上投摩根亚太优势股票型证券投资基金

2013 年度报告摘要

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:二〇一四年三月二十八日

§1 重要提示

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2014年3月27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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	上投摩根亚太优势股票(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	17,279,479,756.91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	本基金为区域性股票型证券投资基金,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。

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	胥洪擎	赵会军
	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

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
邮政编码		–	–

2.5 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cifm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	41,155,429.63	-747,263,395.74	-426,763,983.07
本期利润	-86,714,341.75	1,550,664,032.88	-4,051,633,689.15
加权平均基金份额本期利润	-0.0046	0.0747	-0.1824
本期基金份额净值增长率	-0.69%	14.82%	-26.88%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.4752	-0.4778	-0.4942
期末基金资产净值	9,975,973,887.95	11,616,994,031.18	10,827,990,869.17
期末基金份额净值	0.577	0.581	0.506

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

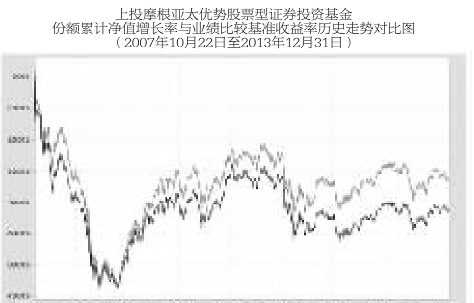
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	2.85%	0.71%	1.08%	0.65%	1.77%	0.06%
过去六个月	7.05%	0.85%	6.90%	0.78%	0.15%	0.07%
过去一年	-0.69%	0.92%	-2.56%	0.84%	1.87%	0.08%
过去三年	-16.62%	1.14%	-10.00%	1.13%	-6.62%	0.01%
过去五年	50.65%	1.31%	68.84%	1.29%	-18.19%	0.02%
自基金合同生效起至今	-42.30%	1.62%	-31.83%	1.67%	-10.47%	-0.05%

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

上投摩根亚太优势股票型证券投资基金
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2013年12月31日)

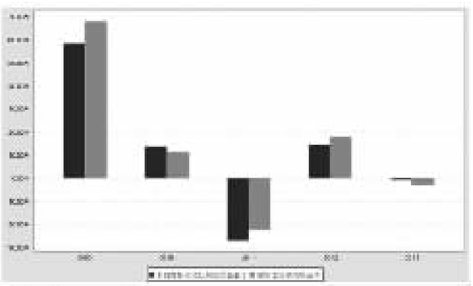


注:1.本基金合同生效日为2007 年10 月22 日,图示时间段为2007 年10 月22 日至2013 年12 月31 日。

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。

3.2.3过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上投摩根亚太优势股票型证券投资基金
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行过利润分配。

§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2013年12月底,公司管理的基金共有二十九只,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、上投摩根阿尔法股票型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋股票型证券投资基金、上投摩根内需动力股票型证券投资基金、上投摩根亚太优势股票型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘股票型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、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股票型证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质股票型证券投资基金、上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金、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、上投摩根核心优选股票型证券投资基金、上投摩根轮动添利债券型证券投资基金、上投摩根智选30股票型证券投资基金、上投摩根成长动力股票型证券投资基金、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和上投摩根双债增利债券型证券投资基金。

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		
杨逸枫	本基金基金经理,投资副总监	2007-10-22	–	20年	台湾新竹清华大学经济学学士,台湾政治大学EMBA财管组硕士。曾就职于台湾南山人寿保险股份有限公司,担任资深投资经理,负责管理公司自有资金在台湾股票市场的投资;1993年加入台湾摩根证券投资信托公司,先后担任JF亚洲基金、JF台湾增长、JF台湾基金的基金经理;2007年7月加入上投摩根基金管理有限公司,任投资副总监,自2007年10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。
张军	本基金基金经理	2008-03-08	–	9年(金融领域从业经验20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股票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股票型证券投资基金基金经理。
郭成东	本基金基金经理助理	2011-09-20	–	10年	毕业于上海对外贸易学院,硕士研究生。曾任天和证券经纪有限公司分析师,路透社中文网财经分析师。2007年加入上投摩根基金管理有限公司,历任市场经理、资深市场经理、投资组合经理。

