

# 上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金（QDII）

## 2021 年第 4 季度报告

### 2021 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年一月二十四日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	上投摩根欧洲动力策略股票（QDII）
基金主代码	006282
交易代码	006282
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 10 月 31 日
报告期末基金份额总额	51,824,156.11 份
投资目标	本基金主要投资于欧洲股票，在严格控制风险的前提下追求超越业绩比较基准的回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将根据欧洲资本市场情况、企业竞争优势等进行综合分析、评估，精选优秀的欧洲企业进行跨市场配置以构建股票投资组合。</p> <p>2、本基金的股票投资策略如下：</p>

	<p>（1）本基金综合考虑不同欧洲地区不同市场的宏观经济环境、增长和通胀背景、不同市场的估值水平和流动性因素、相关公司所处的发展阶段、盈利前景和竞争环境以及其他影响投资组合回报及风险的重要要素将基金资产在欧洲市场之间进行配置。</p> <p>（2）个股选择：从估值、股票质量及趋势三个维度在欧洲上市公司股票中进行筛选，估值方面主要考虑基于市盈率、自由现金流收益率和其他相关价值衡量指标，横向对比选取估值相对便宜的股票；股票质量方面主要考虑企业盈利的可持续性、企业资本的运用配置情况及实际盈利能力，选取拥有可持续利润及严谨的资本管理的盈利公司；股票动能方面，通过每日跟踪公司盈利公告、订单及产品计划，选取正处于正面盈利趋势及正面价格趋势双支撑的股票。除前述三个维度外，本基金还将综合分析企业的财务状况、商业模式以及公司管理层三个方面，从中筛选出优秀的上市公司。</p> <p>（3）投资组合构建：根据上述精选出的个股，结合各项定量和定性指标挑选出最具上涨潜力的标的自下而上构建投资组合。</p> <p>3、其他投资策略：包括债券投资策略、中小企业私募债投资策略、证券公司短期公司债投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准： $90\% \times \text{MSCI 欧洲净收益指数 (MSCI Europe Index (Total Return Net)) 收益率} + 10\% \times \text{税后银行活期存款收益率}$
风险收益特征	本基金属于股票型基金产品，预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

境外投资顾问英文名称	JPMorgan Asset Management(UK) Limited
境外投资顾问中文名称	摩根资产管理（英国）有限公司
境外资产托管人英文名称	The Hong Kong and Shanghai Banking Corporation Limited
境外资产托管人中文名称	香港上海汇丰银行有限公司

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2021年10月1日-2021年12月31日)
1.本期已实现收益	828,746.40
2.本期利润	1,962,901.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.0379
4.期末基金资产净值	66,186,292.79
5.期末基金份额净值	1.2771

注：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。

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 本报告期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	净值增长率①	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	3.04%	0.85%	3.49%	0.78%	-0.45%	0.07%
过去六个月	1.23%	0.83%	2.41%	0.77%	-1.18%	0.06%
过去一年	12.10%	0.81%	12.31%	0.77%	-0.21%	0.04%

过去三年	28.52%	1.07%	36.93%	1.16%	-8.41%	-0.09%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	27.71%	1.04%	30.03%	1.16%	-2.32%	-0.12%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金（QDII）  
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2018年10月31日至2021年12月31日）



注：本基金合同生效日为2018年10月31日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张军	本基金基金经理	2018-10-31	-	18年（金融领域从业经	基金经理张军先生，毕业于上海复旦大学。曾担任上海

	理、投资董事			验 29 年)	<p>国际信托有限公司国际业务部经理，交易部经理。</p> <p>2004年6月加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任交易部总监、投资经理、基金经理、投资组合管理部总监、投资绩效评估总监、国际投资部总监、组合基金投资部总监，现担任投资董事兼高级基金经理。自2008年3月起担任上投摩根亚太优势混合型证券投资基金基金经理，自2012年3月起同时担任上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金基金经理，自2016年12月起同时担任上投摩根全球多元配置证券投资基金基金经理，自2018年10月起同时担任上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金（QDII）基金经理，自2019年7月起同时担任上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）基金经理，自2021年1月起同时担任上投摩根富时发达市场REITs指数型证券投资基金（QDII）基金经理，自2021年6月起同时担任上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金及上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金基金经理，自2021年12月起同时担任上投摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理。</p>
--	--------	--	--	---------	--

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. 张军先生为本基金首任基金经理，其任职日期为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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
张军	公募基金	9	4,894,968,887.23	2008-03-08
	私募资产管理计划	1	154,985,323.00	2021-07-09
	其他组合	-	-	-
	合计	10	5,049,954,210.23	

