

§1 重要提示

1. 重要提示 基金管理人的董事会,董事保证本报告所载於料不存止整記记载,误导性除法或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个规及生物的法律任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字用意,并由董事长发先。基金任管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月20日复庆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,改资组合报告等内容。保证复核内容不存在企囊过滤,误导性陈注或者置大遗漏。基金管理人来混为诚实信用。遗憾专用的规则管理和证用基金数字。但不保证基金一定盈利。基金的过往处避并不代表技术来表现。投资有效是,投资者在作出投资效率前应任何期间未本基金的招募说明书及其更新。本基金的基金条件自2018年7月21日后由上投资模型企工优势规定的企业等发展基金。但不是成本金的招募说明书及其更新。

不可認可。 本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。 本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

2.1基金基本情况		3.2 為(金)同分「		
基金简称		上投摩根亚太优势混合(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		8,171,380,093.39(/)		
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全会 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		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、 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。		

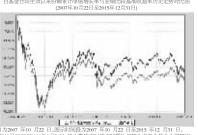
2.3 基金管理人和基金托管人		<u> </u>	·		
风险收益特征	本基金的总统性较基准为。增根原用的综合亚式指数(不合日本)(MSCIAC Asia Pacific Index ex Ispan)。 本基金为区域性混合型证券投资基金、基金投资风险收益水平低于投资型基金。高于债券型基金和平衡型基金。 投资国家与地区市场的分散、风险低于投资中一市场的混合度基金。				
业绩比较基准					
投资策略	展格局 行业与 个股成 优化的	下,通过自上而下分析,甄别不同国家与地区、行业 板块的基本布局,并从中初步筛选出具有国际比较 长性指标分析,挖掘拥有更佳成长特性的公司,构级	。并强调公司品质与成长性的结合。首先在亚大地区经济水与政族权资和《会首先考虑国家与地区的资产管置。 与政族权资和《会首先考虑国家与地区的资产管置。 民族的人会监查公司,同时采取自下而上的会股策略,并重 起来长型公司股票池。最后通过深入的相对价值评估,形式 坚持安全性,流动性和收益性为资产配置原则,并结合现金		
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、韩阳香港、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。			

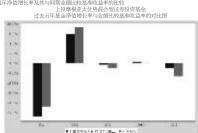
2.3 基金管理人和	基金托管人			
项	B	基金管理人		基金托管人
名称		上投摩根基金管理有限公司		中国工商银行股份有限公司
	姓名	胡迪		洪渊
信息披露负责人	联系电话	021-38794888		010-66105799
	电子邮箱	services@cifm.com		custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-4888		95588
传真		021-20628400		010-66105798
2.4 境外投资顾问	同和境外资产托管人		•	
项目		境外投资顾问		境外资产托管人
英文 IF Asset Managemen		Limited	The I	Bank of New York Mellon Company

WENT THE BEAR IN HEALTHCAN		72	8世日注入(38世) [日入日997]	25/01/21	
3.1 主要会计数据和财务指标	§ 3	主要财务指标、	16金净值表现及利润分配	情况	
3.4 I.R.Z.FI KARIBARA JIBAR					金额单位:人民
3.1.1 期间数据和指标		2015年	2014年		2013年
本期已实现收益		563,294,091.2	21 21	6,093,424.34	41,155,429.
本期利润		32,098,610.8	33 7.	5,427,293.43	-86,714,341
加权平均基金份额本期利润		0.003	12	0.0048	-0.00
本期基金份额净值增长率		-2.58	%	0.69%	-0.6
3.1.2 期末数据和指标		2015年末	2014年末		2013年末

阶段	份额净值增长率 ①	份額净值增长率标准 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	4.43%	1.08%	6.83%	1.22%	-2.40%	-0.14%
过去六个月	-8.12%	1.33%	-8.23%	1.35%	0.11%	-0.02%
过去一年	-2.58%	1.10%	-6.58%	1.10%	4.00%	0.00%
过去三年	-4.87%	0.98%	-12.10%	0.97%	7.23%	0.01%
过去五年	11.86%	0.90%	3.78%	0.86%	8.08%	0.04%
自基金合同生效起至今	-43.40%	1.47%	-36.22%	1.51%	-7.18%	-0.04%

