上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016年12月31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
报告送出日期:二〇一七年三月三十日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月29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2016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	上投摩根全球新兴市场混合(QDII)
基金主代码	378006
交易代码	378006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1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
报告期末基金份额总额	54,030,271.51份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于新兴市场以及在其他证券市场交易的新兴市场企业,通过深入挖掘新兴市场企业的投资价值,努力实现基金资产稳健增值。
投资策略	新兴市场所属国家和地区经济发展多处于转型阶段,劳动力成本低,自然资源丰富,与发达国家与地区比较,其经济发展速度一般相对较高。本基金将充分分享新兴市场经济高增长成果,审慎把握新兴市场的投资机会,争取为投资者带来长期稳健回报。 总体上本基金将采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。首先通过考察不同国家的发展趋势及不同行业的景气程度,决定地区与板块的基本布局;其次采取自下而上的选股策略,在对股票进行基本面分析的同时,通过深入研究股票的价值与动量特性,选取目标投资对象。在固定收益类投资部分,本基金将综合考虑资产市场的安全性、流动性与收益性,并结合现金管理要求等来制订具体策略。
业绩比较基准	MSCI新兴市场股票指数(总回报)
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金,预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于较高预期收益和较预期风险水平的投资品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡鑑	田青
	联系电话	021-38794888	010-67595096
	电子邮箱	services@cifm.com	tianqing12h@ccb.com
客户服务电话		400-889-4888	010-67595096
传真		021-20628400	010-66275853

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	JPMorgan Asset Management(UK) Limited	JPMorgan Chase Bank, N.A.
	中文	摩根资产管理(英国)有限公司	摩根大通银行
注册地址		25 Bank Street Canary Wharf London E14 5JP	- 1111 Polaris Parkway, Columbus, Ohio 43240, U.S.A.
办公地址		- 125 London Wall, London, EC2Y 5AJ, Finsbury Dials, 20 Finsbury Street, London EC2Y 9AQ	- 270 Park Avenue, New York, New York 10017- 2070
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	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	- 3,562,371.11	- 30,489,231.08	6,060,373.66
本期利润	- 1,848,123.38	- 32,869,977.11	1,814,126.73
加权平均基金份额本期利润	- 0.0328	- 0.3996	0.0385
本期基金份额净值增长率	- 1.11%	- 15.09%	2.47%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	- 0.4324	- 0.3787	- 0.0693
期末基金资产净值	43,252,024.97	59,836,647.37	31,824,217.48
期末基金份额净值	0.801	0.810	0.954

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。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	- 2.55%	0.82%	- 0.85%	0.93%	- 1.70%	- 0.11%
过去六个月	3.09%	0.90%	8.14%	0.89%	- 5.05%	0.01%
过去一年	- 1.11%	1.06%	15.99%	1.08%	- 17.10%	- 0.02%
过去三年	- 13.96%	1.33%	- 2.15%	0.99%	- 11.81%	0.34%
过去五年	1.14%	1.15%	3.59%	0.95%	- 2.45%	0.20%
自基金合同生效起至今	- 19.90%	1.14%	- 19.45%	1.05%	- 0.45%	0.09%

注:本基金的业绩比较基准为:MSCI新兴市场股票指数(总回报)。

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

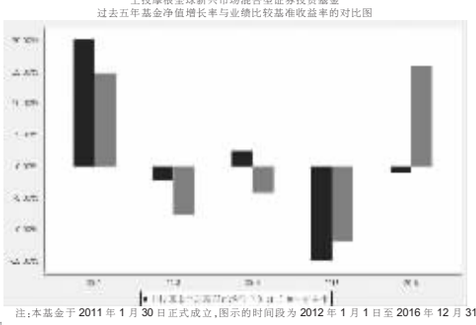
上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年1月30日至2016年12月31日)

注:本基金合同生效日为2011年1月30日,图示时间段为2011年1月30日至2016年12月31日。

本基金建仓期自2011年1月30日至2011年7月29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

上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金
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



注:本基金于2011年1月30日正式成立,图示的时间段为2012年1月1日至2016年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日起未进行过利润分配。

§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2016年12月底,公司管理的基金共有五十二只,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、上投摩根阿尔法混合型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋混合型证券投资基金、上投摩根内需动力混合型证券投资基金、上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘混合型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、上投摩根新兴动力混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金、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、上投摩根核心优选混合型证券投资基金、上投摩根稳动添利债券型证券投资基金、上投摩根智选30混合型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、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、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根民生需求股票型证券投资基金、上投摩根优信增利债券型证券投资基金、上投摩根现金管理货币市场基金、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添盈货币市场基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根纯债添利债券型证券投资基金、上投摩根稳进回报混合型证券投资基金、上投摩根安全战略股票型证券投资基金、上投摩根卓越制造股票型证券投资基金、上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置证券投资基金、上投摩根智慧互联股票型证券投资基金、上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根新兴服务股票型证券投资基金、上投摩根医疗健康股票型证券投资基金、上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根策略精选灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金、上投摩根岁岁丰定期开放债券型证券投资基金、上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金和上投摩根全球多元配置证券投资基金。

