

# 上投摩根全球新兴市场股票型

## 证券投资基金

### 2012 年年度报告

2012 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：二〇一三年三月二十九日

## § 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 2013 年 3 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。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日 止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录.....	1
1.1	重要提示.....	1
1.2	目录.....	1
§ 2	基金简介.....	4
2.1	基金基本情况.....	4
2.2	基金产品说明.....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	境外投资顾问和境外资产托管人.....	5
2.5	信息披露方式.....	5
2.6	其他相关资料.....	5
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 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的说明.....	11
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.8	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.9	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§ 5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§ 6	审计报告.....	14
6.1	审计报告基本信息.....	14
6.2	审计报告的基本内容.....	14
§ 7	年度财务报表.....	15
7.1	资产负债表.....	15
7.2	利润表.....	16
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4	报表附注.....	18
§ 8	投资组合报告.....	36
8.1	期末基金资产组合情况.....	36
8.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	36
8.3	期末按行业分类的权益投资组合.....	37
8.4	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.....	38
8.5	报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
8.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
8.8	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.....	44
8.9	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.....	44
8.10	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.....	45
8.11	投资组合报告附注.....	45
§ 9	基金份额持有人信息.....	46

9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	46
§ 10	开放式基金份额变动.....	46
§ 11	重大事件揭示.....	46
11.1	基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
11.4	基金投资策略的改变.....	47
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
11.8	其他重大事件.....	48
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§ 13	备查文件目录.....	49
13.1	备查文件目录.....	49
13.2	存放地点.....	49
13.3	查阅方式.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金
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	90,496,399.68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，努力实现基金资产的稳健增值。
投资策略	<p>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。</p> <p>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。</p>
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	田青
	联系电话	021-38794999	010-67595096
	电子邮箱	xia.hong@jpmf-sitico.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-4888	010-67595096
传真		021-68881170	010-66275853
注册地址		上海市富城路99号20楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市富城路99号20楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		陈开元	王洪章

## 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

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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
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、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	2012 年	2011 年 1 月 30 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-232,923.71	-12,986,264.04
本期利润	14,325,718.12	-24,311,193.90
加权平均基金份额本期利润	0.1580	-0.1868
本期加权平均净值利润率	18.17%	-20.13%
本期基金份额净值增长率	20.33%	-20.80%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末
期末可供分配利润	-10,515,721.59	-19,553,851.49
期末可供分配基金份额利润	-0.1162	-0.2081
期末基金资产净值	86,218,388.44	74,399,310.40
期末基金份额净值	0.953	0.792
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	2011 年末
基金份额累计净值增长率	-4.70%	-20.80%

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

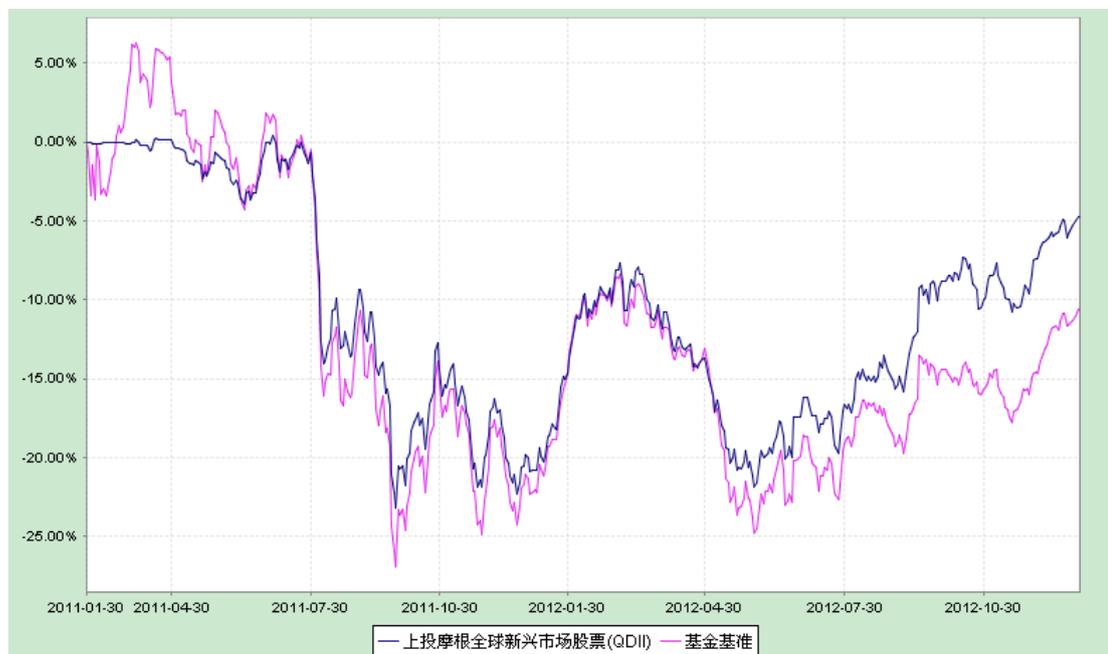
## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.50%	0.56%	4.32%	0.53%	0.18%	0.03%
过去六个月	15.38%	0.72%	11.87%	0.76%	3.51%	-0.04%
过去一年	20.33%	0.81%	14.87%	0.90%	5.46%	-0.09%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-4.70%	0.94%	-10.68%	1.21%	5.98%	-0.27%

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 12 月 31 日)

