

上投摩根亚太优势股票型证券投资基金

[2010] 第四季度报告

基金持有人的声明及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责任。				
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				
报告期：2010年10月1日至2010年12月31日				
基金简称：上投摩根亚太优势股票(QDII)				
基金代码：377016				
交易代码：377016				
基金合同生效日：2007年10月22日				
报告期末基金份额总额：23,583,479,226.07份				
投资目标				
本基金主要投资于亚太地区的证券市场以及其他证券市场，交易地包括但不限于中国香港、中国台湾、美国、日本、韩国、印度、新加坡等区域证券市场(日本除外)、分散投资于海外市场并追求基金资产的增值。				
投资策略				
本基金的投资策略主要通过以下三个步骤实现：首先，根据对全球经济周期的判断，选择一个或多个板块或行业进行配置；其次，根据对不同国家或地区的经济周期的判断，选择具有国际比较优势的大盘股或小盘股，并从中初步筛选出具有国际比较优势的大盘股或小盘股，同时采取自上而下的选股策略，选择一个或多个板块或行业进行配置；最后，通过自上而下分析，甄别不同国家与行业，进行板块或行业的配置。				
业绩比较基准				
本基金的业绩比较基准为：摩根斯坦利资本国际亚太指数(不包含日本)。				
风险收益特征				
本基金为股票型证券投资基金，基金投资风险收益水平高于货币基金和平衡型基金，低于投资国家与地区市场的股票型基金。				
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				
境外资产顾问英文名称				
JF Asset Management Limited				
境外资产顾问中文名称				
The Bank of New York Mellon Company				
境外托管人中文名称				
纽约梅隆银行				
5.1 主要财务指标				
主要财务指标				
报告期(2010年10月1日-2010年12月31日)				
1.本期已实现收益	918,184,919.14			
2.本期利润	890,761,337.67			
3.加权平均基金份额本期利润	0.0370			
4.期末基金份额净值	16,309,260,264.91			
5.期末基金份额净值	0.692			
注：本期利润为根据报告期利润除以报告期基金份额净值计算的每份基金份额收益。本期利润已扣除基金管理费和托管费后的余额，即为可供分配给基金份额持有人的利润。				
3.2 基金份额净值增长率及其与业绩比较基准收益率的比较				
报告期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图				
注：本基金合同生效日为2007年10月22日，报告期时间2007年10月22日至2010年12月31日。				
本基金合同生效日为2007年10月22日，报告期时间2007年10月22日至2010年12月31日。				
5.4 管理人报告				
姓名 职务				
杨逸枫	本基金基金经理及副总经理			
张军	本基金基金经理			
王浩	JF基金经理区城投资经理兼大中华投			
注：本基金基金经理的任职日期为本公司决定正式对外公告之日；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》关于基金从业人的规定；基金托管人的名称和住所及基金托管人的联系人和电话根据基金合同的规定。				
4.1 基金经理及基金经理助理简介				
姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
杨逸枫	本基金基金经理及副总经理	2007-10-22	-	17年以上 曾任职于清华华大经济学硕士，台湾政治大学EMBA财会组毕业生，曾就职于台湾南山人寿保险股份有限公司，2003年加入上投摩根基金管理有限公司，2005年1月担任上投摩根基金管理有限公司基金经理，2007年7月加入上投摩根基金管理有限公司，担任基金经理。
张军	本基金基金经理	2008-3-8	-	6年以上；金融领域从业经验17年以上 中国建设银行股份有限公司国际业务部经理，交易部经理，2006年6月加入上投摩根基金管理有限公司，担任基金经理，2008年3月起担任上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金经理。
王浩	JF基金经理区城投资经理	17年	男，美国印第安纳大学理学士学位，主修金融。	
注：本基金基金经理的任职日期为本公司决定正式对外公告之日；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》关于基金从业人的规定；基金托管人的名称和住所及基金托管人的联系人和电话根据基金合同的规定。				
4.2 本报告期内基金的业绩表现				
注：本基金在本报告期内的业绩表现与同类型基金相比，表现良好。				
4.3 本报告期内基金的费用情况				
注：本基金在本报告期内的费用情况与同类型基金相比，表现良好。				
4.4 公平交易制度的执行情况				
