

# 上投摩根亚太优势股票型证券投资基金

## 2011 年半年度报告

### 2011 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年八月二十五日

## 1 重要提示及目录

### 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。本半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 2011 年 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5	信息披露方式.....	6
2.6	其他相关资料.....	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
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.....	9
4.3	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
5	托管人报告.....	11
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1	资产负债表.....	12
6.2	利润表.....	13
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4	报表附注.....	15
7	投资组合报告.....	26
7.1	期末基金资产组合情况.....	26
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	27
7.3	期末按行业分类的权益投资组合.....	28
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	28
7.5	报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	34
7.7	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.....	34

7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	34
7.9	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 .....	34
7.10	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 .....	34
7.11	投资组合报告附注 .....	34
8	基金份额持有人信息 .....	35
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	35
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 .....	35
9	开放式基金份额变动 .....	35
10	重大事件揭示 .....	36
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	36
10.2	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 .....	36
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	36
10.4	基金投资策略的改变 .....	36
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况 .....	36
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	36
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	36
10.8	其他重大事件 .....	38
11	备查文件目录 .....	38
11.1	备查文件目录 .....	38
11.2	存放地点 .....	38
11.3	查阅方式 .....	38

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根亚太优势股票型证券投资基金
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	22,092,786,836.17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	洪霞	赵会军
	联系电话	021-38794999	010-66105799
	电子邮箱	xia.hong@jpmf-sitico.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-4888	95588
传真		021-68881170	010-66105798
注册地址		上海市富城路 99 号 20 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市富城路 99 号 20 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		陈开元	姜建清

### 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

### 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》 《中国证券报》 《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.51fund.com">http://www.51fund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

### 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上投摩根基金管理有限公司	上海市富城路 99 号 20 楼

### 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期（2011年1月1日至2011年6月30日）
本期已实现收益	1,119,448,546.92
本期利润	-499,909,616.54
加权平均基金份额本期利润	-0.0219
本期加权平均净值利润率	-3.23%
本期基金份额净值增长率	-3.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2011年6月30日）
期末可供分配利润	-8,202,616,149.58
期末可供分配基金份额利润	-0.3713
期末基金资产净值	14,790,391,182.14
期末基金份额净值	0.669
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2011年6月30日）
基金份额累计净值增长率	-33.10%

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

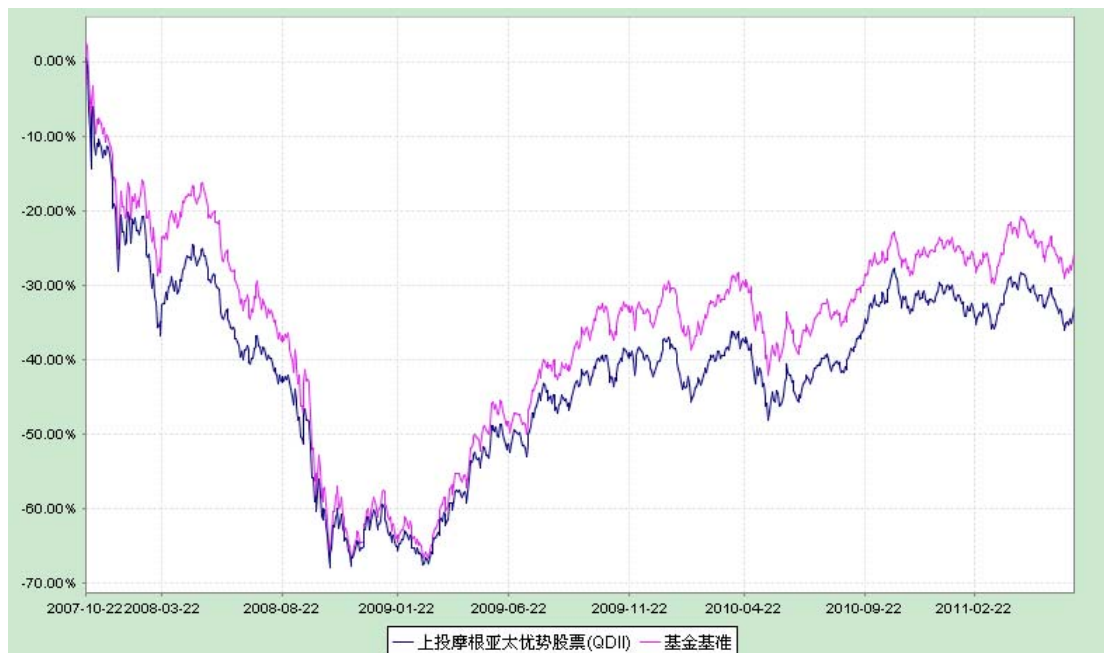
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-3.88%	1.02%	-2.54%	1.04%	-1.34%	-0.02%
过去三个月	-3.04%	0.97%	-2.26%	1.04%	-0.78%	-0.07%
过去六个月	-3.32%	0.99%	-1.79%	1.00%	-1.53%	-0.01%
过去一年	20.54%	0.99%	20.06%	0.97%	0.48%	0.02%
过去三年	6.53%	1.80%	5.60%	1.92%	0.93%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-33.10%	1.87%	-25.62%	1.95%	-7.48%	-0.08%

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 2011 年 6 月 30 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 2011 年 6 月 30 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。

## 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”）与摩根富林明资产管理（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 2011 年 6 月底，公司管理的基金共有十三只，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和上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金。

#### 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	-	17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年加入台湾摩根富林明证券投资信托公司，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。
张军	本基金基金经理	2008-3-8	-	6年（金融领域从业经验17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。

