanta Securities Co Ltd	1	-	-	-	-	-
第一金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

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

2. 交易单元的选择标准：

1) 资本金雄厚,信誉良好。

- 2) 财务状况良好,经营行为规范。
- 3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,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 年上半年度本基金无新增席位,无注销席位。

## 10.7.2 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
Citigroup Global Mkts Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Macquarie Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS LTD	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley Co Intl plc	-	-	-	-	-	-	-	-
Instinet Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura International	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Secs Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong Intl Secs Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Agricole Securities (Taiwan)	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCI Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-

China Everbright Secs (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Samsung Securities Company limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Cathay Securities Corporation	-	-	-	-	-	-	-	-
CIMB Securities (Singapore) Pte Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Daiwa Capital Markets	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank AG London	-	-	-	-	-	-	-	-
DSP Merrill Lynch Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Fubon Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBC International Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
KDB Daewoo Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Korea Investment & Securities (KIS)	-	-	-	-	-	-	-	-
Masterlink Securities Corp	-	-	-	-	-	-	-	-
SinoPac Securities Corporation	-	-	-	-	-	-	-	-
Yuanta Securities Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
第一金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	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。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 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](http://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