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		
张淑梅	本基金基金经理	2016-12-16	-	27年	张淑梅女士,台湾大学财务金融研究所MBA,自1987年9月至1989年2月,在东盟或农股份有限公司担任研究部专员;自1989年3月至1991年8月,在富隆证券股份有限公司担任投行部专员;自1993年3月至1998年1月,在光华证券投资信托股份有限公司担任研究部副理;自1998年2月至2006年7月,在摩根富林明证券信托股份有限公司担任副总经理;自2007年11月至2009年8月,在德夏志亚洲资产管理公司担任副总经理;自2009年9月至2014年6月,在富实国际资产管理公司担任副总经理;自2014年7月至2016年8月,在上投摩根资产管理(香港)有限公司担任投资总监;自2016年9月起加入上投摩根基金管理有限公司,自2016年12月起同时担任上投摩根亚太优势混合型证券投资基金基金经理及上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金基金经理。
王邦祺	本基金基金经理、国际投资部总监助理	2011-01-30	2016-12-16	17年	台湾大学历史学硕士班,曾任职于香港永丰金证券(亚洲)及香港永丰金资产(亚洲)有限公司,负责管理海外可转债及海外新兴市场固定收益部位,2007年9月加入上投摩根基金管理有限公司,任投资经理,从事QDII海外固定收益及海外可转债投资及研究工作,2011年1月至2016年12月担任上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金基金经理,自2014年12月至2016年12月担任上投摩根亚太优势混合型证券投资基金基金经理。
周浩	本基金基金经理助理	2014-9-19	-	9年	美国加利福尼亚大学MBA,2005年2月至2006年10月任B. Riley & Co.权益研究员,2008年1月至2011年8月任罗仕证券中国首席研究员。自2013年2月加入上投摩根基金管理有限公司,曾任投资组合经理。

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.王邦祺生平为本基金首任基金经理,其任职日期指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
Noriko Kuroki	投资组合经理	21年	女,牛津大学硕士,主修哲学、政治和经济学
Anuj Arora	投资组合经理	14年	男,伊利诺斯理工大学硕士,主修金融学

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、《上投摩根全球新兴市场混合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(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;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%的次数为三次,均发生在纯量化投资组合与主动管理投资组合之间。

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

回顾过去一年,新兴市场整体走势与2015年完全相反。MSCI新兴市场指数反弹8.6%,其中新兴亚洲上涨3.8%,但是新兴东欧与拉美分别大涨16.4%与31%。大宗商品价格反弹与资金重新流入新兴市场是主要原因。美联储本轮的紧缩周期已经持续了两年半,美元强势也已持续超过两年,2015年第四季正式升息后,2016年以来汇率走势与过去两年不同,2016年除了俄罗斯卢布以及巴西雷亚尔兑美元大幅升值外,大部分新兴市场货币兑美元呈现稳定走势,资金有持续回流新兴市场的迹象。

个别市场方面,由于商品原材价格反弹,巴西及俄罗斯股汇双涨,MSCI巴西指数大涨61%排第一,俄罗斯涨49%排第二,亚洲其他新兴市场以泰国、台湾及印尼表现较佳,分别上涨22%、14.5%及12%,表现最差的市场,是受特朗普当选负面影响的墨西哥,下跌10.7%;中国及印度则分别小跌1.4%及0.3%。

本基金已经于2015年起,将大部分新兴市场的持股转变为香港上市的新兴中国股票投资,这样的投资策略预计将持续,主要基于以下原因:首先是MSCI新兴市场指数未来将可能纳入A股的权重,如果全部纳入,中国市场的权重将为全球新兴市场指数的40%以上,这将使未来全球资金持续流入中国市场,带来中国市场长期表现较好的局面;我们认为中国市场正处于一个长期高速成长的外销导向经济体转型的过程中,这段时间是股市表现较好的时期,这在1985年至1990年的日本与台湾股市发生过。

回顾2016年,有几件大事影响市场:1月份内地A股市场大幅调整,港股也受到波及。而在第一季度我们看到房地产反弹,原物料大跌,油价在一月份跌到每桶40元以下。中国在2季度实施供给侧改革,去产能,煤、铁、铜价,大宗原物料及油价反弹向上;而六月份英国脱欧意外通过,市场下跌后逐步反弹回升,直到九月底。第四季美国总统选举,随着选情走展,共和党后来居上,市场情绪转为悲观,美元转强,美联储在12月加息,而中国资金出现短暂流动性风险,使得市场又拉回。在亚洲市场方面,印度在11月8日施行废钞,泰皇10月过世,印尼股权大赦,也对个别市场有不同程度的影响。

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-1.11%,同期业绩比较基准收益率为15.99%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在2017年,我们认为三个趋势持续发生:

