上投摩根阿尔法股票型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013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: 二〇一四年一月二十一日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月20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2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根阿尔法股票
基金主代码	377010
交易代码	377010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年10月11日
报告期末基金份额总额	1,097,898,777.88份
投资目标	本基金采用哑铃式投资技术（Barbell Approach），同步以“成长”与“价值”双重量化指标进行股票选择。在基于由下而上的择股流程中，精选个股，纪律执行，构造出相对均衡的不同风格类资产组合。同时结合公司质量、行业市局、风险因子等深入分析，对资产配置进行适度调整，努力控制投资组合的市场适应性，以求多空环境中都能创造超越业绩基准的主动管理回报。
投资策略	本基金充分借鉴摩根资产管理集团全球行之有效的投资理念和技术，依据中国资本市场的具体特征，引入集团在海外市场成功运作的“Dynamic Fund”基金产品概念。具体而言，本基金将以量化指标分析为基础，通过严格的证券选择、积极构建并持续优化“哑铃式”资产组合，结合严密的风险监控，不断谋求超越业绩比较基准的稳定回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金，属于证券投资基金中较高风险、较高收益的基金产品。
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

§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（2013年10月1日-2013年12月31日）
1.本期已实现收益	-70,245,090.63
2.本期利润	31,462,079.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0314
4.期末基金资产净值	2,535,980,466.89
5.期末基金份额净值	2.3098

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

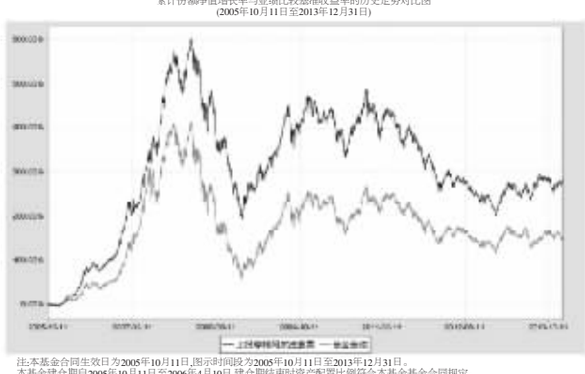
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.71%	1.07%	-2.89%	0.96%	3.60%	0.11%

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

上投摩根阿尔法股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2005年10月11日至2013年12月31日)



注:本基金合同生效日为2005年10月11日,图示时间段为2005年10月11日至2013年12月31日。

本基金建仓期自2005年10月11日至2006年4月10日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

本基金自2013年12月7日起,将基金业绩比较基准由“富时中国A金指×80%+同业存款利率×20%”变更为“沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%”。

§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		
欧宝林	本基金基金经理	2012-11-26	-	6年	欧宝林先生自2004年6月至2007年6月在中德安联(中国)证券投资基金管理有限公司任职研究员、科经理,从事研究方面的工作;2007年6月至2009年6月在国海富兰克林基金管理有限公司(任研究员、基金经理助理);2009年7月至2012年7月在嘉实基金管理有限公司任基金经理助理、基金经理;2010年12月至2012年7月任嘉实主题新动力股票型证券投资基金基金经理;2012年7月起加入上投摩根基金管理有限公司,2012年11月起担任上投摩根阿尔法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.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。

3.因工作需要,经上投摩根基金管理有限公司批准,决定自2014年1月3日起增聘任茂平先生为上投摩根阿尔法股票型证券投资基金的基金经理,同时,因工作需要,经上投摩根基金管理有限公司批准,欧宝林先生自2014年1月10日起不再担任上投摩根阿尔法股票型证券投资基金基金经理;

4.2 管理人对投资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、《上投摩根阿尔法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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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投资、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。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

在经历三季度的较高反弹后,2013年四季度经济增速有所放缓,与之相对应的是市场在四季度呈现出震荡格局,板块间分化十分明显。本基金主要配置的高弹性板块股价受到了抑制,具体来看,基金所配置板块中负贡献较大的是煤炭、有色、房地产等行业,而非银行金融、建材等板块有正贡献。基金四季度跟踪误差和偏离度都达到了预定目标,较好地跟踪住了基准。