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日，其中杨逸枫女士担任本基金首任基金经理的任职日期为本基金基金合同生效之日；

2. 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
郑惠升	JF 基金区域投资经理	17 年	男，美国印第安纳大学学士学位，主修财务
王浩	JF 基金区域投资经理兼大中华投资总监	16 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合规守信情况的说明

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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人建立了完善的公平交易制度，确保不同基金在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。

##### 4.4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

为更好的贯彻落实公平交易制度指导意见的相关精神，公司于 2009 年委托外部专业机构共同制定了公司投资组合投资风格分类办法，并自 2009 年起对旗下管理的投资组合投资风格的划分情况进行定期审阅。本年度，公司已组织相关业务部门及外部专业机构共同审阅了前述公司投资组合投资风格分类办法，并认为现阶段该方法仍旧适当，无需进一步修订。公司沿用前述分类办法，组织相关业务部门及外部专业机构共同开展了 2011 年度投资组合投资风格的划分工作，并将分类结果作为本年度投资组合定期报告中相关披露内容的依据。

本年度，根据公司内部和外部专业机构的评价结果，本基金管理人旗下无与本基金投资风格相似的其他投资组合。

##### 4.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金无异常交易行为。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年是十分不平静的半年，陆续发生了日本大地震、欧洲债务危机的恶化与美国经济复苏出现疲态和举债上限协商迟迟无法达到共识等问题。4 月份时在日本地震对全球经济与产业影响不如原先预期严重的情况下，市场一度大涨，但 5 月份后随着美国陆续公布的经济数据不如预期，加上欧债危机日渐严重，使市场出现开始调整，并在 6 月份出现较大的下跌。但就整个上半年而言，亚洲股市的表现尚称平稳，其中印度尼西亚市场受国内政经情势逐步改善，持续吸引国际资金流入，表现居亚股之冠。印度市场在通胀压力笼罩下，是亚股中跌幅最大的市场，此外新加坡，台湾与香港本地股等与欧美经济连动度大的市场在上半年也呈现下跌走势。在亚太优势基金操作策略部份，我们在上半年降低对香港(含中国 H 股)与印度市场的投资比重，资金加码台湾股市的内需股。

##### 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-3.32%，同期业绩比较基准收益率为-1.79%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2011 年下半年的亚洲股市，我们认为是风险与机会并存的投资环境，市场关心的重点将在：欧美债务状况与亚洲区域通胀等两大变量上。整体而言，我们对市场持审慎乐观态度，并致力在亚洲区域中找寻成长前景看好的投资标的。

1. 欧美债务状况：在南欧债务问题部分，虽然陆续有信评机构下调南欧国家的债信评级，但因德法等主要债权国银行已经同意延展希腊债务还款时间，且欧盟就希腊新一轮救援资金达成一致，同时允许欧洲金融稳定基金(EFSF)从二级市场上收购主权债券。虽然这些努力，并不能真正解决

欧债危机,但有机会降低投资市场的恐慌情绪。

2. 区域内各国通胀状况:美国以及产油国刻意打压油价,使得价格走高动能的减弱,对抑制通胀进一步走高有正面帮助;另一方面,自去年起许多国家陆续调高利率紧缩货币,而这些打压通胀的政策也有机会在下半年陆续见到成效。

在市场部份,我们看好印度尼西亚,泰国,韩国与台湾股市在 2011 年下半年的投资机会。

印度尼西亚股市:在亚洲区域内几个通胀较高的市场中,印度尼西亚通胀率先见顶,另外由于近年来国内政经情势好转,印度尼西亚债信评级或有机会被上调,也使得印度尼西亚股市与债市自 2010 年以来持续受到外资青睐。

泰国股市:虽然上半年泰国政局仍有动荡,但对股汇市并没有造成负面影响,主要原因在于:泰国商业信心已出现强势反弹,并逐步攀升至 1997 年后高位。这表明资本支出正继续上升,对于今年至明年的经济成长均形成正面支持。

韩国股市:在电子与汽车等行业后,韩国的造船、营建等产业在国际市场的竞争力与份额不断攀升。

台湾股市:虽然台股指数表现反复,但台湾内需类股受惠中国内地观光客赴台旅游人数增加,与其消费力的带动,使得内需股今年以来的营运成长良好,并带动股价走高。

#### 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

2011年上半年,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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011年上半年,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 托管人对本半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2011年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2011年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,060,955,022.51	646,976,946.14
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	13,784,986,396.94	15,732,508,766.88
其中：股票投资		12,855,027,611.26	15,157,345,815.38
基金投资		929,958,785.68	575,162,951.50
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		25,733,287.32	10,038,036.66
应收利息	6.4.7.5	82,216.03	105,044.45
应收股利		48,513,836.96	3,750,700.75
应收申购款		856,431.33	889,277.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	28,372,013.81	15,946,385.74
<b>资产总计</b>		<b>14,949,499,204.90</b>	<b>16,410,215,158.08</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		97,340,982.25	5,775,588.80
应付赎回款		26,373,493.22	45,752,542.17
应付管理人报酬		21,698,018.16	24,749,405.85
应付托管费		4,219,059.09	4,812,384.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-3,534,802.99	-19,253.74
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	19,385,864.20
其他负债	6.4.7.8	13,011,273.03	498,361.72
<b>负债合计</b>		<b>159,108,022.76</b>	<b>100,954,893.17</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	22,092,786,836.17	23,583,479,226.07
未分配利润	6.4.7.10	-7,302,395,654.03	-7,274,218,961.16
<b>所有者权益合计</b>		<b>14,790,391,182.14</b>	<b>16,309,260,264.91</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>14,949,499,204.90</b>	<b>16,410,215,158.08</b>

