基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月三十日

上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金

2015 年度报告摘要

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管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明
无。
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
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2015年1月22日至2015年4月10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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。
本报告期内,本基金未实施利润分配。
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
本托管人复核审查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。

§6 审计报告

上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金2015年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所审计,注册会计师陈玲、曹阳签字出具了"无保留意见的审计报告"(编号:普华永道中天审字(2016)第21361号)。投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1 资产负债表
会计主体:上投摩根全球新兴市场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 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:		-	-
银行存款	7.4.7.1	5,649,333.48	2,529,384.28
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	54,545,161.31	29,704,476.71
其中:股票投资		54,545,161.31	29,704,476.71
基金投资		-	-
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		8,850.71	114,488.87
应收利息	7.4.7.5	538.45	367.91
应收股利		17.87	16,222.54
应收申购款		30,985.46	35,107.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	123,735.48	154,293.58
资产总计		60,358,622.76	32,554,311.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 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		104,017.65	31,131.18
应付赎回款		107,966.46	404,081.08
应付管理人报酬		91,342.05	54,364.22
应付托管费		17,760.95	10,570.84
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		-	-
其他负债	7.4.7.8	200,898.28	229,946.03
负债合计		521,975.39	730,094.25
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.9	73,917,944.32	33,343,363.98
未分配利润	7.4.7.10	-14,081,296.95	-1,519,146.50
所有者权益合计		59,836,647.37	31,824,217.48
负债和所有者权益总计		60,358,622.76	32,554,311.73

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值0.810元,基金份额总额73,917,944.32份。
7.2 利润表
会计主体:上投摩根全球新兴市场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 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入		-29,591,915.40	3,829,921.29
1.利息收入		60,406.23	22,088.23
其中:存款利息收入	7.4.7.11	60,406.23	22,088.23
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-27,070,333.72	8,262,698.58
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-28,601,411.82	7,478,183.98
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
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	28,942.29	817.60
股利收益	7.4.7.16	1,502,135.81	783,697.00
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	-2,380,746.03	-4,246,246.93
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-387,074.24	-256,469.55
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	185,832.36	47,830.96
减:二、费用		3,225,681.69	1,997,118.80
1、管理人报酬		1,353,402.88	831,645.33
2、托管费		263,161.62	161,798.89
3、销售服务费		-	-
4、交易费用	7.4.7.19	1,417,700.38	768,082.73
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	191,416.81	235,791.85
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-32,817,600.09	1,832,732.49
减:所得税费用		52,377.03	18,605.76
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-32,869,977.11	1,814,126.73

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:上投摩根全球新兴市场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 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)	33,343,363.98	-1,519,146.50	31,824,217.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	-32,869,977.11	-32,869,977.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	40,574,580.34	20,307,826.66	60,882,407.00
其中:1.基金申购款	214,121,478.82	9,196,819.52	223,317,298.34
2.基金赎回款	-173,546,898.48	11,112,007.14	-162,434,891.34
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)	73,917,944.32	-14,081,296.95	59,836,647.37

项目	上年度可比期间 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)	60,811,610.39	-4,214,945.48	56,596,664.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	1,814,126.73	1,814,126.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-27,468,246.41	881,672.25	-26,586,574.16
其中:1.基金申购款	40,701,818.91	-936,424.44	39,765,394.47
2.基金赎回款	-68,170,065.32	1,818,096.69	-66,351,968.63
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)	33,343,363.98	-1,519,146.50	31,824,217.48