展望下一季度,预计国内经济不会有大的起色,但在国内改革预期以及国外经济明显复苏环境下,市场向下空间十分有限,整体上投指仍然处在震荡筑底阶段,本基金所配置股票对市场的敏感度较高,其从底部反弹的弹性很大,但短期存在一定波动的可能。在投资操作上本基金仍将采取按照标的指数进行完全复制的策略,力争使跟踪误差最小化。

4.4.2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-4.89%,同期业绩比较基准收益率为-4.15%。

§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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,079,326,768.17	81.06
	其中:股票	2,079,326,768.17	81.06
2	固定收益投资	89,470,000.00	3.49
	其中:债券	89,470,000.00	3.49
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	240,000,000.00	9.36
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	66,205,051.53	2.58
6	其他资产	90,162,104.61	3.51
7	合计	2,565,163,924.31	100.00

注:截至2013年12月31日,上投摩根阿尔法股票型证券投资基金资产净值为2,535,980,466.89元,基金份额净值为2.3098元,累计基金份额净值为4.2298元。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	69,833,317.12	2.75
C	制造业	1,237,216,229.18	48.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,509,964.98	0.77
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	439,055,149.76	17.31
G	交通运输、仓储和邮政业	29,215,686.60	1.15
H	住宿和餐饮业	14,246,713.52	0.56
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,252,234.00	1.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	67,695,440.92	2.67
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	177,302,032.09	6.99
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,079,326,768.17	81.99

5.3 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投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600079	人福医药	7,566,752	214,517,419.20	8.46
2	600276	恒瑞医药	3,576,794	135,846,636.12	5.36
3	002646	青青稞酒	6,564,991	131,299,820.00	5.18
4	600511	国药股份	4,793,128	90,446,325.36	3.57
5	000893	东凌粮油	4,931,445	85,412,627.40	3.37
6	002262	恩华药业	2,984,226	84,065,646.42	3.31
7	002390	信邦制药	2,798,412	77,208,187.08	3.04
8	000516	开元投资	13,034,127	77,031,690.57	3.04
9	002159	三特索道	4,433,403	71,688,126.51	2.83
10	600028	中国石化	15,587,794	69,833,317.12	2.75

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	89,470,000.00	3.53
	其中:政策性金融债	89,470,000.00	3.53
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	89,470,000.00	3.53

5.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	130243	13国开43	300,000	29,790,000.00	1.17
2	130248	13国开48	200,000	19,966,000.00	0.79
3	110234	11国开34	200,000	19,878,000.00	0.78
4	130227	13国开27	200,000	19,836,000.00	0.78

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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 1.本基金投资的贵州信邦制药股份有限公司(下称信邦制药,股票代码:002390)于2013年6月3日收到深圳证券交易所《关于对贵州信邦制药股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定》(下称:《决定》)。《决定》指出:2013年1月6日,信邦制药根据国家药监局新药审评技术要求和新出台的政策,通过贵州省药监局向国家药品审评中心请求撤回入参阿甘-rEG注射液的新药生产注册申请,公司对该重大选聘情况未及时履行信息披露,直至2013年1月30日国家药品审评中心在其网站公布相关信息后才进行披露。鉴于上述违规事实,依据有关规定,决定对信邦制药及相关当事人给予通报批评的处分,并记入上市公司诚信档案,并向社会公布。

对上述股票投资决策程序的说明:本基金管理人在投资信邦制药前严格执行了对上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金备选库,由研究员跟踪并分析。上述事件发生后,本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