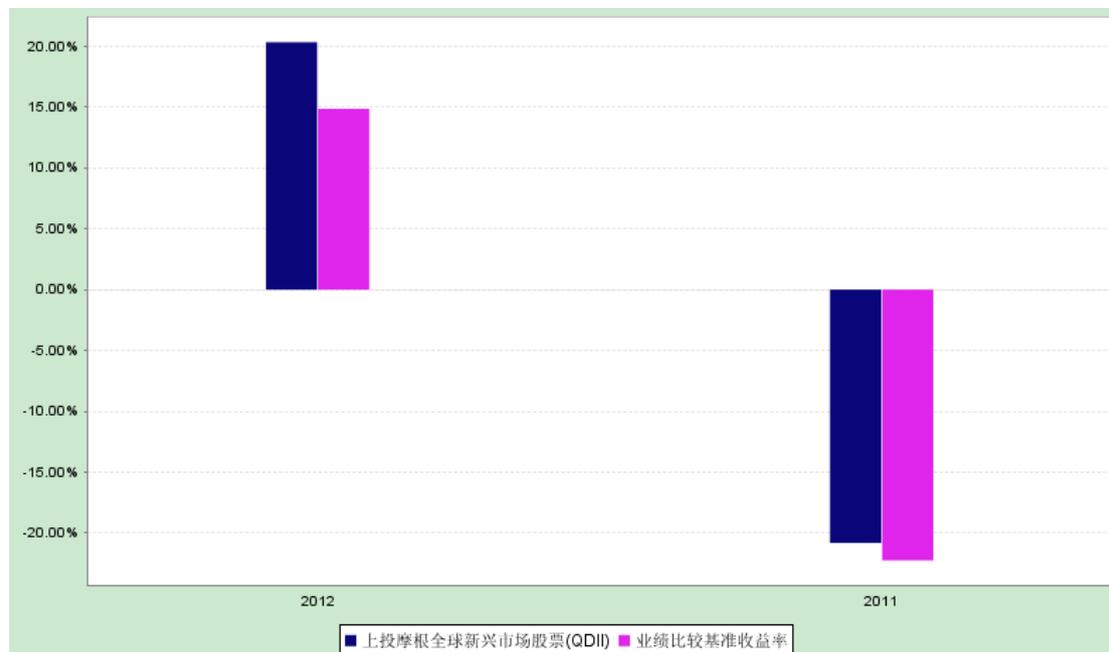


注：1. 本基金合同生效日为 2011 年 1 月 30 日，图示时间段为 2011 年 1 月 30 日至 2012 年 12 月 31 日。

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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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股票型证券投资基金  
自基金合同生效以来每年净值增长率图



注：1. 本基金合同生效日为 2011 年 1 月 30 日。  
2. 合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 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 2012 年 12 月底，公司管理的基金共有二十只，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和上投摩根核心优选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		
王邦祺	本基金基金经理	2011-1-30	-	9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	10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	17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、《上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金基金合同》的规定。除以下情况外，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：本基金曾出现个别交易日由于市场原因造成基金持有一个市场的比例高于基金合同中相关规定的情况，但已在规定时间内调整完毕。

#### 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。对于二级市场投资活动，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量；对于一级市场申购活动，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对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（除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合）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：无。

#### 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

2012 年本基金表现超越业绩基准，我们在台湾、韩国、印度、土耳其以及俄罗斯取得较好的回报，在巴西市场损失一些，主要的原因是我们对于巴西市场太过乐观，低配幅度较低。

##### 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 20.33%，同期业绩比较基准收益率为 14.87%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

以全球投资的角度观察，2000 年有三大趋势发生，第一个是 911 以来，美国又要反恐怖主义，又要民生，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的增加；第三个是欧元面世，边缘欧洲大量消费。以超过十年的角度看，这是新兴市场的全面掘起的原因，弱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。

这是新兴市场过去兴起的背景，也是这三年新兴市场停滞的原因，因为这三大趋势分别告一段落，亦即美元不再走弱、中国对大宗商品的成长告一段落以及欧洲边缘国家的崩溃。

当基地组织被美国削弱，美国也从伊拉克与阿富汗撤军，反恐战争已经告一段落，美国政府的资产负债表最坏的日子已经过去，虽然现在还是很坏，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，我们在过去五个季度已经提示这个风险。

当中国的经济开始需要追求有质量的增长，8% 以上的时代过去，十二五计划的目标只有 7%，这意谓着靠着卖矿卖油部份市场已经把好日子过完，一些拉美与东欧的主要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。

未来十年新兴市场的长期投资趋势究竟在那里？

我们以为有三个方向，第一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增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，但是如果前面所说，对于卖油为生的部份新兴市场国家来说，如果不能转型，长期被投资人抛弃可能是个必然的结果。第二个趋势是人民币的国际化，这是中国资本全面流向世界的开始，也将填补因为美国能源自主，所造成的

国际美元供应短缺，国际流动性不会因为美元不足而短少，未来其它新兴市场受益的程度将很可能比国内高，表现在市场层面，就是众多亚洲货币兑人民币升值，因为中国的需求会带动整个新兴市场，加上人民币又兑其他发达市场升值，当然，亚洲新兴市场会是最大受惠者；第三个趋势是，经济较发达的各个市场纷纷出现老年化的现象，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未来将对未来全球市场的成长提供更重要的支持。

新兴市场的长期投资，基于这三样长期趋势，未来应该会有很不一样的面貌。

就 2013 年来说，还有一个重要的中期因素，就是日元资金大量地从日本国内出走，出走的迦南之地包括菲律宾、泰国、印度尼西亚以及马来西亚，这些市场，过去三年所吸引的外国直接投资，有将近一半来自日本，展望 2013 至 2014 年，以名义国民生产毛额看，可能会超过亚洲四小龙，即所谓的韩国、台湾、香港以及新加坡市场。

基于以上对趋势的看法，从 2013 年开始，在资产配置上，我们可能将对东南亚市场以及印度市场进行较高的资产配置，相对于业绩基准，这会是我们与市场比较大的分野。

#### 4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中以“坚守三条底线、保障合规诚信、支持业务发展、提高工作水平”为总体目标，一切从合规运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部门按照工作计划结合实际情况对公司各项业务进行全面的监察稽核工作，保障和促进公司各项业务合法合规运作，推动内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议并督促有关部门改进。

