# 上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金

# 2012 年半年度报告摘要

# 2012 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期： 二〇一二年八月二十九日

# 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 28 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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股票(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 | 90,440,405.55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。<br>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布局的安全性、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 | 本基金为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。 |

### 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 | 洪霞 | 尹东 |
| | 联系电话 | 021-38794999 | 010-67595003 |
| | 电子邮箱 | xia.hong@jpmf-sitico.com | yindong.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-889-4888 | 010-67595096 |
| 传真 | | 021-68881170 | 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, USA |
| 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 |

### 2.5 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.51fund.com |
| 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 |

## 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（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）** |
|---|---|
| 本期已实现收益 | -2,677,727.80 |
| 本期利润 | 3,276,387.79 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0354 |
| 本期基金份额净值增长率 | 4.29% |
| **3.1.2 期末数据和指标** | **报告期末(2012 年 6 月 30 日)** |

| | |
|---|---|
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1741 |
| 期末基金资产净值 | 74,691,148.44 |
| 期末基金份额净值 | 0.826 |

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 | 3.64% | 1.10% | 3.25% | 1.36% | 0.39% | -0.26% |
| 过去三个月 | -7.40% | 0.90% | -9.56% | 1.10% | 2.16% | -0.20% |
| 过去六个月 | 4.29% | 0.90% | 2.68% | 1.03% | 1.61% | -0.13% |
| 过去一年 | -16.40% | 1.16% | -20.08% | 1.42% | 3.68% | -0.26% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | -17.40% | 1.02% | -20.16% | 1.34% | 2.76% | -0.32% |