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.669 元，基金份额总额 22,092,786,836.17 份。

## 6.2 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-302,490,600.22</b>	<b>-1,124,981,973.95</b>
1. 利息收入		2,067,728.51	2,182,181.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,067,728.51	2,182,181.02
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）		1,337,221,270.08	769,182,052.89
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,171,940,927.38	586,022,016.60
基金投资收益	6.4.7.13	7,875,049.08	9,560,068.40
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-

衍生工具收益	6.4.7.15	6,234,573.85	-
股利收益	6.4.7.16	151,170,719.77	173,599,967.89
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,619,358,163.46	-1,892,998,599.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-22,570,785.50	-3,605,486.72
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	149,350.15	257,878.46
<b>减：二、费用</b>		<b>218,272,103.99</b>	<b>238,048,687.20</b>
1. 管理人报酬		138,487,685.40	136,876,539.24
2. 托管费		26,928,161.02	26,614,882.64
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	52,531,748.49	74,155,146.31
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	324,509.08	402,119.01
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-520,762,704.21</b>	<b>-1,363,030,661.15</b>
减：所得税费用		-20,853,087.67	-31,716,868.07
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-499,909,616.54</b>	<b>-1,331,313,793.08</b>

### 6.3 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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)	23,583,479,226.07	-7,274,218,961.16	16,309,260,264.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-499,909,616.54	-499,909,616.54
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）	-1,490,692,389.90	471,732,923.67	-1,018,959,466.23
其中：1. 基金申购款	159,990,881.99	-51,624,070.41	108,366,811.58
2. 基金赎回款	-1,650,683,271.89	523,356,994.08	-1,127,326,277.81
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)	22,092,786,836.17	-7,302,395,654.03	14,790,391,182.14
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 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)	26,629,166,593.83	-10,457,482,593.83	16,171,684,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,331,313,793.08	-1,331,313,793.08
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)	-1,035,693,408.85	405,715,195.52	-629,978,213.33
其中：1. 基金申购款	359,893,572.16	-148,570,621.34	211,322,950.82
2. 基金赎回款	-1,395,586,981.01	554,285,816.86	-841,301,164.15
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)	25,593,473,184.98	-11,383,081,191.39	14,210,391,993.59

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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：罗嘉

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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 29,568,958,774 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 29,572,160,440 份基金份额，其中认购资金利息折合 3,201,666 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营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 2011 年 8 月 24 日批准报出。

#### 6.4.2 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《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 6.4.4 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年上半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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 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[2004]78 号《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》及其他境内外相关财税法规和实务操作,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) 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,在境内暂免征营业税和企业所得税。

(3) 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,在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元



项目	本期末
	2011 年 6 月 30 日
活期存款	1,060,955,022.51
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,060,955,022.51

注：于 2011 年 6 月 30 日，活期银行存款中包含的外币余额为：港元 528,366,833.28 元(折合人民币 439,400,425.90 元)，美元 21,936,162.55 元(折合人民币 141,962,069.59 元)，印度卢比 264,045,150.20 元(折合人民币 38,225,929.07 元)，新台币 82,784,325.00 元(折合人民币 18,651,871.74 元)，澳元 254,568.75 元(折合人民币 1,763,778.30 元)，新加坡元 1,076,210.64 元(折合人民币 5,673,513.18 元)和泰铢 13,473,776.81(折合人民币 2,837,978.65 元)

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2011 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	11,962,937,663.79	12,855,027,611.26	892,089,947.47
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	债券合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	847,567,072.41	929,958,785.68	82,391,713.27
其他	-	-	-
合计	12,810,504,736.20	13,784,986,396.94	974,481,660.74

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
	2011 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	82,216.03
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

其他	-
合计	82,216.03

## 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
其他应收款	15,586,918.78
待摊费用	-
应收未起息外汇交易	12,785,095.03
合计	28,372,013.81

## 6.4.7.7 应付交易费用

无。

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,017.11
预提费用	238,028.83
应付未起息外汇交易	12,768,227.09
合计	13,011,273.03

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,583,479,226.07	23,583,479,226.07
本期申购	159,990,881.99	159,990,881.99
本期赎回（以“-”号填列）	-1,650,683,271.89	-1,650,683,271.89
本期末	22,092,786,836.17	22,092,786,836.17

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,804,076,455.06	2,529,857,493.90	-7,274,218,961.16
本期利润	1,119,448,546.92	-1,619,358,163.46	-499,909,616.54
本期基金份额交易产生的变动数	482,011,758.56	-10,278,834.89	471,732,923.67
其中：基金申购款	-180,726,437.75	129,102,367.34	-51,624,070.41
基金赎回款	662,738,196.31	-139,381,202.23	523,356,994.08

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,202,616,149.58	900,220,495.55	-7,302,395,654.03

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	1,714,501.93
定期存款利息收入	352,906.10
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	320.48
合计	2,067,728.51

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	11,439,521,711.55
减：卖出股票成本总额	10,267,580,784.17
买卖股票差价收入	1,171,940,927.38

## 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	112,573,616.91
减：卖出/赎回基金成本总额	104,698,567.83
基金投资收益	7,875,049.08

## 6.4.7.14 债券投资收益

无。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

## 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出权证成交总额	39,228,983.46
减：卖出权证成本总额	32,994,409.61
买卖权证差价收入	6,234,573.85