注：本基金在本报告期内的公平交易制度的执行情况与同类型基金相比，表现良好。				
4.5 报告期内基金的利润分配情况				
注：本基金在本报告期内的利润分配情况与同类型基金相比，表现良好。				
5.1 基金概况				
基金简称				
上投摩根亚太优势股票				
基金代码	377016			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2005年10月11日			
报告期末基金份额总额	1,410,967,424.40份			
投资目标				
本基金采用跨资产配置投资策略(Barbell Approach)，同时以“成长”与“价值”双重量化指标进行股票选择。在基于自下而上的择股流程上，精选个股，严格执行，构造出相对均衡的不同风格资产类别。同时结合公司体质、行业布局、风险因子等深入分析，对资产配置进行适度调整，努力挖掘投资组合的市场适应性，以求在宽泛环境中都能创造超越业绩基准的主动管理回报。				
投资策略				
本基金充分借鉴摩根富林明资产管理集团全球行之有效的投资理念和投资方法，依据中国资本市场的具体特征，引入集团在海外的成熟运作经验，通过“动态”、“基本面”、“量化”、“风格”、“行业”、“主题”等不同风格的证券选择，积极构建并形成“量化”、“资产组合”、“资产配置”等不同风格的证券选择，结合严密的风险监控，不断调整投资组合业绩比较基准的稳定回向。				
业绩比较基准				
富国天惠精选价值增长混合型基金，属于证券投资基金中较高风险、较高收益的基金品种。				
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			
5.2 基金份额净值增长率及其与业绩比较基准收益率的比较				
报告期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图				
注：本基金合同生效日为2005年10月11日，报告期时间2005年10月11日至2010年12月31日。				
本基金合同生效日为2005年10月11日，报告期时间2005年10月11日至2010年12月31日。				
5.3 主要财务指标				
主要财务指标				
报告期(2010年10月1日-2010年12月31日)				
1.本期已实现收益	231,021,868.55			
2.本期利润	31,415,910.93			
3.加权平均基金份额本期利润	0.0217			
4.期末基金份额净值	4,446,327,895.24			
5.期末基金份额净值	3,151.3			
注：本期利润为根据报告期利润除以报告期基金份额净值，其他收入(不含公允价值变动收益)和相关费用(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以所列示。				
3.2.2 基金份额净值增长率及其与业绩比较基准收益率的比较				
报告期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图				
注：本基金合同生效日为2005年10月11日，报告期时间2005年10月11日至2010年12月31日。				
本基金合同生效日为2005年10月11日，报告期时间2005年10月11日至2010年12月31日。				
5.4 管理人报告				
姓名 职务				
杨逸枫	本基金基金经理及副总经理			
张军	本基金基金经理			
王浩	JF基金经理区城投资经理兼大中华投			
注：本基金基金经理的任职日期为本公司决定正式对外公告之日；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》关于基金从业人的规定；基金托管人的名称和住所及基金托管人的联系人和电话根据基金合同的规定。				
4.1 基金经理及基金经理助理简介				
姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
杨逸枫	本基金基金经理及副总经理	2007-10-22	-	17年以上 曾任职于清华华大经济学硕士，台湾政治大学EMBA财会组毕业生，曾就职于台湾南山人寿保险股份有限公司，2003年加入上投摩根基金管理有限公司，担任基金经理，2007年7月加入上投摩根基金管理有限公司，担任基金经理。
张军	本基金基金经理	2008-3-8	-	6年以上；金融领域从业经验17年以上 中国建设银行股份有限公司国际业务部经理，交易部经理，2006年6月加入上投摩根基金管理有限公司，担任基金经理，2008年3月起担任上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金经理。
王浩	JF基金经理区城投资经理	17年	男，美国印第安纳大学理学士学位，主修金融。	
注：本基金基金经理的任职日期为本公司决定正式对外公告之日；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》关于基金从业人的规定；基金托管人的名称和住所及基金托管人的联系人和电话根据基金合同的规定。				
4.2 本报告期内基金的业绩表现				
注：本基金在本报告期内的业绩表现与同类型基金相比，表现良好。				
4.3 本报告期内基金的费用情况				
注：本基金在本报告期内的费用情况与同类型基金相比，表现良好。				