米森並が創業打守旧が哲学・安切及其一同別定頭に水体的配益半安切的比较 上投摩根亚太优势混合型证券投资基金 自基金合同生效以来份额累计净值增长率与19動化较基準收益率历史走势对比图 (2007年10月22日至2015年12月31日)





投聯報整金報动灵活配置指令型运转投资基金。上投聯報动态多因子葡酪灵活配置证券投资基金、上投聯報智慧 上投聯報料技商消失J流電器混合型近券投资基金、上投聯報新火服务股票型证券投资基金、上投聯報医疗健康投 辦教文体体和灵活能置混合型证券投资基金。

基金基金 张军 王邦祺

双成果全贝芸的授权限制。基金投资比例符合基金合同和法律法理的要求。 本报告期外中国证监会上海监管局对公司进行了常规全面现场检查。就公司内部控制提出了相应改进意见并采取费令改正的行政监管 公司已经检理要求定定了改正了。 4.4管理人均根告期你公平交易情况的专项说明

易价差进行分析,并留存和设备查。 4.4.2个平交易则度的执行指示 格声响,公司严格执行上述公平交易制度和控制,不是不同的监控分析,公司未发现整体公平交易执行纠误异常的情况。 在之间间向收入局和反向交易的交换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纠误异常的情况。 其中,在同时交易的监定和分析方面。根据注视要求,公司水不同股党组合的同日和临近交易目的同同交易行为进行起处,通过更加 查施途的间向交易行为。定性分析交易形机,以社不同核党组合长、期的交易趋势。重点决定任何可能实现不公平交易的情况。对于规则的异常情况。由此关键领组合经理并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建筑时个季度可不同投资组合在不可能问题的,以其间交易价格与位的交易效发出比分析。 经验证金额上发现间交易价格与位的交易效发出比分析。 报告期内,通过前途分析方法,未发现不同投资组合之间间向交易价差异价的情况。 4.4.3常符交易行为的生现记

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,所贷股份全参与的交易所公开竞价司口反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形,报告期内,所 投资组合参与的交易所公开竞价同口反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为两次,均发生在纯量化投资组

的各中印图。 回顾2015年,我们针对美元升值以及美国经济回升的长期趋势进行调整。加大东北亚市场外销版块的配置,这包括了中国。韩国与合湾市场的科技与工业成块。因应人民币国际依的趋势,我们关注了重点市场的金融成块。这包括了中国与东南亚市场名定主要的银行授与保险是,患后因这季年化的趋势,我们把位了印度与印度但亚亚两个身有人也工作的年节场形。也加强了中国市场民作政块的起置。此外,我们判断中国资本未来全面进入世界体系,这个进程将随着一带一路战略的推动而逐步前进,因此我们也对东南亚市场可能受惠成块给予较多的

上投摩根亚太优势混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

市场的转变。第三,亚太市场的消费升级需求,如化妆品与奢侈品的升级,如高端医疗与保险养老的需要。第四,我们也看好部分新科技发展 所开发出的新应用,如电动车、机械人、新能源以及互联网,这会有很多投资和会。以上这四个投资趋势,将是2016年上半年本基金重点关注的