在本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作贯穿三条主线：

1. 注意密切追踪监管法规政策变化和监管新要求，组织员工学习理解监管精神，推动公司各部门完善制度建设和业务流程，防范日常运作中的违规行为发生。
2. 继续紧抓员工行为、公平交易、利益冲突等方面的日常监控，坚守“三条底线”不动摇；进一步加强内部合规培训和合规宣传，强化合规意识，规范员工行为操守，严格防范利益冲突。
3. 针对风险控制的需求和重点，强化内部审计，提高内部审计工作的水平和效果；按照监管部门的要求，严格推行风险控制自我评估制度，对控制不足的风险点，制订了进一步的控制措施。

在本报告期内的监察稽核工作中，未发现基金投资运作存在违法违规或未履行基金合同承诺从而影响基金份额持有人利益的情形。

公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。本基金运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。我们将继续以合规运作和风险管理为核心，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金份额持有人的利益。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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关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

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2013)第 20345 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金(以下简称“上投摩根全球新兴市场基金”)的财务报表,包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是上投摩根全球新兴市场基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为,上述上投摩根全球新兴市场基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的

	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，公允反映了上投摩根全球新兴市场基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汪棣	王灵
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司	
会计师事务所的地址	中国·上海市	
审计报告日期	2012 年 3 月 28 日	

## § 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股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	6,470,164.92	11,752,156.07
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	81,789,011.00	66,698,742.42
其中：股票投资		81,789,011.00	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,468,893.25	505,773.13
应收利息	7.4.7.5	1,090.08	1,896.88
应收股利		58,460.67	52,104.43
应收申购款		94,692.89	13,492.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	955,521.84	504,072.00
<b>资产总计</b>		<b>90,837,834.65</b>	<b>79,528,237.71</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年12月31日</b>	<b>上年度末 2011年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	125,966.27
应付赎回款		2,923,348.10	4,017,363.92
应付管理人报酬		131,734.46	122,351.62
应付托管费		25,615.10	23,790.58

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		106,888.45	-
其他负债	7.4.7.8	1,431,860.10	839,454.92
负债合计		4,619,446.21	5,128,927.31
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	90,496,399.68	93,953,161.89
未分配利润	7.4.7.10	-4,278,011.24	-19,553,851.49
<b>所有者权益合计</b>		<b>86,218,388.44</b>	<b>74,399,310.40</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>90,837,834.65</b>	<b>79,528,237.71</b>

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.953 元，基金份额总额 90,496,399.68 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月30日（基金 合同生效日）至2011 年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>17,304,904.58</b>	<b>-20,411,805.22</b>
1. 利息收入		34,276.41	1,130,955.24
其中：存款利息收入	7.4.7.11	34,276.41	407,925.32
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		-	723,029.92
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,686,026.99	-9,913,812.92
其中：股票投资收益	7.4.7.12	704,338.24	-11,553,563.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	2,276.95
股利收益	7.4.7.15	1,981,688.75	1,637,474.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	14,558,641.83	-11,324,929.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		5,479.20	-624,063.03
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	20,480.15	320,045.35
<b>减：二、费用</b>		<b>2,870,637.01</b>	<b>3,899,388.68</b>
1. 管理人报酬		1,422,121.67	2,367,542.88
2. 托管费		276,523.66	460,355.56
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	660,747.50	611,244.42

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	511,244.18	460,245.82
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>14,434,267.57</b>	<b>-24,311,193.90</b>
减：所得税费用		108,549.45	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>14,325,718.12</b>	<b>-24,311,193.90</b>

### 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股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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）	93,953,161.89	-19,553,851.49	74,399,310.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,325,718.12	14,325,718.12
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）	-3,456,762.21	950,122.13	-2,506,640.08
其中：1. 基金申购款	22,055,370.04	-2,174,124.40	19,881,245.64
2. 基金赎回款	-25,512,132.25	3,124,246.53	-22,387,885.72
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）	90,496,399.68	-4,278,011.24	86,218,388.44
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）	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）	-	-24,311,193.90	-24,311,193.90
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）	-255,598,241.22	4,757,342.41	-250,840,898.81
其中：1. 基金申购款	5,471,322.93	-277,405.23	5,193,917.70
2. 基金赎回款	-261,069,564.15	5,034,747.64	-256,034,816.51
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）	93,953,161.89	-19,553,851.49	74,399,310.40

报告附注为财务报表的组成部分

本报告 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《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股票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2013年3月28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》、《上投摩根全球新兴市场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 2012 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 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外, 以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款, 买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

##### 递延所得税资产和递延所得税负债

递延所得税资产和递延所得税负债根据资产和负债的计税基础与其账面价值的差额(暂时性差异)计算确认。对于按照税法规定能够于以后年度抵减应纳税所得额的可抵扣亏损，确认相应的递延所得税资产。于资产负债表日，递延所得税资产和递延所得税负债按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计量。

递延所得税资产的确认以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异、可抵扣亏损和税款抵减的应纳税所得额为限。

同时满足下列条件的递延所得税资产和递延所得税负债以抵销后的净额列示：

- 递延所得税资产和递延所得税负债与同一税收征管部门对本基金征收的所得税相关；
- 本基金拥有以净额结算当期所得税资产及当期所得税负债的法定权利。

#### 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，在境内暂免征营业税和企业所得税。

(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 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
活期存款	6,470,164.92	11,752,156.07
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	6,470,164.92	11,752,156.07

注：于2012年12月31日，银行存款中包含的外币余额为：港币6.25元(折合人民币5.07元)，美元89,954.56元(折合人民币565,409.38元)，新台币1,834,818.00元(折合人民币397,146.89元)，韩元2,880.00元(折合人民币16.91元)，印度卢比4,399,793.20元(折合人民币504,743.57元)。

于2011年12月31日，银行存款中包含的外币余额为：港币2,215,824.51元(折合人民币1,797,657.75元)，美元62,297.84元(折合人民币392,532.46元)，新台币2,059,106.00元(折合人民币428,489.08元)，韩元3,145.00元(折合人民币17.20元)。

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		78,555,299.03	81,789,011.00	3,233,711.97
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		78,555,299.03	81,789,011.00	3,233,711.97
项目		上年度末 2011年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		78,023,672.28	66,698,742.42	-11,324,929.86
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		78,023,672.28	66,698,742.42	-11,324,929.86