2.本基金投资的中国石油化工股份有限公司(下称:中国石化,股票代码:600028)于2013年11月24日发布公告:2013年11月22日凌晨,中国石化位于青岛经济技术开发区的原油管道发生破裂,导致原油泄漏,部分原油漏入市政排水暗渠,流入海边。当日上午10点30分左右,市政排水暗渠发生爆燃,导致周边行人、拍险人员伤亡的重大事故。关于此次事故发生的原因以及有关事宜,中国政府已派出事故调查组进行全面调查。中国石化于2014年1月12日就前述事件再次发布公告:国务院对山东省青岛市“11?22”中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告作出批复,同意国务院事故调查处理结果,认定是一起特别重大责任事故,同意对有关责任单位和责任人的处理建议,对中国石化处当地政府的48名责任人分别给予纪律处分,对涉嫌犯罪的15名责任人移送司法机关依法追究法律责任。

对上述股票投资决策程序的说明:本基金管理人在投资中国石化前严格执行了对上市公司的调研、内部研究推荐、投资计划审批等相关投资决策流程。上述股票根据股票池审批流程进入本基金备选库,由研究员跟踪并分析。上述事件发生后,本基金管理人对上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述事项对上市公司财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响,因此,没有改变本基金管理人对上述上市公司的投资判断。

其余八名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,014,282.04
2	应收证券清算款	87,335,142.25
3	应收股利	-
4	应收利息	1,238,357.96
5	应收申购款	574,322.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	90,162,104.61

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

因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

序号	918,299,364.94
本报告期基金总申购份额	
减:本报告期基金总赎回份额	
本报告期基金拆分变动份额	
本报告期末基金份额总额	

无。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准上投摩根阿尔法股票型证券投资基金设立的文件;
2. 《上投摩根阿尔法股票型证券投资基金基金合同》;
3. 《上投摩根阿尔法股票型证券投资基金托管协议》;
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
二〇一四年一月二十一日

上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013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:中国银行股份有限公司
报告送出日期: 二〇一四年一月二十一日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月20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2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上证180高ETF
基金主代码	510450
交易代码	510450
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年7月8日
报告期末基金份额总额	52,920,713.00份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%,以实现对上证180高贝塔指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用完全复制策略,按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时,本基金将运用其他方法建立实际组合,力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。
业绩比较基准	上证180高贝塔指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金等,为高风险、高收益产品。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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（2013年10月1日-2013年12月31日）
1.本期已实现收益	-317,455.57
2.本期利润	-2,702,915.33
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0657
4.期末基金资产净值	55,382,596.54
5.期末基金份额净值	1.0465

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,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	-4.89%	1.29%	-4.15%	1.31%	-0.74%	-0.02%

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

上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金

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

(2013年7月8日至2013年12月31日)

注:本基金合同生效日为2013年7月8日,截至报告期末本基金合同生效未满一年。根据基金合同的规定,本基金建仓期自基金合同生效之日起六个月。本基金在本报告期末尚处在建仓期内。

§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		
黄栋	本基金基金经理	2013-7-8	-	9年	上海财经大学经济学硕士;2005年至2010年先后在东方证券、工银瑞信基金从事金融工程研究工作;2010年7月起加入上投摩根基金管理有限公司,主要负责金融工程研究方面的工作。2012年9月起担任上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金基金经理,自2013年7月起同时担任上证180高贝塔交易型开放式指数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. 黄栋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。

4.2 管理人对投资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、《上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金》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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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投权、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。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

在经历三季度的较高反弹后,2013年四季度经济增速有所放缓,与之相对应的是市场在四季度呈现出震荡格局,板块间分化十分明显,本基金主要配置的高弹性板块股价受到了抑制,具体来看,基金所配置板块中负贡献较大的是煤炭、有色、房地产等行业,而非银行金融、建材等板块有正贡献。基金四季度跟踪误差和偏离度都达到了预定目标,较好地跟踪住了基准。

展望下一季度,预计国内经济不会有大的起色,但在国内改革预期以及国外经济明显复苏环境下,市场向下空间十分有限,整体上投指仍然处在震荡筑底阶段,本基金所配置股票对市场的敏感度较高,其从底部反弹的弹性很大,但短期存在一定波动的可能。在投资操作上本基金仍将采取按照标的指数进行完全复制的策略,力争使跟踪误差最小化。