72.在旧時期出升。如是如于人机聚人。兩面網以及且與時,這至有很多大致的反流,以口為至了教育起身,特定如时于上于平平本並並無点大注的。
4.7 管理人材报告期内基金估值程序等事项的说明
4.7 管理人材报告期内基金估值程序等事项的说明
4.7 管理人材报告期内基金估值程序等事项的说明
表绘词的基金估值和会计核真由基金共和成立。根据相关的法律法规矩定,基金合同的约定,制定了内部控制措施。对基金估值和会 线膜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真的准确性。基金会计部人员与具备基金人业资格和相关工作
未公司成立了信息要是《新程》、基金会社是从自然管理等与有的负责人以及基金经理,所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会估估值事项发表意见,评估基金估值的公允性和合理
基金经理是估位委员会的重要或员。参加信值委员会会义。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。
4.4 管理人对报告期内基金和铜分配情况的识明
4.4 特理人报告期内基金和铜分配情况的识明
4.4 特定相对编令是未被解明务是。
4.4 报告期内基金表的同分配情况的识明
5.5 未被告期本基金来接着到的是是一个发展。

5. 托管人报告
1. 报告期内本基金托管人遭废乎信情况声明
5. 托管人报告
2. 报告期内。本基金托管人遭废乎信情况声明
4. 不报电时内。本基金行客人遭废乎信情况声明
4. 不报电时内。本基金行客人在对土投掌模亚火优势混合型证券投资基金好任管过程中,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。不存在任何期常基金份额持有人利益的行为。完全年职尽费地履行了基金社管人尽户的义务。
2. 托管人对报告期内本基金投资企准遗址等。企由任用,利用公营特估的规定,并经申时,上投摩根亚大优势混合型证券投资基金的投资运程。本金资产净临时程,基金份额申请权的依付事。基金房里用于支守间里。一个存在任何期等基金份额持有人利益的行为。在各里要方面的运作严格按废基金会的所规定是了。本任告期内,上投摩根亚大优势混合型证券投资基金未进行利用分配。
3. 托管人权本年度设计中地外各位高等均等成实。准确的运营发表意识。
本任官人权法对上投降根金企管理机及公司编制报政案,准确的运营发表意识。
4. 不同人依法对上投降根金企管理机及公司编制报政器的上投摩根亚大优势混合型证券投资基金加5年年度报告中财务指标,净值表现,例则的分配价。对参与保存、投资组合投资等进行,有。可以中等基本、确由证金。
2. 上投降根亚大优势混合型证券投资基金加5年度财务会计划在1200年度,每日中市场全局工作,该上的专员工作。第一日中市场全局工作,该上的专员工作,是一个专人工作,该上的专员工作,该上的专员工作,该上的专员工作,该上的专员工作,该上的专员工作,该上的专员工作,该是一个专人工作,该是一个专人工作,该是一个专人工作,该是一个专人工作,这一个专人工作,这一个专人工作,这一个专人工作,这一个专人工作,这一个专人工作,这一个专人工作,这一个专人工作,这一个专人工作,这一个专人工作,这一个专人工作,这一个专人工作,这一个工作,这

7.1 资产负债表 会计主体:上投摩根亚太优势混合型证券投资基金 报告截止日:2015年12月31日

			単位:人民市
资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:		-	-
银行存款	7.4.7.1	266,890,850.14	493,756,853.72
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	4,375,237,446.38	7,366,993,101.49
其中:股票投资		4,363,157,000.88	7,366,993,101.49
基金投资		12,080,445.50	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买人返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,968,458.44	33,735,528.66
应收利息	7.4.7.5	24,773.26	65,761.81
应收股利		745,037.71	2,705,304.42
应收申购款		62,824.29	295,491.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	10,120,736.83	5,590.44
资产总计		4,657,050,127.05	7,897,557,631.59
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6,384,360.71	21,057,414.62
应付赎回款		15,844,054.99	57,978,737.96
应付管理人报酬		7,063,721.84	12,959,414.06
应付托管费		1,373,501.48	2,519,886.07
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	7.4.14(1)(a)	522,910.69	-
其他负债	7.4.7.8	4,823,310.74	487,014.64
负债合计		36,011,860.45	95,002,467.35
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.9	8,171,380,093.39	13,422,752,840.68
未分配利润	7.4.7.10	-3,550,341,826.79	-5,620,197,676.44
所有者权益合计		4,621,038,266.60	7,802,555,164.24
负债和所有者权益总计		4,657,050,127.05	7,897,557,631.59
	1		