注：于 2012 年 12 月 31 日，股票投资中含房地产信托投资成本为 1,995,997.72 元，公允价值为 2,032,560.38 元。

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应收活期存款利息	1,090.08	1,896.88
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	1,090.08	1,896.88

## 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
其他应收款	955,521.84	504,072.00
待摊费用	-	-
合计	955,521.84	504,072.00

注：于 2012 年 12 月 31 日，其他应收款余额为应收货币兑换款。

## 7.4.7.7 应付交易费用

无余额。

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	9,705.66	15,140.82
预提费用	436,780.55	320,000.00
其他应付款	985,373.89	504,314.10
合计	1,431,860.10	839,454.92

注：于 2012 年 12 月 31 日，其他应付款余额为应付货币兑换款折合人民币 958,346.24 元 及 应付印度税务顾问费折合人民币 27,027.65 元。

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	93,953,161.89	93,953,161.89
本期申购	22,055,370.04	22,055,370.04
本期赎回（以“-”号填列）	-25,512,132.25	-25,512,132.25
本期末	90,496,399.68	90,496,399.68

## 7.4.7.10 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	-10,618,284.39	-8,935,567.10	-19,553,851.49
本期利润	-232,923.71	14,558,641.83	14,325,718.12
本期基金份额交易产生的变动数	335,486.51	614,635.62	950,122.13
其中：基金申购款	-3,007,373.79	833,249.39	-2,174,124.40
基金赎回款	3,342,860.30	-218,613.77	3,124,246.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,515,721.59	6,237,710.35	-4,278,011.24

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 2011年1月30日(基金合同生效 日)至2011年12月31日
活期存款利息收入	34,156.39	399,006.35
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	8,897.98
其他	120.02	20.99
合计	34,276.41	407,925.32

## 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月3 1日	上年度可比期间 2011年1月30日(基金合同生效 日)至2011年12月31日
卖出股票成交总额	163,450,253.35	81,024,038.75
减：卖出股票成本总额	162,745,915.11	92,577,602.70
买卖股票差价收入	704,338.24	-11,553,563.95

## 7.4.7.13 债券投资收益

无。

## 7.4.7.14 衍生工具收益

## 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 2011年1月30日(基金合同生效 日)至2011年12月31日
卖出权证成交总额	-	20,198.81
减：卖出权证成本总额	-	17,921.86
买卖权证差价收入	-	2,276.95

注：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。

## 7.4.7.14.2 衍生工具收益——买卖股指期货差价收入

无。

## 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 2011年1月30日(基金合同生效 日)至2011年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,981,688.75	1,637,474.08
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,981,688.75	1,637,474.08

## 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月30日（基金合同生效日）至2011年12月31日
1. 交易性金融资产	14,558,641.83	-11,324,929.86
——股票投资	14,558,641.83	-11,324,929.86
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	14,558,641.83	-11,324,929.86

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月30日（基金合同生效日）至2011年12月31日
基金赎回费收入	20,480.15	320,045.35
合计	20,480.15	320,045.35

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。

## 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月30日（基金合同生效日）至2011年12月31日
交易所市场交易费用	660,747.50	611,244.42
银行间市场交易费用	-	-
合计	660,747.50	611,244.42

## 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月30日（基金合同生效日）至2011年12月31日
信息披露费	290,000.00	260,000.00
审计费	72,000.00	60,000.00
其他	149,244.18	140,245.82
合计	511,244.18	460,245.82

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

无。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 7.4.9 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	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
上海国际信托有限公司(“上国投”)	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、境外投资顾问
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
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
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
JPMorgan Chase & Co.	与境外投资顾问存在控制关系的机构
JPMorgan Asset Management Holdings Inc.	与境外投资顾问存在控制关系的机构
JP Morgan Asset Management Holdings(UK) Limited	与境外投资顾问存在控制关系的机构
JP Morgan Asset Management International Limited	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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年1月30日(基金合同生 效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,422,121.67	2,367,542.88
其中：支付销售机构的客户维护费	761,046.52	1,089,664.11

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。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月30日（基金合同生效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	276,523.66	460,355.56

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.35\% / \text{当年天数}。$$

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

无。

**7.4.10.5 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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月30日（基金合同生效日）至2011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
中国建设银行	5,456,183.38	34,119.65	9,133,518.76	398,989.11
摩根大通银行	1,013,981.54	36.74	2,618,637.31	17.24

注：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。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.10.7 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。

**7.4.11 利润分配情况**

无。

**7.4.12 期末（2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券**

无。

**7.4.13 金融工具风险及管理****7.4.13.1 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评估的评估，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控管，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，将风险控制在可承受的范围内。

#### **7.4.13.2 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建设银行以及境外次托管行摩根大通银行，与该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 2012 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2011 年 12 月 31 日：同）。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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%。本基金所持证券均在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