注：本报告期内买卖权证成交金额/差价收入皆为行权认购权证成交总额/差价收入。

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	151,170,719.77
基金投资产生的股利收益	-
合计	151,170,719.77

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,619,358,163.46
——股票投资	-1,586,324,775.21
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-33,033,388.25
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,619,358,163.46

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	149,350.15
合计	149,350.15

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	52,531,748.49
银行间市场交易费用	-
合计	52,531,748.49

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	89,260.27
信息披露费	148,768.56

银行费用	1,136.56
税务顾问费	85,343.69
合计	324,509.08

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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 Corporation, “纽约梅隆银行”)	境外资产托管人

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	138,487,685.40	136,876,539.24
其中：支付销售机构的客户维护费	18,243,740.02	17,913,059.09

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。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月	2010年1月1日至2010年6月30

	30日	日
当期发生的基金应支付的托管费	26,928,161.02	26,614,882.64

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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
期初持有的基金份额	-	10,399,032.78
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	10,399,032.78
期末持有的基金份额	-	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.00%

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2011年1月1日至2011年6月30日		2010年1月1日至2010年6月30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	412,533,156.46	1,702,798.35	494,943,641.35	1,825,147.53
纽约梅隆银行	648,421,866.05	364,609.68	464,889,202.65	356,031.88

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。

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

##### 6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未实施利润分配。

##### 6.4.12 期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监督和风险控制评估，并负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依据风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行管控，并提出内控建议。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行以及境外次托管行纽约梅隆银行，与该等银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。(2010 年 12 月 31 日：同)

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除银行存款外的金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化，市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

##### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日							
	美元 折合人民币	港元 折合人民币	澳元 折合人民币	新加坡元 折合人民币	韩元 折合人民币	印度卢比 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产								
银行存款	141,962,069.59	439,400,425.90	1,763,778.30	5,673,513.18	-	38,225,929.07	21,489,850.39	648,515,566.43
交易性金融资产	929,958,785.68	4,015,034,022.61	2,250,652,303.58	456,569,713.35	2,464,660,710.73	1,158,663,957.69	2,509,446,903.30	13,784,986,396.94
应收证券清算款	-	-	-	-	-	25,733,287.32	-	25,733,287.32
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	26,487,019.79	13,573,960.91	-	-	8,452,856.26	-	48,513,836.96
其他资产	-	-	-	-	-	15,586,918.78	12,785,095.03	28,372,013.81
资产合计	1,071,920,855.27	4,480,921,468.30	2,265,990,042.79	462,243,226.53	2,464,660,710.73	1,246,662,949.12	2,543,721,848.72	14,536,121,101.46
以外币计价的负债								



应付证券清算款	14,133,526.31				34,462,684.41	33,121,697.86	15,623,073.67	97,340,982.25
应交税费						-3,534,802.99		-3,534,802.99
递延所得税负债								
其他负债							12,768,227.09	12,768,227.09
<b>负债合计</b>	<b>14,133,526.31</b>				<b>34,462,684.41</b>	<b>29,586,894.87</b>	<b>28,391,300.76</b>	<b>106,574,406.35</b>
<b>资产负债表</b>								
<b>外汇风险敞口净额</b>	<b>1,057,787,328.96</b>	<b>4,480,921,468.30</b>	<b>2,265,990,042.79</b>	<b>462,243,226.53</b>	<b>2,430,198,026.32</b>	<b>1,217,076,054.25</b>	<b>2,515,330,547.96</b>	<b>14,429,546,695.11</b>
项目	上年度末							
	2010年12月31日							
	美元 折合人民币	港元 折合人民币	澳元 折合人民币	新加坡元 折合人民币	韩元 折合人民币	印度卢比 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
<b>以外币计价的资产</b>								
银行存款	101,109,278.15	18,890,399.73	738,146.19	245,562.82			33,911,571.49	<b>154,894,958.38</b>
交易性金融资产	575,162,951.50	5,779,831,715.14	2,769,191,918.41	945,318,371.70	2,185,755,402.96	1,548,911,270.30	1,928,337,136.87	<b>15,732,508,766.88</b>
应收证券清算款		3,772,925.71				6,265,110.95		<b>10,038,036.66</b>
应收利息	287.36							<b>287.36</b>
应收股利			3,750,700.75					<b>3,750,700.75</b>
其他资产						15,946,385.74		<b>15,946,385.74</b>
<b>资产合计</b>	<b>676,272,517.01</b>	<b>5,802,495,040.58</b>	<b>2,773,680,765.35</b>	<b>945,563,934.52</b>	<b>2,185,755,402.96</b>	<b>1,571,122,766.99</b>	<b>1,962,248,708.36</b>	<b>15,917,139,135.77</b>
<b>以外币计价的负债</b>								
应付证券清算款		5,775,588.80						<b>5,775,588.80</b>
应交税费						-19,253.74		<b>-19,253.74</b>
递延所得税负债						19,385,864.20		<b>19,385,864.20</b>
其他负债								
<b>负债合计</b>		<b>5,775,588.80</b>				<b>19,366,610.46</b>		<b>25,142,199.26</b>
<b>资产负债表</b>								
<b>外汇风险敞口净额</b>	<b>676,272,517.01</b>	<b>5,796,719,451.78</b>	<b>2,773,680,765.35</b>	<b>945,563,934.52</b>	<b>2,185,755,402.96</b>	<b>1,551,756,156.53</b>	<b>1,962,248,708.36</b>	<b>15,891,996,936.51</b>