			单位:人民币
項目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31 日
一、收入		199,417,493.28	306,866,505.22
1.利息收人		1,182,433.32	2,412,620.67
其中:存款利息收入	7.4.7.11	1,182,433.32	1,997,397.99
债券利息收人		-	-
资产支持证券利息收人		-	-
买人返售金融资产收人		-	-
其他利息收入		-	415,222.68
2投资收益(损失以"-"填列)		683,439,025.96	447,188,321.33
其中:股票投资收益	7.4.7.12	586,105,367.09	262,825,673.33
基金投资收益	7.4.7.13	-98,517.40	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	97,432,176.27	184,362,648.00
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	-531,195,480.38	-140,666,130.91
4.汇兑收益(损失以"—"号填列)		45,914,823.51	-2,101,781.80
5.其他收人(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	76,690.87	33,475.93
减:二、费用		166,079,535.78	236,744,652.13
 管理人报酬 		105,636,349.94	164,035,068.71
2. 托管费		20,540,401.40	31,895,707.83
3. 销售服务费		-	-
 交易費用 	7.4.7.19	39,175,703.16	40,151,767.20
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	727,081.28	662,108.39
三、利润总额(亏损总额以"="号填列)		33,337,957.50	70,121,853.09
减:所得税费用	7.4.14(1)(d)	1,239,346.67	-5,305,440.34
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		32,098,610.83	75,427,293.43

			中亚:人民田	
项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	
一、期初所有者权益(基金净值)	13,422,752,840.68	-5,620,197,676.44	7,802,555,164.24	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	32,098,610.83	32,098,610.83	
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)	-5,251,372,747.29	2,037,757,238.82	-3,213,615,508.47	
其中:1.基金申购款	157,778,900.86	-60,345,033.22	97,433,867.64	
2.基金赎回款	-5,409,151,648.15	2,098,102,272.04	-3,311,049,376.11	
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)	8,171,380,093.39	-3,550,341,826.79	4,621,038,266.60	
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	17,279,479,756.91	-7,303,505,868.96	9,975,973,887.95	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	75,427,293.43	75,427,293.43	
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)	-3,856,726,916.23	1,607,880,899.09	-2,248,846,017.14	
其中:1.基金申购款	62,893,555.25	-26,550,207.66	36,343,347.59	
2.基金赎回款	-3,919,620,471.48	1,634,431,106.75	-2,285,189,364.73	
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)	13,422,752,840.68	-5,620,197,676.44	7,802,555,164.24	

7.4 报表创注
7.4 报表创注
7.4 报表处本情况
7.4 报表处本情况
7.4 报表处本情况
7.4 报表处本情况
7.4 报表处本情况
7.4 报告处本情况
7.4 报告处本情况
7.4 报告处本情况
7.4 报告处本情况
7.4 现货机 1.4 证 1.4 证

行题的企业指数(不含日本)。 以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2016年3月25日批准报出。 。本财务报志由本基金的基金管理人上投票模基金管理有限公司于2016年3月25日批准银出、 人名全计程表的编纂结构。 本基金的财务报表按照财政部于2006年2月5日及以后期则领布的(企业会计编则)。表现具体会计编则及其他相关规定(以 本基金的财务报表按照财政部于2006年2月5日及以后期则领布的(企业会计编则)。本理报告和半年度报告》、中国证券股份基金业协 以下海豚、中国基金业协会)领师的(证券投资基金会计核效业务部门)、《上经增根亚水达劳报合量证券投资基金基金台司》和在财务 规则注27.41所列示约中国证金会 中国基金业协会发布的有关规定及合作的基金行业关系操作编制。 7.31通信企业会计划规则及连修关键定的判明 本基金。2015年度财务股政符合企会计值的资业、再实定整定股广方基金。2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果 基金净和发金油的采用的全计设策。会计估计与最近一期年度报告相一致的设明 本基金本报告期采用的会计按策。会计估计与最近一期年度报告相一致。 7.44本股份期诉求用的会计按策。会计估计与最近一期年度报告相一致。 7.45会计论实理以及差值更正的说明 本基金本股告期未发生会计按策度更

