

2018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:中国建设银行股份有限公司

报告送达日期:二〇一八年七月十九日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金销售机构的从业人员不存在虚假记载、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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2018年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告告白为财务资料未经审计。

本报告告白自2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(FOF)

基金代码 378006

交易代码 378006

基金运作方式 契约型开放式基金

基金合同生效日 2011年1月30日

报告期末基金份额总额 83,251,343.49份

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2018年4月1日-2018年6月30日

1.本期已实现收益 1,733,525.76

2.本期利润 692,110.65

3.加权平均基金份额本期利润 0.0073

4.期末基金份额净值 89,977,074.94

5.期末基金资产净值 1081

注:本期已实现收益指本基金本期利息收入、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。

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),计人费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本期报告期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 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差额④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.09% -3.86% 0.93% 3.79% 0.16%

3.2.2 自基金合同生效以来本基金累计份额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

上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图

(2011年1月30日至2018年6月30日)

注:本期已实现收益指本基金本期利息收入、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。

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),计人费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2.3 基金净值表现

3.2.4 本期报告期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 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差额④ ①-③ ②-④

过去三个月 11.83% 10.04% 10.14% 0.93% 1.69% 0.11%

3.2.5 自基金合同生效以来本基金累计份额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

上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图

(2011年1月30日至2018年6月30日)

注:本期已实现收益指本基金本期利息收入、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。

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),计人费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2.6 基金净值表现

3.2.7 本期报告期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 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差额④ ①-③ ②-④

过去三个月 11.83% 10.04% 10.14% 0.93% 1.69% 0.11%

3.2.8 自基金合同生效以来本基金累计份额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

上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图

(2011年1月30日至2018年6月30日)

注:本期已实现收益指本基金本期利息收入、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。

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),计人费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2.9 基金净值表现

3.2.10 本期报告期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 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差额④ ①-③ ②-④

过去三个月 11.83% 10.04% 10.14% 0.93% 1.69% 0.11%

3.2.11 自基金合同生效以来本基金累计份额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

上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图

(2011年1月30日至2018年6月30日)

注:本期已实现收益指本基金本期利息收入、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。

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),计人费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2.12 基金净值表现

3.2.13 本期报告期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 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差额④ ①-③ ②-④

过去三个月 11.83% 10.04% 10.14% 0.93% 1.69% 0.11%

3.2.14 自基金合同生效以来本基金累计份额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

上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图

(2011年1月30日至2018年6月30日)

注:本期已实现收益指本基金本期利息收入、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。

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),计人费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2.15 基金净值表现

3.2.16 本期报告期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 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差额④ ①-③ ②-④

过去三个月 11.83% 10.04% 10.14% 0.93% 1.69% 0.11%

3.2.17 自基金合同生效以来本基金累计份额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

上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图

(2011年1月30日至2018年6月30日)

注:本期已实现收益指本基金本期利息收入、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。

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),计人费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2.18 基金净值表现

3.2.19 本期报告期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 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差额④ ①-③ ②-④

过去三个月 11.83% 10.04% 10.14% 0.93% 1.69% 0.11%

3.2.20 自基金合同生效以来本基金累计份额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

上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图

(2011年1月30日至2018年6月30日)

注:本期已实现收益指本基金本期利息收入、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。

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),计人费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2.21 基金净值表现

3.2.22 本期报告期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 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差额④ ①-③ ②-④

过去三个月 11.83% 10.04% 10.14% 0.93% 1.69% 0.11%

3.2.23 自基金合同生效以来本基金累计份额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

上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图

(2011年1月30日至2018年6月30日)

注:本期已实现收益指本基金本期利息收入、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。

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),计人费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2.24 基金净值表现

3.2.25 本期报告期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 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差额④ ①-③ ②-④

过去三个月 11.83% 10.04% 10.14% 0.93% 1.69% 0.11%

3.2.26 自基金合同生效以来本基金累计份额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

上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图

(2011年1月30日至2018年6月30日)

注:本期已实现收益指本基金本期利息收入、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。

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),计人费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2.27 基金净值表现

3.2.28 本期报告期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 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差额④ ①-③ ②-④

过去三个月 11.83% 10.04% 10.14% 0.93% 1.69% 0.11%

3.2.29 自基金合同生效以来本基金累计份额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

上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图

(2011年1月30日至2018年6月30日)

注:本期已实现收益指本基金本期利息收入、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。

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),计人费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2.30 基金净值表现

3.2.31 本期报告期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 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差额④ ①-③ ②-④

过去三个月 11.83% 10.04% 10.14% 0.93% 1.69% 0.11%

3.2.32 自基金合同生效以来本基金累计份额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

上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图

(2011年1月30日至2018年6月30日)

注:本期已实现收益指本基金本期利息收入、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。

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),计人费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.2.33 基金净值表现

3.2.34 本期报告期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 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 收益率差额④ ①-③ ②-④

过去三个月 11.83% 10.04% 10.14% 0.9