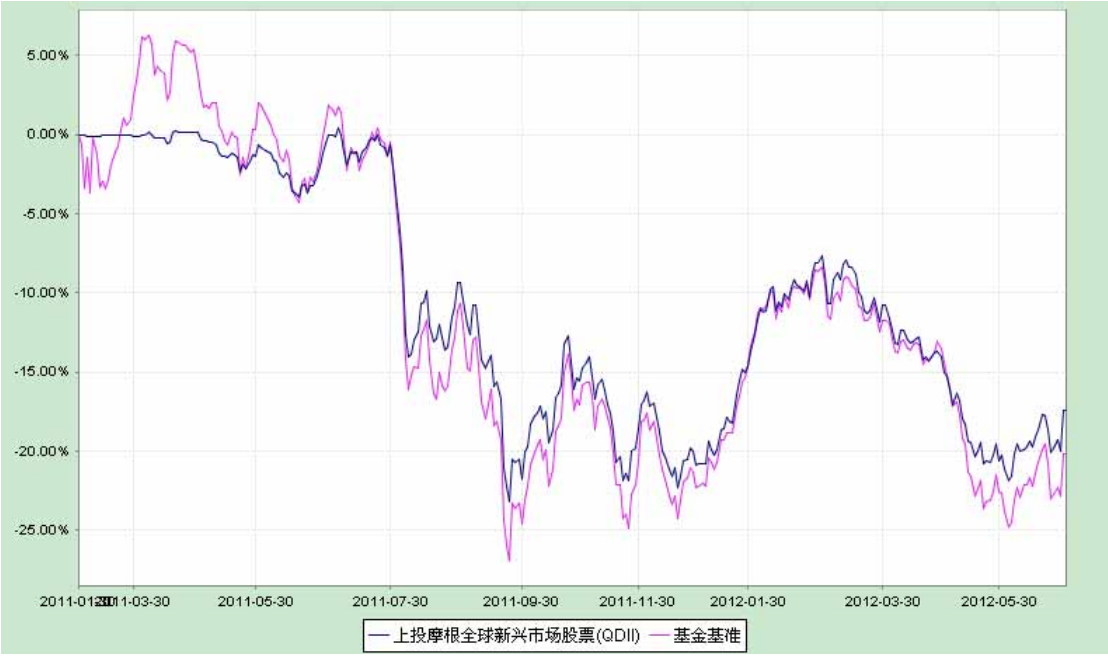
注：本基金的业绩比较基准为：MSCI 新兴市场股票指数（总回报）

### 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

（2011 年 1 月 30 日至 2012 年 6 月 30 日）




注：1.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 2012 年 6 月 30 日。

2．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。

# 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 2012 年 6 月底，公司管理的基金共有十八只，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和上投摩根分红添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 | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 王邦祺 | 本基金基金经理 | 2011-01-30 | - | 8 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 月起任上投摩根全球新兴市场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根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.王邦祺先生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 |
|---|---|---|---|
| Anuj Arora | 投资组合经理 | 9 年 | 男，伊利诺斯理工大学硕士，主修金融学 |
| Noriko Kuroki | 投资组合经理 | 16 年 | 女，牛津大学硕士，主修哲学、政治和经济学 |

### 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。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 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相

关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、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环节均得到公平对待。

对于二级市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保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量；对于一级市场申购活动，本公司遵循价格优先、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。

报告期内，通过对不同投资组合之间的交易价差和分配结果监控分析，监察稽核部未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

#### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易时间、交易价格、分配结果监控分析，监察稽核部未发现存在异常交易行为。

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：不适用。

### 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

以全球投资的角度观察，2000年以来有三大趋势发生：第一个是911以来，美国受累于反恐怖主义和民生的双重诉求，造成整个国家支出高于收入，美元持续走弱；第二个是中国加入世界贸易组织，对全球的出口大量增加，同时对大宗商品的需求也大量增加；第三个是欧元面世，边缘欧洲市场大量消费。以超过十年的角度看，这是新兴市场全面掘起的原因，弱势美元支持新兴市场的流动性，中国对大宗商品的需求推高新兴市场中商品市场的兴起，欧元的面世更使欧洲需求带动东欧与非洲的高速成长。

这是新兴市场场过去兴起的背景，也是这两年新兴市场停滞的原因，因为这三大趋势分别告一段落。

当基地组织被美国削弱，美国从伊拉克与阿富汗撤军，反恐战争已经告一段落，美国政府资产负债表最坏的日子已经过去，虽然现在美国经济形势仍不容乐观，但是已经足以使美元汇率全面提升，这不利于整体新兴市场的流动性，我们在过去三个季度已经关注此风险。

当中国的经济开始需要追求有质量的增长，GDP增长8%以上的时代已经过去，十二五计划中GDP的增长目标只有7%，这意味着靠着卖矿卖油的部份市场最繁荣的景况可能已经过去，一些拉美与东欧市场若不能跟着有效转型，未来有被投资人长期抛弃的风险；最后欧元面世之后的边缘欧洲消费泡沫已经破灭，市场正在消化相关的后遗症。

#### 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 4.29%，同期业绩比较基准收益率为 2.68%。

### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来十年新兴市场的投资趋势究竟在哪里？我们认为有三个：第一个是人民币的国际化，这是中国资本全面流向世界的开始，这将填补美元供应短缺所造成的国际流动性短缺，未来其它新兴市场受益的程度将很可能比国内高，特别是在海外资产价值这一个层面；第二个趋势是美国能源自主，这将使美国未来对于全球能源的需求大幅下降，就算新兴市场的能源需求高速成长也无法再推高国际能源价格，这对大部份需要能源进口支持的亚洲市场是个结构性的机会；第三个是经济较发达的各个市场纷纷出现老龄化的现象，有人口红利的市场越来越少，人口结构比较年轻的印度、土耳其以及非洲市场将对未来全球市场的成长提供更重要的支持。