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:章砚麟,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
上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(原名为上投摩根全球新兴市场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[2010]1277号《关于核准上投摩根全球新兴市场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《上投摩根全球新兴市场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2011年1月6日至2011年1月26日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币349,529,284.05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(2011)第048号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金基金合同》于2011年1月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为349,551,403.11份基金份额,其中认购资金利息折合31,119.06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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,境外资产托管人为摩根大通银行,境外投资顾问为摩根资产管理(英国)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》,上投摩根全球新兴市场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全球新兴市场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》和《上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为与中国证监会签署备忘录的新兴国家或地区的证券。本基金拟投资的新兴市场主要根据摩根斯坦利新兴市场指数所包含的国家或地区进行界定,主要包括:中国、巴西、韩国、台湾、印度、南非、俄罗斯、墨西哥、以色列、马来西亚、印度尼西亚、智利、土耳其、泰国、波兰、哥伦比亚、匈牙利、菲鲁、埃及、捷克、菲律宾、摩洛哥等国家或地区。如果根据组利新兴市场指数所包含的国家或地区增加、减少或变更,本基金投资的主要证券市场将相应调整。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:摩根斯坦利新兴市场股票指数(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》、《上投摩根全球新兴市场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 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。
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股息收入,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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
摩根大通银行(JPMorgan &Chase Bank , N.A.)	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、境外投资顾问
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
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
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
J.P. Morgan Chase & Co.	与境外投资顾问在控制关系的机构
J.P. Morgan Asset Management Holdings Inc.	与境外投资顾问在控制关系的机构
J.P. Morgan Asset Management Holdings(UK) Limited	与境外投资顾问在控制关系的机构
J.P. Morgan Asset Management International Limited	与境外投资顾问在控制关系的机构
J.P. Morgan BCS 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。
7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易
无。
7.4.8.2关联方报酬
7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 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	1,353,402.88	831,645.33
其中:支付销售机构的客户维护费	273,163.93	306,604.28

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=前一日基金资产净值 X 1.8% / 当年天数。
7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 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	263,161.62	161,798.89

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值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=前一日基金资产净值 X 0.35% / 当年天数。
7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
无。
7.4.8.4各关联方投资本基金的情况
无。
7.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 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
中国建设银行	2,304,589.90	57,458.02	1,295,468.38	22,044.11
摩根大通银行	3,344,746.58	40.83	1,243,885.88	0.10

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人摩根大通银行保管,按适用利率计息。
7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
无。
7.4.8.7其他关联交易事项的说明
无。
7.4.9期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券
无。
7.4.10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	-	-	13,992.48	90,566.21

(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	-	13,992.48

(d) 所得税费用

项目	本期 2015年度	上年度可比期间 2014年度
当期所得税费用	63,325.67	-11,797.23
递延所得税费用	-10,948.64	30,392.99
合计	52,377.03	18,605.76

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 2015年度	
	应纳税所得	当期所得税费用
印度市场股票投资	413,703.56	63,325.67
	上年度可比期间 2014年度	
	应纳税所得	当期所得税费用
印度市场股票投资	-	-11,797.23

(2) 公允价值
(a) 金融工具公允价值计量的方法
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
(i) 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54,545,161.31元,无属于第二层次及第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次的余额为29,704,476.71元,无属于第二层次及第三层次的余额)。
(ii) 公允价值所属层次间的重大变动
本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。
(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额
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	54,545,161.31	90.37
	其中:普通股	54,545,161.31	90.37
	存托凭证	-	-
	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	5,649,333.48	9.36
8	其他各项资产	164,127.97	0.27
9	合计	60,358,622.76	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	52,129,863.21	87.12
中国台湾	1,252,578.61	2.09
南非	908,890.28	1.52
韩国	101,899.48	0.17
土耳其	40,467.51	0.07
波兰	39,876.27	0.07
墨西哥	35,714.30	0.06
印度尼西亚	26,143.98	0.04
智利	9,727.57	0.02
合计	54,545,161.31	91.16

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(%)
金属与采矿	8,103,616.10	13.54
资本市场	5,857,365.20	9.79
工业集团企业	5,354,812.18	8.95
石油、天然气与消费用燃料	5,048,068.84	8.44
商业服务与商业用品	3,988,250.03	6.67
保险	3,628,974.89	6.06
机械制造	3,105,807.82	5.19
能源设备与服务	2,739,627.23	4.58
食品	2,728,097.08	4.56
建筑与工程	2,029,985.75	3.39
家庭耐用消费品	1,975,691.93	3.30
建筑产品	1,813,145.60	3.03
专营零售	1,794,712.52	3.00
制药	1,722,320.75	2.88
商业银行	1,708,768.43	2.86
酒店、餐馆与休闲	1,441,132.37	2.41
休闲设备与用品	1,252,578.61	2.09
个人用品	101,899.48	0.17
食品与主要用品零售	99,911.42	0.17
交通基本设施	40,467.51	0.07
饮料	9,727.57	0.02
合计	54,545,161.31	91.16