.45.2会计估计变更的说明 L集会本报告期未发生会计估计变更。

4.6税项 提開技能。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 的通知)及其他附近境内外免务法原取完务操作。主要税项仍实如下。 以近行基金方式条款债金不属于竞级税政党部,不成败营业税。 自由涨金款销的源自建价的差价收入,其及及的境外所得税税收取策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行。在境内不予征收 且银矿不振论企业所得税。

(4) 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

人所得税和企业所得税。 7.4.7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("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 Company, "纽约梅隆银行")	境外资产托管人
上海国际信托有限公司("上海信托")	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
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
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
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
F资产管理有限公司	境外投资顺问
J.P. Morgan Chase & Co.	与境外投资顺问存在控制关系的机构
I.P. Morgan Asset Management Holdings Inc.	与境外投资顺问存在控制关系的机构
I.P. Morgan Asset Management (Asia) Inc.	与境外投资顺问存在控制关系的机构
ID Manager SCS Investment (CD) Limited	甘本等面上的职业案组改本等面/美国/专图公司控制的公司

		単位:人氏巾
項目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	105,636,349.94	164,035,068.71
其中:支付销售机构的客户维护费	12,043,020.56	21,767,046.33
注:本基金按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费 直日)的管理人报酬,逐日累计至每月月底,按月支付给基金 日管理人报酬。任值日尚未让据当日管理人报酬及托管	金管理人上投摩根。其计算公式为:	

項目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	20,540,401.40	31,895,707.83
注:本基金按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费		上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含
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		

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况.

元。 7.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收人

			平亚:人民
			可比期间 至2014年12月31日
期末余額	当期利息收入	期末余額	当期利息收人
129,597,520.14	1,182,433.32	270,223,284.31	1,997,268.65
137,293,330.00	-	223,533,569.41	-
266,890,850.14	1,182,433.32	493,756,853.72	1,997,268.65
	2015年1月1日至2 期末余額 129,597,520.14 137,293,330.00	129,597,520.14 1,182,433.32 137,293,330.00 -	2013年1月1日至2013年12月31日 2014年1月1日 期末会額 当期利息收入 期末余額 129.97,530.14 1,182,433.32 270,223,284.31 137,293,330.00 - 223,333,599.41

无。 748.7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用的其他关联交易事项 7.4.9期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

无。 74.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事項 (1) 于2015年12月31日,本财务报表中列示的递延所得税负债和所得税费用均与本基金的印度市场股票投资相关。本基金投资于印度

		2015年1	2月31日		2014年12月31日			
	递延所得税的	£)**	可抵扣暂时性差异	遊	正所得税资产	可抵扣暂时性差异		
未实现资本损失	-	-	-	-		-		
			(b) 递延所得税负	资				
		2015年1	2月31日		2014年	□12月31日		
	递延所得税位	价	应纳税暂时性差异	遊	正所得税负债	应纳税暂时性差异		
未实现资本利得	522,910.69	3	3,021,906.42	-		-		
(c) 抵销后的递延	所得税资产和递延所得	早税负债净	额列示如下:					
		2015年12月31日		2014年12月31日				
递延所得税负债净额		522,910.69			-			
(d) 所得税费用								
Ij	(E	本期 2015年度			上年度可比期间 2014年度			
当期所得税费用		811,328.74	1		-5,305,440.34			
递延所得税费用		428,017.93			-			
É	rit	1,239,346.67			-5,305,440.34			
应纳税所得项目及	相应的当期所得税费用	分析如下:						
IJ	(E	本期 2015年度						
					纳税所得。 当期所			
印度市场股票投资		4,995,678.61 811,328.74						
				上年度7 2014				
		应纳税所	FF.		当期所得税费用			
印度市场股票投资		_			-5.305.440.34			