未来新兴市场的长期投资，基于这三个长期趋势，应该会有很不一样的面貌，而2012年就处于一个重要的转折上。

### 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

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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2012 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2011 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| 资 产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 11,319,576.21 | 11,752,156.07 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 63,743,692.91 | 66,698,742.42 |
| 其中：股票投资 | | 63,743,692.91 | 66,698,742.42 |
| 基金投资 | | - | - |
| 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 | | 626,273.49 | 505,773.13 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 837.57 | 1,896.88 |
| 应收股利 | | 323,769.78 | 52,104.43 |
| 应收申购款 | | 21,585.76 | 13,492.78 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | 504,072.00 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 资产总计 | | **76,035,735.72** | **79,528,237.71** |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末<br>2012 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>2011 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 | | 734,183.15 | 125,966.27 |
| 应付赎回款 | | 282,540.80 | 4,017,363.92 |
| 应付管理人报酬 | | 107,271.09 | 122,351.62 |
| 应付托管费 | | 20,858.26 | 23,790.58 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 199,733.98 | 839,454.92 |
| 负债合计 | | 1,344,587.28 | 5,128,927.31 |
| **所有者权益：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 90,440,405.55 | 93,953,161.89 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -15,749,257.11 | -19,553,851.49 |
| 所有者权益合计 | | **74,691,148.44** | **74,399,310.40** |
| 负债和所有者权益总计 | | **76,035,735.72** | **79,528,237.71** |

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.826 元，基金份额总额 90,440,405.55 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| **项 目** | **附注号** | **本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日** | **上年度可比期间<br>2011 年 1 月 30 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日** |
|---|---|---|---|
| **一、收入** | | **4,648,281.48** | **500,062.46** |
| 1.利息收入 | | 17,501.58 | 1,042,035.52 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 17,501.58 | 377,149.17 |
| 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 | | - | 664,886.35 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -1,320,326.70 | 243,150.90 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -2,426,610.03 | -176,302.25 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 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 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 1,106,283.33 | 419,453.15 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 5,954,115.59 | -711,874.45 |
| 4.汇兑收益（损失以“－”号填列） | | -10,302.68 | -356,267.15 |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 7,293.69 | 283,017.64 |
| **减：二、费用** | | **1,371,893.69** | **2,162,373.99** |
| 1．管理人报酬 | | 709,233.36 | 1,477,321.02 |
| 2．托管费 | | 137,906.44 | 287,256.88 |
| 3．销售服务费 | | - | - |
| 4．交易费用 | 6.4.7.19 | 279,677.57 | 187,537.37 |
| 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 | 245,076.32 | 210,258.72 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | **3,276,387.79** | **-1,662,311.53** |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | **3,276,387.79** | **-1,662,311.53** |

### 6.3 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股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 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 | 93,953,161.89 | -19,553,851.49 | 74,399,310.40 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 金净值） | | | |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 3,276,387.79 | 3,276,387.79 |
| 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） | -3,512,756.34 | 528,206.59 | -2,984,549.75 |
| 其中：1.基金申购款 | 5,667,027.37 | -730,221.02 | 4,936,806.35 |
| 2.基金赎回款 | -9,179,783.71 | 1,258,427.61 | -7,921,356.10 |
| 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） | 90,440,405.55 | -15,749,257.11 | 74,691,148.44 |
| **项目** | **上年度可比期间 2011 年 1 月 30 日（基金合同生效日）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） | 349,551,403.11 | - | 349,551,403.11 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -1,662,311.53 | -1,662,311.53 |
| 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） | -224,003,556.53 | 216,867.95 | -223,786,688.58 |
| 其中：1.基金申购款 | 2,653,282.60 | -26,613.15 | 2,626,669.45 |
| 2.基金赎回款 | -226,656,839.13 | 243,481.10 | -226,413,358.03 |
| 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） | 125,547,846.58 | -1,445,443.58 | 124,102,403.00 |

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：张璐

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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”)《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》(证监许可[2010]1277 号文)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 349,520,284.05 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司验资报告予以验证。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《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基金合同》的有关规定，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。本基金主要投资于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：MSCI 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 2012 年 8 月 28 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》、《上投摩根全球新兴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 2012 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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 基金托管人、基金代销机构 |
| 摩根大通银行(JPMorgan &Chase Bank, N.A.) | 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2012年1月1日至2012年6月30日 | 上年度可比期间<br>2011年1月30日（基金合同生效日）至2011年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 709,233.36 | 1,477,321.02 |
| 其中：支付销售机构的客户 | 383,523.54 | 668,380.82 |

| | | |
|---|---|---|
| 维护费 | | |

注：支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.8%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1.8% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2012年1月1日至2012年6月30日 | 上年度可比期间<br>2011年1月30日（基金合同生效日）至2011年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 137,906.44 | 287,256.88 |

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.35% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