4.4 公平交易制度的执行情况				
注：本基金在本报告期内的公平交易制度的执行情况与同类型基金相比，表现良好。				
4.5 报告期内基金的利润分配情况				
注：本基金在本报告期内的利润分配情况与同类型基金相比，表现良好。				
5.1 基金概况				
基金简称				
上投摩根亚太优势股票				
基金代码	377016			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2005年10月11日			
报告期末基金份额总额	1,410,967,424.40份			
投资目标				
本基金采用跨资产配置投资策略(Barbell Approach)，同时以“成长”与“价值”双重量化指标进行股票选择。在基于自下而上的择股流程上，精选个股，严格执行，构造出相对均衡的不同风格资产类别。同时结合公司体质、行业布局、风险因子等深入分析，对资产配置进行适度调整，努力挖掘投资组合的市场适应性，以求在宽泛环境中都能创造超越业绩基准的主动管理回报。				
投资策略				
本基金充分借鉴摩根富林明资产管理集团全球行之有效的投资理念和投资方法，依据中国资本市场的具体特征，引入集团在海外的成熟运作经验，通过“动态”、“基本面”、“量化”、“风格”、“行业”、“主题”等不同风格的证券选择，积极构建并形成“量化”、“资产组合”、“资产配置”等不同风格的证券选择，结合严密的风险监控，不断调整投资组合业绩比较基准的稳定回向。				
业绩比较基准				
富国天惠精选价值增长混合型基金，属于证券投资基金中较高风险、较高收益的基金品种。				
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			
5.2 基金份额净值增长率及其与业绩比较基准收益率的历史走势对比图				
注：本基金合同生效日为2005年10月11日，报告期时间2005年10月11日至2010年12月31日。				
本基金合同生效日为2005年10月11日，报告期时间2005年10月11日至2010年12月31日。				
5.3 主要财务指标				
主要财务指标				
报告期(2010年10月1日-2010年12月31日)				
1.本期已实现收益	231,021,868.55			
2.本期利润	31,415,910.93			
3.加权平均基金份额本期利润	0.0217			
4.期末基金份额净值	4,446,327,895.24			
5.期末基金份额净值	3,151.3			
注：本期利润为根据报告期利润除以报告期基金份额净值，其他收入(不含公允价值变动收益)和相关费用(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以所列示。				
3.2.2 基金份额净值增长率及其与业绩比较基准收益率的比较				
报告期内基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图				
注：本基金合同生效日为2005年10月11日，报告期时间2005年10月11日至2010年12月31日。				
本基金合同生效日为2005年10月11日，报告期时间2005年10月11日至2010年12月31日。				
5.4 管理人报告				
姓名 职务				
杨逸枫	本基金基金经理及副总经理			
张军	本基金基金经理			
王浩	JF基金经理区城投资经理兼大中华投			
注：本基金基金经理的任职日期为本公司决定正式对外公告之日；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》关于基金从业人的规定；基金托管人的名称和住所及基金托管人的联系人和电话根据基金合同的规定。				
4.1 基金经理及基金经理助理简介				
姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
杨逸枫	本基金基金经理及副总经理	2007-10-22	-	17年以上 曾任职于清华华大经济学硕士，台湾政治大学EMBA财会组毕业生，曾就职于台湾南山人寿保险股份有限公司，2003年加入上投摩根基金管理有限公司，担任基金经理，2007年7月加入上投摩根基金管理有限公司，担任基金经理。
张军	本基金基金经理	2008-3-8	-	6年以上；金融领域从业经验17年以上 中国建设银行股份有限公司国际业务部经理，交易部经理，2006年6月加入上投摩根基金管理有限公司，担任基金经理，2008年3月起担任上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金经理。
王浩	JF基金经理区城投资经理	17年	男，美国印第安纳大学理学士学位，主修金融。	
注：本基金基金经理的任职日期为本公司决定正式对外公告之日；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》关于基金从业人的规定；基金托管人的名称和住所及基金托管人的联系人和电话根据基金合同的规定。				
4.2 本报告期内基金的业绩表现				
注：本基金在本报告期内的业绩表现与同类型基金相比，表现良好。				
4.3 本报告期内基金的费用情况				
注：本基金在本报告期内的费用情况与同类型基金相比，表现良好。				