4.4.2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-4.89%,同期业绩比较基准收益率为-4.15%。

§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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	53,586,829.62	95.68
	其中:股票	53,586,829.62	95.68
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	2,040,296.91	3.64
6	其他资产	378,755.38	0.68
7	合计	56,005,881.91	100.00

注:截至2013年12月31日,上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金资产净值为55,382,596.54元,基金份额净值为1.0465元,累计基金份额净值为1.0465元。

上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	787,134.20	1.42
B	采矿业	6,703,057.29	12.10
C	制造业	9,742,793.89	17.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,674,428.19	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	22,221,826.53	40.12
K	房地产业	12,455,494.38	22.49
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	53,584,734.48	96.75

5.3 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

5.3.1期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600999	招商证券	95,370	1,209,291.60	2.18
2	600837	海通证券	106,493	1,205,500.76	2.18
3	601555	东吴证券	134,927	1,160,372.20	2.10
4	600109	国金证券	67,253	1,141,283.41	2.06
5	601166	兴业银行	110,982	1,125,357.48	2.03
6	600030	中信证券	87,395	1,114,286.25	2.01
7	601688	华泰证券	121,629	1,089,795.84	1.97
8	600000	浦发银行	111,958	1,055,763.94	1.91
9	600369	西南证券	105,033	1,042,977.69	1.88
10	600748	上实发展	138,135	1,042,919.25	1.88

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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。

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

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没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	378,223.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	532.19
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	378,755.38

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。

5.10.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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

因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	46,920,713
本报告期基金总申购份额	112,000,000
减:本报告期基金总赎回份额	106,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	52,920,713

§7 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

8.1.1. 中国证监会批准上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金设立的文件;

8.1.2. 《上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

8.1.3. 《上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

8.1.4. 《上投摩根开放式基金业务规则》;

8.1.5. 基金管理人业务资格批件、营业执照;

8.1.6. 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
二〇一四年一月二十一日

上投摩根亚太优势股票型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期: 二〇一四年一月二十一日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月20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2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上投摩根亚太优势股票 QDII）
基金主代码	377016
交易代码	377016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年10月22日
报告期末基金份额总额	17,279,479,756.91份
投资目标	本基金主要投资于亚太地区证券市场以及在其他证券市场交易的亚太企业，投资市场包括但不限于澳大利亚、韩国、香港、印度及新加坡等区域证券市场（日本除外），分散投资风险并追求基金资产稳定增值。
投资策略	本基金在投资过程中注重各区域市场环境、政经前景分析，并强调公司品质与成长性的结合。首先在亚太地区经济发展格局下，通过自上而下分析，甄别不同国家与地区、行业与板块的投资机会，首先考虑国家与地区的资产配置，决定行业与板块的基本布局，并从中初步筛选出具有国际比较优势的大盘蓝筹公司，同时还敢自下而上的选股策略，注重个股成长性指标分析，挖掘拥有更佳成长特性的公司，构建成长型公司股票池。最后通过深入的相对价值评估，形成优化的核心投资组合。在固定收益类投资部分，其资产布局坚持安全性、流动性和收益性为资产配置原则，并结合现金管理、货币市场工具等来制订具体策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：摩根斯坦利综合亚太指数（不含日本）MSCI AC Asia Pacific Index ex Japan）。
风险收益特征	本基金为区域性股票型证券投资基金，基金投资风险收益水平高于债券型基金和平衡型基金。由于投资国家与地区市场的分散，风险低于投资单一市场的股票型基金。
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
境外投资顾问英文名称	JF Asset Management Limited
境外投资顾问中文名称	JF资产管理有限公司
境外资产托管人英文名称	The Bank of New York Mellon Company
境外资产托管人中文名称	纽约梅隆银行

§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（2013年10月1日-2013年12月31日）
1.本期已实现收益	-8,694,998.63
2.本期利润	298,830,236.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0169
4.期末基金资产净值	9,975,973,887.95
5.期末基金份额净值	0.577

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)