#### 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
Blake Crawford	摩根资产管理(英国)执行董事, 摩根资产管理国际股票团队中不受限投资组合子团队的投资经理	13年	Blake Crawford, 执行董事, 是摩根资产管理国际股票团队的投资经理。在2008年作为管理培训生加入公司 Blake 拥有巴斯大学的经济学学士学位, 同时也是特许金融分析师。
Alexander Whyte	摩根资产管理(英国)副总裁, 摩根资产管理国际股票团队中不受限投资组合子团队的投资经理	8年	Alexander Whyte, 副总裁, 是摩根资产管理国际股票团队的投资经理。Alex 自2013年就以管理培训生的身份加入公司。Alex 拥有剑桥大学的机械工程学士学位和硕士学位, 并且是特许金融分析师。
Victoria Helvert	摩根资产管理(英国)副总裁, 摩根资产管理国际股票团队助理投资经理	8年	Victoria Helvert, 副总裁, 是摩根资产管理国际股票团队的助理投资经理。Victoria 自2013年就以管理培训生的身份加入公司。Victoria 拥有杜伦大学的经济学学士学位, 并且是英格兰及威尔士特许会计师(ACA)。

#### 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。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金(QDII)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: 本基金曾出现个别由于市场原因引起的投资组合的投资指标被动偏离相关比例要求的情形, 但已在规定时间内调整完毕。

#### 4.4 公平交易专项说明

#### 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。

对于交易所市场投资活动，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；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，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收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，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，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的分析，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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：无。

### 4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

欧洲股市在本报告期内的表现呈现10月上涨、11月下跌、12月震荡反弹的走势。股价在10月份自上季度末的下跌后回升，原因是市场对企业盈利的乐观情绪和令人鼓舞的经济数据。然而，供应链问题的扩大继续打压投资者的情绪。欧元区企业活动增长放缓至6个月低点，10月综合采购经理人指数（PMI）从56.2降至54.3，主要原因是制造业大幅下滑。虽然整体经济增长率目前仍高于长期平均水平，但由于疫情继续扰乱经济并推高物价，短期内经济增长面临下行风险。与此同时，随着企业提高产能以满足需求，就业增长加速至2021年来最高水平。据初步估计，欧元区第三季度经济扩张2.2%，略高于市场预期的2.0%。尽管供应链中断、原材料短缺和消费价格上涨，但强劲的国内需求和出口仍是经济增长的主要支撑因素。在欧元区最大的经济体中，法国的扩张速度最快，其次是意大利、西班牙和德国。与此同时，欧元区年通胀率从9月份的3.4%跃升至10月份的4.1%，达到2008年年中的水



平。然而，欧洲央行再次维持货币政策不变。英国的消费者物价指数（CPI）在截至11月份的12个月里飙升了5.1%，达到近十年新高。劳动力市场依然强劲，11月份失业率降至4.2%，工业生产在各个行业都出现了广泛的复苏。随着英国央行（BoE）对工资上涨压力越来越警惕，短期内加息看起来可行。原油价格在10月份继续上涨，创下多年新高，而天然气和煤炭供应出现短缺。股价表现方面，10月涨幅最大的板块是科技半导体、公用事业和金融服务，只有电信板块涨幅落后。

欧洲股市在11月份出现负回报，因为波动主导了投资者情绪，原因是出现了新的新冠病毒株奥密克戎，加上新病例不断增加，导致整个地区引入了新的人员流动限制举措。市场担心奥密克戎变异是否会显著降低现有疫苗的有效性，这是未来几周需要监测的关键问题。在新冠疫情的担忧上升之前，经济方面出现了令人鼓舞的迹象。11月欧元区综合采购经理人指数（PMI）从54.2升至55.8，显示经济复苏正在发挥作用。新业务订单的流入以更快的速度增长，就业高速增长，而由于持续的限制，积压的工作以更高的速度增加。与此同时，整个欧盟新增新型冠状病毒肺炎病例有所回升，政府通过引入人员流动限制以遏制疫情蔓延的应对措施，导致消费者和企业信心明显下降。此外，成本压力和供应链问题仍然是阻碍因素。欧洲央行（ECB）在货币政策方面继续坚持其“通胀是短暂的”的观点，尽管欧元区11月的年通胀率从4.1%加速至4.9%。此外，欧洲央行行长拉加德重申，由于中期通胀前景依然低迷，欧洲央行明年不太可能加息。与此同时，美联储主席鲍威尔发表鹰派证词，敦促加快缩减购债规模。在英国，在强劲的市场环境支撑下，新商业订单流入连续第10个月上升。尽管面临全球供应链相关瓶颈和严重的员工短缺，英国11月制造业采购经理人指数升至58.1的3个月高点。英国央行（BoE）表示未来几个月将适度收紧货币政策，在截至10月的12个月中，英国央行的利率从9月的3.1%飙升至4.2%。与此同时，在没有政府休假计划的情况下，劳动力市场继续走强，因为企业继续在圣诞节前招聘，以满足不断增长的需求。由于新出现的奥密克戎变体再度实施旅行限制，油价从去年10月触及的高点回落。由于担心新的新冠疫情，以及企业和消费者士气高涨，欧元兑美元汇率进一步贬值，触及2020年7月以来的最低水平。在股市中，当月上涨的板块只有零售、建筑建筑和房地产，而银行、石油、运输服务和交易板块涨幅最大。