于 2012 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等。

#### 7.4.13.4.2 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。

## 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日						
	港币 折合人民币	美元 折合人民币	南非兰特 折合人民币	新台币 折合人民币	韩元 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	5.07	565,409.38	-	397,146.89	16.91	504,743.57	1,467,321.82
交易性金融资产	16,992,587.34	14,802,471.93	6,663,919.78	9,642,589.91	8,902,914.72	24,784,527.32	81,789,011.00
应收证券清算款	911,118.25	-	-	-	104,172.33	453,602.67	1,468,893.25
应收利息	-	0.63	-	-	-	-	0.63
应收股利	-	58,460.67	-	-	-	-	58,460.67
其他资产	-	955,521.84	-	-	-	-	955,521.84
<b>资产合计</b>	<b>17,903,710.66</b>	<b>16,381,864.45</b>	<b>6,663,919.78</b>	<b>10,039,736.80</b>	<b>9,007,103.96</b>	<b>25,742,873.56</b>	<b>85,739,209.21</b>
以外币计价的负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	91,808.20	-	-	-	1,065,234.69	1,157,042.89
<b>负债合计</b>	<b>-</b>	<b>91,808.20</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,065,234.69</b>	<b>1,157,042.89</b>
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	<b>17,903,710.66</b>	<b>16,290,056.25</b>	<b>6,663,919.78</b>	<b>10,039,736.80</b>	<b>9,007,103.96</b>	<b>24,677,638.87</b>	<b>84,582,166.32</b>
项目	上年度末 2011年12月31日						
	港币 折合人民币	美元 折合人民币	南非兰特 折合人民币	新台币 折合人民币	韩元 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	1,797,657.75	392,532.46	-	428,489.08	17.20	-	2,618,696.49
交易性金融资产	13,696,024.25	14,383,755.39	5,833,654.40	8,481,004.33	9,121,346.12	15,182,957.93	66,698,742.42
应收证券清算款	505,773.13	-	-	-	-	-	505,773.13
应收利息	1.22	7.94	-	-	-	-	9.16
应收股利	-	34,423.33	-	-	-	17,681.10	52,104.43
其他资产	-	504,072.00	-	-	-	-	504,072.00
<b>资产合计</b>	<b>15,999,456.35</b>	<b>15,314,791.12</b>	<b>5,833,654.40</b>	<b>8,909,493.41</b>	<b>9,121,363.32</b>	<b>15,200,639.03</b>	<b>70,379,397.63</b>
以外币计价的负债							
应付证券清算款	-	-	-	14,342.10	111,624.17	-	125,966.27
其他负债	504,314.10	-	-	-	-	-	504,314.10
<b>负债合计</b>	<b>504,314.10</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>14,342.10</b>	<b>111,624.17</b>	<b>-</b>	<b>630,280.37</b>
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	<b>15,495,142.25</b>	<b>15,314,791.12</b>	<b>5,833,654.40</b>	<b>8,895,151.31</b>	<b>9,009,739.15</b>	<b>15,200,639.03</b>	<b>69,749,117.26</b>

## 7.4.13.4.2.2 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 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	增加约 423	增加约 349
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	下降约 423	下降约 349	

## 7.4.13.4.3 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，采用“自上而下”的策略，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。

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%。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。

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日		上年度末 2011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	81,789,011.00	94.86	66,698,742.42	89.65
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	81,789,011.00	94.86	66,698,742.42	89.65

注：上述其他价格敞口按股票发行方主要业务地分析如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日		上年度末 2011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 (%)
中国内地	16,090,007.43	18.66	11,893,794.53	15.99
巴西	10,311,315.65	11.96	12,816,377.95	17.23
印度	10,122,787.99	11.74	4,875,395.09	6.55
中国台湾	9,642,589.91	11.18	8,481,004.33	11.40
韩国	8,902,914.72	10.33	9,121,346.12	12.26
俄罗斯	7,859,521.20	9.12	5,287,889.56	7.11
南非	6,663,919.78	7.73	5,833,654.40	7.84
波兰	2,345,511.63	2.72	1,737,231.50	2.34
墨西哥	2,290,654.79	2.66	1,614,145.80	2.17
中国香港	902,579.91	1.05	1,802,229.72	2.42
其他市场	6,657,207.99	7.72	3,235,673.42	4.35
合计	81,789,011.00	94.86	66,698,742.42	89.65

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除摩根斯坦利新兴市场股票指数(总回报)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 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
	1. 摩根斯坦利新兴市场股票指数(总回报)上升5%	增加约413	增加约290
	2. 摩根斯坦利新兴市场股票指数(总回报)下降5%	下降约413	下降约290

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 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。

于 2012 年 12 月 31 日，本基金对印度市场股票投资产生的未实现资本盈利确认相关的递延所得税负债 106,888.45 元。(于 2011 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 99,551.91 元。)

(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 2012 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 81,789,011.00 元，无属于第二层级及第三层级的余额。(2011 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 66,698,742.42 元，无属于第二层级和第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

## § 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	81,789,011.00	90.04
	其中：普通股	64,953,978.69	71.51
	存托凭证	14,802,471.93	16.30
	优先股	-	-
	房地产信托	2,032,560.38	2.24
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	6,470,164.92	7.12
8	其他各项资产	2,578,658.73	2.84
9	合计	90,837,834.65	100.00

注：截至 2012 年 12 月 31 日，本基金资产净值为 86,218,388.44 元，基金份额净值为 0.953 元，累计基金份额净值为 0.953 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(人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	16,992,587.34	19.71
印度	10,122,787.99	11.74
中国台湾	9,642,589.91	11.18
韩国	8,902,914.72	10.33
英国	7,859,521.20	9.12
美国	6,942,950.73	8.05
南非	6,663,919.78	7.73

巴西	3,368,364.92	3.91
波兰	2,345,511.63	2.72
墨西哥	2,290,654.79	2.66
土耳其	2,073,331.01	2.40
新加坡	2,032,560.38	2.36
印度尼西亚	1,581,565.49	1.83
马来西亚	969,751.11	1.12
合计	81,789,011.00	94.86

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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
商业银行	11,648,617.21	13.51
石油、天然气与消费用燃料	8,248,180.15	9.57
综合金融服务	5,746,549.18	6.67
金属与采矿	5,679,554.72	6.59
保险	5,081,915.69	5.89
纺织品、服装与奢侈品	4,011,202.68	4.65
食品	3,389,278.14	3.93
饮料	3,219,923.37	3.73
个人用品	3,056,576.28	3.55
化学制品	2,789,502.08	3.24
无线电信业务	2,544,410.75	2.95
食品与主要用品零售	2,272,496.73	2.64
商业服务与商业用品	2,257,161.32	2.62
家庭耐用消费品	2,206,601.91	2.56
房地产投资信托(REITs)	2,032,560.38	2.36
电力公用事业	1,898,900.14	2.20
交通基本设施	1,868,413.40	2.17
房地产管理和开发	1,693,828.34	1.96
半导体产品与设备	1,663,001.54	1.93
综合消费者服务	1,619,048.18	1.88
互助储蓄银行与抵押贷款	1,426,283.08	1.65
航空航天与国防	1,138,268.05	1.32
电气设备	1,047,392.13	1.21
医疗保健提供商与服务	969,751.11	1.12
制药	902,579.91	1.05
休闲设备与用品	880,952.68	1.02
汽车零配件	873,403.44	1.01