无。

6.4.8.5 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<br>2012年1月1日至2012年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2011年1月30日（基金合同生效日）至2011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 |
| 中国建设银行 | 4,202,363.02 | 17,481.46 | 11,242,410.19 | 369,652.79 |
| 摩根大通银行 | 7,117,213.19 | 20.12 | 2,540,113.74 | - |

本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人摩根大通银行保管，按适用利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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 | 63,743,692.91 | 83.83 |
| | 其中：普通股 | 51,019,372.96 | 67.10 |
| | 存托凭证 | 12,724,319.95 | 16.73 |
| | 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 | 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 | 11,319,576.21 | 14.89 |
| 8 | 其他各项资产 | 972,466.60 | 1.28 |
| 9 | 合计 | 76,035,735.72 | 100.00 |

注：截至 2012 年 6 月 30 日，本基金资产净值为 74,691,148.44 元，基金份额净值为 0.826 元，累计基金份额净值为 0.826 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(人民币元) | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| 中国香港 | 13,082,285.74 | 17.52 |
| 中国台湾 | 9,293,964.45 | 12.44 |

| | | |
|---|---|---|
| 美国 | 7,666,512.48 | 10.26 |
| 印度 | 6,342,639.39 | 8.49 |
| 韩国 | 6,279,893.73 | 8.41 |
| 南非 | 5,980,784.76 | 8.01 |
| 英国 | 5,057,807.47 | 6.77 |
| 土耳其 | 2,967,845.76 | 3.97 |
| 墨西哥 | 2,145,799.31 | 2.87 |
| 巴西 | 2,088,976.49 | 2.80 |
| 波兰 | 1,808,034.82 | 2.42 |
| 泰国 | 920,057.87 | 1.23 |
| 印度尼西亚 | 109,090.64 | 0.15 |
| 合计 | 63,743,692.91 | 85.34 |

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（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| 石油、天然气与消费用燃料 | 8,721,836.88 | 11.68 |
| 商业银行 | 6,030,880.75 | 8.07 |
| 金属与采矿 | 4,666,688.16 | 6.25 |
| 食品 | 4,186,780.13 | 5.61 |
| 综合金融服务 | 4,043,718.55 | 5.41 |
| 个人用品 | 3,620,221.49 | 4.85 |
| 食品与主要用品零售 | 2,988,995.78 | 4.00 |
| 饮料 | 2,957,687.69 | 3.96 |
| 燃气公用事业 | 2,921,134.34 | 3.91 |
| 无线电信业务 | 2,102,015.79 | 2.81 |
| 汽车零配件 | 2,063,502.59 | 2.76 |
| 综合电信业务 | 1,643,019.27 | 2.20 |
| 独立电力生产商与能源贸易商 | 1,555,774.47 | 2.08 |
| 工业集团企业 | 1,516,635.49 | 2.03 |
| 多元化零售 | 1,412,070.70 | 1.89 |
| 水公用事业 | 1,364,971.94 | 1.83 |
| 交通基本设施 | 1,311,155.84 | 1.76 |
| 纺织品、服装与奢侈品 | 1,145,402.67 | 1.53 |
| 制药 | 836,619.68 | 1.12 |
| 电子设备、仪器和元件 | 820,587.89 | 1.10 |
| 房地产管理和开发 | 798,389.76 | 1.07 |
| 资本市场 | 795,499.78 | 1.07 |

| | | |
|---|---|---|
| 建筑与工程 | 791,702.80 | 1.06 |
| 电力公用事业 | 782,776.47 | 1.05 |
| 消费信贷 | 777,592.56 | 1.04 |
| 烟草 | 762,290.30 | 1.02 |
| 机械制造 | 740,744.52 | 0.99 |
| 保险 | 719,769.04 | 0.96 |
| 互助储蓄银行与抵押信贷 | 665,941.11 | 0.89 |
| 贸易公司与经销商 | 650,078.34 | 0.87 |
| 休闲设备与用品 | 349,208.13 | 0.47 |
| 合计 | 63,743,692.91 | 85.34 |

