

上投摩根亚太优势股票型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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:二〇一五年七月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监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。

基金托管人中行国际银行有限公司根据本基金合同规定，于2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告。

基金代销机构承诺不以任何方式影响投资人对基金的判断，并不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表未来表现。投资人投资于本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2015年4月1日起至2015年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

本基金主要投资于亚太地区证券市场以及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(本基金除外)，并投资于风险资产。

本基金的投资目标是追求基金资产的长期增值。

本基金的投资策略是通过分析宏观经济形势、行业发展趋势、公司基本面等，选择具有成长性的行业和公司，进行积极主动的资产配置。

本基金将通过在不同国家、地区的股票、债券、货币市场工具等资产类别之间进行资产配置，力争实现基金资产的长期增值。

本基金的业绩比较基准为MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan。

本基金的风险收益特征为：基金投资风险收益水平高于货币基金和平衡型基金，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。

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

基金代销机构名称:JF Asset Management Limited

JF资产管理有限公司

JF资产管理有限公司名称:JF资产管理有限公司

境外销售代理人名称:The Bank of New York Mellon Company

境外销售代理人中文名称:纽约梅隆银行

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 (2015年4月1日-2015年6月30日)

1.本期已实现收益 447,827,082.34

2.本期利润 163,403.28

3.加权平均基金份额本期利润 0.0162

4.期末基金资产净值 5,410,869,844.72

5.期末基金份额净值 0.6116

注:本基金的业绩报酬率为:净利得除以(MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan)指数(不含日本)(不包含日本)

本基金的业绩比较基准为:MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan。

本基金的风险收益特征为:基金投资风险收益水平高于货币基金和平衡型基金,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。

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

基金代销机构名称:JF Asset Management Limited

JF资产管理有限公司

JF资产管理有限公司名称:JF资产管理有限公司

境外销售代理人名称:The Bank of New York Mellon Company

境外销售代理人中文名称:纽约梅隆银行

§ 4 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 (2015年4月1日-2015年6月30日)

1.本期已实现收益 447,827,082.34

2.本期利润 163,403.28

3.加权平均基金份额本期利润 0.0162

4.期末基金资产净值 5,410,869,844.72

5.期末基金份额净值 0.6116

注:本基金的业绩报酬率为:净利得除以(MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan)指数(不含日本)(不包含日本)

本基金的业绩比较基准为:MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan。

本基金的风险收益特征为:基金投资风险收益水平高于货币基金和平衡型基金,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。

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

基金代销机构名称:JF Asset Management Limited

JF资产管理有限公司

JF资产管理有限公司名称:JF资产管理有限公司

境外销售代理人名称:The Bank of New York Mellon Company

境外销售代理人中文名称:纽约梅隆银行

§ 5 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 (2015年4月1日-2015年6月30日)

1.本期已实现收益 447,827,082.34

2.本期利润 163,403.28

3.加权平均基金份额本期利润 0.0162

4.期末基金资产净值 5,410,869,844.72

5.期末基金份额净值 0.6116

注:本基金的业绩报酬率为:净利得除以(MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan)指数(不含日本)(不包含日本)

本基金的业绩比较基准为:MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan。

本基金的风险收益特征为:基金投资风险收益水平高于货币基金和平衡型基金,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。

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

基金代销机构名称:JF Asset Management Limited

JF资产管理有限公司

JF资产管理有限公司名称:JF资产管理有限公司

境外销售代理人名称:The Bank of New York Mellon Company

境外销售代理人中文名称:纽约梅隆银行

§ 6 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证明细

序号 公司名称(中文) 证券代码(人民币) 所在国家(地区) 所属行业 数量(股) 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例(%)

1 Tricor Holdings Ltd 700 HK 香港交易所 中资金融股 3,148,300.00 384,410,599.00 7.10

2 Lorte Chemical Corp. — 美国 联邦储备系统 123,000,000 194,872,324.58 3.60

3 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. 2330 台湾证券交易所 台湾半导体股 3,970,000 110,821,135.52 2.04