注: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. 杨逸枫女士为本基金首任基金经理,其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
许安庆	JF基金区域投资经理	37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	19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遵规守信情况的说明

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、《上投摩根亚太优势股票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公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求,制订了《上投摩根基金管理有限公司公平交易制度》,规范了公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动,同时涵盖了授权、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各个环节,以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

公司执行自上而下的三级授权体系,依次为投资决策委员会、投资总监、经理人,经理人在其授权范围内自主决策,投资决策委员会和投资总监均不得干预其授权范围内的投资活动。公司已建立客观的研究方法,严禁利用内幕信息作为投资依据,各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立集中交易制度,执行公平交易分配。对于交易所市场投资活动,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机会;对于银行间市场投资活动,通过交易对手库控制和交易室询价机制,严格防范交易对手风险并抽检价格公允性;对于一级市场申购投资行为,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。

公司制订了《异常交易监控与报告制度》,通过系统和人工相结合的方式进行投资交易行为的监控分析,并执行异常交易行为监控分析记录工作机制,确保公平交易可稽核。公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析,并留存报告备查。

4.4.2公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行上述公平交易制度和控制方法,开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的收益率差异、以及不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易时机和交易价差等方面的监控分析,公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

其中,在同向交易的监控和分析方面,根据法规要求,公司对不同投资组合的同日和临近交易日的同向交易行为进行监控,通过定期抽查前述的同向交易行为,定性分析交易时机、对比不同投资组合长期的交易趋势,重点关注任何可能导致不公平交易的情形。对于识别的异常情况,由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理解释。同时,公司根据法规的要求,通过系统模块定期对连续四个季度内不同投资组合在不同时间窗内(日内、3日内、5日内)的同向交易价差进行分析,采用概率统计方法,主要关注不同投资组合之间同向交易价差均值为零的显著性检验,以及同向交易价格占优的交易次数占比分析。

报告期内,通过前述分析方法,未发现不同投资组合之间同向交易价差异常的情况。

4.4.3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,公司未发现存在异常交易行为。

报告期内,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%的情形共计发生1次,为指数基金在建仓期被动跟踪标的指数和其他投资组合发生的反向交易。

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

2013年的亚太股市呈现"W型"走势,市场的转折向下的时间是在5月份,分析造成亚太市场在5月下旬后陷入狂风暴雨的因素主要有二:第一个同时也是最重要的因素是对于美联储在下半年开始缩减QE规模的担忧;第二个因素是中国银行间利率的飙高。因此我们看到5月下旬至6月份全球股债市大幅下跌,其中受创最深的是新兴市场。在外资超卖的影响下,使得摩根史坦利(MSCI)新兴市场指数自5月中旬起一度下跌逾15%,亚太股市的跌幅也逾10% 。之后市场于低位震荡2个月,由于亚太市场的估值在8月底跌到相对底部,在低估值与对QE减码担忧减缓的影响下,9月份市场开始出现反弹,特别是月中的FOMC会后并未如市场预期进行QE减码更带动全球金融市场大涨。第四季后的亚太市场则是箱型盘整。由于美联储宣布自2014年1月开始将会循序渐进地减少购债的额度, QE的减码使得投资者对资金是否再次流出含亚洲股市在内的新兴市场又有担忧,因此多数市场在12月份走低。

亚太优势基金在主要投资的市场中,绩效正贡献来源主要是中国H股与香港本地市场。在中国(H股)部分,虽然银行、电信、能源、原材料等大型股的表现在年内多跑输指数,但环保、网络等与中国经济转型相关度高的类股,其股价在2013年表现亮眼。香港本地股部分表现最亮眼的则是澳门博彩股,由于持续受惠于内地赴澳门旅游的趋势,加上业者经营效率的改善,使得相关上市公司在2013年的营运成长屡创佳绩,带动股价一路走高。印度与印度尼西亚市场是2013年对基金负贡献较大的市场,由于我们仍担心两个市场的货币稳定度,也降低了基金对两个市场的投资比重。

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-0.69%,同期业绩比较基准收益率为-2.56%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