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值5%	增加约72,148	增加约79,460
	2. 所有外币相对人民币贬值5%	下降约72,148	下降约79,460

## 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和衍生工具，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票及其他权益类证券投资比例为基金资产净值的 60%-100%，其它允许投资的金融工具为 0%-40%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	12,855,027,611.26	86.91	15,157,345,815.38	92.94
交易性金融资产-基金投资	929,958,785.68	6.29	575,162,951.50	3.53
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	13,784,986,396.94	93.20	15,732,508,766.88	96.46

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	增加约68,925	增加约81,668
	2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	下降约68,925	下降约81,668

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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	12,855,027,611.26	85.99
	其中：普通股	12,292,935,680.44	82.23
	存托凭证	562,091,930.82	3.76
2	基金投资	929,958,785.68	6.22
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,060,955,022.51	7.10
8	其他各项资产	103,557,785.45	0.69
9	合计	14,949,499,204.90	100.00

注：截至2011年6月30日，上投摩根亚太优势股票型证券投资基金资产净值为14,790,391,182.14元，基金份额净值为0.669元，累计基金份额净值为0.669元。

## 7.2 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	4,015,034,022.61	27.15
韩国	2,464,660,710.73	16.66
澳大利亚	2,250,652,303.58	15.22
印度	1,158,663,957.69	7.83
中国台湾	774,665,717.12	5.24
英国	555,541,045.46	3.76
新加坡	456,569,713.35	3.09
印度尼西亚	435,411,005.70	2.94
泰国	389,156,696.56	2.63
马来西亚	354,672,438.46	2.40
合计	12,855,027,611.26	86.91

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。

## 7.3 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 (%)
商业银行业	2,254,480,824.74	15.24
金属及采矿业	1,105,547,512.25	7.47
化工业	1,023,384,499.34	6.92
石油，天然气及消耗燃料业	959,594,707.88	6.49
半导体及半导体设备业	712,270,851.03	4.82
机械业	700,143,393.42	4.73
房地产管理及开发业	692,301,358.43	4.68
建筑材料业	657,816,473.24	4.45
产业融合业	628,005,593.58	4.25
建筑及工程业	430,687,262.31	2.91
烟草业	408,520,431.82	2.76
商业服务及供应业	380,409,114.90	2.57
多线零售业	319,582,376.60	2.16
保险业	314,574,699.41	2.13
食品零售业	300,639,883.72	2.03
运输业	272,081,997.18	1.84
汽车业	255,794,959.55	1.73
储蓄及抵押贷款	245,403,245.78	1.66
网络软件及服务	195,186,669.43	1.32
新闻传播业	172,935,234.26	1.17
多元化金融服务业	170,944,919.90	1.16
航空业	165,729,599.50	1.12
电子设备及元件业	151,310,642.59	1.02
酒店业	116,212,574.69	0.79
医疗保健设备与用品业	104,311,011.38	0.71
能源设备及服务业	78,264,279.10	0.53
海洋业	38,893,495.23	0.26
合计	12,855,027,611.26	86.91

注：行业分类标准：MSCI

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

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	118,806	594,841,395.09	4.02
2	China Construction Bank CORP	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港证券交易所	中国香港	84,541,150	453,474,417.01	3.07
3	Hyundai Heavy Industries Co Ltd	现代重工集团	009540 KS	韩国证券交易所	韩国	156,857	421,677,366.36	2.85
4	KB Financial Group Inc	KB 金融集团	105560 KS	韩国证券交易所	韩国	1,196,337	366,207,871.32	2.48
5	Petronas Chemicals Group Bhd	-	PCHEM MK	马来西亚证券交易所	马来西亚	23,340,200	354,672,438.46	2.40
6	Agricultural Bank of China Ltd	中国农业银行股份有限公司	1288 HK	香港证券交易所	中国香港	103,080,000	350,608,663.47	2.37
7	Keppel Corp Ltd	吉宝企业有限公司	KEP SP	新加坡证券交易所	新加坡	5,731,300	334,770,891.52	2.26
8	Rio Tinto plc	力拓有限公司	RIO LN	伦敦证券交易所	英国	600,000	280,169,479.75	1.89
9	PT United Tractors Tbk	-	UNTR IJ	印度尼西亚证券交易所	印度尼西亚	14,819,060	278,466,027.06	1.88
10	BHP Billiton plc	必和必拓有限公司	BLT LN	伦敦证券交易所	英国	1,080,000	275,371,565.71	1.86
11	ITC Ltd	-	ITC IN	印度证券交易所	印度	9,000,000	264,430,422.97	1.79
12	CNOOC Ltd	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港证券交易所	中国香港	17,351,000	262,038,605.34	1.77
13	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	澳大利亚新西兰银行集团	ANZ AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	1,700,000	259,125,711.59	1.75
14	Housing Development Finance Corp Ltd	-	HDFC IN	印度证券交易所	印度	2,400,000	245,403,245.78	1.66
15	Hana Financial Group Inc	韩亚金融集团	086790 KS	韩国证券交易所	韩国	1,070,810	242,105,141.30	1.64
16	China National Building Material Co Ltd	中国建材股份有限公司	3323 HK	香港证券交易所	中国香港	17,936,000	227,617,188.25	1.54
17	OCI Co Ltd	-	010060 KS	韩国证券交易所	韩国	92,219	225,272,519.70	1.52
18	Siam Cement Public Co Ltd	-	SCC-R TB	泰国证券交易所	泰国	2,979,900	221,562,455.92	1.50
19	Intime Department Store (Group) Co Ltd	银泰百货(集团)有限公司	1833 HK	香港证券交易所	中国香港	19,453,000	213,866,601.03	1.45
20	National Australia Bank Ltd	澳大利亚国家银行有限公司	NAB AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	1,200,000	213,009,649.12	1.44
21	Yanzhou Coal Mining Co Ltd	兖州煤业股份有限公司	1171 HK	香港证券交易所	中国香港	8,590,000	211,451,027.68	1.43
22	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公	700 HK	香港证券交	中国香港	1,111,300	195,186,669.43	1.32