美联储（FED）在十二月的会议上宣布，计划在2022年春季而非夏季之前停止购买新债券。这种更快的购买缩减为美联储在明年比原先预期更早加息提供了选择，而美联储点阵图显示，委员会预计明年将加息三次。从通胀和劳动力市场来看，美联储和市场预期的转变似乎不无道理。11月份，美国整体通胀率为6.8%，近9个月来一直高于目标水平，通胀压

力扩大，失业率回落至 4.2%，美联储预计失业率在 2022 年底将达到 3.5%。显然，奥密克戎变种是可能阻止美联储明年实施三次加息的关键风险。

展望未来，尽管全球经济增长势头可能已在第二季度见顶，但强劲的经济数据、政策支持 and 疫苗的成功推出继续推动基本面向好。虽然新的变种奥密克戎令人担忧，并将造成破坏，但广泛的疫苗推广和更好的治疗使我们更有信心，结果将没有我们在 2020 年观察到的那么严重。然而还有很多我们不知道的事情，我们将非常仔细地监控新发布的数据。随着需求的激增和生产率的飙升，整个欧洲的盈利增长将十分强劲，这将继续提高企业的盈利能力。供应链需要继续逐步稳定，从而在中期内缓和通货膨胀上升的影响。

对股市的风险在于各国央行将如何应对经济增长和通胀可能出现的进一步上行意外。各国央行的目标是缩减债券购买规模，同时对新冠变体对经济的影响保持警惕。尽管各国央行认为目前的通胀是“暂时的”，但我们可以预期，未来几个月，政策正常化周期将开始展开。

尽管每一场危机都是不同的，但展望未来五年，我们预计盈利增长将是可观的，与全球金融危机后的反弹并没有太大的不同。一直处于风暴中心的周期性调整的市场、行业和企业可能会从中受益，但随着复苏的形成，区分周期性与结构性逆风和顺风至关重要。尽管这在很大程度上已被消化，但历史经验表明，经济反弹带来的增长潜力往往被低估。我们认为，在通胀温和上升的环境下，股票应该会表现良好，因为销售上升往往会抵消投入价格上涨的影响，而投入价格上涨在需求强劲时可能会转嫁给客户。经济增长疲弱而通胀强劲的环境，才可能会对金融资产回报造成相当大的损害。总体而言，今年迄今股市表现强劲，尽管我们不会对股市出现一些波动感到意外，但我们相信，强劲的经济增长，加上相对宽松的货币政策，将为股市提供支撑。

本报告期欧洲动力策略股票份额净值增长率为:3.04%，同期业绩比较基准收益率为:3.49%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)

1	权益投资	60,869,261.91	89.77
	其中：普通股	59,067,896.14	87.11
	存托凭证	-	-
	优先股	1,287,679.19	1.90
	房地产信托	513,686.58	0.76
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	6,509,431.68	9.60
8	其他各项资产	427,321.87	0.63
9	合计	67,806,015.46	100.00

## 5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
英国	13,398,650.15	20.24
瑞士	10,400,823.67	15.71
法国	10,211,182.54	15.43
德国	8,821,475.11	13.33
荷兰	5,453,701.83	8.24
丹麦	1,954,165.95	2.95
瑞典	1,838,061.80	2.78

意大利	1,682,281.79	2.54
奥地利	1,527,190.36	2.31
爱尔兰	1,300,623.32	1.97
西班牙	1,255,169.98	1.90
比利时	1,078,316.92	1.63
芬兰	993,799.28	1.50
挪威	953,819.21	1.44
合计	60,869,261.91	91.97