多元化零售	866,883.42	1.01
消费信贷	755,774.99	0.88
合计	81,789,011.00	94.86

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	Companhia de Bebidas das Americas	-	ABV US	纽约证券 交易所	美国	12,200	3,219,923.37	3.73
2	Ruentex Industries Ltd	润泰全球 股份有限 公司	2915 TT	台湾证券 交易所	中国台湾	180,000	2,805,195.77	3.25
3	Mining & Metallurgic al Co Norilsk Nickel	-	MNOD LI	伦敦证券 交易所	英国	24,000	2,780,202.36	3.22
4	Tatneft	-	ATAD LI	伦敦证券 交易所	英国	9,300	2,546,890.89	2.95
5	IDFC Ltd	-	IDFC IN	印度国家 证券交易 所	印度	128,000	2,515,393.09	2.92
6	Cosmax Inc	-	044820 KS	韩国证券 交易所	韩国	9,500	2,415,095.09	2.80
7	Shoprite Holdings Ltd	-	SHP SJ	约翰内斯 堡证券交 易所	南非	15,000	2,272,496.73	2.64
8	S1 Corp	-	012750 KS	韩国证券 交易所	韩国	5,500	2,257,161.32	2.62
9	MRV Engenharia Participaco es SA	-	MRVE3 BZ	圣保罗证 券交易所	巴西	60,000	2,206,601.91	2.56
10	Vale SA	-	VALE US	纽约证券 交易所	美国	15,000	1,976,161.20	2.29
11	Sasol Ltd	-	SOL SJ	约翰内斯 堡证券交 易所	南非	7,100	1,908,289.77	2.21
12	Tata Power Co Ltd	-	TPWR IN	印度国家 证券交易 所	印度	150,000	1,898,900.14	2.20
13	China Pacific Insurance (Group) Co Ltd	中国太平 洋保险(集 团)股份有 限公司	2601 HK	香港交易 所	中国香港	80,000	1,858,682.08	2.16

14	China Life Insurance Co Ltd	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	香港交易所	中国香港	88,000	1,805,484.20	2.09
15	China Mobile Ltd	中国移动有限公司	941 HK	香港交易所	中国香港	24,000	1,756,503.22	2.04
16	Banco Bradesco SA	-	BBD US	纽约证券交易所	美国	16,000	1,746,866.16	2.03
17	Sberbank of Russia OJSC	-	SBER LI	伦敦证券交易所	英国	22,000	1,700,856.30	1.97
18	PetroChina Co Ltd	中国石油天然气股份有限公司	857 HK	香港交易所	中国香港	190,000	1,691,789.95	1.96
19	Bank of China Ltd	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港交易所	中国香港	600,000	1,683,518.32	1.95
20	SK Hynix Inc	-	000660 KS	韩国证券交易所	韩国	11,000	1,663,001.54	1.93
21	Lung Yen Life Service Corp	龙岩股份有限公司	5530 TT	台湾证券交易所	中国台湾	80,000	1,619,048.18	1.88
22	China Merchants Bank Co Ltd	招商银行股份有限公司	3968 HK	香港交易所	中国香港	115,000	1,594,720.03	1.85
23	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	-	PKO PW	华沙证券交易所	波兰	21,000	1,573,761.33	1.83
24	Grupo Financiero Banorte SA de CV	-	GFNORTEO MM	墨西哥证券交易所	墨西哥	38,000	1,534,879.80	1.78
25	Far East Horizon Ltd	远东宏信有限公司	3360 HK	香港交易所	中国香港	300,000	1,518,085.89	1.76
26	Housing Development Finance Corp Ltd	-	HDFC IN	印度国家证券交易所	印度	15,000	1,426,283.08	1.65
27	China Life Insurance Co Ltd	中国人寿保险股份有限公司	2823 TT	台湾证券交易所	中国台湾	250,000	1,417,749.41	1.64
28	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	80,000	1,398,066.28	1.62
29	Cosco Pacific Ltd	中远太平洋有限公司	1199 HK	香港交易所	中国香港	150,000	1,342,922.13	1.56

30	Tiger Brands Ltd	-	TBS SJ	约翰内斯堡证券交易所	南非	5,300	1,277,061.67	1.48
31	Tupras-Turkiye Petrol Rafinerileri AS	-	TUPRS TI	伊斯坦布尔证券交易所	土耳其	7,000	1,269,637.89	1.47
32	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	-	LMRT SP	新加坡证券交易所	新加坡	500,000	1,260,702.01	1.46
33	RMB Holdings Ltd	-	RMH SJ	约翰内斯堡证券交易所	南非	40,000	1,206,071.61	1.40
34	Hong Yi Fiber Industry Co	宏益纤维工业股份有限公司	1452 TT	台湾证券交易所	中国台湾	575,000	1,206,006.91	1.40
35	Banco Estado do Rio Grande do Sul SA	-	BRSR6	圣保罗证券交易所	巴西	24,400	1,161,763.01	1.35
36	Korea Aerospace Industries Ltd	-	047810 KS	韩国证券交易所	韩国	7,500	1,138,268.05	1.32
37	Bharat Heavy Electricals Ltd	-	BHEL IN	印度国家证券交易所	印度	40,000	1,047,392.13	1.21
38	Rallis India Ltd	-	RALI IN	印度国家证券交易所	印度	60,000	1,028,004.48	1.19
39	IHH Healthcare Bhd	-	IHH MK	吉隆坡证券交易所	马来西亚	140,000	969,751.11	1.12
40	Sinofert Holdings Ltd	中化化肥控股有限公司	297 HK	香港交易所	中国香港	600,000	914,744.06	1.06
41	United Laboratories Intl Holdings Ltd	联邦制药国际控股有限公司	3933 HK	香港交易所	中国香港	300,000	902,579.91	1.05
42	Johnson Health Tech Co Ltd	乔山健康科技股份有限公司	1736 TT	台湾证券交易所	中国台湾	55,000	880,952.68	1.02
43	BOSCH Ltd	-	BOS IN	印度国家证券交易所	印度	800	873,403.44	1.01
44	PT Summarecon Agung Tbk	-	SMRA IJ	雅加达证券交易所	印度尼西亚	700,000	867,415.30	1.01
45	Taiwan FamilyMart	全家便利	5903 TT	台湾证券	中国台湾	30,000	866,883.42	1.01