□ 5.305,440.34

○ 公全价值
○ 公全价值
○ 公全价值
○ 公全价值
○ 公金价值
○ 公金仓值

大。 (6) 非持续的以公允价值计量的金融工具 于2015年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014年12月31日;同)。

于2015年12月31日,不盈金水持申1时对57500公众几0.1841年12月6日 (6) 不以公允价值计量价金施工员。 不以公允价值计量价金施资产和负债主要包括应收款项和其他金施负债,其聚而价值与公允价值相差很小。 (3) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其值重要事项。 \$8投资组合报告

8.1期末基金资产组合情况

序号	项目	金額	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,363,157,000.88	93.69
	其中:普通股	4,053,993,743.57	87.05
	存托凭证	309,163,257.31	6.64
	优先股	_	_
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	12,080,445.50	0.26
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	买人返售金融资产	-	-
	其中:买斯式回购的买人返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	266,890,850.14	5.73
8	其他各项资产	14,921,830.53	0.32
9	合计	4,657,050,127.05	100.00

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
商业银行	606,998,660.86	13.14
互联网软件与服务	429,578,893.05	9.30
保险	379,243,586.27	8.21
半导体产品与设备	338,103,852.83	7.32
电脑与外围设备	257,365,861.31	5.57
制药	173,636,328.74	3.76
石油、天然气与消费用燃料	156,187,542.74	3.38
房地产管理和开发	153,075,463.16	3.31
综合金融服务	141,802,930.84	3.07
食品	129,981,144.26	2.81
建筑与工程	122,152,468.31	2.64
工业集团企业	112,616,649.61	2.44
化学制品	101,138,006.93	2.19
烟草	92,595,618.12	2.00
个人用品	91,709,535.65	1.98
机械制造	87,522,795.98	1.89
金属与采矿	82,987,161.33	1.80
电子设备、仪器和元件	80,078,775.91	1.73
水公用事业	75,379,339.28	1.63
互助储蓄银行与抵押信贷	74,426,410.22	1.61
互联网与售货目录零售	69,670,593.71	1.51
建筑材料	68,231,571.03	1.48
电力公用事业	68,169,795.69	1.48
信息技术服务	59,797,559.43	1.29
纺织品、服装与奢侈品	59,607,491.11	1.29
综合电信业务	53,534,896.00	1.10
公路与铁路	51,418,915.06	1.11
交通基本设施	46,015,867.38	1.00
医疗保健提供商与服务	40,295,446.30	0.83
商业服务与商业用品	39,677,093.24	0.86
无线电信业务	39,291,882.00	0.85
航空航天与国防	19,225,543.00	0.42
燃气公用事业	15,339,039.35	0.33
海运	15,098,014.59	0.33
酒店、餐馆与休闲	14,608,931.17	0.33
食品与主要用品零售	10,447,466.12	0.23
独立电力生产商与能源贸易商	6,145,870.30	0.13
合计	4,363,157,000.88	94.42

注:行业分类标准:MSCI 8.4指数投资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

0.1100	DE DOMENTA DE COMPANSAR DE COMP	managa (2 1 m / 2	1 APAMELA	.54.74244			金额单位:	人民币
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	占金产值例 (%)
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	中田香港	3,148,500.00	402,256, 925.33	8.70
2	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	中田香港	5,141,500.00	185,220, 172.41	4.01
Taiwan Sei	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co	_	2330 TT	台湾证券交易所	中国台湾	5,819,000.00	164,503, 149.52	3.56
	Lid		TSM US	纽约证券交易所	美国	94,251.00	13,923,643.68	0.30
4	AIA Group Ltd	友邦保险控股有限公司	1299 HK	香港证券交易所	中国香港	4,538,800.00	177,197, 239.27	3.83
5	Samsung Electronics Co Ltd	三星电子有限公司	005930 KS	韩国证券交易所	韩田	19,000.00	132,580, 089.58	2.87
6	Catcher Technology Co Ltd	-	2474 TT	台湾证券交易所	中国台湾	2,287,000.00	124,785, 771.73	2.70
7	KB Financial Group Inc	-	105560 KS	韩国证券交易所	韩田	600,000.00	110,151, 127.05	2.38
8	Lotte Chemical Corp	-	011170 KS	韩国证券交易所	韩田	75,000.00	101,138, 006.93	2.19
9	CK Hutchison Holdings Ltd	长江和记实业有限公司	1 HK	香港证券交易所	中国香港	1,105,000.00	96,833,125.74	2.10
10	KT & G Corp	-	033780 KS	韩田证券交易所	韩国	160,000.00	92,595,618.12	2.00