4 TSMC US 中国美国存托凭证 871,900,000 79,407,311.00 1.47

5 Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd 2318 香港证券交易所 中国保险业 1,000,000 163,833,844.63 3.02

6 China Pacific Insurance Co., Ltd 2601 香港证券交易所 中国保险业 5,227,200.00 153,346,655.84 2.83

7 Insurance Corp. of America Inc. 000700 台湾证券交易所 美国保险业 21,000,000 149,943,763.43 2.70

8 Catcher Technologies Co. 2474 台湾证券交易所 中国台湾 1,928,000 147,459,528.72 2.73

9 Suning Electronics Co. Ltd 002328 深圳证券交易所 中国台湾 21,000,000 145,943,763.43 2.70

10 Advanced Semiconductor 制造有限公司 2311 台湾证券交易所 中国台湾 17,227,000.00 142,604,494.90 2.64

11 KTC & C Corp. — 033760 台湾证券交易所 台湾股 270,000.00 140,435,494.91 2.60

12 Housing 中国台湾 1,040,000 129,444,343.42 2.39

13 Development Finance 中国台湾 1,040,000 129,444,343.42 2.39

注:本基金的业绩报酬率为:净利得除以(MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan)指数(不含日本)(不包含日本)

本基金的业绩比较基准为:MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan。

本基金的风险收益特征为:基金投资风险收益水平高于货币基金和平衡型基金,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。

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

基金代销机构名称:JF Asset Management Limited

JF资产管理有限公司

JF资产管理有限公司名称:JF资产管理有限公司

境外销售代理人名称:The Bank of New York Mellon Company

境外销售代理人中文名称:纽约梅隆银行

§ 7 基金资产运用情况和资金投资基本配置明细

序号 项目 金额(人民币元)

1 国债 11,692,994,061.93

2 银行存款 106,484,971.99

3 其他资产 5,000,000.00

4 合计 11,808,470,033.92

注:本基金的业绩报酬率为:净利得除以(MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan)指数(不含日本)(不包含日本)

本基金的业绩比较基准为:MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan。

本基金的风险收益特征为:基金投资风险收益水平高于货币基金和平衡型基金,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。

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

基金代销机构名称:JF Asset Management Limited

JF资产管理有限公司

JF资产管理有限公司名称:JF资产管理有限公司

境外销售代理人名称:The Bank of New York Mellon Company

境外销售代理人中文名称:纽约梅隆银行

§ 8 报告期内基金的业绩表现

报告期自2015年4月23日起至2015年6月30日止。

§ 9 基金产品概况

基金名称 上投摩根亚太优势股票型证券投资基金

基金代码 001192

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2015年4月23日

报告期末基金总资产 3,643,746,561.91份

报告期末基金总负债 -1,057,000.00份

报告期末基金净资产 3,506,926,157.13份

报告期末基金份额净值 0.961

注:本基金实现收益扣除非关联交易收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)、赎回费用、红利再投、基金转换费用后余额为零时点数。

本基金的业绩比较基准为:MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan。

本基金的风险收益特征为:基金投资风险收益水平高于货币基金和货币型基金，属于较高风险收益水平的基金产品。

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

§ 10 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 (2015年4月23日-基金合同生效日-2015年6月30日)

1.本期已实现收益 60,256,354.19

2.本期利润 -491,918,775.86

3.加权平均基金份额本期利润 -0.1357

4.期末基金资产净值 3,506,926,157.13

5.期末基金份额净值 0.961

注:本基金实现收益扣除非关联交易收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)、赎回费用、红利再投、基金转换费用后余额为零时点数。

本基金的业绩比较基准为:MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan。

本基金的风险收益特征为:基金投资风险收益水平高于货币基金和货币型基金，属于较高风险收益水平的基金产品。