		司		易所				
23	Samsung C&T Corp	三星 C&T 公司	000830 KS	韩国证券交 易所	韩国	382,900	190,318,927.11	1.29
24	Brambles Ltd	-	BXB AU	澳大利亚证 券交易所	澳大利亚	3,800,000	190,090,187.79	1.29
25	Transurban Group	-	TCL AU	澳大利亚证 券交易所	澳大利亚	5,000,000	181,180,143.27	1.22
26	News Corp Inc	-	NWS AU	澳大利亚证 券交易所	澳大利亚	1,500,000	172,935,234.26	1.17
27	Infrastructure Development Finance Co Ltd	-	IDFC IN	印度证券交 易所	印度	9,000,000	170,944,919.90	1.16
28	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd	中国平安保险(集 团)股份有限公司	2318 HK	香港证券交 易所	中国香港	2,527,500	168,889,235.84	1.14
29	PTT Chemical Public Co Ltd	-	PTTCH-R TB	泰国证券交 易所	泰国	5,412,800	167,594,240.64	1.13
30	Leighton Holdings Ltd	-	LEI AU	澳大利亚证 券交易所	澳大利亚	1,150,000	166,127,987.96	1.12
31	Qantas Airways Ltd	-	QAN AU	澳大利亚证 券交易所	澳大利亚	13,000,000	165,729,599.50	1.12
32	Samsung Engineering Co Ltd	-	028050 KS	韩国证券交 易所	韩国	106,597	164,766,123.79	1.11
33	Incitec Pivot Ltd	-	IPL AU	澳大利亚证 券交易所	澳大利亚	6,000,000	160,463,943.33	1.08
34	China Resources Land Ltd	华润置地有限公 司	1109 HK	香港证券交 易所	中国香港	13,498,000	158,050,911.18	1.07
35	Cairn India Ltd	-	CAIR IN	印度证券交 易所	印度	3,500,000	157,962,631.88	1.07
36	PT Astra International Tbk	-	ASII IJ	印度尼西亚 证券交易所	印度尼西亚	3,272,500	156,944,978.64	1.06
37	Cheung Kong (Holdings) Ltd	长江实业(集团) 有限公司	1 HK	香港证券交 易所	中国香港	1,643,000	155,490,818.91	1.05
38	Agile Property Holdings Ltd	雅居乐地产控股 有限公司	3383 HK	香港证券交 易所	中国香港	15,455,000	155,003,406.43	1.05
39	BOC Hong Kong (Holdings) Ltd	中银香港(控股) 有限公司	2388 HK	香港证券交 易所	中国香港	7,803,000	146,654,357.44	0.99
40	AMP Ltd	-	AMP AU	澳大利亚证 券交易所	澳大利亚	4,300,000	145,685,463.57	0.99
41	Wesfarmers Ltd	-	WES AU	澳大利亚证 券交易所	澳大利亚	660,000	145,643,892.60	0.98
42	KT & G Corp	-	033780 KS	韩国证券交 易所	韩国	358,000	144,090,008.85	0.97
43	China Yurun Food Group Ltd	中国雨润食品集 团有限公司	1068 HK	香港证券交 易所	中国香港	7,804,000	142,130,178.31	0.96

44	China Petroleum & Chemical Corp	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港证券交易所	中国香港	21,076,000	137,238,157.03	0.93
45	Mega Financial Holding Co Ltd	兆丰金融控股股份有限公司	2886 TT	台湾证券交易所	中国台湾	23,466,000	132,704,941.86	0.90
46	Hindalco Industries Ltd	-	HNDL IN	印度证券交易所	印度	5,000,000	130,691,502.74	0.88
47	Zijin Mining Group Co Ltd	紫金矿业集团股份有限公司	2899 HK	香港证券交易所	中国香港	38,452,000	124,712,063.74	0.84
48	Hang Lung Properties Ltd	恒隆集团有限公司	101 HK	香港证券交易所	中国香港	4,661,000	123,650,168.16	0.84
49	Aluminum Corp of China Ltd	中国铝业股份有限公司	2600 HK	香港证券交易所	中国香港	22,566,000	123,107,170.20	0.83
50	Oil Search Ltd	-	OSH AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	2,600,000	119,793,677.90	0.81
51	Taiwan Cement Corp	台湾水泥股份有限公司	1101 TT	台湾证券交易所	中国台湾	12,361,000	119,198,745.21	0.81
52	Sands China Ltd	金沙中国有限公司	1928 HK	香港证券交易所	中国香港	6,654,400	116,212,574.69	0.79
53	Korea Kumho Petrochemical Co Ltd	-	011780 KS	韩国证券交易所	韩国	81,000	115,381,357.21	0.78
54	Hidili Industry Intl Development Ltd	恒鼎实业国际发展有限公司	1393 HK	香港证券交易所	中国香港	19,009,000	106,389,620.62	0.72
55	Parkson Retail Group Ltd	百盛商业集团有限公司	3368 HK	香港证券交易所	中国香港	11,170,500	105,715,775.57	0.71
56	Wharf (Holdings) Ltd	九龙仓(集团)有限公司	4 HK	香港证券交易所	中国香港	2,227,100	100,106,053.75	0.68
57	Sintex Industries Ltd	-	SINT IN	印度证券交易所	印度	3,800,000	99,793,150.56	0.67
58	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	正新橡胶工业股份有限公司	2105 TT	台湾证券交易所	中国台湾	5,318,000	98,849,980.91	0.67
59	China Shineway Pharmaceutical Group Ltd	中国神威药业集团有限公司	2877 HK	香港证券交易所	中国香港	7,455,000	95,599,791.88	0.65
60	Hutchison Whampoa Ltd	和记黄埔有限公司	13 HK	香港证券交易所	中国香港	1,349,000	94,235,851.92	0.64
61	Asciano Ltd	-	AIO AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	8,000,000	90,901,853.91	0.61
62	TPK Holdings Co Ltd	-	3673 TT	台湾证券交易所	中国台湾	460,000	90,685,988.84	0.61
63	Commonwealth Bank of Australia	澳大利亚联邦银行	CBA AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	250,000	90,590,071.63	0.61
64	ACC Ltd	-	ACC IN	印度证券交易所	印度	650,000	89,438,083.86	0.60
65	Advanced Semiconductor	-	2311 TT	台湾证券交易所	中国台湾	12,487,000	88,622,291.17	0.60