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前十名权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	Yestar Intl Holdings Co Ltd	-	2393 HK	香港交易所	中国香港	1,400,000.00	3,988,250.03	6.67
2	Fosun Intl Ltd	复星国际	656 HK	香港交易所	中国香港	360,000.00	3,649,751.50	6.10
3	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd	中国平安保险	2318 HK	香港交易所	中国香港	100,000.00	3,602,830.91	6.02
4	Zijin Mining Group Co Ltd	-	2899 HK	香港交易所	中国香港	2,100,000.00	3,571,829.81	5.97
5	CNOOC Ltd	-	883 HK	香港交易所	中国香港	490,000.00	3,313,180.07	5.54
6	Haitong Securities Co Ltd	海通证券	6837 HK	香港交易所	中国香港	180,000.00	2,066,181.64	3.45
7	China State Construction Intl Holdings Ltd	-	3311 HK	香港交易所	中国香港	180,000.00	2,029,985.75	3.39
8	Haier Electronics Group Co Ltd	海尔电器	1169 HK	香港交易所	中国香港	150,000.00	1,975,691.93	3.30
9	Huatai Securities Co Ltd	华泰证券	6886 HK	香港交易所	中国香港	130,000.00	1,969,324.13	3.29
10	Jiangxi Copper Co Ltd	江西铜业	358 HK	香港交易所	中国香港	240,000.00	1,848,000.90	3.09