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。

### 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
制药	6,406,689.61	9.68
商业银行	6,239,110.43	9.43
保险	4,395,625.61	6.64
石油、天然气与消费用燃料	3,617,853.68	5.47
纺织品、服装与奢侈品	3,337,110.02	5.04
食品	3,199,435.74	4.83
机械制造	2,771,135.73	4.19
半导体产品与设备	2,335,154.50	3.53
资本市场	2,020,817.46	3.05
汽车	1,862,705.49	2.81
信息技术服务	1,801,159.42	2.72
食品与主要用品零售	1,506,424.63	2.28
化学制品	1,288,450.56	1.95
多元化零售	1,201,053.76	1.81
专业服务	1,155,224.18	1.75
贸易公司与经销商	1,115,943.69	1.69
电气设备	1,077,019.68	1.63
工业集团企业	1,067,030.07	1.61
航空货运与物流	1,047,430.68	1.58
通信设备	1,035,480.79	1.56
复合型公用事业	1,001,520.77	1.51
航空航天与国防	913,417.38	1.38
家庭耐用消费品	885,711.39	1.34
经销商	872,598.43	1.32
软件	765,191.34	1.16
建筑产品	764,214.55	1.15
金属与采矿	737,204.27	1.11

综合电信业务	668,428.70	1.01
饮料	618,773.84	0.93
个人用品	583,989.26	0.88
专营零售	528,664.39	0.80
股权房地产投资信托 (REITs)	513,686.58	0.78
互动媒体与服务	415,305.27	0.63
建筑材料	401,594.37	0.61
医疗保健设备与用品	354,633.11	0.54
建筑与工程	333,346.53	0.50
容器与包装	326,640.60	0.49
汽车零配件	325,737.05	0.49
独立电力生产商与能源贸易 商	325,071.04	0.49
媒体	307,210.61	0.46
电子设备、仪器和元件	301,432.32	0.46
互助储蓄银行与抵押贷款	224,295.69	0.34
综合金融服务	219,738.69	0.33
合计	60,869,261.91	91.97

注：行业分类标准：MSCI

## 5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	NESTLE SA-REG	雀巢	NESN SW	SIX 瑞士	瑞士	3,305.00	2,938,889.76	4.44
2	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEI	罗氏	ROG SW	SIX 瑞士	瑞士	928.00	2,454,753.17	3.71

	N							
3	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	轩尼 诗一 路 易· 威登 集团	MC FP	巴黎 泛欧 证券 交易 所	法国	310.00	1,627,103.7 9	2.46
4	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	-	AD NA	阿姆 斯特 丹泛 欧证 券交 易所	荷兰	6,924.00	1,506,424.6 3	2.28
5	TOTALENERGIES SE	道达 尔	TTE FP	巴黎 泛欧 证券 交易 所	法国	3,834.00	1,235,373.1 2	1.87
6	BP PLC	英国 石油 公司	BP/ LN	伦敦 证券 交易 所	英国	42,502.0 0	1,208,933.3 5	1.83
7	ALLIANZ SE-REG	安联 保险	ALV GY	Xetr a	德国	791.00	1,185,844.0 3	1.79
8	NOVO NORDISK A/S-B	诺和 诺德	NOVO B DC	哥本 哈根 证券 交易 所	丹麦	1,658.00	1,183,365.7 0	1.79
9	NOVARTIS AG-REG	诺华	NOVN SW	SIX 瑞士	瑞士	2,111.00	1,182,501.4 1	1.79
10	ASML HOLDING NV	阿斯 麦	ASML NA	阿姆 斯特 丹泛 欧证 券交 易所	荷兰	229.00	1,168,395.1 0	1.77

### 5.5 报告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。

**5.6 报告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。

**5.7 报告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。

**5.8 报告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。

**5.9 报告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。

**5.10 投资组合报告附注**

5.10.1 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

**5.10.3 其他资产构成**

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	47,180.06
3	应收股利	20,401.73
4	应收利息	394.05
5	应收申购款	312,180.12
6	其他应收款	47,165.91
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	427,321.87

#### 5.10.4 报告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。

#### 5.10.5 报告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。

#### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	51,511,610.26
报告期期间基金总申购份额	11,452,140.54
减：报告期期间基金总赎回份额	11,139,594.69
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	51,824,156.11

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

### §8 备查文件目录

#### 8.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金（QDII）募集注册的文件；



2. 《上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金（QDII）基金合同》；
3. 《上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金（QDII）托管协议》；
4. 《上投摩根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。

## 8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

## 8.3 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。

上投摩根基金管理有限公司

二〇二二年一月二十四日