	Engineering Inc			易所				
66	Standard Foods Corp	佳格食品股份有限公司	1227 TT	台湾证券交易所	中国台湾	3,250,000	78,350,441.29	0.53
67	WorleyParsons Ltd	-	WOR AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	400,000	78,264,279.10	0.53
68	President Chain Store Corp	-	2912 TT	台湾证券交易所	中国台湾	2,054,000	76,821,509.32	0.52
69	Origin Energy Ltd	-	ORG AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	650,000	71,110,608.05	0.48
70	Midas Holdings Ltd	-	MIDAS SP	新加坡证券交易所	新加坡	19,000,000	65,106,109.49	0.44
71	Quanta Computer Inc	广达电脑有限公司	2382 TT	台湾证券交易所	中国台湾	3,957,000	60,624,653.75	0.41
72	Fraser & Neave Ltd	-	FNN SP	新加坡证券交易所	新加坡	1,748,000	53,354,957.54	0.36
73	Orient Overseas (Intl) Ltd	东方海外(国际)有限公司	316 HK	香港证券交易所	中国香港	933,500	38,893,495.23	0.26
74	Green Energy Technology Inc	绿能科技股份有限公司	3519 TT	台湾证券交易所	中国台湾	1,285,000	28,807,164.77	0.19
75	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd	上海医药集团股份有限公司	2607 HK	香港证券交易所	中国香港	500,000	8,711,219.50	0.06
76	Olam Intl Ltd	-	OLAM SP	新加坡证券交易所	新加坡	232,772	3,337,754.80	0.02

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）。

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 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	Commonwealth Bank of Australia	CBA AU	439,618,074.92	2.70
2	BHP Billiton plc	BLT LN	335,822,404.47	2.06
3	Hana Financial Group Inc	086790 KS	334,301,038.07	2.05
4	Rio Tinto plc	RIO LN	325,071,734.54	1.99
5	Genting Singapore plc	GENS SP	319,031,393.47	1.96
6	China National Building Material Co Ltd	3323 HK	263,509,144.23	1.62
7	OCI Co Ltd	010060 KS	263,156,617.47	1.61
8	KB Financial Group Inc	105560 KS	256,186,890.87	1.57



9	Samsung Electronics Co Ltd	005930 KS	221,895,259.61	1.36
10	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	218,959,757.17	1.34
11	National Australia Bank Ltd	NAB AU	203,434,950.76	1.25
12	China Petroleum & Chemical Corp	386 HK	190,499,971.01	1.17
13	Leighton Holdings Ltd	LEI AU	190,376,063.58	1.17
14	Samsung C&T Corp	000830 KS	180,566,252.64	1.11
15	Brambles Ltd	BXB AU	174,257,803.02	1.07
16	PTT Chemical Public Co Ltd	PTTCH-R TB	169,518,698.94	1.04
17	Hyundai Heavy Industries Co Ltd	009540 KS	168,222,766.46	1.03
18	Aluminum Corp of China Ltd	2600 HK	158,811,388.27	0.97
19	Advanced Semiconductor Engineering Inc	2311 TT	152,552,183.32	0.94
20	Hang Lung Properties Ltd	101 HK	150,689,280.82	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。

#### 7.5.2 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	BHP Billiton Ltd	BHP AU	472,210,230.89	2.90
2	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd	2318 HK	399,071,946.20	2.45
3	China Construction Bank Corp	939 HK	381,845,086.70	2.34
4	Commonwealth Bank of Australia	CBA AU	333,821,937.42	2.05
5	Yanzhou Coal Mining Co Ltd	1171 HK	299,846,333.00	1.84
6	Rio Tinto Ltd	RIO AU	290,586,979.23	1.78
7	KB Financial Group Inc	105560 KS	289,458,227.43	1.77
8	Genting Singapore plc	GENS SP	283,463,816.70	1.74
9	Siam Cement Public Co Ltd	SCC-R TB	272,719,326.75	1.67
10	Daelim Industrial Co Ltd	000210 KS	238,725,107.83	1.46
11	CNOOC Ltd	883 HK	220,508,678.59	1.35
12	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	ANZ AU	213,872,599.60	1.31
13	Banpu Public Co Ltd	BANPU-R TB	202,886,748.52	1.24
14	Samsung Techwin Co Ltd	012450 KS	198,256,585.91	1.22
15	Westpac Banking Corp	WBC AU	196,909,960.28	1.21
16	Samsung Engineering Co Ltd	028050 KS	196,834,331.78	1.21
17	Olam Intl Ltd	OLAM SP	187,887,270.13	1.15
18	Agile Property Holdings Ltd	3383 HK	175,911,962.13	1.08
19	WorleyParsons Ltd	WOR AU	175,609,150.42	1.08