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益投资明细,应阅读登载于http://www.cifm.com网站的年度报告正文。
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	占期初基金资产净值比例(%)
1	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	1818 HK	8,223,477.89	25.84
2	New China Life Insurance Co Ltd	1336 HK	7,938,305.44	24.94
3	Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Co Ltd	8138 HK	7,815,741.41	24.56
4	Shanghai Fosun Pharmaceutical (Group) Co Ltd	2196 HK	7,303,475.55	22.95
5	Cogobuy Group	400 HK	6,666,847.45	20.95
6	CIMC Enric Holdings Ltd	3899 HK	6,610,523.40	20.77
7	Haitong Securities Co Ltd	6837 HK	5,792,587.18	18.20
8	Lee's Pharmaceutical Holdings Ltd	950 HK	5,414,311.77	17.01
9	Hilong Holding Ltd	1623 HK	5,392,948.30	16.95
10	Fosun Intl Ltd	656 HK	5,277,510.09	16.58
11	China Life Insurance Co Ltd	2628 HK	5,150,761.63	16.19
12	Poly Culture Group Corp Ltd	3636 HK	5,111,119.17	16.06
13	China Gas Holdings Ltd	384 HK	5,102,051.73	16.03
14	CITIC Securities Co Ltd	6030 HK	5,006,709.09	15.73
15	China Petroleum & Chemical Corp	386 HK	4,926,764.26	15.48
16	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd	338 HK	4,889,037.41	15.36
17	China Auto Rental Inc	699 HK	4,824,319.88	15.16
18	Travelsky Technology Ltd	696 HK	4,788,031.37	15.05
19	CITIC Telecom Intl Holdings Ltd	1883 HK	4,652,618.20	14.62
20	BBMG Corp	2009 HK	4,579,887.80	14.39
21	China State Construction Intl Holdings Ltd	3311 HK	4,575,179.94	14.38
22	Sinopec Kantons Holdings Ltd	934 HK	4,371,969.10	13.74
23	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd	2318 HK	4,290,206.32	13.48
24	Texhong Textile Group Ltd	2678 HK	4,210,691.21	13.23
25	Anta Sports Products Ltd	2020 HK	4,043,461.51	12.71
26	China Pacific Insurance (Group) Co Ltd	2601 HK	3,973,658.23	12.49
27	Intime Retail (Group) Co Ltd	1833 HK	3,970,313.78	12.48
28	Guangdong Investment Ltd	270 HK	3,740,715.17	11.75
29	Belle Intl Holdings Ltd	1880 HK	3,723,481.16	11.70
30	Hua Hong Semiconductor Ltd	1347 HK	3,720,231.42	11.69
31	Goldpac Group Ltd	3315 HK	3,712,342.04	11.67
32	Yestar Intl Holdings Co Ltd	2393 HK	3,567,980.89	11.21
33	Sinofert Holdings Ltd	297 HK	3,545,987.60	11.14
34	Semiconductor Manufacturing Intl Corp	981 HK	3,506,773.94	11.02
35	CNOOC Ltd	883 HK	3,481,957.73	10.94
36	Zijin Mining Group Co Ltd	2899 HK	3,444,444.25	10.82
37	Weichai Power Co Ltd	2338 HK	3,410,939.65	10.72
38	Beijing Enterprises Holdings Ltd	392 HK	3,324,771.30	10.45
39	Far East Horizon Ltd	3360 HK	3,297,317.64	10.33
40	CPMC Holdings Ltd	906 HK	3,168,487.96	9.95
41	Real Nutriceutical Group Ltd	2010 HK	3,157,976.64	9.92
42	Cosco Pacific Ltd	1199 HK	2,760,539.84	8.67
43	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd	3618 HK	2,743,086.70	8.62
44	ENN Energy Holdings Ltd	2688 HK	2,735,767.36	8.60
45	China Merchants Holdings Intl Co Ltd	144 HK	2,592,586.33	8.15
46	Kingdee Intl Software Group Co Ltd	268 HK	2,578,213.71	8.10
47	Hengan Intl Group Co Ltd	1044 HK	2,395,203.80	7.53
48	Tencent Holdings Ltd	700 HK	2,353,425.73	7.40
49	Bank of China Ltd	3988 HK	2,318,103.49	7.28
50	China Communications Services Corp Ltd	552 HK	2,306,497.48	7.25
51	Zhuzhou CSR Times Electric Co Ltd	3898 HK	2,236,479.30	7.03
52	Chanjet Information Technology Co Ltd	1588 HK	2,193,476.54	6.89
53	Value Partners Group Ltd	806 HK	2,153,511.18	6.77
54	Anton Oilfield Services Group	3337 HK	2,112,815.43	6.64
55	Vinda Intl Holdings Ltd	3331 HK	2,076,984.88	6.53
56	NagaCorp Ltd	3918 HK	1,948,549.07	6.12
57	C P Pokphand Co Ltd	43 HK	1,926,867.49	6.05
58	China Lesso Group Holdings Ltd	2128 HK	1,924,592.88	6.05
59	Jiangxi Copper Co Ltd	358 HK	1,859,142.78	5.84
60	China ZhengTong Auto Services Holdings Ltd	1728 HK	1,851,443.49	5.82
61	China XLX Fertiliser Ltd	1866 HK	1,807,384.21	5.68
62	China Modern Dairy Holdings Ltd	1117 HK	1,799,089.85	5.65
63	Minth Group Ltd	425 HK	1,782,623.72	5.60
64	China Shenhua Energy Co Ltd	1088 HK	1,760,122.87	5.53
65	Huatai Securities Co Ltd	6886 HK	1,726,194.72	5.42
66	Shanghai Industrial Holdings Ltd	363 HK	1,702,483.44	5.35
67	CRRC Corp Ltd	1766 HK	1,701,247.92	5.35
68	China Minsheng Banking Corp Ltd	1988 HK	1,675,886.12	5.27
69	Haier Electronics Group Co Ltd	1169 HK	1,650,464.41	5.19
70	China Medical System Holdings Ltd	867 HK	1,641,677.49	5.16
71	Lonking Holdings Ltd	3339 HK	1,562,130.20	4.91
72	Ajisen (China) Holdings Ltd	538 HK	1,544,836.94	4.85
73	Boyaa Interactive Intl Ltd	434 HK	1,533,417.56	4.82
74	China Life Insurance Co Ltd	2823 TT	1,483,494.48	4.66
75	Ruentex Industries Ltd	2915 TT	1,419,895.75	4.46
76	China Aircraft Leasing Group Hldgs Ltd	1848 HK	1,361,254.53	4.28
77	Tsingtao Brewery Co Ltd	168 HK	1,352,421.59	4.25
78	Anhui Conch Cement Co Ltd	914 HK	1,324,041.90	4.16
79	Xiao Nan Guo Restaurants Holdings Ltd	3666 HK	1,288,046.04	4.05
80	Johnson Health Tech Co Ltd	1736 TT	1,272,265.50	4.00
81	Gold Fields Ltd	GFI SJ	1,145,924.89	3.60
82	Global Brands Group Holding Ltd	787 HK	1,095,496.34	3.44
83	Cheung Kong Infrastructure Holdings Ltd	1038 HK	1,027,338.25	3.23
84	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	2317 TT	972,406.10	3.06
85	Wei Chuan Foods Corp	1201 TT	901,139.04	2.83
86	China ITS Holdings Co Ltd	1900 HK	872,784.79	2.74
87	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	2689 HK	795,656.50	2.50
88	Sentronic Intl Corp	3232 TT	666,417.11	2.09
89	S-1 Corp	012750 KS	659,906.26	2.07

注:"买入金额"(或"买入股票成本")、"卖出金额"(或"卖出股票