	Co Ltd	商店股份有限公司		交易所				
46	China Synthetic Rubber Corp	中国合成橡胶股份有限公司	2104 TT	台湾证券交易所	中国台湾	120,000	846,753.54	0.98
47	Lukoil	-	LKOD LI	伦敦证券交易所	英国	2,000	831,571.65	0.96
48	Oberoi Realty Ltd	-	OBER IN	印度国家证券交易所	印度	25,000	826,413.04	0.96
49	SK Telecom Co Ltd	-	017670 KS	韩国证券交易所	韩国	880	787,907.53	0.91
50	Ascendas India Trust	-	AIT SP	新加坡证券交易所	新加坡	200,000	771,858.37	0.90
51	KGHM Polska Miedz SA	-	KGH PW	华沙证券交易所	波兰	2,000	771,750.30	0.90
52	Compartamos SAB de CV	-	COMPARC* MM	墨西哥证券交易所	墨西哥	85,000	755,774.99	0.88
53	PT Charoen Pokphand Indonesia Tbk	-	CPIN IJ	雅加达证券交易所	印度尼西亚	300,000	714,150.19	0.83
54	Turkiye Garanti Bankasi AS	-	GARAN TI	伊斯坦布尔证券交易所	土耳其	20,000	652,252.26	0.76
55	Amorepacific Corp	-	090430 KS	韩国证券交易所	韩国	90	641,481.19	0.74
56	Shenzhen Intl Holdings Ltd	深圳国际控股有限公司	152 HK	香港交易所	中国香港	800,000	525,491.27	0.61
57	Multi Commodity Exchange of India Ltd	-	MCX IN	印度国家证券交易所	印度	3,000	506,998.59	0.59
58	Koza Altin Isletmeleri AS	-	KOZAL TI	伊斯坦布尔证券交易所	土耳其	1,000	151,440.86	0.18

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）。

## 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	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	1818 HK	4,267,294.87	5.74
2	Cosmax Inc	044820 KS	3,659,112.33	4.92
3	PetroChina Co Ltd	857 HK	3,605,879.41	4.85
4	China Pacific Insurance (Group) Co Ltd	2601 HK	3,390,274.83	4.56
5	Samsung C&T Corp	000830 KS	2,997,705.90	4.03
6	Guangdong Investment Ltd	270 HK	2,962,121.42	3.98
7	Tata Power Co Ltd	TPWR IN	2,448,667.65	3.29
8	Sinofert Holdings Ltd	297 HK	2,424,135.39	3.26
9	Beijing Enterprises Holdings Ltd	392 HK	2,332,489.08	3.14
10	Lung Yen Life Service Corp	5530 TT	2,320,354.31	3.12
11	Cosco Pacific Ltd	1199 HK	2,240,938.45	3.01
12	Evergrande Real Estate Group Ltd	3333 HK	2,214,704.46	2.98
13	China Gas Holdings Ltd	384 HK	2,177,719.71	2.93
14	MRV Engenharia Participacoes SA	MRVE3 BZ	2,154,071.00	2.90
15	Celltrion Inc	068270 KS	2,112,294.16	2.84
16	Koza Altin Isletmeleri AS	KOZAL TI	2,104,941.21	2.83
17	Far East Horizon Ltd	3360 HK	2,095,073.23	2.82
18	Cathay Financial Holding Co Ltd	2882 TT	2,072,044.70	2.79
19	S1 Corp	012750 KS	2,036,157.23	2.74
20	Mining & Metallurgical Co Norilsk Nickel	MNOD LI	2,007,898.46	2.70
21	Ruentex Industries Ltd	2915 TT	1,966,142.40	2.64
22	China Life Insurance Co Ltd	2823 TT	1,938,419.98	2.61
23	Jaiprakash Associates Ltd	JPA IN	1,929,308.77	2.59
24	SK Telecom Co Ltd	017670 KS	1,926,152.82	2.59
25	LG Chem Ltd	051910 KS	1,926,118.95	2.59
26	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd	2318 HK	1,865,306.35	2.51
27	Phoenix Satellite Television Holdings Ltd	2008 HK	1,787,088.50	2.40
28	CITIC Securities Co Ltd	6030 HK	1,740,119.22	2.34
29	China Life Insurance Co Ltd	2628 HK	1,717,952.13	2.31
30	Rallis India Ltd	RALI IN	1,700,893.93	2.29
31	Zijin Mining Group Co Ltd	2899 HK	1,696,508.12	2.28
32	China Mobile Ltd	941 HK	1,656,008.48	2.23
33	Bank of China Ltd	3988 HK	1,641,399.83	2.21

34	Hyundai Heavy Industries Co Ltd	009540 KS	1,617,876.83	2.17
35	Asustek Computer Inc	2357 TT	1,611,106.07	2.17
36	KT & G Corp	033780 KS	1,610,642.53	2.16
37	Catcher Technology Co Ltd	2474 TT	1,575,490.22	2.12
38	PT Summarecon Agung Tbk	SMRA IJ	1,569,365.51	2.11
39	Johnson Health Tech Co Ltd	1736 TT	1,568,583.90	2.11
40	SK Hynix Inc	000660 KS	1,518,027.66	2.04
41	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	2689 HK	1,506,682.81	2.03
42	Tata Global Beverages Ltd	TGBL IN	1,490,051.78	2.00