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 | Companhia de Bebidas das Americas | - | ABV US | 纽约证券交易所 | 美国 | 12,200 | 2,957,687.69 | 3.96 |
| 2 | Tingyi (Cayman Islands) Holdings Corp | 康师傅控股有限公司 | 322 HK | 香港交易所 | 中国香港 | 140,000 | 2,262,559.22 | 3.03 |
| 3 | China Gas Holdings Ltd | 中国燃气控股有限公司 | 384 HK | 香港交易所 | 中国香港 | 700,000 | 2,203,198.44 | 2.95 |
| 4 | 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 | 130,000 | 2,063,502.59 | 2.76 |
| 5 | Infrastructure Development Finance Co Ltd | - | IDFC IN | 印度国家证券交易所 | 印度 | 128,000 | 1,974,125.50 | 2.64 |
| 6 | Tatneft | - | ATAD LI | 伦敦证券交易所 | 英国 | 9,300 | 1,973,463.67 | 2.64 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 7 | Lukoil | - | LKOD LI | 伦敦证券交易所 | 英国 | 5,500 | 1,939,372.46 | 2.60 |
| 8 | Vale SA | - | VALE US | 纽约证券交易所 | 美国 | 15,000 | 1,883,238.97 | 2.52 |
| 9 | Sasol Ltd | - | SOL SJ | 约翰内斯堡证券交易所 | 南非 | 7,100 | 1,880,061.73 | 2.52 |
| 10 | Shoprite Holdings Ltd | - | SHP SJ | 约翰内斯堡证券交易所 | 南非 | 15,000 | 1,747,825.43 | 2.34 |

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，应阅读登载于本基金管理人网站（www.51fund.com）的半年度报告正文。

### 7.5 报告期内权益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 | Zhaojin Mining Industry Co Ltd | 1818 HK | 2,228,695.53 | 3.00 |
| 2 | Samsung C&T Corp | 000830 KS | 2,193,404.35 | 2.95 |
| 3 | China Gas Holdings Ltd | 384 HK | 2,177,719.71 | 2.93 |
| 4 | Cathay Financial Holding Co Ltd | 2882 TT | 2,072,044.70 | 2.79 |
| 5 | PetroChina Co Ltd | 857 HK | 1,927,995.22 | 2.59 |
| 6 | Celltrion Inc | 068270 KS | 1,612,272.39 | 2.17 |
| 7 | Evergrande Real Estate Group Ltd | 3333 HK | 1,548,126.18 | 2.08 |
| 8 | President Chain Store Corp | 2912 TT | 1,465,123.70 | 1.97 |
| 9 | China Resources Power Holdings Co Ltd | 836 HK | 1,429,402.55 | 1.92 |
| 10 | China Resources Enterprise Ltd | 291 HK | 1,347,612.62 | 1.81 |
| 11 | Multi Commodity Exchange of India Ltd | MCX IN | 1,316,663.96 | 1.77 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 12 | Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd | 338 HK | 1,295,522.46 | 1.74 |
| 13 | Guangdong Investment Ltd | 270 HK | 1,272,886.81 | 1.71 |
| 14 | Cosmax Inc | 044820 KS | 1,256,275.40 | 1.69 |
| 15 | LG Chem Ltd | 051910 KS | 1,236,887.54 | 1.66 |
| 16 | Ruentex Industries Ltd | 2915 TT | 1,233,548.76 | 1.66 |
| 17 | Jaiprakash Associates Ltd | JPA IN | 1,228,108.87 | 1.65 |
| 18 | Sinofert Holdings Ltd | 297 HK | 1,224,358.42 | 1.65 |
| 19 | Samsung Electronics Co Ltd | 005930 KS | 1,137,882.91 | 1.53 |
| 20 | SK Telecom Co Ltd | 017670 KS | 1,122,424.56 | 1.51 |