自从2013年5月后就开始有部分投资者担心1997年的亚洲金融风暴是否再现,我们认为现在与1997年相似的之处仅在于大规模资本于前几年陆续流入后的集中性流出,但现在亚洲经济体和1997年存在许多不同之处。首先就市场最担心的经常账部分分析:在1997年东南亚金融风暴前亚洲许多国家的经常帐赤字都是双位数字,但现在东北亚各国都是盈余。外汇准备是抵御外资流出最重要的武器,虽然近期外资的确大举流出亚股,但与印度外汇准备2540亿,泰国1660亿元水平相较,规模都不大,也显示了多数亚洲国家都有相当的外汇准备安全垫来面对外资流出。

我们认为QE减码对亚太股市的负面影响有限, 主要原因为这次的减码代表着美国经济复苏趋势的确立,以出口为导向的经济体,包括台湾、新加坡、香港、韩国等国家都将因此受惠。此外,投资人对QE退场议题的反应主要来自于心理面因素,而这样的担忧确实会压抑市场短线的表现。但另一方面由于美联储仅是减缓购债规模,而非自市场回收资金,而且包含欧洲、日本等全球主要央行仍持续为市场注入流动性,这些资金仍将于金融体系中流通,因此其实不须过度担心QE减码后对全球资金面的影响。整体而言,我们认为全球股市会逐步由先前的资金行情走向基本面行情,和成熟市场复苏高相关的东北亚股市在短线盘整后应该仍有向上走高动力,其他东南亚市场则观察其经济体质是否改善,足以抵御QE退场影响。

但2014年中,许多亚太市场的确也有些内部各自的投资风险部分是我们会密切留意的。例如:韩国股市由于日币再度贬值对韩国的出口相关个股形成压力。泰国部分则有政治前景不明是否冲击经济的担忧。印度市场虽然新任央行总裁上任后宣布了改革措施,使市场对于印度摆脱近期危机的信心增强,但仍需观望印度今年举行国会大选后,是否能将改革进一步落实并推出更多刺激经济政策。

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。

§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

2013年,本基金托管人在对上投摩根亚太优势股票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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2013年,上投摩根亚太优势股票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股票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,上投摩根亚太优势股票型证券投资基金未进行利润分配。

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股票型证券投资基金2013年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 审计报告

上投摩根亚太优势股票型证券投资基金2013年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所有限公司审计、注册会计师汪棣、王灵签字出具了"无保留意见的审计报告"(编号:普华永道中天审字(2014)第20812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:上投摩根亚太优势股票型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	566,847,229.02	499,155,741.18
结算备付金		–	–
存出保证金		–	–
交易性金融资产	7.4.7.2	9,447,929,486.42	11,161,647,046.09
其中:股票投资		9,447,929,486.42	11,011,267,137.40
基金投资		–	150,379,908.69
债券投资		–	–
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
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		2,511,140.70	–
应收利息	7.4.7.5	68,283.40	72,639.74
应收股利		–	–
应收申购款		260,693.70	404,017.18
递延所得税资产		–	–
其他资产	7.4.7.6	7,030,902.29	6,403,314.52
资产总计		10,024,647,735.53	11,667,682,758.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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		–	–
应付赎回款		27,698,846.69	17,325,023.98
应付管理人报酬		15,866,256.17	17,581,567.03
应付托管费		3,085,105.36	3,418,638.05
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	7.4.14(1)(a)	–	11,881,429.86
其他负债	7.4.7.8	2,023,639.36	482,068.61
负债合计		48,673,847.58	50,688,727.53
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	17,279,479,756.91	19,991,921,418.98
未分配利润	7.4.7.10	-7,303,505,868.96	-8,374,927,387.80
所有者权益合计		9,975,973,887.95	11,616,994,031.18
负债和所有者权益总计		10,024,647,735.53	11,667,682,758.71

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.577元,基金份额总额17,279,479,756.91份。