2. 所属国家(MEN)列元证券挂牌的证券交易所所在国家(地区)。 3. 投资者被了解本相控制末基金投资的所有权益明细,应阅读登载于本基金管理人网站(www.cifm.com)的年度报告正文。 8.据德斯纳克姆·拉德伯奇世上次 8.5.1常计灭人金额短出期初基金资产净值2%或前20公的权益投资明细

					金额单位:人民币:
	序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买人金额	占期初基金 资产净值比例(%)
			2330 TT	166,544,319.22	2.13
	1	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	TSM US	36,841,136.50	0.47
的公司	2	Ping An Insurance (Group) Company of China Ltd	2318 HK	180,109,127.51	2.31
的公司	3	Tata Consultancy Services Ltd	TCS IN	144,780,356.29	1.86
灣的公司	4	Catcher Technology Co Ltd	2474 TT	143,621,551.76	1.84
	5	KT & G Corp	033780 KS	138,737,012.40	1.78
	6	Korea Electric Power Corp	015760 KS	134,900,923.46	1.73
	7	Housing Development Finance Corp Ltd	HDFC IN	124,902,827.10	1.60
	8	Korea Gas Corp	036460 KS	115,834,003.76	1.48
制的公司	9	SK Hynix Inc	000660 KS	108,615,019.90	1.39
	10	Hyundai Heavy Industries Co Ltd	009540 KS	97,483,445.80	1.25
	11	Fubon Financial Holding Co Ltd	2881 TT	95,249,557.79	1.22
	12	Samsung Electronics Co Ltd	005930 KS	94,683,560.89	1.21
	13	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	388 HK	91,373,419.42	1.17
单位:人民币元	14	Cosmax Inc	192820 KS	89,268,596.61	1.14
[1]	15	Hongkong Land Holdings Ltd	HKL SP	85,560,712.21	1.10
12月31日	16	KB Financial Group Inc	105560 KS	85,413,715.27	1.09
164,035,068.71	17	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd	338 HK	85,326,645.95	1.09
21,767,046.33	18	Hyundai Steel Co	004020 KS	85,098,737.03	1.09
日)至估值日(含	19	KCC Corp	002380 KS	83,981,628.42	1.08
	20	Ambuja Cements Ltd	ACEM IN	78,163,460,66	1.00

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	资产净值比例(%)
	TO SEE LEW COLORS	2330 TT	4,770,101.62	0.0
1	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	TSM US	400,518,644.28	5.1
2	Samsung Electronics Co Ltd	005930 KS	391,313,754.03	5.0
3	Axis Bank Ltd	AXSB IN	318,737,548.91	4.0
4	Ambuja Cements Ltd	ACEM IN	221,776,896.75	2.8
5	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	219,963,473.72	2.8
6	HDFC Bank Ltd	HDFCB IN	216,582,610.39	2.7
7	Mahindra & Mahindra Ltd	MM IN	193,060,341.23	2.4
8	China Minsheng Banking Corp Ltd	1988 HK	179,163,634.40	2.3
9	KB Financial Group Inc	105560 KS	172,601,764.44	2.2
10	China Pacific Insurance (Group) Co Ltd	2601 HK	147,434,611.29	1.8
11	Korea Electric Power Corp	015760 KS	145,336,028.67	1.8
12	Lotte Chemical Corp	011170 KS	144,755,392.55	1.8
13	AAC Technologies Holdings Inc	2018 HK	139,973,313.77	1.7
14	SK Hynix Inc	000660 KS	136,630,629.82	1.7
15	AIA Group Ltd	1299 HK	133,069,518.50	1.7
16	China Vanke Co Ltd	2202 HK	117,754,180.28	1.5
17	Infosys Ltd	INFO IN	116,885,953.98	1.5
18	DBS Group Holdings Ltd	DBS SP	109,301,168.46	1.4
19	Mahindra & Mahindra Financial Services Ltd	MMFS IN	101,974,361.74	1.3
20	Orion Corp	001800 KS	98,963,930.30	1.2