20	Formosa Chemicals & Fibre Corp	1326 TT	168,302,714.51	1.03
----	--------------------------------	---------	----------------	------

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。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	9,517,713,552.06
卖出收入（成交）总额	11,439,521,711.55

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。

### 7.6 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。

### 7.7 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。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

### 7.9 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。

### 7.10 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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	iShares MSCI Taiwan Webs Index Units	ETF	ETF	I shares Inc.	929,958,785.68	6.29

### 7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

#### 7.11.3 其他资产构成

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	25,733,287.32
3	应收股利	48,513,836.96
4	应收利息	82,216.03
5	应收申购款	856,431.33
6	其他应收款	15,586,918.78
7	待摊费用	-
8	应收未起息外汇交易	12,785,095.03
9	其他	-
10	合计	103,557,785.45

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 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。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

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。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
1,519,299	14,541.43	224,442,050.83	1.02%	21,868,344,785.34	98.98%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	414,005.34	0.0019%

## 9 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	29,572,160,439.53
-------------------------	-------------------

额总额	
本报告期期初基金份额总额	23,583,479,226.07
本报告期基金总申购份额	159,990,881.99
减：本报告期基金总赎回份额	1,650,683,271.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	22,092,786,836.17

## 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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：

2011年1月29日基金管理人发布《上投摩根基金管理有限公司关于聘任高级管理人员的公告》，经本公司董事会审议通过，决定聘任经晓云女士、冯刚先生为本公司副总经理。

#### 基金托管人：

无。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	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	成交金额	占当期	佣金	占当期	

	元数量		股票成交总额的比例		基金成交总额的比例		佣金总量的比例	
Goldman Sachs Securities Ltd	1	1,434,371,351.29	6.84%	-	-	1,641,362.45	5.04%	-
JP Morgan Secs Ltd	1	798,508,368.57	3.81%	-	-	1,434,192.93	4.40%	-
CIMB Securities Ltd	1	150,073,479.98	0.72%	-	-	268,198.45	0.82%	-
Macquarie Securities Ltd	1	475,361,588.27	2.27%	-	-	859,041.46	2.64%	-
Citigroup Global Mkts Ltd	1	1,854,376,877.40	8.85%	-	-	2,528,938.90	7.76%	-
Merrill Lynch	1	2,899,428,511.28	13.83%	106,870,278.02	17.66%	4,940,878.26	15.17%	-
CLSA Ltd	1	1,167,356,113.85	5.57%	-	-	2,082,720.22	6.39%	-
Morgan Stanley Ltd	1	2,565,876,647.88	12.24%	130,119,274.63	21.50%	3,541,408.33	10.87%	-
Credit Suisse Ltd	1	2,356,233,316.76	11.24%	122,771,348.55	20.29%	3,953,403.98	12.14%	-
Samsung Securities Co Ltd	1	391,096,092.23	1.87%	-	-	684,417.72	2.10%	-
UBS Securities Ltd	1	3,027,271,503.88	14.44%	104,554,939.69	17.28%	3,923,176.40	12.04%	-
HSBC Hongkong	1	120,564,616.56	0.58%	-	-	210,988.00	0.65%	-
Deutsche Bank AG London	1	219,169,086.38	1.05%	140,785,566.28	23.27%	348,881.88	1.07%	-
China Intl Capital Corp Secs Ltd	1	332,050,743.50	1.58%	-	-	581,088.80	1.78%	-
Sinopac Securities Co Ltd	1	723,253,413.00	3.45%	-	-	1,265,688.59	3.89%	-
Yuanta Securities Co Ltd	1	492,400,940.06	2.35%	-	-	861,701.88	2.65%	-
CCB International Securities Ltd	1	429,239,300.46	2.05%	-	-	751,168.81	2.31%	-
Nomura intl Ltd	1	1,458,594,998.12	6.96%	-	-	2,588,290.56	7.95%	-
BNP Paribas	1	43,456,712.88	0.21%	-	-	76,049.25	0.23%	-
Masterlink Securities Corp	1	18,551,601.26	0.09%	-	-	32,465.24	0.10%	-
Enam Securities Ltd	1	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities(HK) Co Ltd	1	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Ltd	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, 并能为本基金提供全面的信息服。
- 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：

- 1) 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。

2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

4. 2011 年上半年度新增 China Merchants Securities(HK) Co Ltd、Haitong International Securities Company Ltd、Masterlink Securities Corporation 共计 3 个席位，无注销席位。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1.	上投摩根基金管理有限公司关于聘任高级管理人员的公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券时报》和《中国证券报》	2011 年 1 月 29 日
2.	上投摩根亚太优势股票型证券投资基金节假日暂停交易的公告	同上	2011 年 4 月 21 日
3.	上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金暂停申购、赎回、定期定额投资的公告	同上	2011 年 5 月 9 日

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准上投摩根亚太优势股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金托管协议》；
- 4、《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

网址：[www.51fund.com](http://www.51fund.com)

上投摩根基金管理有限公司  
二〇一一年八月二十五日