7.2 利润表

会计主体:上投摩根亚太优势股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		182,955,616.18	1,895,216,487.52
1.利息收入		2,252,199.70	2,616,703.01
其中:存款利息收入	7.4.7.11	2,252,199.70	2,616,703.01
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)		350,052,156.18	-391,222,779.83
其中:股票投资收益	7.4.7.12	152,858,907.85	-602,748,049.74
基金投资收益	7.4.7.13	4,017,842.92	-8,636,067.29
债券投资收益	7.4.7.14	–	–
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益	7.4.7.15	–	3,530,812.35
股利收益	7.4.7.16	193,175,405.41	216,630,524.85
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	-127,869,771.38	2,297,927,428.62
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-41,544,513.51	-14,159,714.38
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	65,545.19	54,850.10
减:二、费用		282,079,269.72	326,275,017.25
1.管理人报酬		193,091,900.35	201,105,718.04
2.托管费		37,545,647.25	39,103,889.60
3.销售服务费		–	–
4.交易费用	7.4.7.19	50,746,965.62	85,444,800.06
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	694,756.50	620,609.55
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-99,123,653.54	1,568,941,470.27
减:所得税费用	7.4.14(1)(d)	-12,409,311.79	18,277,437.39
四、净利润(净亏损以"-"号填列		-86,714,341.75	1,550,664,032.88

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:上投摩根亚太优势股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	19,991,921,418.98	-8,374,927,387.80	11,616,994,031.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-86,714,341.75	-86,714,341.75
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)	-2,712,441,662.07	1,158,135,860.59	-1,554,305,801.48
其中:1.基金申购款	85,758,601.35	-36,731,129.85	49,027,471.50
2.基金赎回款	-2,798,200,263.42	1,194,866,990.44	-1,603,333,272.98
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)	17,279,479,756.91	-7,303,505,868.96	9,975,973,887.95
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	21,406,245,942.25	-10,578,255,073.08	10,827,990,869.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	1,550,664,032.88	1,550,664,032.88
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)	-1,414,324,523.27	652,663,652.40	-761,660,870.87
其中:1.基金申购款	138,287,515.73	-64,312,052.22	73,975,463.51
2.基金赎回款	-1,552,612,039.00	716,975,704.62	-835,636,334.38
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)	19,991,921,418.98	-8,374,927,387.80	11,616,994,031.18

报告附注为财务报表的组成部分

本报告从7.1至7.4财务报表由下列负责人签署;

基金管理公司负责人:章硕麟,主管会计工作负责人:胡志强,会计机构负责人:张璐

7.4报表附注

7.4.1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2014年03月27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》、《上投摩根亚太优势股票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 2013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 2013年12月31日的财务状况以及2013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

本基金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。

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("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 Mellon Company,"纽约梅隆银行")	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
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
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
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
JF资产管理有限公司	境外投资顾问
J.P. Morgan Chase & Co.	与境外投资顾问存在控制关系的机构
J.P. Morgan Asset Management Holdings Inc.	与境外投资顾问存在控制关系的机构
J.P. Morgan Asset Management (Asia) Inc.	与境外投资顾问存在控制关系的机构
J.P. Morgan 8CS 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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	193,091,900.35	201,105,718.04
其中:支付销售机构的客户维护费	25,516,716.70	26,490,231.28

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。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	37,545,647.25	39,103,889.60

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。

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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
中国工商银行	312,433,355.63	2,252,085.94	330,148,068.61	2,378,674.08
纽约梅隆银行	254,413,873.39	–	169,007,672.57	237,572.55

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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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2013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

	2013年12月31日		2012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

	2013年12月31日		2012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	–	–	11,881,429.86	76,902,458.64

(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:

	2013年12月31日	2012年12月31日
递延所得税负债净额	–	11,881,429.86

注:于2013年12月31日,本基金未对印度市场股票投资产生的未实现资本损失确认相关的递延所得税资产16,225,855.37元。

(d) 所得税费用

项目	本期 2013年度	上年度可比期间 2012年度
当期所得税费用	–	6,167,216.25
递延所得税费用	-12,409,311.79	12,110,221.14
合计	-12,409,311.79	18,277,437.39

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 2013年度	
	应纳税所得	当期所得税费用
印度市场股票投资	–	–
	上年度可比期间 2012年度	
	应纳税所得	当期所得税费用
印度市场股票投资	–	6,167,216.25