首先全球央行货币政策方向收敛的效果非常明显,欧美CPI快速上行。一方面美元指数横盘震荡促使大宗商品上涨,另一方面经过两年的市场出清,全球大宗商品也有上涨的基础,结果是美国、欧洲的CPI快速上行。美国2015年CPI中枢为0%,2016年10月已经上升至1.6%,为2014年11月以来最高值;欧洲2015年CPI中枢也为0%,2016年10月已经上升至0.5%,为2014年5月以来最高值。即使我们不考虑抑制全球资产泡沫、不考虑特朗普的"再通胀"预期,仅仅关注美国、欧洲的通胀变化,就可以得出全球央行流动性拐点的结论。

第二个趋势是政治风险将大于经济风险,2017年是选举年,先后有法国总统、韩国总统以及德国总理的选举;市场关注意大利的动向,因为意大利有可能进行脱欧的公投。另外,特朗普的政策走向,美国边境关税、移民政策、财政政策,公司税率减免,国际关系政策等等。这将会使市场的波动变大,但风险却也创造了投资机会。

第三个趋势是,中国迈向发展中国家,经济已出现老年化的现象,消费升级及制造升级是未来趋势,老年需求将是未来市场关注的焦点。

新兴市场基金基于这三个长期趋势,我们的投资进行相应的调整。美联储的加息,将使美元相对强势,我们针对美元升值以及美国经济回升的长期趋势进行调整,加大对市场外销板块的关注,这包括科技与外销板块。因应利率回升的趋势,我们将关注重点市场的金融板块,尤其是存险及银行板块。最后因应老年化的趋势,我们将加强中国市场医疗板块的关注,也看好中国市场的消费升级需求,如旅游及高端医疗与保险养老的需要。而新科技发展所开发出的新应用,如电动车、机械人、新能源以及互联网,也有很多投资机会。

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。

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,本基金存在连续六十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2016年1月13日至2016年12月31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2016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,注册会计师陈玲、曹阳签字出具了"无保留意见的审计报告"(编号:普普华永道中天审字(2017)第20520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:2016年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产:		-	-
银行存款	7.4.7.1	9,742,047.89	5,649,333.48
结算备付金		1,016,807.04	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	35,219,413.71	54,545,161.31
其中:股票投资		35,219,413.71	54,545,161.31
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		742,849.07	8,850.71
应收利息	7.4.7.5	1,422.05	538.45
应收股利		-	17.87
应收申购款		18,787.38	30,985.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	1,352,715.00	123,735.48
资产总计		48,094,042.14	60,358,622.76
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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		2,900,205.81	104,017.65
应付赎回款		345,402.41	107,956.46
应付管理人报酬		67,485.25	91,342.05
应付托管费		13,122.14	17,760.95
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	24,766.17	-
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	1,491,035.39	200,898.28
负债合计		4,842,017.17	521,975.39
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.9	54,030,271.51	73,917,944.32
未分配利润	7.4.7.10	- 10,778,246.54	- 14,081,296.95
所有者权益合计		43,252,024.97	59,836,647.37
负债和所有者权益总计		48,094,042.14	60,358,622.76

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值0.801元,基金份额总额54,030,271.51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:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入		- 97,082.70	- 29,591,915.40
1.利息收入		19,419.65	60,406.23
其中:存款利息收入	7.4.7.11	19,419.65	60,406.23
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)		- 2,012,578.49	- 27,070,333.72
其中:股票投资收益	7.4.7.12	- 2,719,877.09	- 28,601,411.82
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	- 262.03	28,942.29
股利收益	7.4.7.16	707,560.63	1,502,135.81
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	1,714,247.73	- 2,380,746.03
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		142,850.99	- 387,074.24
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	38,977.42	185,832.36
减:二、费用		1,751,040.68	3,225,684.68
1.管理人报酬		796,020.31	1,353,402.88
2.托管费		154,781.74	263,161.62
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.19	660,401.91	1,417,700.38
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	139,836.72	191,419.80
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		- 1,848,123.38	- 32,817,600.08
减:所得税费用		-	52,377.03
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		- 1,848,123.38	- 32,869,977.11

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:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	73,917,944.32	- 14,081,296.95	59,836,647.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	0.00	- 1,848,123.38	- 1,848,123.38
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)	- 19,887,672.81	5,151,173.79	- 14,736,499.02
其中:1.基金申购款	17,218,777.04	- 3,523,308.25	13,695,468.79
2.基金赎回款	- 37,106,449.85	8,674,482.04	- 28,431,967.81
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)	54,030,271.51	- 10,778,246.54	43,252,024.97

项目	上年度可比期间 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(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	9,195,819.52	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

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:章硕麟,主管会计工作负责人:胡志强,会计机构负责人:张鹏

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349,520,284.05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、秘鲁、埃及、捷克、菲律宾、摩洛哥等国家或地区。如果摩根斯坦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2017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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。本基金于2016年度出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表以持续经营为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016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2016年12月31日的财务状况以及2016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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》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)于2016年5月1日前,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。自2016年5月1日起,金融业由缴纳