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	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	1818 HK	4,663,871.59	6.27
2	Beijing Enterprises Holdings Ltd	392 HK	3,242,186.91	4.36
3	Samsung C&T Corp	000830 KS	3,225,989.05	4.34
4	Evergrande Real Estate Group Ltd	3333 HK	3,215,190.73	4.32
5	CITIC Securities Co Ltd	6030 HK	3,109,890.66	4.18
6	Guangdong Investment Ltd	270 HK	3,061,193.92	4.11
7	Cosmax Inc	044820 KS	3,030,397.31	4.07
8	Hengan Intl Group Co Ltd	1044 HK	2,981,128.18	4.01
9	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	2105 TT	2,750,169.07	3.70
10	Koza Altin Isletmeleri AS	KOZAL TI	2,465,429.50	3.31
11	Thai Union Frozen Products Public Co Ltd	TUF/F TB	2,315,998.82	3.11
12	China Gas Holdings Ltd	384 HK	2,276,002.65	3.06
13	Hang Lung Properties Ltd	101 HK	2,208,050.22	2.97
14	DR Reddy's Laboratories Ltd	DRRD IN	2,202,109.79	2.96
15	Hyundai Mobis	012330 KS	2,148,465.00	2.89
16	Celltrion Inc	068270 KS	2,116,515.16	2.84
17	Jaiprakash Associates Ltd	JPA IN	2,105,681.25	2.83
18	KT & G Corp	033780 KS	2,103,357.38	2.83
19	Samsung Life Insurance Co Ltd	032830 KS	2,072,771.42	2.79
20	Zijin Mining Group Co Ltd	2899 HK	2,047,893.22	2.75
21	Johnson Health Tech Co Ltd	1736 TT	1,925,567.48	2.59
22	PetroChina Co Ltd	857 HK	1,924,711.73	2.59
23	LG Chem Ltd	051910 KS	1,890,701.80	2.54
24	Cathay Financial Holding Co Ltd	2882 TT	1,843,030.86	2.48

25	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	2317 TT	1,840,187.65	2.47
26	Charoen Pokphand Foods Public Co Ltd	CPF/F TB	1,808,825.84	2.43
27	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	2689 HK	1,760,522.53	2.37
28	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd	2318 HK	1,742,348.28	2.34
29	Phoenix Satellite Television Holdings Ltd	2008 HK	1,707,186.46	2.29
30	Tata Global Beverages Ltd	TGBL IN	1,696,035.87	2.28
31	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2330 TT	1,686,299.39	2.27
32	Asustek Computer Inc	2357 TT	1,673,010.72	2.25
33	Catcher Technology Co Ltd	2474 TT	1,629,148.93	2.19
34	Sands China Ltd	1928 HK	1,594,198.94	2.14
35	Sinofert Holdings Ltd	297 HK	1,566,607.97	2.11
36	Yung Tay Engineering Co Ltd	1507 TT	1,555,922.11	2.09
37	China Resources Power Holdings Co Ltd	836 HK	1,554,697.92	2.09
38	China Pacific Insurance (Group) Co Ltd	2601 HK	1,553,324.55	2.09
39	Anta Sports Products Ltd	2020 HK	1,542,230.05	2.07
40	OCI Co Ltd	010060 KS	1,536,525.59	2.07

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	163,277,541.85
卖出收入（成交）总额	163,450,253.35

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。

### 8.6 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

### 8.9 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

**8.10 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

**8.11 投资组合报告附注****8.11.1**

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。

**8.11.2**

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。

**8.11.3 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	1,468,893.25
3	应收股利	58,460.67
4	应收利息	1,090.08
5	应收申购款	94,692.89
6	其他应收款	955,521.84
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,578,658.73

**8.11.4 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

**8.11.5 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

**8.11.6 其他需要说明的重要事项**

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。

## § 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
4,113	22,002.53	-	-	90,496,399.68	100.00%

### 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	1,360,415.85	1.5033%

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(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	22,055,370.04
减：本报告期基金总赎回份额	25,512,132.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	90,496,399.68

## § 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：

无。

#### 基金托管人：

2012年11月15日，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管业务部总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2012〕961号）。聘任郑绍平为中国建设银行投资托管业务部副总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2012〕1036号）。

### 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 72,000 元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 2 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

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	238,741,493.72	73.07%	134,049.17	45.93%	-
HSBC Securities Corp Ltd	1	27,805,763.14	8.51%	48,661.78	16.67%	-
Masterlink Securities Corp	1	18,627,062.65	5.70%	32,598.33	11.17%	-
Morgan Stanley Ltd	1	13,831,496.29	4.23%	25,404.87	8.70%	-
Merrill Lynch	1	6,301,725.50	1.93%	12,439.01	4.26%	-
Yuanta Securities Co Ltd	1	5,065,686.55	1.55%	8,865.20	3.04%	-
Goldman Sachs International London	1	4,048,032.71	1.24%	7,406.25	2.54%	-
Citigroup Global Mkts Ltd	1	2,743,604.63	0.84%	5,397.31	1.85%	-
JP Morgan Secs Ltd	1	2,229,047.80	0.68%	3,900.96	1.34%	-
Deutsche Bank AG London	1	2,045,844.50	0.63%	3,886.11	1.33%	-
Credit Suisse Ltd	1	1,934,656.27	0.59%	3,385.65	1.16%	-
Nomura Financial Investment	1	1,901,171.64	0.58%	3,326.95	1.14%	-
Sinopac Securities Corp	1	607,896.40	0.19%	1,063.09	0.36%	-
Samsung Securities Co Ltd	1	479,412.02	0.15%	838.90	0.29%	-
CCB International Securities Ltd	1	364,901.38	0.11%	638.58	0.22%	-

CLSA Ltd	1	-	-	-	-	-
CIMB Securities Pte Ltd	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-

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,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,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、个股分析的研究报及周到的信息服。

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

### 11.8 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.	上投摩根全球新兴股票型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资的公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券时报》和《中国证券报》	2012 年 3 月 30 日
2.	上投摩根全球新兴股票型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资的公告	同上	2012 年 12 月 20 日

### § 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、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,王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

2、2012年11月15日,根据工作需要,中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《上投摩根全球新兴市场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。

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 13.3 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

二〇一三年三月二十九日