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 | Evergrande Real Estate Group Ltd | 3333 HK | 2,629,948.36 | 3.53 |
| 2 | Zhaojin Mining Industry Co Ltd | 1818 HK | 2,093,881.16 | 2.81 |
| 3 | PetroChina Co Ltd | 857 HK | 1,924,711.73 | 2.59 |
| 4 | Cathay Financial Holding Co Ltd | 2882 TT | 1,843,030.86 | 2.48 |
| 5 | Hon Hai Precision Industry Co Ltd | 2317 TT | 1,840,187.65 | 2.47 |
| 6 | Samsung C&T Corp | 000830 KS | 1,839,718.97 | 2.47 |
| 7 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 2330 TT | 1,686,299.39 | 2.27 |
| 8 | Hang Lung Properties Ltd | 101 HK | 1,507,739.18 | 2.03 |
| 9 | Hengan Intl Group Co Ltd | 1044 HK | 1,486,475.70 | 2.00 |
| 10 | CITIC Securities Co Ltd | 6030 HK | 1,475,906.54 | 1.98 |
| 11 | DR Reddy's Laboratories Ltd | DRRD IN | 1,466,797.49 | 1.97 |
| 12 | Hyundai Mobis | 012330 KS | 1,452,144.67 | 1.95 |
| 13 | Samsung Life Insurance Co Ltd | 032830 KS | 1,361,089.75 | 1.83 |
| 14 | Nine Dragons Paper Holdings Ltd | 2689 HK | 1,345,367.00 | 1.81 |
| 15 | Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd | 338 HK | 1,269,580.20 | 1.71 |
| 16 | Johnson Health Tech Co Ltd | 1736 TT | 1,263,048.67 | 1.70 |
| 17 | Jaiprakash Associates Ltd | JPA IN | 1,242,192.91 | 1.67 |
| 18 | Daelim Industrial Co Ltd | 000210 KS | 1,239,661.14 | 1.67 |
| 19 | LG Chem Ltd | 051910 KS | 1,215,180.00 | 1.63 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 20 | Thai Union Frozen Products Public Co Ltd | TUF/F TB | 1,193,190.08 | 1.60 |

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 | 61,316,356.35 |
| 卖出收入（成交）总额 | 67,799,115.83 |

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。

**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**

本基金本报告期末未持有基金。

**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**

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 626,273.49 |
| 3 | 应收股利 | 323,769.78 |
| 4 | 应收利息 | 837.57 |
| 5 | 应收申购款 | 21,585.76 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 972,466.60 |

**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 |
| 3,539 | 25,555.36 | - | - | 90,440,405.55 | 100.00% |

### 8.2 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 | 1,398,310.02 | 1.5461% |

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。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2011 年 1 月 30 日）基金份额总额 | 349,551,403.11 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 93,953,161.89 |
| 本报告期基金总申购份额 | 5,667,027.37 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 9,179,783.71 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 90,440,405.55 |

# 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：
无。
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 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 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 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| UBS Securities Ltd | 1 | 93,883,653.21 | 72.71% | 60,101.85 | 48.62% | |
| HSBC Securities Corp Ltd | 1 | 14,955,137.33 | 11.58% | 26,172.27 | 21.17% | |
| Merrill Lynch | 1 | 4,199,343.29 | 3.25% | 8,398.69 | 6.79% | |
| Morgan Stanley Ltd | 1 | 4,539,825.19 | 3.52% | 8,241.43 | 6.67% | |
| Masterlink Securities Corp | 1 | 4,485,620.96 | 3.47% | 7,850.47 | 6.35% | |
| Yuanta Securities Co Ltd | 1 | 3,052,666.14 | 2.36% | 5,342.46 | 4.32% | |
| Citigroup Global Mkts Ltd | 1 | 2,010,806.12 | 1.56% | 4,021.59 | 3.25% | |
| Samsung Securities Company limited | 1 | 479,412.02 | 0.37% | 838.90 | 0.68% | |
| Sinopac Securities | 1 | 462,043.98 | 0.36% | 808.12 | 0.65% | |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Corp | | | | | | |
| Nomura Financial Investment | 1 | 458,128.05 | 0.35% | 801.67 | 0.65% | |
| Credit Suisse Ltd | 1 | 429,891.99 | 0.33% | 752.28 | 0.61% | |
| JP Morgan Secs Ltd | 1 | 158,943.90 | 0.12% | 278.10 | 0.22% | |

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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. 2012 上半年度新增席位: JP Morgan Secs Ltd，无注销席位。

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

2012 年 1 月 16 日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任中国建设银行股份有限公司董事长、执行董事。

**上投摩根基金管理有限公司**

**二〇一二年八月二十九日**