(2) 公允价值

(a) 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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于2013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级的余额为9,447,929,486.42元,无属于第二层级和第三层级的余额 (2012年12月31日:第一层级的余额为11,161,647,046.09元,无属于第二层级和第三层级的余额)。

§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	9,447,929,486.42	94.25
	其中:普通股	8,394,650,007.28	83.74
	存托凭证	1,053,279,479.14	10.51
	优先股	–	–
	房地产信托	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
	其中:远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	货币市场工具	–	–
8	银行存款和结算备付金合计	566,847,229.02	5.65
9	其他资产	9,871,020.09	0.10
10	合计	10,024,647,735.53	100.00

注:截至2013年12月31日,上投摩根亚太优势股票型证券投资基金资产净值为9,975,973,887.95元,基金份额净值为0.577元,累计基金份额净值为0.577元。

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	4,348,619,594.12	43.59
韩国	1,924,340,796.06	19.29
印度	712,287,738.39	7.14
中国台湾	715,255,023.98	7.17
泰国	417,131,290.09	4.18
美国	485,482,937.54	4.87
新加坡	387,263,344.31	3.88
印度尼西亚	110,916,650.93	1.11
卢森堡	150,665,251.51	1.51
马来西亚	195,966,859.49	1.96
合计	9,447,929,486.42	94.71

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(%)
商业银行	1,680,535,854.24	16.85
半导体产品与设备	1,153,134,345.52	11.56
房地产管理和开发	667,124,713.71	6.69
汽车	608,782,319.42	6.10
石油、天然气与消费用燃料	581,625,956.41	5.83
保险	579,568,961.92	5.81
互联网软件与服务	389,608,209.77	3.91
酒店、餐馆与休闲	350,234,636.91	3.51
金属与采矿	329,408,024.28	3.30
食品	267,274,425.24	2.68
电子设备、仪器和元件	211,534,516.47	2.12
建筑材料	186,219,166.64	1.87
信息技术服务	176,086,601.99	1.77
工业集团企业	169,383,504.24	1.70
能源设备与服务	163,356,330.27	1.64
化学制品	157,824,366.51	1.58
独立电力生产商与能源贸易商	155,536,051.96	1.56
资本市场	149,387,621.01	1.50
燃气公用事业	136,752,128.82	1.37
多元化零售	133,305,052.76	1.34
互助储蓄银行与抵押信贷	132,995,857.84	1.33
纺织品、服装与奢侈品	131,573,181.28	1.32
电力公用事业	116,490,105.75	1.17
综合电信业务	107,812,190.53	1.08
综合金融服务	104,978,413.05	1.05
水公用事业	100,402,467.30	1.01
建筑与工程	87,356,320.06	0.88
通信设备	80,397,835.60	0.81
机械制造	67,941,767.36	0.68
海运	67,463,919.67	0.68
商业服务与商业用品	64,749,908.75	0.65
航空公司	56,283,626.86	0.56
医疗保健设备与用品	44,044,520.31	0.44
居家用品	38,756,583.97	0.39
合计	9,447,929,486.42	94.71

注:行业分类标准:MSCI

8.4 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	Samsung Electronics Co Ltd	三星电子有限公司	005930 KS	韩国证券交易所	韩国	68,859	545,792,269.67	5.47
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港交易所	中国香港	1,001,900	389,608,209.77	3.91
3	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	–	TSM US	纽约证券交易所	美国	3,647,512	387,839,717.58	3.89
4	China Construction Bank Corp	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港交易所	中国香港	78,218,150	359,760,118.03	3.61
5	AIA Group Ltd	友邦保险控股有限公司	1299 HK	香港交易所	中国香港	10,040,600	307,085,194.48	3.08
6	POSCO	韩国浦项钢铁公司	005490 KS	韩国证券交易所	韩国	155,897	294,058,339.84	2.95
7	KB Financial Group Inc	–	105560 KS	韩国证券交易所	韩国	873,125	213,115,822.35	2.14
8	Galaxy Entertainment Group Ltd	–	27 HK	香港交易所	中国香港	3,641,000	199,098,241.55	2.00
9	Hyundai Motor Co Ltd	现代汽车	005380 KS	韩国证券交易所	韩国	142,127	194,187,062.28	1.95
10	Agricultural Bank of China Ltd	中国农业银行股份有限公司	1288 HK	香港交易所	中国香港	62,816,000	188,167,608.22	1.89