8.5.3权益投资的买人成本总额及卖出收入总额

『人成本(成交)总额	5,129,511,115.96
出收人(成交)总额	8,176,078,140.40

本基金本报告期末未持有债券

: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

本基金本程告期未来持有債券。 &明末按公告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 本基金本限告期末未持有资产支持证券。 &明末按公告价值占基金资产净值比例大小排客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行生品。 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

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 "在一个社会与TETRACEMENTS" 8.11.3期末其他各项资产构成 单位:人民币5

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

本基金本联告期末前十全股票中不存在流通受限情况。 8.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分 因四舍五人的原因,投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

金额单位:人民币元

报告期仍无基金份额持有人大会改议。 12 基金管理人。 基金管理人: 本公司于2015年1月17日发布公告:因个人原因,冯刚先生自2015年1月15日起不再担任本公司副总经理。 本公司于2015年1月17日发布公告:因个人原因,陈星德先生自2015年11月30日起不再担任本公司副总经理。 基金托管人:

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

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券华永道中天会计师事务所有即公司的报酬为

。300元,自则该甲环以阿二胺甲甲环胺分的虚环中联办分中。 11.6 管理人,并称及及其高龄管理人员会稽查或处罚等情况 报告期小。管理人,书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 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

吸基金的的争顺则示。
2 交易年完的经基标他。
1)资本金值票信誉良好。
2)财务状况良好 经营行分顺范。
3)内部管理规范 "格 具备程金的内控制度。
4)具备基金定作所需的高效 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,并能为本基金提供金面的信息服务。
5)研究实力按强,有固定控制实规,相专门研究人员,能及时、定期、金面地为本基金提供宏观经济,行业情况,市场走向,个股分析的研步及服储价产间解条。

3. 文の中元的20年程打:
 本基金管理上使期召开会议、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. 2015年度新撰中Jobn Securities Company Limited1个席位、无注销席位。
 11.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

		132 3002	_	27.2.72.03			100.00.00	
券商名称	成交金額	占当期债券 成交总额的 比例	成交金 額	占当期回购 成交总额的 比例	成交金 額	占当期权证 成交总额的 比例	成交金額	占当期基金 成交总额的 比例
UBS LTD	-	-	-	-	-	-	21,697,917.80	81.47%
Citigroup Global Mkts Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura International	-	-	-	-	-	-	-	-
Macquarie Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley Co Intl plc	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	4,933,601.79	18.53%
JP Morgan Secs Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Instinct Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCI Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Masterlink Securities Corp	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Samsung Securities Company limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Yuanta Securities Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
SinoPac Securities Corporation	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong Intl Secs Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
China Everbright Secs (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
DSP Merrill Lynch Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Agricole Securities (Taiwan)	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank AG London	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Fubon Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Cathay Securities Corporation	-	-	-	-	-	-	-	-
CIMB Securities (Singapore) Pte Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Daiwa Capital Markets	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBC International Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
KDB Daewoo Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Korea Investment & Securities (KIS)	-	-	-	-	-	-	-	-
第一金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
Total	-	-	-	_	-	_	26.631.519.59	100.00%

§ 12影响投资者决策的其他重要信息 上投摩根基金管理有限公司