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)。

3. 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 报告期内股票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	POSCO	005490 KS	284,731,688.30	2.45
2	China Petroleum & Chemical Corp	386 HK	270,767,817.03	2.33
3	Hyundai Motor Co Ltd	005380 KS	261,064,846.63	2.25
4	Samsung Electronics Co Ltd	005930 KS	244,677,762.95	2.11
5	CNOOC Ltd	883 HK	200,506,227.21	1.73
6	KIA Motors Corp	000270 KS	180,165,697.95	1.55
7	KB Financial Group Inc	105560 KS	164,169,387.89	1.41
8	Infosys Ltd	INFO IN	156,381,642.19	1.35
9	Hutchison Whampoa Ltd	13 HK	147,744,786.35	1.27
10	Innolux Corp	3481 TT	147,602,236.87	1.27
11	Sands China Ltd	1928 HK	144,369,940.49	1.24
12	Want Want China Holdings Ltd	151 HK	132,113,316.22	1.14
13	E Sun Financial Holding Co Ltd	2884 TT	72,759,735.38	0.63
		ESNFY LX	53,172,687.95	0.46
14	China Life Insurance Co Ltd	2823 TT	116,143,271.96	1.00
15	China Construction Bank Corp	939 HK	114,719,555.84	0.99
16	SK Innovation Co Ltd	096770 KS	113,999,470.88	0.98
17	United Microelectronics Corp Ltd	UMC US	86,379,732.20	0.74
		2303 TT	27,480,969.01	0.24
18	PTT Exploration & Production Public Co Ltd	PTTEP-R TB	112,198,204.26	0.97
19	Geely Automobile Holdings Ltd	175 HK	107,186,856.34	0.92
20	Ping An Insurance(Group)Co of China	2318 HK	106,382,900.89	0.92

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。

8.5.2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	Samsung Electronics Co Ltd	005930 KS	254,758,909.16	2.19
2	Hyundai Heavy Industries Co Ltd	009540 KS	247,670,392.90	2.13
3	Hyundai Mobis	012330 KS	246,150,148.15	2.12
4	POSCO	005490 KS	242,298,850.02	2.09
5	KIA Motors Corp	000270 KS	230,127,864.99	1.98
6	CNOOC Ltd	883 HK	210,219,826.31	1.81
7	PT Astra International Tbk	ASII IJ	200,183,640.31	1.72
8	Hyundai Motor Co Ltd	005380 KS	192,500,819.43	1.66
9	Shinhan Financial Group Co Ltd	055550 KS	185,619,486.23	1.60
10	New World Development Co Ltd	17 HK	175,625,384.08	1.51
11	KB Financial Group Inc	105560 KS	170,553,389.30	1.47
12	Hutchison Whampoa Ltd	13 HK	164,483,819.62	1.42
13	China Mobile Ltd	941 HK	164,480,992.56	1.42
14	Jardine Matheson Holdings Ltd	JM SP	163,504,010.94	1.41
15	Samsung C&T Corp	000830 KS	156,702,863.88	1.35
16	Krung Thai Bank Public Co Ltd	KTB-R TB	151,845,454.11	1.31
17	China Oilfield Services Ltd	2883 HK	146,455,088.58	1.26
18	Cheung Kong (Holdings) Ltd	1 HK	138,901,382.36	1.20
19	China Construction Bank Corp	939 HK	137,920,318.81	1.19
20	AAC Technologies Holdings Inc	2018 HK	136,858,387.24	1.18

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。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

金额单位:人民币元

买入成本(成交)总额	7,807,139,838.55
卖出收入(成交)总额	9,410,713,915.11

8.6 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。

8.7 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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

8.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1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。

8.12.2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。

8.12.3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	2,511,140.70
3	应收股利	–
4	应收利息	68,283.40
5	应收申购款	260,693.70
6	其他应收款	5,501,746.36
7	待摊费用	–
8	应收货币兑换款	1,529,155.93
9	其他	–
10	合计	9,871,020.09

8.12.4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。

8.12.5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。

8.12.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
1,242,729	13,904.46	149,832,168.90	0.87%	17,129,647,588.01	99.13%

9.2 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	108,765.62	0.0006%

注:期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0,该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为0。

§10 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	19,991,921,418.98
本报告期基金总申购份额	85,758,601.35
减:本报告期基金总赎回份额	2,798,200,263.42
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	17,279,479,756.91

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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:

2013年2月8日基金管理人发布《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》,经上投摩根基金管理有限公司董事会审议通过,决定聘任陈星德先生为公司副总经理且陈星德先生不再担任公司督察长一职、聘任刘万方先生为公司督察长。

2013年4月19日基金管理人发布《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》,经上投摩根基金管理有限公司董事会审议通过,决定聘任张军先生为公司副总经理。

基金托管人:

无。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。报告年度应支付给聘任普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为187,000元,目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为7年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1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		基金交易		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	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	
Morgan Stanley Co Intl plc	1	2,299,256,521.44	13.35%	33,986,215.42	22.81%	–	–	–
UBS LTD	1	1,910,397,808.62	11.10%	–	–	–	–	–
Merrill Lynch	1	1,905,251,887.28	11.07%	33,477,546.60	22.47%	–	–	–
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	1	1,259,732,647.14	7.32%	–	–	–	–	–
Credit Suisse Ltd	1	1,187,029,704.78	6.89%	–	–	–	–	–
Nomura International	1	1,033,826,245.11	6.00%	–	–	–	–	–
Macquarie Securities Ltd	1	930,525,311.44	5.40%	–	–	–	–	–
Goldman Sachs	1	891,591,967.01	5.18%	81,554,555.57	54.73%	–	–	–
Citigroup Global Mkts Ltd	1	864,629,209.83	5.02%	–	–	–	–	–
JP Morgan Secs Ltd	1	766,761,675.71	4.45%	–	–	–	–	–
CLSA Limited	1	638,614,258.03	3.71%	–	–	–	–	–
Instinet Ltd	1	573,854,798.98	3.33%	–	–	–	–	–
HSBC Securities	1	447,291,359.76	2.60%	–	–	–	–	–
Credit Agricole Securities (Taiwan)	1	334,622,211.62	1.94%	–	–	–	–	–
Masterlink Securities Corp	1	334,182,140.03	1.94%	–	–	–	–	–
Deutsche Bank AG London	1	301,844,979.28	1.75%	–	–	–	–	–
Samsung Securities Company limited	1	287,532,732.04	1.67%	–	–	–	–	–
BOCI Securities Ltd	1	269,798,482.56	1.57%	–	–	–	–	–
China Merchants Securities (HK)	1	236,300,530.84	1.37%	–	–	–	–	–
CITIC Securities Brokerage (HK) Ltd	1	190,244,851.41	1.10%	–	–	–	–	–
Yuanta Securities Co Ltd	1	141,659,016.09	0.82%	–	–	–	–	–
ICBC International Securities Ltd	1	95,834,990.13	0.56%	–	–	–	–	–
SINOPAC SECURITIES CORPORATION	1	72,198,571.63	0.42%	–	–	–	–	–
CCB International Securities Ltd	1	58,493,729.23	0.34%	–	–	–	–	–
China Everbright Secs (HK) Ltd	1	57,754,150.01	0.34%	–	–	–	–	–
DSP Merrill Lynch Ltd	1	51,073,586.84	0.30%	–	–	–	–	–
BNP Paribas Securities	1	35,746,629.81	0.21%	–	–	–	–	–
CIMB Securities (Singapore) Pte Ltd	1	32,239,200.26	0.19%	–	–	–	–	–
Haitong Intl Secs Co Ltd	1	9,564,556.75	0.06%	–	–	–	–	–
Daiwa Capital Markets	1	–	–	–	–	–	–	–
Korea Investment & Securities (KIS)	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. 2013年度新增CITIC Securities Brokerage (HK) Limited、Daiwa Capital Markets、Korea Investment & Securities (KIS)、第一金证券股份有限公司共计4个席位,无注销席位。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一四年三月二十八日